

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

Wallrich AI Libero

31. Mai 2023

Inhaltsverzeichnis

Vermögensübersicht per 31.05.2023	4
Vermögensaufstellung per 31.05.2023	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	9
Allgemeine Angaben	11

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

Wallrich AI Libero

in der Zeit vom 01.12.2022 bis 31.05.2023.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von +3,30 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Mai 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, Nicholas Brinckmann, Ludger Wibbeke

Vermögensübersicht per 31.05.2023

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	13.349.917,78	100,17
1. Anleihen	12.871.771,38	96,59
2. Investmentanteile	218.040,00	1,64
3. Derivate	-133.300,00	-1,00
4. Bankguthaben	329.807,51	2,47
5. Sonstige Vermögensgegenstände	63.598,89	0,48
II. Verbindlichkeiten	-23.052,44	-0,17
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-23.052,44	-0,17
III. Fondsvermögen	EUR 13.326.865,34	100,00

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung per 31.05.2023

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	8.319.812,60	62,43
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	8.319.812,60	62,43
DE0001104867	0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)		EUR	800	200	0 %	98,3210	786.568,00	5,90
XS1515245089	0,000000000% European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2016(24)		EUR	600	600	0 %	97,3730	584.238,00	4,38
XS2343821794	0,000000000% VOLKSWAGEN LEASING 21/24		EUR	300	300	0 %	95,7062	287.118,54	2,15
XS2079723552	0,050000000% DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23)		EUR	200	0	0 %	98,3655	196.731,00	1,48
XS2003420465	0,125000000% Bank of Queensland Ltd. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)		EUR	200	200	0 %	96,2656	192.531,24	1,44
DE000A2R9ZT1	0,250000000% Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23)		EUR	200	0	0 %	98,5675	197.135,00	1,48
XS1936779245	0,500000000% Westpac Sec. NZ Ltd. (Ldn Br.) EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2019(24)		EUR	200	200	0 %	98,0510	196.102,00	1,47
XS1956955980	0,625000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)		EUR	100	100	0 %	97,7000	97.700,00	0,73
XS1458405898	0,750000000% Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)		EUR	150	0	0 %	99,5950	149.392,50	1,12
XS1823532640	1,125000000% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)		EUR	200	0	0 %	98,8295	197.659,00	1,48
XS1362384262	1,200000000% Linde Inc. EO-Notes 2016(16/24)		EUR	200	0	0 %	98,4575	196.915,00	1,48
XS1380334141	1,300000000% Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2016(16/24)		EUR	300	300	0 %	98,2240	294.672,00	2,21
XS2089322098	1,375000000% RAI-Radiotele. Italiana S.p.A. EO-Notes 2019(24)		EUR	200	0	0 %	96,3775	192.755,00	1,45
DE0001102358	1,500000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 14/24		EUR	900	900	0 %	98,6045	887.440,50	6,66
XS1910851242	1,500000000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23)		EUR	200	0	0 %	98,8660	197.732,00	1,48
XS1121229402	1,750000000% Australia Pac. Airports (Mel.) EO-Med.-T. Notes 2014(14/24)		EUR	200	0	0 %	96,5190	193.038,00	1,45
DE0001102333	1,750000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2014 (2024)		EUR	600	0	0 %	99,0845	594.507,00	4,46
XS1084563615	1,750000000% Robert Bosch GmbH MTN v.2014(2014/2024)		EUR	200	200	0 %	98,1554	196.310,82	1,47
EU000A1ZE225	1,875000000% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2014(24)		EUR	500	0	0 %	98,7575	493.787,50	3,71
DE0001102325	2,000000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 13/23		EUR	1.500	0	200 %	99,8050	1.497.075,00	11,23
XS2265369657	3,000000000% LUFTHANSA AG 20/26		EUR	100	0	0 %	94,8125	94.812,50	0,71
XS2002496409	3,125000000% BayWa AG Notes v. 19/24		EUR	300	0	0 %	99,7880	299.364,00	2,25

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾	
							im Berichtszeitraum			
XS2545247863	3,2500000000% Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 22(24)		EUR	100	100	0 %	99,6880	99.688,00	0,75	
XS1729872736	3,4160000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-FLR Med.Term Nts 2017(24)		EUR	200	0	0 %	98,2700	196.540,00	1,47	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	4.460.998,50	33,47	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	4.460.998,50	33,47	
DE0001141786	0,0000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.178 v.2018(23)		EUR	600	0	0 %	98,8890	593.334,00	4,45	
FR0014001N46	0,0000000000% Frankreich EO-OAT 2020(24)		EUR	300	300	0 %	97,6870	293.061,00	2,20	
FR0127462911	0,0000000000% Frankreich EO-Treasury Bills 2022(23)		EUR	1.200	1.200	0 %	98,4000	1.180.800,00	8,86	
FR0127613505	0,0000000000% Frankreich EO-Treasury Bills 2023(24)		EUR	800	800	0 %	97,6365	781.092,00	5,86	
DE000A2LQNP8	0,2500000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15286 v.19(24)		EUR	200	200	0 %	97,7580	195.516,00	1,47	
XS1942615607	0,2500000000% Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)		EUR	200	200	0 %	97,8325	195.665,00	1,47	
DE000A2YNQ58	0,5000000000% Wirecard AG Anleihe v.19/24		EUR	300	100	0 %	13,9275	41.782,50	0,31	
EU000A1Z6630	0,6250000000% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2015(23)		EUR	500	200	0 %	98,9030	494.515,00	3,71	
XS2075185228	0,9000000000% Harley Davidson Finl Serv.Inc. EO-Notes 19/24		EUR	100	0	0 %	95,3460	95.346,00	0,72	
BE0002631126	1,1250000000% KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(24)		EUR	200	0	0 %	98,2985	196.597,00	1,48	
XS2468129429	1,2410000000% Athene Global Funding EO-Medium-Term Notes 2022(24)		EUR	200	0	0 %	96,8460	193.692,00	1,45	
XS0982019126	3,0000000000% E.ON Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2013(24)		EUR	200	0	0 %	99,7990	199.598,00	1,50	
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	90.960,28	0,68	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	90.960,28	0,68	
DE000A30VKC3	5,0000000000% V-Bank AG FLR-Nachr.Inh.-Sch.22(27/unb.)		EUR	100	0	0 %	90,9603	90.960,28	0,68	
Investmentanteile							EUR	218.040,00	1,64	
KVG - eigene Investmentanteile							EUR	218.040,00	1,64	
DE000A2JQH30	Wallrich AI Peloton Inhaber-Anteile		ANT	2.000	0	2.500	EUR	109,0200	218.040,00	1,64
Summe Wertpapiervermögen							EUR	13.089.811,38	98,22	

Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)	EUR							-133.300,00	-1,00
Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)	EUR							-133.300,00	-1,00
Optionsrechte	EUR							-133.300,00	-1,00
Optionsrechte auf Aktienindices	EUR							-133.300,00	-1,00
Put ESTX 50 4000,000000000 16.06.2023	XEUR	EUR	Anzahl	-100	EUR	7,9000		-7.900,00	-0,06
Put ESTX 50 4075,000000000 21.07.2023	XEUR	EUR	Anzahl	-330	EUR	38,0000		-125.400,00	-0,94
Bankguthaben	EUR							329.807,51	2,47
EUR - Guthaben bei:	EUR							288.852,24	2,17
Bank: National-Bank AG		EUR		1,93				1,93	0,00
Bank: UniCredit Bank AG		EUR		0,00				0,00	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		EUR		288.850,31				288.850,31	2,17
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen	EUR							40.955,27	0,31
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		USD		43.936,81				40.955,27	0,31
Sonstige Vermögensgegenstände	EUR							63.598,89	0,48
Zinsansprüche		EUR		63.598,89				63.598,89	0,48
Sonstige Verbindlichkeiten	EUR							-23.052,44	-0,17
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾		EUR		-23.052,44				-23.052,44	-0,17
Fondsvermögen	EUR							13.326.865,34	100,00
Anteilwert Wallrich AI Libero P	EUR							101,81	
Umlaufende Anteile Wallrich AI Libero P	STK							130.897,202	

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

				per 31.05.2023		
US-Dollar	(USD)		1,072800	=		1 Euro (EUR)

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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
DE000A2LQNY0	0,500000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35309 v. 19(23)	EUR	0	300
XS1200670955	0,750000000% Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2015(15/23)	EUR	0	300
XS1167644407	0,875000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-MTN 15/23	EUR	0	300
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS0933547456	2,750000000% DirecTV EO-Notes 13/23	EUR	0	150
XS2154335363	3,875000000% Harley Davidson Finl Serv.Inc. EO-Notes 2020(20/23)	EUR	0	100

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
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			861
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 100,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 8.724.370,70 EUR.

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 98,22

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -1,00

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 Wallrich AI Libero P	EUR	101,81
Umlaufende Anteile Wallrich AI Libero P	STK	130.897,202

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 Schlusskursen des vorhergehenden 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 Aufwandsersatzungen.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse Wallrich AI Libero P sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
DE000A2JQH30	Wallrich AI Peloton Inhaber-Anteile ¹⁾	0,95

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

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: service@hansainvest.de

Web: 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
 - stellvertretender Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied 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 Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH, Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Greiff capital management AG (seit 01.03.2023))

- Nicholas Brinckmann

- (zugleich Sprecher der Geschäftsführung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

- Ludger Wibbeke

- (zugleich stellvertretender Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

VERWAHRSTELLE

Donner & Reuschel AG
Ballindamm 27
20095 Hamburg

Haftendes Eigenkapital: 380,667 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 20,500 Mio. EUR
Stand: 31.12.2021

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhlentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST