

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

Wallrich Marathon Balance

30. Juni 2023

Inhaltsverzeichnis

Vermögensübersicht per 30.06.2023	4
Vermögensaufstellung per 30.06.2023	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Allgemeine Angaben	10

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie über die Entwicklung des offenen inländischen Publikums-AIF (Sonstiges Sondervermögen)

Wallrich Marathon Balance

in der Zeit vom 01.01.2023 bis 30.06.2023.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von +3,95 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Juni 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 30.06.2023

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	10.475.934,17	100,22
1. Aktien	3.318.576,00	31,75
2. Anleihen	1.656.937,43	15,85
3. Investmentanteile	5.116.165,97	48,94
4. Derivate	-21.844,88	-0,21
5. Bankguthaben	390.046,83	3,73
6. Sonstige Vermögensgegenstände	16.052,82	0,15
II. Verbindlichkeiten	-23.019,45	-0,22
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-23.019,45	-0,22
III. Fondsvermögen	EUR 10.452.914,72	100,00

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

Vermögensaufstellung per 30.06.2023

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	3.813.646,00	36,48
Aktien							EUR	3.318.576,00	31,75
DE000A1K0375	artnet		STK	65.000	0	0	EUR 7,8500	510.250,00	4,88
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	7.800	6.300	7.200	EUR 50,5100	393.978,00	3,77
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	3.500	0	0	EUR 111,0400	388.640,00	3,72
DE0005140008	Deutsche Bank		STK	30.000	20.000	30.000	EUR 9,5180	285.540,00	2,73
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	2.000	0	0	EUR 167,4000	334.800,00	3,20
DE0008232125	Deutsche Lufthansa		STK	30.000	0	60.000	EUR 9,4520	283.560,00	2,71
DE000ENAG999	E.ON SE		STK	20.000	0	10.000	EUR 11,5350	230.700,00	2,21
DE0007037129	RWE		STK	15.000	0	0	EUR 39,8200	597.300,00	5,71
DE0007664039	Volkswagen Vorzugsaktien		STK	2.400	0	0	EUR 122,4200	293.808,00	2,81
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	495.070,00	4,74
DE0001102333	1.7500% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2014 (2024)		EUR	500	0	0	% 99,0140	495.070,00	4,74
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	981.283,69	9,39
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	981.283,69	9,39
DE000A2YNQ58	0.5000% Wirecard AG Anleihe v. 19/24		EUR	300	0	0	% 14,7500	44.250,00	0,42
US91282CFV81	4.1250% United States of America DL-Notes 2022(32) Ser.F-2032		USD	1.000	1.000	0	% 102,0430	937.033,69	8,96
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	180.583,74	1,73
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	180.583,74	1,73
DE000A30VKC3	5.0000% V-Bank AG FLR-Nachr.Inh.-Sch.22(27/unb.)		EUR	200	0	0	% 90,2919	180.583,74	1,73
Investmentanteile							EUR	5.116.165,97	48,94
KVG - eigene Investmentanteile							EUR	2.799.133,00	26,78
DE000A2DTL29	Wallrich AI Libero Inhaber-Anteile P		ANT	11.750	0	0	EUR 102,5000	1.204.375,00	11,52
DE000A2JQH30	Wallrich AI Peloton Inhaber-Anteile		ANT	14.600	0	0	EUR 109,2300	1.594.758,00	15,26
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	2.317.032,97	22,17
IE00BGBN6P67	Inves.Mkt.II-I.Elw.GI.B.UC.ETF Registered Acc.Shs USD o.N.		ANT	6.500	0	7.000	EUR 58,1900	378.235,00	3,62
DE000A0F5UF5	iShares NASDAQ-100 UCITS ETF DE		ANT	11.600	11.600	0	EUR 133,5800	1.549.528,00	14,82
IE00B3YCGJ38	I.M.-I.S&P 500 UETF Registered Shares Acc o.N.		ANT	500	500	0	USD 847,8300	389.269,97	3,72
Summe Wertpapiervermögen							EUR	10.091.679,40	96,54

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Derivate							EUR	-21.844,88	-0,21
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	-21.844,88	-0,21
Zinsterminkontrakte							EUR	-21.844,88	-0,21
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures 20.09.2023		XCBT	USD	1.500.000				-21.844,88	-0,21
Bankguthaben							EUR	390.046,83	3,73
EUR - Guthaben bei:							EUR	383.371,37	3,67
Bank: Norddeutsche Landesbank -GZ-			EUR	5,19				5,19	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	383.366,18				383.366,18	3,67
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	6.675,46	0,06
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	211,94				216,98	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			GBP	14,92				17,29	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	7.014,45				6.441,19	0,06
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	16.052,82	0,15
Zinsansprüche			EUR	16.052,82				16.052,82	0,15
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-23.019,45	-0,22
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾			EUR	-23.019,45				-23.019,45	-0,22
Fondsvermögen							EUR	10.452.914,72	100,00
Anteilwert Wallrich Marathon Balance I							EUR	104,74	
Umlaufende Anteile Wallrich Marathon Balance I							STK	99.797,043	

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 30.06.2023				
Britisches Pfund	(GBP)	0,863000	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,976750	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,089000	=	1 Euro (EUR)

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XCBT CHICAGO BOARD OF TRADE

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				
Aktien				
DE000BASF111	BASF SE	STK	0	4.000
Investmentanteile				
KVG - eigene Investmentanteile				
LU1148628354	WALLRICH-Prämienstrategie Actions au Porteur I o.N.	ANT	0	3.000
Gruppenfremde Investmentanteile				
IE00B1XNHC34	iShsII-S&P GI Clean Ergy UCITS Registered Shares o.N.	ANT	0	60.000

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
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte: DAX Index)	EUR			3.876
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte: DAX Index)	EUR			8.027
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte: 10Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe) Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe)	EUR			6.305

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 40.108.275,68 EUR.

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 96,54

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -0,21

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 Marathon Balance I	EUR	104,74
Umlaufende Anteile Wallrich Marathon Balance I	STK	99.797,043

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 Marathon Balance I 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 %
IE00B3YCGJ38	I.M.-I.S&P 500 UETF Registered Shares Acc o.N. ¹⁾	0,35
IE00BGBN6P67	Inves.Mkt.II-I.Elw.GI.B.UC.ETF Registered Acc.Shs USD o.N. ¹⁾	0,65
DE000A0F5UF5	iShares NASDAQ-100 UCITS ETF DE ¹⁾	0,30
IE00B1XNHC34	iShsII-S&P GI Clean Ergy UCITS Registered Shares o.N. ¹⁾	0,65
DE000A2DTL29	Wallrich AI Libero Inhaber-Anteile P ¹⁾	0,95
DE000A2JQH30	Wallrich AI Peloton Inhaber-Anteile ¹⁾	0,95
LU1148628354	WALLRICH-Prämienstrategie Actions au Porteur I o.N. ¹⁾	0,60

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