

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

# HALBJAHRESBERICHT

D&R Zinsen

30. April 2024



**DONNER & REUSCHEL**  
PRIVATBANK SEIT 1798

**HANSAINVEST**

## Inhaltsverzeichnis

---

Vermögensübersicht per 30.04.2024	4
Vermögensaufstellung per 30.04.2024	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	13
Allgemeine Angaben	16

## Einleitende Worte

---

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

D&R Zinsen

in der Zeit vom 01.11.2023 bis 30.04.2024.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von +3,35 % in der Klasse I, von +3,46 % in der Klasse I2, von +3,20 % in der Klasse P sowie von +3,56 % in der Klasse 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, Ludger Wibbeke

## Vermögensübersicht per 30.04.2024

### VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>256.326.320,92</b>	<b>100,06</b>
1. Anleihen	249.103.741,53	97,24
2. Derivate	-873.235,38	-0,34
3. Bankguthaben	4.367.821,53	1,71
4. Sonstige Vermögensgegenstände	3.727.993,24	1,46
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-159.459,46</b>	<b>-0,06</b>
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-159.459,46	-0,06
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>EUR 256.166.861,46</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>193.428.449,82</b>	<b>75,51</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>193.428.449,82</b>	<b>75,51</b>
BE0000350596	0.4000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2020(40)	EUR		4.000	4.000	0	%	64,0315	2.561.260,00	1,00
FR0013515806	0.5000% Frankreich EO-OAT 2020(40)	EUR		5.000	5.000	0	%	65,8562	3.292.811,15	1,29
DK0009527103	0.5000% Nykredit Realkredit A/S DK-Anl. Serie 01E/E per 2043	DKK		13.503	0	394	%	78,9250	1.429.008,08	0,56
ES0000012F76	0.5000% Spanien EO-Obligaciones 2020(30)	EUR		2.000	0	3.500	%	86,5040	1.730.080,00	0,68
DK0002047224	1.0000% Nordea Kredit Realkreditaktie. DK-Anl. per 2053	DKK		31.710	0	540	%	74,9800	3.188.054,91	1,24
SK4000019857	1.0000% Slowakei EO-Anl. 2021(51)	EUR		1.000	0	0	%	53,5653	535.653,33	0,21
FR0014009O62	1.2500% Frankreich EO-OAT 2022(38)	EUR		570	0	0	%	77,9330	444.217,83	0,17
DE000MHB31J9	1.8750% Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser. 2000 v.22(32)	EUR		2.500	0	0	%	91,3212	2.283.030,90	0,89
DE000LB2ZTL3	2.0000% Landesbank Baden-Württemberg DL-MTN-Pfandbr.S. 828 v.22(25)	USD		1.500	0	0	%	96,9985	1.358.141,98	0,53
XS2330503694	2.0000% Rumänien EO-MTN 21/33	EUR		500	0	0	%	75,5505	377.752,50	0,15
DE000BLB6JQ5	2.1250% Bayerische Landesbank Öff.Pfandbr.v.22(31)	EUR		4.000	0	0	%	93,8441	3.753.764,88	1,47
FR001400CGA2	2.1250% Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(30)	EUR		3.000	0	0	%	94,7394	2.842.181,25	1,11
XS2495085784	2.1250% PKO Bank Hipoteczny S.A. EO-Mortg. Covered MTN 2022(25)	EUR		4.000	0	1.000	%	98,0134	3.920.534,48	1,53
XS2434895558	2.1250% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2022(28)Reg.S	EUR		2.500	0	0	%	91,7151	2.292.878,13	0,90
PTOTEW0E0017	2.2500% Portugal, Republik EO-Obr. 2018(34)	EUR		3.500	0	0	%	93,1056	3.258.695,16	1,27
DE000BU2Z007	2.3000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2023 (2033)	EUR		27.500	0	15.500	%	98,5779	27.108.927,45	10,58
ES00000128Q6	2.3500% Spanien EO-Obligaciones 2017(33)	EUR		10.000	0	0	%	93,2050	9.320.500,00	3,64
FR001400CM22	2.3750% Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2022(30)	EUR		3.600	0	0	%	95,8230	3.449.627,46	1,35
XS2534912485	2.5000% ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(30)	EUR		3.000	0	0	%	96,7771	2.903.314,02	1,13
DE000NWB0AS6	2.5000% NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AE v.22(37)	EUR		4.000	0	0	%	92,4598	3.698.393,32	1,44
DE000BU2Z015	2.6000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2023 (2033)	EUR		2.000	0	0	%	100,8021	2.016.042,46	0,79
EU000A3K4DM9	2.6250% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(48)	EUR		1.000	0	0	%	89,1150	891.150,00	0,35
XS2587748174	2.7500% Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts. Ser.1228 v.23(32)	EUR		3.200	0	3.000	%	98,6433	3.156.586,66	1,23
IT0005340929	2.8000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28)	EUR		4.000	4.000	0	%	97,9537	3.918.148,80	1,53
DE000SCB0047	3.0000% Deutsche Kreditbank AG 23/35	EUR		2.900	0	0	%	98,9330	2.869.055,90	1,12

## 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				
EU000A3K4ES4	3.0000% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2024(34)		EUR	2.000	2.000	0	%	99,6220	1.992.440,00	0,78	
IE000GVLBXU6	3.0000% Irland EO-Treasury Bonds 2023(43)		EUR	800	0	0	%	99,0065	792.052,21	0,31	
FR001400FD12	3.0000% La Banq. Postale Home Loan SFH EO-Med.-Ter.Obl.Fin.Hab.23(31)		EUR	1.400	0	0	%	99,2137	1.388.991,69	0,54	
XS2611177382	3.1000% International Bank Rec. Dev. EO-MTN 23/38		EUR	3.400	0	0	%	98,7942	3.359.001,95	1,31	
AT0000A33SK7	3.1500% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(53)		EUR	1.750	0	0	%	99,0878	1.734.036,36	0,68	
XS2747590896	3.2120% Assicurazioni Generali S.p.A. EO-Medium-Term Notes 24(24/29)		EUR	2.000	2.000	0	%	98,3740	1.967.480,00	0,77	
XS2254184547	3.2500% Veritas S.p.A. EO-Notes 2020(27)		EUR	250	0	0	%	88,3530	220.882,50	0,09	
XS2751666426	3.3750% ENEL Finance Intl N.V. EO-MTN 24/28		EUR	2.000	2.000	0	%	99,3860	1.987.720,88	0,78	
EU000A2SCAK5	3.3750% Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2023(38)		EUR	3.000	0	0	%	101,7593	3.052.777,98	1,19	
XS2576364371	3.5000% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(28)		EUR	1.300	0	0	%	100,7070	1.309.191,00	0,51	
XS2770514789	3.5000% Verizon Communications Inc. EO-Notes 2024(24/32)		EUR	2.000	2.000	0	%	98,8474	1.976.948,60	0,77	
SK4000022828	3.5000% Vseobecná úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2023(26)		EUR	4.600	0	0	%	99,5060	4.577.276,00	1,79	
XS2178857954	3.6240% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2020(30)Reg.S		EUR	700	0	0	%	91,8870	643.209,00	0,25	
XS2746102479	3.6250% Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)		EUR	1.000	1.000	0	%	98,5167	985.166,66	0,38	
XS2638490354	3.7075% Bank of New Zealand EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2023(28)		EUR	3.000	0	0	%	101,0923	3.032.770,20	1,18	
IT0005552507	3.7500% Banco BPM S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2023(28)		EUR	3.000	0	0	%	100,5840	3.017.520,00	1,18	
SK4000022539	3.7500% Slowakei EO-Anl. 2023(35)		EUR	5.200	0	0	%	100,0218	5.201.135,32	2,03	
XS2637445276	3.7500% UniCredit Bk Czech R.+Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(28)		EUR	3.000	0	0	%	100,3250	3.009.750,00	1,17	
BE0002964451	3.8750% Fluvius System Operator CVBA EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)		EUR	2.000	0	0	%	101,2206	2.024.411,84	0,79	
XS2648672660	3.8750% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)		EUR	5.000	0	0	%	102,8420	5.142.100,00	2,01	
XS2718201515	3.8750% Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)		EUR	1.200	1.200	0	%	101,0204	1.212.244,39	0,47	
XS2778272471	4.0000% Bank Gospodarstwa Krajowego EO-Medium-Term Notes 2024(32)		EUR	1.000	1.000	0	%	99,8690	998.690,00	0,39	
XS2532370231	4.0000% Estland, Republik EO-Bonds 22/32		EUR	5.000	0	0	%	104,1695	5.208.475,00	2,03	
IT0005542359	4.0000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)		EUR	9.000	9.000	0	%	103,1034	9.279.306,36	3,62	
XS2678945317	4.0820% Korea Housing Fin.Corp. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2023(27)		EUR	6.000	0	0	%	102,1000	6.126.000,00	2,39	

## 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			
IT0005566408	4.1000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(29)	EO	EUR	10.000	10.000	0	%	103,3444	10.334.440,10	4,03
IT0005560948	4.2000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(34)	EO	EUR	4.000	4.000	0	%	103,4990	4.139.960,00	1,62
XS2586944147	4.2500% Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(43)	EO	EUR	2.000	0	0	%	101,7750	2.035.500,00	0,79
IT0005518128	4.4000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(33)	EO	EUR	7.000	7.000	0	%	105,5103	7.385.717,50	2,88
XS2689949399	5.5000% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2023(28)Reg.S	EO	EUR	3.000	0	0	%	102,3844	3.071.531,25	1,20
ES0000012411	5.7500% Spanien 01/32	EO	EUR	2.000	2.000	0	%	118,9069	2.378.137,50	0,93
NO0010906944	6.0900% Heimstaden Bostad AB NK-FLR Med.-T.Nts 2020(24/25)	EO	NOK	2.000	0	0	%	98,4155	167.084,88	0,07
XS2538441598	6.6250% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2022(29)Reg.S	EO	EUR	1.000	1.000	0	%	107,6690	1.076.690,00	0,42
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>27.734.894,82</b>	<b>10,83</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>27.734.894,82</b>	<b>10,83</b>
DK0006350657	0.5000% DLR Kredit A/S DK-Anl. per 2043	EO	DKK	18.362	0	562	%	79,4250	1.955.562,54	0,76
DK0004616364	0.5000% Realkredit Danmark AS DK-Anl. Serie 22S per 2043	EO	DKK	13.526	0	395	%	78,9250	1.431.390,36	0,56
DE000A3MP7K3	1.1250% Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(37)	EO	EUR	2.000	0	0	%	79,8212	1.596.424,06	0,62
XS2104886341	1.1250% Mexiko EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	EO	EUR	2.000	2.000	0	%	85,3215	1.706.430,00	0,67
EU000A2SCAC2	2.3750% European Financial Stability Facility (EFSF) 22/32	EO	EUR	2.500	0	0	%	95,8305	2.395.762,20	0,94
DE000NRW0N67	2.9000% Nordrhein-Westfalen, Land Med.T.LSA v.23(33) Reihe 1561	EO	EUR	1.000	0	0	%	99,6828	996.827,70	0,39
FR001400O9E0	3.1110% Arkéa Public Sector SCF EO-M.T.Obl.Fonc.Pu.S. 2024(29)	EO	EUR	2.500	2.500	0	%	99,7707	2.494.267,75	0,97
XS2778374129	3.3590% NTT Finance Corp. EO-Medium-Term Nts 2024(24/31)	EO	EUR	1.000	1.000	0	%	99,5440	995.440,00	0,39
SI0002104303	3.6250% Slowenien, Republik EO-Bonds 2023(33)	EO	EUR	2.000	0	0	%	103,7325	2.074.650,00	0,81
XS2764405432	3.7500% EXOR N.V. EO-Notes 2024(24/33)	EO	EUR	2.000	2.000	0	%	98,8357	1.976.713,12	0,77
BE0390123868	3.7500% Proximus S.A. EO-Med.-Term Notes 2024(24/34)	EO	EUR	1.500	1.500	0	%	100,0265	1.500.397,50	0,59
XS2726461986	3.8750% BNI (Finance) B.V. EO-Notes 2023(23/30)	EO	EUR	1.000	1.000	0	%	101,7101	1.017.101,28	0,40
ES0236463008	4.2000% Audax Renovables S.A. EO-Nts 20/27	EO	EUR	2.000	0	0	%	80,9165	1.618.330,00	0,63
XS2643673952	4.5000% Nasdaq Inc. EO-Notes 2023(23/32)	EO	EUR	2.000	1.300	0	%	104,6328	2.092.656,76	0,82
XS2804483381	4.5230% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Pref. Med.-T.Nts 24(27)	EO	EUR	2.300	2.300	0	%	100,0500	2.301.150,00	0,90
NO0010976327	5.6800% Heimstaden Bostad AB NK-FLR Med.-T. Nts 2021(26/26)	EO	NOK	8.000	0	0	%	94,8350	644.024,35	0,25
USU07264AH42	6.1250% Bayer US Finance LLC DL-Notes 2023(23/26) Reg.S	EO	USD	1.000	1.000	0	%	100,4630	937.767,20	0,37

## 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>
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>27.940.396,89</b>	<b>10,91</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>27.940.396,89</b>	<b>10,91</b>
FI4000560958	0.0000% Finnland, Republik EO-Treasury Bills 2023(24)	EO	EUR	2.300	2.300	0	%	98,9325	2.275.447,50	0,89
XS2066727061	0.2950% Canadian Imperial Bk of Comm. YN-Medium-Term Notes 2019(24)	EO	JPY	500.000	0	0	%	99,7910	2.972.978,61	1,16
DE000A3LE0Z0	4.5000% Debt Marketplace S.a r.l. EO-FLR Fund Lkd Notes 2023(28)	EO	EUR	12.000	0	0	%	101,7159	12.205.912,44	4,76
DE000A3MP5T8	5.0000% Domicil Real Estate AG Pflichtwandelschuld.v. 21(24)	EO	EUR	1.900	0	0	%	109,0169	2.071.321,75	0,81
XS2411312387	5.0000% Zomerschoon B.V. 21/25	EO	EUR	8.500	0	0	%	98,9969	8.414.736,59	3,28
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>249.103.741,53</b>	<b>97,24</b>
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								<b>EUR</b>	<b>-873.235,38</b>	<b>-0,34</b>
<b>Zins-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>-1.169.270,58</b>	<b>-0,46</b>
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>EUR</b>	<b>-1.169.270,58</b>	<b>-0,46</b>
10-Year Gov. of Canada Bond Futures 19.06.2024		XMOD	CAD	60.000.000					-1.058.642,50	-0,41
10-Year Japanese Gov. Bond Futures 13.06.2024		XOSE	JPY	-6.000.000.000					546.982,07	0,21
Euro-BOBL-Futures 06.06.2024		XEUR	EUR	45.000.000					-454.500,00	-0,18
Euro-Schatz-Future 06.06.2024		XEUR	EUR	60.000.000					-247.878,00	-0,10
FBTS 06.06.2024		XEUR	EUR	26.000.000					-104.000,00	-0,04
Long Term Ultra US Treasury Bd Futures 18.06.2024		XCBT	USD	-3.000.000					173.270,79	0,07
Long Term Ultra US Treasury Bd Futures 18.06.2024		XCBT	USD	-3.000.000					-24.502,94	-0,01
<b>Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>296.035,20</b>	<b>0,12</b>
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>								<b>EUR</b>	<b>536.412,00</b>	<b>0,21</b>
<b>Offene Positionen</b>								<b>EUR</b>	<b>536.412,00</b>	<b>0,21</b>
JPY/EUR 500.00 Mio.			OTC						547.924,36	0,21
NOK/EUR 10.20 Mio.			OTC						14.505,18	0,01
USD/EUR 2.00 Mio.			OTC						-26.017,54	-0,01
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>								<b>EUR</b>	<b>-240.376,80</b>	<b>-0,09</b>
<b>Geschlossene Positionen</b>								<b>EUR</b>	<b>-240.376,80</b>	<b>-0,09</b>
JPY/EUR 830.00 Mio.			OTC						-240.376,80	-0,09
<b>Bankguthaben</b>								<b>EUR</b>	<b>4.367.821,53</b>	<b>1,71</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>								<b>EUR</b>	<b>2.153.639,98</b>	<b>0,84</b>
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	2.153.639,98					2.153.639,98	0,84

## 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>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>159.273,78</b>	<b>0,06</b>
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CZK	946,34				37,65	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		DKK	1.079.511,33				144.747,36	0,06
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		NOK	163.456,55				13.875,41	0,01
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		SEK	7.182,19				613,36	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>2.054.907,77</b>	<b>0,80</b>
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		AUD	1,58				0,97	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CAD	1.488.625,41				1.018.037,55	0,40
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CHF	321,61				329,60	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		GBP	1.659,36				1.943,50	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		JPY	216.761.936,00				1.291.556,55	0,50
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		USD	-275.281,68				-256.960,40	-0,10
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>3.727.993,24</b>	<b>1,46</b>
	Quellensteueransprüche		EUR	700.181,03				700.181,03	0,27
	Zinsansprüche		EUR	3.027.812,21				3.027.812,21	1,18
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-159.459,46</b>	<b>-0,06</b>
	Sonstige Verbindlichkeiten <sup>2)</sup>		EUR	-159.459,46				-159.459,46	-0,06
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>256.166.861,46</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert D&amp;R Zinsen V</b>							<b>EUR</b>	<b>90,36</b>	
<b>Anteilwert D&amp;R Zinsen I</b>							<b>EUR</b>	<b>87,55</b>	
<b>Anteilwert D&amp;R Zinsen P</b>							<b>EUR</b>	<b>93,54</b>	
<b>Anteilwert D&amp;R Zinsen I2</b>							<b>EUR</b>	<b>94,07</b>	
<b>Umlaufende Anteile D&amp;R Zinsen V</b>							<b>STK</b>	<b>2.340.355,000</b>	
<b>Umlaufende Anteile D&amp;R Zinsen I</b>							<b>STK</b>	<b>259.820,000</b>	
<b>Umlaufende Anteile D&amp;R Zinsen P</b>							<b>STK</b>	<b>201.338,000</b>	
<b>Umlaufende Anteile D&amp;R Zinsen I2</b>							<b>STK</b>	<b>33.100,000</b>	

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

<sup>2)</sup> 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 30.04.2024				
Australischer Dollar	(AUD)	1,633350	=	1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	(GBP)	0,853800	=	1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,457900	=	1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	(JPY)	167,830000	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,462250	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	11,780300	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	11,709600	=	1 Euro (EUR)

## WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.04.2024		
Schweizer Franken	(CHF)	0,975750	=	1 Euro (EUR)
Tschechische Krone	(CZK)	25,133500	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,071300	=	1 Euro (EUR)

## MARKTSCHLÜSSEL

### Terminbörse

XCBT	CHICAGO BOARD OF TRADE
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND
XMOD	THE MONTREAL EXCHANGE / BOURSE DE MONTREAL
XOSE	OSAKA EXCHANGE

OTC	Over-The-Counter
-----	------------------

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
DK0009397069	1.0000% Jyske Realkredit A/S DK-Anl. Ser.111.E per 2050	DKK	0	4.292
DK0002044551	1.0000% Nordea Kredit Realkreditaktie. DK-Anl. per 2050 Ser.SDRO	DKK	0	4.306
DK0009522815	1.0000% Nykredit Realkredit A/S DK-Anl. Serie 01E/E per 2050	DKK	0	4.378
DK0004612454	1.0000% Realkredit Danmark AS DK-Anl. Serie 23S per 2050	DKK	0	4.345
DE0001102572	0.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2052)	EUR	0	5.000
XS2100269088	0.0100% Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2020(25)Reg.S	EUR	0	14.000
DE0001030567	0.1000% Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.15(26)	EUR	0	5.000
FI4000507231	0.1250% Finnland, Republik EO-Bonds 2021(31)	EUR	0	3.500
SK4120015108	0.2505% Vseobecná úverová Banka AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 19(24)	EUR	0	5.800
XS2259191273	0.5000% Ungarn EO-Bonds 2020(30)	EUR	1.000	1.000
IT0005543803	1.5442% Italien, Republik EO-Infl.Idx Lkd B.T.P.2023(29)	EUR	0	8.000
DE000BU25018	2.4000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.188 v.2023(28)	EUR	0	5.000
DE000A3MQUX3	2.5000% DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1252 22(31)	EUR	0	3.200
DE000SHFM865	2.6250% Schleswig-Holstein, Land Landesschatzanw.v.22(28) A.1	EUR	0	2.000
DE000A30V356	3.0000% Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.272 v.23(33)	EUR	0	500
XS1888179477	3.1000% Vodafone Group PLC EO-FLR Notes 2018(23/79)	EUR	0	300
XS2002496409	3.1250% BayWa AG Notes v.2019(2024/2024)	EUR	0	4.000
DE000A2YNWC7	3.2500% ING-DIBA AG HPF 23/28	EUR	3.100	3.100
IT0005579807	3.2500% Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-Mortg.Covered MTN 2024(28)	EUR	1.000	1.000
IT0005554578	3.6250% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdr.23(28)	EUR	0	3.100
BE0000326356	4.0000% Belgien 12/32	EUR	0	3.000
SK4000021986	4.0000% Slowakei EO-Anl. 2022(32)	EUR	2.000	2.000
XS2579483319	4.5000% Bulgarien EO-Bonds 2023(33) Reg.S	EUR	2.000	4.000
XS2719281227	4.7220% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 23/25	EUR	2.300	2.300
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
CZ0001005920	1.5000% Tschechien KC-Bonds 2020(40)	CZK	0	250.000
DK0009399784	0.5000% Jyske Realkredit A/S DK-Anl. Ser. 111E per 2043	DKK	0	7.868
DK0002047141	0.5000% Nordea Kredit Realkreditaktie. DK-Anl. per 2043	DKK	0	6.018
XS2264194205	0.6250% CTP B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/23)	EUR	0	500
SE0016589105	4.3750% Heimstaden AB EO-Bonds 2021(21/27)	EUR	0	2.000
DE000CZ45YA3	4.6400% Commerzbank AG FLR-MTN Ser.1037 v.24(26/27)	EUR	1.000	1.000
JP503601AH13	0.2840% National Australia Bank Ltd. YN-Notes 2017(24)	JPY	0	700.000

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
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>				
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			1.221.439
10Yr. Austr. Commonw.Treasury Bonds (synth. Anleihe)				
10Yr. Government of Canada Bonds (synth. Anleihe)				
2-3,25Yr. Ita. Rep. Government Bonds (synth. Anleihe)				
2Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe)				
5Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe)				
8,5-10Yr. Ita. Rep. Government Bonds (synth. Anleihe)				
Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe)				
Bundesrep. Deutschland Euro-SCHATZ (synth. Anleihe)				
Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe				
Großbritannien Long Gilt synth.Anleihe)				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			472.337
10Yr. Austr. Commonw.Treasury Bonds (synth. Anleihe)				
10Yr. Japan Government Bonds (synth. Anleihe)				
2Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe)				
Long Term Ultra USA Treasury Bond (synth. Anleihe)				
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>				
<b>Verkauf von Devisen auf Termin:</b>				
CAD/EUR	EUR			17.661
CZK/EUR	EUR			7.140
JPY/EUR	EUR			3.185
NOK/EUR	EUR			1.778
SEK/EUR	EUR			22.951
USD/EUR	EUR			3.683
<b>Optionsrechte</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
Gekaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			2
Euro Bund Futures				
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures)				

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 97,24

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -0,34

### 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 D&R Zinsen V	EUR	90,36
Anteilwert D&R Zinsen I	EUR	87,55
Anteilwert D&R Zinsen P	EUR	93,54
Anteilwert D&R Zinsen I2	EUR	94,07
Umlaufende Anteile D&R Zinsen V	STK	2.340.355,000
Umlaufende Anteile D&R Zinsen I	STK	259.820,000
Umlaufende Anteile D&R Zinsen P	STK	201.338,000
Umlaufende Anteile D&R Zinsen I2	STK	33.100,000

### ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	D&R Zinsen V	D&R Zinsen I
ISIN	DE000A2QAYL7	DE000A2QJKM5
Währung	Euro	Euro
Fondsaufgabe	02.11.2020	01.02.2021
Ertragsverwendung	Ausschüttend	Ausschüttend
Verwaltungsvergütung	0,32% p.a.	0,70% p.a.
Ausgabeaufschlag	3,00%	3,00%
Mindestanlagevolumen	0	100.000

  

	D&R Zinsen P	D&R Zinsen I2
ISIN	DE000A3E3YT1	DE000A3E3YU9
Währung	Euro	Euro
Fondsaufgabe	01.02.2023	01.02.2023
Ertragsverwendung	Ausschüttend	Ausschüttend
Verwaltungsvergütung	1,00% p.a.	0,50% p.a.
Ausgabeaufschlag	3,00%	0,00%
Mindestanlagevolumen	0	1.000.000

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### 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 D&R Zinsen I keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse D&R Zinsen I2 keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse D&R Zinsen P sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse D&R Zinsen 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 Vergütungssysteme 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**

---

Donner & Reuschel AG  
Ballindamm 27  
20095 Hamburg

Haftendes Eigenkapital: 372,400 Mio. EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 20,500 Mio. EUR  
Stand: 31.12.2022

## **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

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

**HANSA**INVEST