

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

# HALBJAHRESBERICHT

DuoPlus

30. April 2024

## Inhaltsverzeichnis

---

Vermögensübersicht per 30.04.2024	4
Vermögensaufstellung per 30.04.2024	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Allgemeine Angaben	10

## Einleitende Worte

---

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie über die Entwicklung des OGAW-Fonds

DuoPlus

in der Zeit vom 01.11.2023 bis 30.04.2024.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von 0,11 % in der Anteilklasse DuoPlus R sowie von 0,15 % in der Anteilklasse DuoPlus V.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende April darstellte. Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre

HANSAINVEST-Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz, Claudia Pauls, Ludger Wibbeke

## Vermögensübersicht per 30.04.2024

### VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>95.401.473,52</b>	<b>100,35</b>
1. Anleihen	78.365.841,77	82,43
2. Derivate	217.480,00	0,23
3. Bankguthaben	16.386.790,35	17,24
4. Sonstige Vermögensgegenstände	431.361,40	0,45
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-328.356,32</b>	<b>-0,35</b>
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-328.356,32	-0,35
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>EUR 95.073.117,20</b>	<b>100,00</b>

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung per 30.04.2024

### VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.04.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
							im Berichtszeitraum			
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>72.408.471,77</b>	<b>76,16</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>72.408.471,77</b>	<b>76,16</b>
DE0001141802	0.0000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24)		EUR	4.000	0	0	%	98,3670	3.934.680,00	4,14
EU000A1G0EJ9	0.0000% Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2020(25)		EUR	6.000	0	0	%	95,3685	5.722.110,00	6,02
FI4000511449	0.0000% Finnland, Republik EO-Bonds 21/26		EUR	3.000	0	0	%	93,1759	2.795.276,25	2,94
FR0014003513	0.0000% Frankreich EO-OAT 2021(27)		EUR	4.000	0	0	%	91,9845	3.679.380,00	3,87
ES0000012J15	0.0000% Spanien EO-Bonos 2021(27)		EUR	2.500	0	0	%	91,8778	2.296.943,75	2,42
AT0000A2QRW0	0.0000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25)		EUR	3.500	0	0	%	96,6950	3.384.325,00	3,56
EU000A1G0EN1	0.0001% Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2021(26)		EUR	2.000	0	0	%	93,2550	1.865.100,00	1,96
IT0005433690	0.2500% Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(28)		EUR	2.500	0	0	%	88,8545	2.221.363,55	2,34
XS1501554874	0.3750% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2016(26)		EUR	2.000	0	0	%	93,2205	1.864.410,00	1,96
DE0001104891	0.4000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)		EUR	3.000	0	0	%	98,8275	2.964.825,00	3,12
PTOTEL0E0028	0.4750% Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30)		EUR	3.000	0	0	%	86,3920	2.591.760,00	2,73
DE0001102374	0.5000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 15/25		EUR	3.500	0	0	%	97,7255	3.420.392,50	3,60
FI4000278551	0.5000% Finnland, Republik EO-Bonds 17/27		EUR	3.500	0	0	%	92,3314	3.231.598,13	3,40
FR0013131877	0.5000% Frankreich EO-OAT 2016(26)		EUR	2.500	0	0	%	94,8633	2.371.583,35	2,49
AT0000A2WSC8	0.9000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(32)		EUR	2.000	0	0	%	85,8115	1.716.230,00	1,81
XS1619567677	0.9500% Litauen, Republik EO-MTN 17/27		EUR	3.000	0	0	%	93,1180	2.793.540,00	2,94
DE0001102366	1.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2014 (2024)		EUR	2.000	0	0	%	99,2685	1.985.370,00	2,09
IE00BV8C9418	1.0000% Irland EO-Treasury Bonds 2016(26)		EUR	2.000	0	0	%	96,0660	1.921.320,00	2,02
FR0011962398	1.7500% Frankreich EO-OAT 14/24		EUR	3.500	0	0	%	98,9265	3.462.427,50	3,64
DE0001104909	2.2000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)		EUR	3.000	0	0	%	99,1600	2.974.800,00	3,13
IT0005240350	2.4500% Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(33)		EUR	700	0	0	%	89,9633	629.743,33	0,66
DE000BU22007	2.5000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.23(25)		EUR	2.000	0	0	%	99,2010	1.984.020,00	2,09
ES0000012K61	2.5500% Spanien EO-Bonos 2022(32)		EUR	2.000	0	0	%	95,1308	1.902.615,00	2,00
BE0000332412	2.6000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 14/24 Ser. 72		EUR	3.000	0	0	%	99,8125	2.994.375,00	3,15

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.04.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
							im Berichtszeitraum			
IT0005340929	2.8000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28)	EO-	EUR	2.000	0	0	%	97,6423	1.952.846,52	2,05
BE0000333428	3.0000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(34) Ser. 73	EO-	EUR	2.000	0	0	%	99,5363	1.990.726,66	2,09
XS2547270756	4.1250% Litauen, Republik EO-MTN 22/28	EO-	EUR	1.000	0	0	%	102,8065	1.028.065,00	1,08
IT0001278511	5.2500% Italien 98/29	EO-	EUR	2.500	0	0	%	109,1458	2.728.645,23	2,87
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>5.957.370,00</b>	<b>6,27</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>5.957.370,00</b>	<b>6,27</b>
FR0127921312	0.0000% Frankreich EO-Treasury Bills 2023(24)	EO-	EUR	6.000	0	0	%	99,2895	5.957.370,00	6,27
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>78.365.841,77</b>	<b>82,43</b>
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								<b>EUR</b>	<b>217.480,00</b>	<b>0,23</b>
<b>Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>-32.000,00</b>	<b>-0,03</b>
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>EUR</b>	<b>-32.000,00</b>	<b>-0,03</b>
Euro STOXX Mid Index 21.06.2024			XEUR	EUR	Anzahl	3.200			-32.000,00	-0,03
<b>Zins-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>249.480,00</b>	<b>0,26</b>
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>EUR</b>	<b>249.480,00</b>	<b>0,26</b>
Euro-BOBL-Futures 06.06.2024 <sup>2)</sup>			XEUR	EUR		-23.100.000			249.480,00	0,26
<b>Bankguthaben</b>								<b>EUR</b>	<b>16.386.790,35</b>	<b>17,24</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>								<b>EUR</b>	<b>16.386.790,35</b>	<b>17,24</b>
Verwahrstelle: DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen.			EUR			16.386.790,35			16.386.790,35	17,24
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR</b>	<b>431.361,40</b>	<b>0,45</b>
Zinsansprüche			EUR			431.361,40			431.361,40	0,45
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR</b>	<b>-328.356,32</b>	<b>-0,35</b>
Sonstige Verbindlichkeiten <sup>3)</sup>			EUR			-328.356,32			-328.356,32	-0,35
<b>Fondsvermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>95.073.117,20</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert DuoPlus R</b>								<b>EUR</b>	<b>52,94</b>	
<b>Anteilwert DuoPlus V</b>								<b>EUR</b>	<b>85,05</b>	
<b>Umlaufende Anteile DuoPlus R</b>								<b>STK</b>	<b>1.792.393,158</b>	
<b>Umlaufende Anteile DuoPlus V</b>								<b>STK</b>	<b>2.216,000</b>	

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

<sup>2)</sup> Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

<sup>3)</sup> noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Vertriebsprovision

## MARKTSCHLÜSSEL

### Terminbörse

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

## WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
------	---------------------	---------------------------------------	-----------------	--------------------

Fehlanzeige

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	---------------------------------------	-----------------	--------------------	------------------

### Terminkontrakte

#### Wertpapier-Terminkontrakte

#### Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten

Verkaufte Kontrakte

(Basiswerte:	EUR			27.167
--------------	-----	--	--	--------

Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe))

#### Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte

(Basiswerte:	EUR			77.542
--------------	-----	--	--	--------

ESTX Mid Index (Price) (EUR))

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 82,43

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,23

### ZUSÄTZLICHE ANHANGANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 BETREFFEND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

### SONSTIGE ANGABEN

Anteilwert DuoPlus R	EUR	52,94
Anteilwert DuoPlus V	EUR	85,05
Umlaufende Anteile DuoPlus R	STK	1.792.393,158
Umlaufende Anteile DuoPlus V	STK	2.216,000

### ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	DuoPlus R	DuoPlus V
ISIN	DE000A0RK8R9	DE000A2DP537
Währung	Euro	Euro
Fondsaufgabe	18.05.2009	02.11.2017
Ertragsverwendung	Thesaurierend	Thesaurierend
Verwaltungsvergütung	1,57% p.a.	0,57% p.a.
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Mindestanlagevolumen	0	500.000

### ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

Der Anteilwert wird durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH ermittelt. Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum Handel zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Tagesschlusskursen des betroffenen Börsentages gem. § 27 KARBV. Investmentanteile werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV).

Die bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

Bankguthaben und Festgelder werden mit dem Nominalbetrag und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet. Die Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände erfolgt zu ihrem Markt- bzw. Nominalbetrag.

### AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandserstattungen.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse DuoPlus R keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse DuoPlus V keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

## BESCHREIBUNG, WIE DIE VERGÜTUNGEN UND GGF. SONSTIGE ZUWENDUNGEN BERECHNET WURDEN

---

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen des § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

## ERGEBNISSE DER JÄHRLICHEN ÜBERPRÜFUNG DER VERGÜTUNGSPOLITIK

---

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

## ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN DER FESTGELEGTEN VERGÜTUNGSPOLITIK

---

Keine Änderung im Berichtszeitraum

## Allgemeine Angaben

---

### KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

---

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft  
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96

Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70

E-Mail: [info@hansainvest.de](mailto:info@hansainvest.de)

Web: [www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)

Haftendes Eigenkapital: 28,189 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2022

### GESELLSCHAFTER

---

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

### AUFSICHTSRAT

---

- Martin Berger
  - Vorsitzender
  - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth (bis zum 07.11.2023)
  - stellvertretender Vorsitzender
  - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Dr. Stefan Lemke (ab dem 15.02.2024)
  - stellvertretender Vorsitzender
  - stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, Mitglied des Vorstandes der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Markus Barth

- Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg
- Dr. Thomas A. Lange
  - Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen
- Prof. Dr. Harald Stützer
  - Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach
- Prof. Dr. Stephan Schüller
  - Kaufmann

### GESCHÄFTSFÜHRUNG

---

- Dr. Jörg W. Stotz
  - (Sprecher, zugleich Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG und der Greiff capital management AG)
- Claudia Pauls (ab dem 01.04.2024)
- Ludger Wibbeke
  - (zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. und Aufsichtsratsvorsitzender der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

## **VERWAHRSTELLE**

---

DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank  
Platz der Republik  
60325 Frankfurt am Main

Haftendes Eigenkapital: 21.895,810 Mio EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 4.926,200 Mio EUR

## **WIRTSCHAFTSPRÜFER**

---

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Fuhrentwiete 5  
20355 Hamburg  
Deutschland

**HANSAINVEST**

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der  
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8  
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

[info@hansainvest.de](mailto:info@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)

**HANSA**INVEST