

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

D&R Zinsen

31. Oktober 2023

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht D&R Zinsen	4
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	29
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	45
Allgemeine Angaben	48

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

D&R Zinsen

in der Zeit vom 01.11.2022 bis 31.10.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Dr. Jörg W. Stotz, Nicholas Brinckmann, Ludger Wibbeke

Tätigkeitsbericht für das Sondervermögen D&R Zinsen für das Geschäftsjahr vom 01.11.2022 bis 31.10.2023

Anlageziel und Anlagepolitik

Ziel des D&R Zinsen ist es eine positive Rendite zu erwirtschaften.

D&R Zinsen ist ein global ausgerichteter Anleihefonds mit einem aktiven Investmentansatz, der sich an keiner Benchmark orientiert. Die Anlage kann in alle verfügbaren Anleiheklassen erfolgen. Über die Auswahl und die Zusammensetzung der jeweiligen Allokation (unter anderem Wertpapierinstrument, Regionen und Sektoren) entscheiden die Anlagegremien der Donner & Reuschel Gruppe auf Basis fundamentaler und quantitativer Analysen. Der Einsatz von Derivaten kann zu Investitions- und auch Absicherungszwecken erfolgen.

Zentralbanken haben global auf die Inflation reagiert und Zinsen erhöht. In März und dem Folgemonat wurde der Markt durch den Kollaps der Credit Suisse und einiger US Regionalbanken beeinflusst. Durch ein Liquiditätsprogramm der US Zentralbank konnte die Situation in den Griff bekommen werden. Im Herbst zeichneten deutlich schwächere Wirtschaftsindikatoren eine mögliche Rezession ab.

Die Duration, als Sensitivitätskennzahl der durchschnittlichen Kapitalbindungsdauer, blieb im Fonds hoch. Das Portfoliomanagement setzt auf eine deutlich frühere und stärkere Zinssenkungsphase.

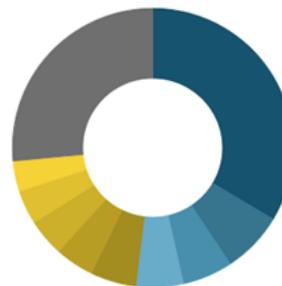
Die Allokation in Unternehmensanleihen wurde niedrig gehalten. Damit ist der Fonds defensiv aufgestellt.

Der Fonds bewirbt unter anderem ökologische oder soziale Merkmale oder eine Kombination aus diesen Merkmalen und ist damit als Fonds gem. Art 8 Abs. 1 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu qualifizieren. Die Angaben zu den regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten werden im Anhang des Jahresberichts ausgegeben.

Portfoliostruktur sowie wesentliche Änderungen im Berichtszeitraum per 31.10.2023



Staatsanleihen	49,8 %
Pfandbriefe	29,8 %
Untern.-Anleihen	20,4 %



Deutschland	33,6 %
Südkorea	7,1 %
Slowakei	5,8 %
Spanien	5,5 %
Italien	5,3 %
Luxemburg	4,5 %
Niederlande	4,3 %
Dänemark	4,0 %
Tschechische Republik	3,5 %
Sonstige	26,5 %

Portfoliostruktur sowie wesentliche Änderungen im Berichtszeitraum per 31.10.2022



Staatsanleihen	37,0 %
Pfandbriefe	35,3 %
Untern.-Anleihen	27,7 %



USA	25,4 %
Deutschland	23,7 %
Niederlande	8,4 %
Frankreich	6,3 %
Großbritannien	4,4 %
Norwegen	4,2 %
Dänemark	4,1 %
Schweden	3,5 %
Finnland	2,8 %
Sonstige	17,1 %

Wesentliche Risiken des Sondervermögens im Berichtszeitraum

Adressenausfallrisiko:

Adressenausfallrisiken resultieren aus dem möglichen Ausfall von Zins- und Tilgungszahlungen der Einzelinvestments in Renten, die so weit wie möglich diversifiziert werden, um Konzentrationsrisiken zu verringern. Dies betrifft nicht nur die Auswahl der Schuldner, sondern auch die Auswahl der Sektoren und Länder.

Marktpreisrisiken:

Marktpreisrisiken resultieren aus den Kursbewegungen der gehaltenen Finanzinstrumente. Die Kurs- oder Marktpreisentwicklung hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird.

Währungsrisiken:

Die Finanzinstrumente können in einer anderen Währung als der Währung des Sondervermögens angelegt sein. Der Fonds erhält die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der anderen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert solcher Anlagen und somit auch der Wert des Fondsvermögens.

Liquiditätsrisiken:

Aufgrund der Anlagepolitik ist das Sondervermögen den Rentenmärkten inhärenten Liquiditätsrisiken ausgesetzt. Um diese Liquiditätsrisiken zu begrenzen, achtet das Fondsmanagement auf ein ausreichendes Emissionsvolumen der einzelnen Anleihen sowie einen hohen Diversifikationsgrad im Sondervermögen.

Operationelle Risiken:

Unter operationellen Risiken wird die Gefahr von Verlusten verstanden, die durch die Unangemessenheit oder das Versagen von internen Verfahren, Menschen und Systemen oder durch externe Ereignisse verursacht werden. Beim operationellen Risiko differenziert die Gesellschaft zwischen technischen Risiken, Personalrisiken, Produktrisiken sowie Risiken aus Kunden- und Geschäftsbeziehungen und hat hierzu u.a. die folgenden Vorkehrungen getroffen:

Ex ante und ex post Kontrollen sind Bestandteil des Orderprozesses.

Rechts- und Personalrisiken werden durch Rechtsberatung und Schulungen der Mitarbeiter minimiert.

Darüber hinaus werden Geschäfte in Finanzinstrumenten ausschließlich über kompetente und erfahrene Kontrahenten abgeschlossen. Die Verwahrung der Finanzinstrumente erfolgt durch eine etablierte Verwahrstelle mit guter Bonität.

Die Ordnungsmäßigkeit der für das Sondervermögen relevanten Aktivitäten und Prozesse wird regelmäßig durch die interne Revision überwacht.

Sonstige Risiken

Seit dem 24.2.2022 führt Russland Krieg gegen die Ukraine („Russland-Ukraine-Krieg“).

Die Börsen sind seit Beginn des Konfliktes von einer deutlich höheren Volatilität geprägt. Die weitere Entwicklung an den Kapitalmärkten hängt von vielen Faktoren ab: vom Verlauf der Kampfhandlungen, den wirtschaftlichen Folgen infolge der gegen Russland und Belarus verhängten Sanktionen, einer weiterhin steigenden bzw. hohen Inflation, der Lage an den Rohstoffmärkten sowie anstehenden geldpolitischen Entscheidungen. Es ist davon auszugehen, dass die Rahmenbedingungen der Weltwirtschaft und an den Börsen weiterhin von erhöhter Unsicherheit geprägt sein werden. Daher unterliegt auch die zukünftige Wertentwicklung dieses Sondervermögens größeren Marktpreisrisiken.

Veräußerungsergebnis

D&R Zinsen V:

Durch Veräußerungsgeschäfte wurde ein Gewinn von 21,003 Mio. Euro erzielt. Dem stehen Verluste von 46,563 Mio. Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Verlust von 25,560 Mio. Euro ergibt.

D&R Zinsen I:

Durch Veräußerungsgeschäfte wurde ein Gewinn von 2,157 Mio. Euro erzielt. Dem stehen Verluste von 4,693 Mio. Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Verlust von 2,536 Mio. Euro ergibt.

D&R Zinsen I2:

Durch Veräußerungsgeschäfte wurde ein Gewinn von 0,193 Mio. Euro erzielt. Dem stehen Verluste von 0,448 Mio. Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Verlust von 0,255 Mio. Euro ergibt.

D&R Zinsen P:

Durch Veräußerungsgeschäfte wurde ein Gewinn von 0,989 Mio. Euro erzielt. Dem stehen Verluste von 2,516 Mio. Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Verlust von 1,527 Mio. Euro ergibt.

Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Sondervermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg.

Das Portfoliomanagement des Sondervermögens übernimmt DONNER & REUSCHEL Luxemburg S.A., Luxemburg.

Die Verwaltungsgesellschaft und der Portfoliomanager gehören der Signal Iduna Gruppe an.

Sonstige für den Anleger wesentliche Ereignisse

Es haben sich für den Anleger keine weiteren wesentlichen Ereignisse ergeben.

Wertentwicklung des D&R Zinsen im abgelaufenen Geschäftsjahr

Im Berichtszeitraum vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 ergaben sich nachfolgende Wertentwicklungen der einzelnen Anteilklassen des D&R Zinsen:

D&R Zinsen V: -5,92%

D&R Zinsen I: -6,22%

D&R Zinsen I2 (ab 1.2.2023): -8,19%

D&R Zinsen P (ab 1.2.2023): -8,48%

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	277.551.602,07	100,09
1. Anleihen	268.503.326,83	96,83
2. Derivate	-410.150,50	-0,15
3. Bankguthaben	3.591.185,77	1,30
4. Sonstige Vermögensgegenstände	5.867.239,97	2,12
II. Verbindlichkeiten	-250.089,46	-0,09
1. Kurzfristige Verbindlichkeiten	-5.236,86	0,00
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-244.852,60	-0,09
III. Fondsvermögen	EUR 277.301.512,61	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾	
							im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	232.890.991,01	83,98	
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	232.890.991,01	83,98	
DE0001102572	0.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2021 (2052)		EUR	5.000	5.000	0	%	42,2245	2.111.225,00	0,76	
XS2100269088	0.0100% Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2020(25)Reg.S		EUR	14.000	14.000	0	%	94,8805	13.283.270,00	4,79	
DE0001030567	0.1000% Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.15(26) ²⁾		EUR	5.000	8.000	3.000	%	98,1380	6.101.141,32	2,20	
FI4000507231	0.1250% Finnland, Republik EO-Bonds 2021(31)		EUR	3.500	3.500	0	%	78,2050	2.737.175,00	0,99	
SK4120015108	0.2500% Vseobecná úverová Banka AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 19(24)		EUR	5.800	1.000	2.000	%	98,3475	5.704.155,00	2,06	
DK0006350657	0.5000% DLR Kredit A/S DK-Anl. per 2043		DKK	18.925	0	1.139	%	75,6600	1.918.416,26	0,69	
DK0009399784	0.5000% Jyske Realkredit A/S DK-Anl. Ser. 111E per 2043		DKK	7.868	0	395	%	74,8480	789.022,21	0,28	
DK0002047141	0.5000% Nordea Kredit Realkreditaktie. DK-Anl. per 2043		DKK	6.018	0	371	%	75,0480	605.157,53	0,22	
DK0009527103	0.5000% Nykredit Realkredit A/S DK-Anl. Serie 01E/E per 2043		DKK	13.898	0	770	%	74,7730	1.392.318,31	0,50	
DK0004616364	0.5000% Realkredit Danmark AS DK-Anl. Serie 22S per 2043		DKK	13.920	0	769	%	74,7980	1.395.063,10	0,50	
ES0000012F76	0.5000% Spanien EO-Obligaciones 2020(30)		EUR	5.500	5.500	0	%	82,7375	4.550.562,50	1,64	
DK0009397069	1.0000% Jyske Realkredit A/S DK-Anl. Ser.111.E per 2050		DKK	4.292	0	148	%	70,4750	405.269,29	0,15	
DK0002044551	1.0000% Nordea Kredit Realkreditaktie. DK-Anl. per 2050 Ser.SDRO		DKK	4.306	0	156	%	70,6250	407.491,09	0,15	
DK0002047224	1.0000% Nordea Kredit Realkreditaktie. DK-Anl. per 2053		DKK	32.250	0	1.081	%	69,8700	3.019.036,33	1,09	
DK0009522815	1.0000% Nykredit Realkredit A/S DK-Anl. Serie 01E/E per 2050		DKK	4.378	0	155	%	70,4000	412.953,04	0,15	
DK0004612454	1.0000% Realkredit Danmark AS DK-Anl. Serie 23S per 2050		DKK	4.345	0	154	%	70,4000	409.825,51	0,15	
SK4000019857	1.0000% Slowakei EO-Anl. 2021(51)		EUR	1.000	0	0	%	45,0905	450.905,00	0,16	
DE000A3MP7K3	1.1250% Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(37)		EUR	2.000	0	0	%	73,8479	1.476.958,88	0,53	
FR0014009O62	1.2500% Frankreich EO-OAT 2022(38)		EUR	570	0	0	%	72,2490	411.819,30	0,15	
IT0005543803	1.5000% Italien, Republik EO-Infl.Idx Lkd B.T.P.2023(29) ²⁾		EUR	8.000	8.000	0	%	96,7320	7.920.493,55	2,86	
CZ0001005920	1.5000% Tschechien KC-Bonds 2020(40)		CZK	250.000	0	0	%	63,5120	6.467.617,11	2,33	
DE000MHB31J9	1.8750% Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser. 2000 v.22(32)		EUR	2.500	0	0	%	87,6360	2.190.900,00	0,79	
DE000LB2ZTL3	2.0000% Landesbank Baden-Württemberg DL-MTN-Pfandbr.S. 828 v.22(25)		USD	1.500	0	0	%	95,1230	1.343.671,72	0,48	
XS2330503694	2.0000% Rumänien EO-MTN 21/33		EUR	500	0	0	%	68,3425	341.712,50	0,12	
DE000BLB6JQ5	2.1250% Bayerische Landesbank Öff.Pfandbr.v.22(31)		EUR	4.000	0	0	%	90,8380	3.633.520,00	1,31	

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
FR001400CGA2	2.1250% Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(30)		EUR	3.000	0	0	%	91,8180	2.754.540,00	0,99
XS2495085784	2.1250% PKO Bank Hipoteczny S.A. EO-Mortg. Covered MTN 2022(25)		EUR	5.000	0	0	%	96,8990	4.844.950,00	1,75
XS2434895558	2.1250% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2022(28)Reg.S		EUR	2.500	0	0	%	86,8315	2.170.787,50	0,78
PTOTEW0E0017	2.2500% Portugal, Republik EO-Obr. 2018(34)		EUR	3.500	3.500	0	%	87,7855	3.072.492,50	1,11
DE000BU2Z007	2.3000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2023 (2033)		EUR	43.000	43.000	0	%	96,0255	41.290.965,00	14,89
ES00000128Q6	2.3500% Spanien EO-Obligaciones 2017(33)		EUR	10.000	10.000	0	%	87,9920	8.799.200,00	3,17
FR001400CM22	2.3750% Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2022(30)		EUR	3.600	0	0	%	93,0395	3.349.422,00	1,21
DE000BU25018	2.4000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.188 v.2023(28)		EUR	5.000	5.000	0	%	98,7025	4.935.125,00	1,78
DE000A3MQUX3	2.5000% DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1252 22(31)		EUR	3.200	0	0	%	92,8105	2.969.936,00	1,07
DE000NWB0AS6	2.5000% NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AE v.22(37)		EUR	4.000	0	0	%	86,7787	3.471.146,64	1,25
DE000BU2Z015	2.6000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2023 (2033)		EUR	2.000	2.000	0	%	98,0420	1.960.840,00	0,71
EU000A3K4DM9	2.6250% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(48)		EUR	1.000	1.000	0	%	80,0715	800.715,00	0,29
DE000SHFM865	2.6250% Schleswig-Holstein, Land Landesschatzanw.v.22(28) A.1		EUR	2.000	2.000	0	%	97,0215	1.940.430,00	0,70
XS2587748174	2.7500% Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts. Ser.1228 v.23(32)		EUR	6.200	6.200	0	%	95,7048	5.933.699,65	2,14
DE000NRW0N67	2.9000% Nordrhein-Westfalen, Land Med.T.LSA v.23(33) Reihe 1561		EUR	1.000	1.000	0	%	95,7083	957.082,75	0,35
DE000A30V356	3.0000% Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.272 v. 23(33)		EUR	500	500	0	%	96,7430	483.715,00	0,17
DE000SCB0047	3.0000% Deutsche Kreditbank AG 23/35		EUR	2.900	2.900	0	%	94,0645	2.727.870,50	0,98
IE000GVLBXU6	3.0000% Irland EO-Treasury Bonds 2023(43)		EUR	800	800	0	%	91,0762	728.609,77	0,26
FR001400FD12	3.0000% La Banq. Postale Home Loan SFH EO-Med.-Ter.Obl.Fin.Hab.23(31)		EUR	1.400	1.400	0	%	96,1315	1.345.841,00	0,49
XS2611177382	3.1000% International Bank Rec. Dev. EO-MTN 23/38		EUR	3.400	3.400	0	%	92,9872	3.161.563,34	1,14
XS1888179477	3.1000% Vodafone Group PLC EO-FLR Notes 2018(23/79)		EUR	300	0	0	%	99,8840	299.652,00	0,11
XS2002496409	3.1250% BayWa AG Notes v. 2019(2024/2024)		EUR	4.000	0	0	%	99,2240	3.968.960,00	1,43
AT0000A33SK7	3.1500% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(53)		EUR	1.750	1.750	0	%	88,9264	1.556.212,63	0,56
XS2254184547	3.2500% Veritas S.p.A. EO-Notes 2020(27)		EUR	250	0	0	%	86,4525	216.131,25	0,08
EU000A2SCAK5	3.3750% Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2023(38)		EUR	3.000	3.000	0	%	94,4085	2.832.255,00	1,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
XS2576364371	3.5000% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(28)		EUR	1.300	1.300	0	%	98,5425	1.281.052,50	0,46
SK4000022828	3.5000% Vseobecná úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2023(26)		EUR	4.600	4.600	0	%	98,7360	4.541.856,00	1,64
XS2178857954	3.6240% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2020(30)Reg.S		EUR	700	700	0	%	85,7880	600.516,00	0,22
IT0005554578	3.6250% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdbr.23(28)		EUR	3.100	3.100	0	%	99,0300	3.069.930,00	1,11
SI0002104303	3.6250% Slowenien, Republik EO-Bonds 2023(33)		EUR	2.000	2.000	0	%	99,6175	1.992.350,00	0,72
XS2638490354	3.7075% Bank of New Zealand EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2023(28)		EUR	3.000	3.000	0	%	99,2881	2.978.642,04	1,07
IT0005552507	3.7500% Banco BPM S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2023(28)		EUR	3.000	3.000	0	%	99,2850	2.978.550,00	1,07
SK4000022539	3.7500% Slowakei EO-Anl. 2023(35)		EUR	5.200	5.200	0	%	94,8035	4.929.782,00	1,78
XS2637445276	3.7500% UniCredit Bk Czech R. +Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(28)		EUR	3.000	3.000	0	%	98,8600	2.965.800,00	1,07
BE0002964451	3.8750% Fluvius System Operator CVBA EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)		EUR	2.000	2.000	0	%	97,4875	1.949.750,00	0,70
XS2648672660	3.8750% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)		EUR	5.000	5.000	0	%	98,0135	4.900.675,00	1,77
BE0000326356	4.0000% Belgien 12/32		EUR	3.000	3.000	0	%	104,7195	3.141.585,00	1,13
XS2532370231	4.0000% Estland, Republik EO-Bonds 22/32		EUR	5.000	0	0	%	101,0290	5.051.450,00	1,82
XS2678945317	4.0820% Korea Housing Fin.Corp. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2023(27)		EUR	6.000	6.000	0	%	100,4865	6.029.190,00	2,17
ES0236463008	4.2000% Audax Renovables S.A. EO-Nts 20/27		EUR	2.000	0	0	%	68,9800	1.379.600,00	0,50
XS2586944147	4.2500% Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(43)		EUR	2.000	2.000	0	%	93,2050	1.864.100,00	0,67
SE0016589105	4.3750% Heimstaden AB EO-Bonds 2021(21/27)		EUR	2.000	0	0	%	40,1340	802.680,00	0,29
XS2579483319	4.5000% Bulgarien EO-Bonds 2023(33) Reg.S		EUR	2.000	2.000	0	%	96,5995	1.931.990,00	0,70
XS2643673952	4.5000% Nasdaq Inc. EO-Notes 2023(23/32)		EUR	700	700	0	%	99,6308	697.415,83	0,25
XS2689949399	5.5000% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2023(28)Reg.S		EUR	3.000	3.000	0	%	99,4520	2.983.560,00	1,08
NO0010976327	5.6400% Heimstaden Bostad AB NK-FLR Med.-T. Nts 2021(26/26)		NOK	8.000	0	0	%	89,8500	607.268,98	0,22
NO0010906944	6.0700% Heimstaden Bostad AB NK-FLR Med.-T.Nts 2020(24/25)		NOK	2.000	0	0	%	95,5365	161.425,58	0,06
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								EUR	13.194.700,08	4,76
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	13.194.700,08	4,76
JP503601AH13	0.2840% National Australia Bank Ltd. YN-Notes 2017(24)		JPY	700.000	700.000	0	%	99,9960	4.423.483,32	1,60
XS2066727061	0.2950% Canadian Imperial Bk of Comm. YN-Medium-Term Notes 2019(24)		JPY	500.000	500.000	0	%	99,6585	3.148.966,76	1,14
XS2264194205	0.6250% CTP B.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/23)		EUR	500	0	0	%	99,5910	497.955,00	0,18
EU000A2SCAC2	2.3750% European Financial Stability Facility (EFSF) 22/32		EUR	2.500	0	0	%	91,8760	2.296.900,00	0,83

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
XS2534912485	2.5000% ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(30)		EUR	3.000	0	0	%	94,2465	2.827.395,00	1,02
Nicht notierte Wertpapiere								EUR	22.417.635,74	8,08
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	22.417.635,74	8,08
DE000A3LE0Z0	4.5000% Debt Marketplace S.a r.l. EO-FLR Fund Lkd Notes 2023(28)		EUR	12.000	12.000	0	%	100,8459	12.101.503,20	4,36
DE000A3MP5T8	5.0000% Domicil Real Estate AG Pflichtwandelschuld.v. 21(24)		EUR	1.900	0	0	%	125,6742	2.387.810,24	0,86
XS2411312387	5.0000% Zomerschoon B.V. 21/ 25		EUR	8.500	0	0	%	93,2744	7.928.322,30	2,86
Summe Wertpapiervermögen								EUR	268.503.326,83	96,83
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								EUR	-410.150,50	-0,15
Zins-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)								EUR	1.143.053,97	0,41
Zinsterminkontrakte								EUR	987.797,85	0,36
10-Year Gov. of Canada Bond Futures 18.12.2023		XMOD	CAD	50.000.000					313.637,76	0,11
10-Year Japanese Gov. Bond Futures 13.12.2023		XOSE	JPY	-9.500.000.000					1.095.873,39	0,40
10-Year Japanese Gov. Bond Futures 13.12.2023		XOSE	JPY	-5.000.000.000					298.091,51	0,11
Euro Bund Futures 07.12.2023		XEUR	EUR	14.500.000					116.000,00	0,04
Euro-BOBL-Futures 07.12.2023		XEUR	EUR	65.100.000					-449.190,00	-0,16
Euro-BOBL-Futures 07.12.2023		XEUR	EUR	27.900.000					-36.270,00	-0,01
Five-Year U.S. Treasury Notes Futures 12/23 29.12.2023		XCBT	USD	18.000.000					-160.237,46	-0,06
Two-Year U.S. Treasury Notes Futures 29.12.2023		XCBT	USD	68.000.000					-190.107,35	-0,07
Optionsrechte								EUR	155.256,12	0,06
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								EUR	155.256,12	0,06
Call 10-Year U.S. Treasury Notes 113,000000000 22.12.2023		XCBT	USD	Anzahl	400				47.085,41	0,02
Call 10-Year U.S. Treasury Notes 113,000000000 23.02.2024		XCBT	USD	Anzahl	450				139.049,11	0,05
Call 10-Year U.S. Treasury Notes 114,000000000 23.02.2024		XCBT	USD	Anzahl	180				43.700,73	0,02
Call 10-Year U.S. Treasury Notes 115,000000000 23.02.2024		XCBT	USD	Anzahl	-180				-34.431,21	-0,01
Call 10-Year U.S. Treasury Notes 116,500000000 23.02.2024		XCBT	USD	Anzahl	680				95.052,08	0,03
Call Euro Bund Future 132,500000000 24.11.2023		XEUR	EUR	Anzahl	250				-62.500,00	-0,02
Call Euro Bund Future 133,000000000 22.12.2023		XEUR	EUR	Anzahl	190				-9.500,00	0,00
Call Euro Bund Future 133,500000000 24.11.2023		XEUR	EUR	Anzahl	520				-83.200,00	-0,03
Call Euro Bund Future 136,500000000 24.11.2023		XEUR	EUR	Anzahl	-250				20.000,00	0,01

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	-1.553.204,47	-0,56
Devisenterminkontrakte (Verkauf)							EUR	1.059.087,46	0,38
Offene Positionen							EUR	434.876,93	0,16
	CAD/EUR 1.00 Mio.	OTC						-742,05	0,00
	CAD/EUR 1.00 Mio.	OTC						13.669,94	0,00
	CAD/EUR 15.00 Mio.	OTC						-11.571,16	0,00
	CAD/EUR 2.00 Mio.	OTC						2.378,52	0,00
	CAD/EUR 2.00 Mio.	OTC						15.326,13	0,01
	CAD/EUR 2.00 Mio.	OTC						-571,25	0,00
	CAD/EUR 3.00 Mio.	OTC						53.212,79	0,02
	CZK/EUR 175.00 Mio.	OTC						-193.953,89	-0,07
	JPY/EUR 500.00 Mio.	OTC						297.219,44	0,11
	JPY/EUR 700.00 Mio.	OTC						382.562,17	0,14
	NOK/EUR 10.50 Mio.	OTC						9.934,28	0,00
	USD/EUR 5.00 Mio.	OTC						-132.587,99	-0,05
Geschlossene Positionen							EUR	624.210,53	0,23
	NOK/EUR 6.50 Mio.	OTC						-25.486,83	-0,01
	USD/EUR 44.00 Mio.	OTC						649.697,36	0,23
Devisenterminkontrakte (Kauf)							EUR	-2.612.291,93	-0,94
Offene Positionen							EUR	-2.612.291,93	-0,94
	JPY/EUR 3500.00 Mio.	OTC						-1.866.185,81	-0,67
	JPY/EUR 500.00 Mio.	OTC						-244.960,24	-0,09
	JPY/EUR 500.00 Mio.	OTC						-249.864,26	-0,09
	JPY/EUR 500.00 Mio.	OTC						-251.281,62	-0,09
Bankguthaben							EUR	3.591.185,77	1,30
EUR - Guthaben bei:							EUR	504.659,98	0,18
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		EUR	504.659,98				504.659,98	0,18
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							EUR	115.929,46	0,04
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CZK	2.461.854,86				100.279,22	0,04
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		DKK	3.436,06				460,38	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		NOK	172.609,88				14.582,72	0,01
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		SEK	7.182,19				607,14	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	2.970.596,33	1,07
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CAD	490.204,80				333.847,38	0,12
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CHF	319,52				333,68	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		GBP	0,06				0,07	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		JPY	337.865.093,00				2.135.143,40	0,77

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		USD	532.300,52				501.271,80	0,18
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	5.867.239,97	2,12
	Cash Collateral		EUR	1.610.000,00				1.610.000,00	0,58
	Quellensteueransprüche		EUR	716.822,81				716.822,81	0,26
	Zinsansprüche		EUR	3.540.417,16				3.540.417,16	1,28
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-5.236,86	0,00
EUR - Kredite							EUR	-5.236,86	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		EUR	-5.236,86				-5.236,86	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-244.852,60	-0,09
	Sonstige Verbindlichkeiten ³⁾		EUR	-244.852,60				-244.852,60	-0,09
Fondsvermögen							EUR	277.301.512,61	100,00
Anteilwert D&R Zinsen V							EUR	88,11	
Anteilwert D&R Zinsen I							EUR	85,54	
Anteilwert D&R Zinsen P							EUR	91,52	
Anteilwert D&R Zinsen I2							EUR	91,81	
Umlaufende Anteile D&R Zinsen V							STK	2.641.848,000	
Umlaufende Anteile D&R Zinsen I							STK	269.497,000	
Umlaufende Anteile D&R Zinsen P							STK	201.352,000	
Umlaufende Anteile D&R Zinsen I2							STK	33.100,000	

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

²⁾ Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um inflationsindexierte Anleihen.

³⁾ 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 31.10.2023		
Britisches Pfund	(GBP)	0,873650	=	1 Euro (EUR)	
Dänische Krone	(DKK)	7,463600	=	1 Euro (EUR)	
Japanischer Yen	(JPY)	158,240000	=	1 Euro (EUR)	
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,468350	=	1 Euro (EUR)	
Norwegische Krone	(NOK)	11,836600	=	1 Euro (EUR)	
Schwedische Krone	(SEK)	11,829500	=	1 Euro (EUR)	
Schweizer Franken	(CHF)	0,957550	=	1 Euro (EUR)	
Tschechische Krone	(CZK)	24,550000	=	1 Euro (EUR)	
US-Dollar	(USD)	1,061900	=	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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS2056376135	0.0100% Skipton Building Society EO-Cov.Med.-T. Bonds 2019(24)	EUR	2.000	2.000
DE0001030542	0.1000% Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.12(23)	EUR	0	23.000
XS1999730374	0.1000% Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2019(24)Reg.S	EUR	2.640	2.640
DE000AAR0249	0.1250% Aareal Bank AG MTN-HPF.S.226 v.2019(2024)	EUR	4.600	4.600
DE000BHY0MT5	0.1250% Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.17(24) Ser.203	EUR	1.400	1.400
DE000CZ40NN0	0.1250% Commerzbank AG 19/24	EUR	0	900
IE00BKFCV568	0.2000% Irland EO-Treasury Bonds 20/27	EUR	4.000	4.000
DE000BLB6JF8	0.2500% Bayerische Landesbank HPF-MTN v.18(24)	EUR	0	5.000
FR0013219573	0.2500% Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab. 2016(24)	EUR	6.000	10.000
FR0013399110	0.2500% Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2019(24)	EUR	500	500
XS2305244241	0.2500% LEASEPLAN 21/26 MTN	EUR	0	250
XS1967590180	0.2500% Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2019(24)	EUR	2.000	2.000
XS1522968277	0.2500% Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	EUR	0	5.000
XS1722558258	0.3750% Achmea Bank N.V. EO-Cov.MTN 17/24	EUR	1.800	1.800
XS1720933297	0.3750% Aegon Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	EUR	5.000	5.000
FR0013238219	0.3750% BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(24)	EUR	3.500	3.500
FR0013255858	0.3750% Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2017(24)	EUR	900	900
FR0013281748	0.3750% Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2017(24)	EUR	500	500
XS1719108463	0.3750% DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 17/24	EUR	630	630
FR0013232998	0.3750% La Banq. Postale Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	EUR	5.000	5.000
XS1880870602	0.3750% SANTANDER UK 18/23 MTN	EUR	500	5.650
XS1637099026	0.3750% SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	EUR	0	7.296
XS1568860685	0.3750% Stadshypotek AB EO-Med.-T. Hyp.-Pfandbr.17(24)	EUR	300	300
XS2393701284	0.4000% American Tower Corp. EO-Notes 2021(21/27)	EUR	0	500
XS1606633912	0.4000% Swedbank Hypotek AB EO-M.-T. Mortg.Cov.Nts 17(24)	EUR	1.700	1.700
XS2346206902	0.4500% American Tower Corp. EO-Notes 2021(2027)	EUR	0	600
XS1523136247	0.4500% Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	EUR	0	5.000
XS1778322351	0.4500% Swedbank Hypotek AB EO-M.-T. Mortg.Cov.Nts 18(23)	EUR	2.610	2.610
FR0013162302	0.5000% Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2016(24)	EUR	400	400
XS1751347946	0.5000% Dexia Crédit Local S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(25)	EUR	5.000	5.000
XS2301127119	0.7500% Akelius Resid.Ppty Fincng B.V. EO-MTN 21/30	EUR	0	800
BE0002483585	0.7500% Belfius Bank S.A. EO-Cov.MTN 15/25	EUR	4.000	4.000
XS2049767598	0.7500% Castellum AB EO-Medium-Term Nts 2019(19/26)	EUR	0	300

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
XS2300292617	0.7500% Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/26)	EUR	0	500
XS2303052695	0.7500% CTP BV 21/27	EUR	0	500
XS1690669574	0.7500% PKO Bank Hipoteczny S.A. EO-Mortg. Covered MTN 2017(24)	EUR	0	1.400
XS2291340433	0.7500% Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/28)	EUR	0	1.000
XS2343114687	0.8750% Eurofins Scientfic EO-MTN 21/31	EUR	0	1.200
XS2385393405	1.0000% Cellnex Finance Company 21/27	EUR	0	400
XS2193733503	1.0000% Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 20/27	EUR	0	300
DE000A3T0YH5	1.0000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15317 v. 22(26)	EUR	0	500
FI4000496468	1.0000% Kemira Oy EO-Notes 2021(27/28)	EUR	0	300
XS2342227837	1.0000% Sagax EURO MTN NL B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/29)	EUR	0	1.000
XS2360853332	1.2880% Prosus N.V. EO-Med.-T.Nts 2021(21/29)144A	EUR	0	2.700
XS2225207468	1.3750% Heimstaden Bostad Treasury B.V EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	EUR	0	300
XS1380394806	1.5000% Ferrari N.V. EO-Notes 2016(16/23)	EUR	0	300
XS2211183244	1.5390% Prosus N.V. EO-MTN 20/28	EUR	0	300
XS2244936659	1.6250% Infrastr. Wirless It. SpA. 20/28	EUR	0	800
XS2332552541	1.6250% Louis Dreyfus Company Finance B.V. 21/28	EUR	0	2.000
FR0011991306	1.7500% Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(24)	EUR	500	500
XS2332687040	1.7500% Infrastrutt. Wireless Italiane EO-MTN 21/31	EUR	0	300
XS1998902479	1.9500% AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/23)	EUR	0	6.500
XS2211183756	2.0310% Prosus N.V. EO-MTN 20/32	EUR	0	200
XS2531929094	2.1250% Danske Mortgage Bank PLC EO-Mortg.Covered MTN 2022(25)	EUR	0	2.000
XS2330501995	2.2500% Athora Netherlands NV 21/31	EUR	0	200
XS2363910436	2.2500% Mexiko EO-Notes 2021(21/36)	EUR	0	1.000
XS1020769748	2.3750% ABN AMRO Bank N.V. EO-Cov. MTN 14/24	EUR	2.400	2.400
FR0011637743	2.3750% BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab. 13/23	EUR	1.200	1.200
XS2536375368	2.3750% Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF 22/26	EUR	0	3.000
XS2293060658	2.3760% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	EUR	0	400
XS2536806289	2.5000% Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2022(28)	EUR	0	2.000
XS2536376416	2.5000% Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(27)	EUR	0	1.000
DE000A289FK7	2.6250% ALLIANZ SUB 20(31)/und	EUR	0	400
FR0014003S56	2.6250% Electricité de France (E.D.F.) EUR-Nts 21/und.	EUR	0	1.000
XS2258400162	2.6250% Rumänien EO-MTN 20/40	EUR	0	200
DE000LB381U7	2.7500% Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(24)R.832	EUR	0	2.000
XS2178857285	2.7500% Rumänien EO-Med.-Term Nts 2020(26)Reg.S	EUR	0	600
FR0014004AE8	3.0000% Air France-KLM S.A. EO-Obl. 2021(21/24)	EUR	0	1.000

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
FR0014005O90	3.0000% La Banque Postale EO-FLR Notes 2021(28/Und.)	EUR	0	2.200
XS2265369657	3.0000% LUFTHANSA AG 20/26	EUR	0	400
XS2555209381	3.1250% Sparebank. Sør Boligkreditt AS EO-Mortg.Cov. MTN 2022(25)	EUR	2.500	2.500
XS2555209035	3.2050% Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(24)	EUR	6.000	6.000
BE6338543786	3.2500% Argenta Spaarbank N.V. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 22(26)	EUR	0	1.000
FR0011213453	3.6000% Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2012(24)	EUR	8.900	8.900
FR001400JHR9	3.6250% Société Générale SFH S.A. EO-M.-T. Obl.Fin.Hab. 2023(26)	EUR	2.000	2.000
XS1795406658	3.8750% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	EUR	0	300
XS2345784057	4.8080% Bank of America Corp. EO-FLR MTN 2021(24/25)	EUR	0	3.600
XS1224953882	4.8750% Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2015(23/Und.)	EUR	0	5.264
FR0011401751	5.3750% Electricité de France EO-FLR MTN 13/25	EUR	0	300
XS2195511006	6.0000% AMS AG 20/25	EUR	0	1.200
XS1858998708	2.2500% Deutsche Telekom AG NK-MTN 18/23	NOK	0	6.000
US03027XBR08	1.4500% American Tower Corp. DL-Notes 21/26	USD	0	900
XS2283177561	3.0000% Zurich Finance (Ireland) DAC DL-FLR MTN 2021(31/51)	USD	0	400
US037833ER75	4.1000% Apple Inc. DL-Notes 2022(22/62)	USD	0	1.500
US65559D2A65	6.6250% Nordea Bank Abp DL-FLR MTN 2019(26/Und.) Reg.S	USD	0	1.000
USN4297BBC74	7.0000% Kon. KPN N.V. DL-FLR Cap.Secs 13(23/73)Reg.S	USD	0	3.000

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

DE000BU0E014	0.0000% Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/01 f.17.01.24	EUR	5.000	5.000
DE000LB1DRT9	0.2000% Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.778 v.17(24)	EUR	0	2.360
DE000A2LQNP8	0.2500% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15286 v. 19(24)	EUR	900	900
FR0013375797	0.3750% ARKEA HOME LOANS 18/24MTN	EUR	300	300
XS1566992415	0.3750% Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2017(24)	EUR	3.300	3.300
XS1565074744	0.3750% Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2017(24)	EUR	1.000	3.000
XS2430951660	0.8770% Barclays PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/28)	EUR	0	1.500
XS2338355014	1.0000% BPP Europe Holdings S.A.R.L. EO-MTN 21/28	EUR	0	1.000
FR0014004UE6	1.0000% Valéo S.E. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28)	EUR	0	900
XS2247718435	1.2500% BPP Europe Holdings S.A.R.L. EO-MTN 20/27	EUR	0	300
XS2135361686	1.3500% Mexiko EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	EUR	0	600
XS2193982803	1.3620% Upjohn Finance B.V. EO-Notes 2020(20/27)	EUR	0	300
XS2289587789	1.4500% Mexiko EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	EUR	0	600
FR0011885722	2.0000% Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Foncières 14(24)	EUR	2.500	5.000
DE000A3E5TR0	2.6000% Allianz 21(32)/und	EUR	0	1.000

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
XS2010032618	2.6240% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	EUR	0	300
XS1785467751	2.6250% Faurecia S.A. EO-Notes 2018(18/25)	EUR	0	100
XS2272358024	2.6250% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB Namn-Aktier Serie D o.N. 2020(26)/und	EUR	0	1.000
XS2536938439	2.6250% Stadshypotek AB EO-Med.-T. Hyp.-Pfandbr.22(29)	EUR	0	7.000
DE000HV2AY79	2.7500% UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2131 v.22(26)	EUR	7.700	7.700
XS2166217278	3.0000% Netflix Inc. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	EUR	0	1.000
XS2332245377	3.1000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Cap.Sec. 2021(28/Und.)	EUR	0	1.200
FR0011182542	4.1250% Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2012(24)	EUR	1.300	1.300
US912828WU04	0.1599% United States of America DL-Inflation-Prot. Secs 14/24	USD	10.000	10.000
US9128286N55	0.6072% United States of America DL-Inflation-Prot. Secs 19/24	USD	11.000	11.000
US9128284H06	0.6250% United States of America DL-Inflation-Prot. Secs 18/23	USD	0	28.500
US9128286R69	2.2500% United States of America DL-Notes 2019(24)	USD	0	20.500
USX10001AB51	3.2000% Allianz 21(28)/und	USD	0	2.600
US912810TK43	3.3750% United States of America DL-Bonds 2022(42)	USD	0	5.000
US500769JX36	3.6250% Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.2023 (2026)	USD	1.000	1.000
US11135FAL58	4.1100% Broadcom Inc. DL-Notes 2020(20/28)	USD	0	300
FR0014002RQ0	4.8750% CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 2021(30/Und.)	USD	0	1.000
USG84228CX43	7.7500% Standard Chartered PLC DL-FLR Bds 2017(23/Und.) Reg.S	USD	0	6.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Zertifikate				
XS2174671102	V.d.Heydt S.F.(Comp. IIV) Fund IIV Compartment 2090	EUR	0	7.000
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU1900228542	NN(L)NN(L)Eur.ABS Act. Nom. I EUR Acc. oN	ANT	0	1.520

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				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			3.653.605
10Yr. Austr. Commonw.Treasury Bonds (synth. Anleihe)				
10Yr. Government of Canada Bonds (synth. Anleihe)				
10Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe)				
2Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe)				
5Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe)				

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
Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe)				
Bundesrep. Deutschland Euro-BUXL (synth. Anleihe)				
Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe				
Großbritannien Long Gilt synth. Anleihe				
Long Term Ultra USA Treasury Bond (synth. Anleihe)				
U.S.A. Treasury (Long) Bonds (synth. Anleihe)				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			2.059.981
10Yr. Austr. Commonw. Treasury Bonds (synth. Anleihe)				
10Yr. Japan Government Bonds (synth. Anleihe)				
10Yr. U.S.A. States Treasury Notes (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-BUXL (synth. Anleihe)				
Bundesrep. Deutschland Euro-SCHATZ (synth. Anleihe)				
Großbritannien Long Gilt synth. Anleihe				
Long Term Ultra USA Treasury Bond (synth. Anleihe)				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
Verkauf von Devisen auf Termin:				
CAD/EUR	EUR			681
CAD/USD	EUR			8.276
NOK/EUR	EUR			1.608
USD/EUR	EUR			95.289
Devisenterminkontrakte (Kauf)				
Kauf von Devisen auf Termin:				
JPY/EUR	EUR			24.041
USD/AUD	EUR			6.151
USD/CAD	EUR			6.151
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Zins-Derivate				
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			746
Euro-Schatz-Future				
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures				
Two-Year U.S. Treasury Notes Futures)				

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) D&R ZINSEN V FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2022 BIS 31.10.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		1.003.967,35
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		3.660.844,84
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		271.871,34
davon negative Habenzinsen	-911,97	
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-6.173,04
Summe der Erträge		4.930.510,49
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-40.671,77
2. Verwaltungsvergütung		-883.856,42
a) fix	-883.856,42	
3. Verwahrstellenvergütung		-111.737,31
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-12.602,59
5. Sonstige Aufwendungen		-32.748,75
6. Aufwandsausgleich		123.895,32
Summe der Aufwendungen		-957.721,52
III. Ordentlicher Nettoertrag		3.972.788,97
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		21.002.827,11
2. Realisierte Verluste		-46.562.873,21
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-25.560.046,10
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-21.587.257,13
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-2.203.780,71
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		9.969.775,81
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		7.765.995,10
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-13.821.262,03

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) D&R ZINSEN I FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2022 BIS 31.10.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		97.933,68
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		360.400,45
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		27.554,07
davon negative Habenzinsen	-89,42	
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-685,52
Summe der Erträge		485.202,68
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-4.420,34
2. Verwaltungsvergütung		-199.280,60
a) fix	-199.280,60	
3. Verwahrstellenvergütung		-12.134,42
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-2.086,76
5. Sonstige Aufwendungen		-3.620,98
6. Aufwandsausgleich		41.332,71
Summe der Aufwendungen		-180.210,39
III. Ordentlicher Nettoertrag		304.992,29
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		2.157.069,21
2. Realisierte Verluste		-4.692.932,34
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-2.535.863,13
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-2.230.870,84
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-550.006,93
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		1.635.621,51
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.085.614,58
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.145.256,26

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) D&R ZINSEN P FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.02.2023 BIS 31.10.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		64.689,21
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		229.867,27
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		13.645,35
davon negative Habenzinsen	-72,60	
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-101,86
Summe der Erträge		308.099,97
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-1.802,80
2. Verwaltungsvergütung		-142.588,96
a) fix	-142.588,96	
3. Verwahrstellenvergütung		-5.720,12
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-1.239,18
5. Sonstige Aufwendungen		-1.866,65
6. Aufwandsausgleich		258,96
Summe der Aufwendungen		-152.958,75
III. Ordentlicher Nettoertrag		155.141,22
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		988.947,61
2. Realisierte Verluste		-2.516.376,35
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.527.428,74
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.372.287,52
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		795.582,09
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-1.227.876,04
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-432.293,95
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.804.581,47

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) D&R ZINSEN I2 FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.02.2023 BIS 31.10.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		10.422,24
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		37.616,79
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		2.182,42
davon negative Habenzinsen	-14,95	
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-16,03
Summe der Erträge		50.205,42
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-302,54
2. Verwaltungsvergütung		-11.753,51
a) fix	-11.753,51	
3. Verwahrstellenvergütung		-941,78
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-744,73
5. Sonstige Aufwendungen		-220,79
6. Aufwandsausgleich		306,45
Summe der Aufwendungen		-13.656,90
III. Ordentlicher Nettoertrag		36.548,52
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		192.562,53
2. Realisierte Verluste		-447.527,83
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-254.965,30
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-218.416,78
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		177.522,77
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-202.477,84
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-24.955,07
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-243.371,85

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN V

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.11.2022)		283.209.321,26
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-33.651.896,57
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	42.438.576,75	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-76.090.473,32	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-2.953.019,63
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-13.821.262,03
davon nicht realisierte Gewinne	-2.203.780,71	
davon nicht realisierte Verluste	9.969.775,81	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2023)		232.783.143,03

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN I

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.11.2022)		34.800.543,13
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-10.093.604,76
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	2.599.676,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-12.693.281,26	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-509.816,62
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.145.256,26
davon nicht realisierte Gewinne	-550.006,93	
davon nicht realisierte Verluste	1.635.621,51	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2023)		23.051.865,49

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN P

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.02.2023)		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		20.188.852,46
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	20.280.630,20	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-91.777,74	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		43.194,59
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.804.581,47
davon nicht realisierte Gewinne	795.582,09	
davon nicht realisierte Verluste	-1.227.876,04	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2023)		18.427.465,58

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN I2

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.02.2023)		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		3.245.867,49
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	4.247.450,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.001.582,51	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		36.542,87
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-243.371,85
davon nicht realisierte Gewinne	177.522,77	
davon nicht realisierte Verluste	-202.477,84	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2023)		3.039.038,51

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN V ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	62.087.247,81	23,50
1. Vortrag aus dem Vorjahr	37.111.631,73	14,05
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-21.587.257,13	-8,17
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	46.562.873,21	17,63
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-59.709.584,60	-22,60
1. Der Wiederanlage zugeführt	-24.792.113,15	-9,38
2. Vortrag auf neue Rechnung	-34.917.471,45	-13,22
III. Gesamtausschüttung	2.377.663,20	0,90
1. Endausschüttung	2.377.663,20	0,90
a) Barausschüttung	2.377.663,20	0,90

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN I ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	6.149.281,99	22,82
1. Vortrag aus dem Vorjahr	3.687.220,49	13,68
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-2.230.870,84	-8,28
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	4.692.932,34	17,41
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-5.914.819,60	-21,95
1. Der Wiederanlage zugeführt	-2.457.039,78	-9,12
2. Vortrag auf neue Rechnung	-3.457.779,82	-12,83
III. Gesamtausschüttung	234.462,39	0,87
1. Endausschüttung	234.462,39	0,87
a) Barausschüttung	234.462,39	0,87

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN P ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	1.144.088,83	5,68
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.372.287,52	-6,82
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	2.516.376,35	12,50
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-956.831,47	-4,75
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	-956.831,47	-4,75
III. Gesamtausschüttung	187.257,36	0,93
1. Endausschüttung	187.257,36	0,93
a) Barausschüttung	187.257,36	0,93

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS D&R ZINSEN I2 ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	229.111,05	6,92
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-218.416,78	-6,60
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	447.527,83	13,52
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-198.328,05	-5,99
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	-198.328,05	-5,99
III. Gesamtausschüttung	30.783,00	0,93
1. Endausschüttung	30.783,00	0,93
a) Barausschüttung	30.783,00	0,93

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE D&R ZINSEN V

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	232.783.143,03	88,11
2022	283.209.321,26	93,65
2021	218.904.826,81	102,75
(Auflegung 02.11.2020)	1.000.000,00	100,00

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE D&R ZINSEN I

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	23.051.865,49	85,54
2022	34.800.543,13	91,21
2021	21.533.656,27	100,35
(Auflegung 01.02.2021)	500.000,00	100,00

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE D&R ZINSEN P

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	18.427.465,58	91,52
(Auflegung 01.02.2023)	100,00	100,00

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE D&R ZINSEN I2

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	3.039.038,51	91,81
(Auflegung 01.02.2023)	100,00	100,00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	452.516.828,28
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Donner & Reuschel AG		
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		96,83
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		-0,15
Dieses Sondervermögen wendet gemäß Derivateverordnung den einfachen Ansatz an.		

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	88,11
Anteilwert D&R Zinsen I	EUR	85,54
Anteilwert D&R Zinsen P	EUR	91,52
Anteilwert D&R Zinsen I2	EUR	91,81
Umlaufende Anteile D&R Zinsen V	STK	2.641.848,000
Umlaufende Anteile D&R Zinsen I	STK	269.497,000
Umlaufende Anteile D&R Zinsen P	STK	201.352,000
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

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.

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE D&R ZINSEN V

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,37 %
---	--------

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE D&R ZINSEN I

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,72 %
---	--------

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE D&R ZINSEN P

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,79 %
---	--------

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE D&R ZINSEN I2

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,44 %
---	--------

Die Gesamtkostenquote für die Anteilklassen I2 und P betrachten aufgrund der Neuauflage den Zeitraum vom 01.02.2023 bis zum 31.10.2023.

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.11.2022 BIS 31.10.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	12.394.627.814,64
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	12.394.627.814,64
Relativ in %	100,00 %

Transaktionskosten: 510.826,63 EUR

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurden keine Pauschalvergütungen an die Kapitalverwaltungsgesellschaft oder an Dritte gezahlt.

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.

VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
LU1900228542	NN(L)NN(L)Eur.ABS Act. Nom. I EUR Acc. oN ¹⁾	0,36

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

D&R Zinsen V

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Bewertung von Vermögensgegenständen	EUR	6.853,00
Ratingkosten	EUR	11.261,15

D&R Zinsen I

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Bewertung von Vermögensgegenständen	EUR	772,00
Ratingkosten	EUR	1.269,62

D&R Zinsen P

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Bewertung von Vermögensgegenständen	EUR	235,67
Ratingkosten	EUR	786,06

D&R Zinsen I2**Sonstige Erträge**

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Aufwand Marktrisiko- und Liquiditätsrisikomessung DerivateV	EUR	19,30
Bewertung von Vermögensgegenständen	EUR	38,02
Ratingkosten	EUR	60,50

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

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2022 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)	EUR	22.647.706
davon feste Vergütung	EUR	18.654.035
davon variable Vergütung	EUR	3.993.671
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)		298
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risktaker)	EUR	1.499.795
davon Geschäftsleiter	EUR	1.129.500
davon Führungskräfte	EUR	370.295

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen aus dem Fonds an Mitarbeiter der Auslagerungsunternehmen.

Die Vergütungsdaten der Donner & Reuschel Luxemburg S.A. für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager		Donner & Reuschel Luxemburg S.A.
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	3.544.829,00
davon feste Vergütung	EUR	3.312.778,00
davon variable Vergütung	EUR	232.051,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens		32

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

D&R Zinsen

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900NYFDA4J2QHTT80

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: _%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es _% an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: _%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



INWIEWEIT WURDEN DIE MIT DEM FINANZPRODUKT BEWORBENEN ÖKOLOGISCHEN UND/ODER SOZIALEN MERKMALE ERFÜLLT?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewirbt unter Berücksichtigung bestimmter Ausschlusskriterien ökologische oder soziale Merkmale oder eine Kombination aus diesen Merkmalen.

Für den Fonds sind folgende ESG-Faktoren maßgeblich:

Mindestens 51% des Wertes des Sondervermögens müssen in Wertpapiere investiert werden, die unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitskriterien ausgewählt werden und von dem Datenprovider MSCI ESG Research LLC unter ökologischen und sozialen Kriterien

analysiert und positiv bewertet werden. Im Rahmen dieser Mindestquote von 51% sind nur solche Titel erwerbbar, die ein ESG Rating von mindestens BB aufweisen. Ferner wurden ESG-Ausschlusskriterien berücksichtigt.

Die Ausrichtung an den vorgegebenen ESG-Faktoren wurde ordnungsgemäß in den Anlageprozess implementiert. Die beworbenen Merkmale wurden im Laufe des Berichtszeitraumes durchgehend beachtet. Es wurden keine Verstöße gegen die im Verkaufsprospekt dargestellten Ausschlusskriterien oder Anlagegrenzen festgestellt.

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts - PAI) sind kein Bestandteil der Anlagestrategie des Sondervermögens.

Der Fonds darf in Aktien und Anleihen investieren, für welche (noch) keine Daten des Datenproviders MSCI ESG Research LLC vorhanden sind und damit aktuell nicht gesagt werden kann, ob gegen die im Verkaufsprospekt genannten Ausschlusskriterien verstoßen wurde. Sobald für solche Aktien und Anleihen Daten vorhanden sind, wurden die im Verkaufsprospekt genannten Ausschlusskriterien eingehalten. Sie gelten also für 100 % der Aktien und Anleihen, die entsprechend gescreent werden konnten.

Es wurden keine Derivate verwendet, um die von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

Die HANSAINVEST berücksichtigt bei der Verwaltung von Vermögensanlagen derzeit noch nicht umfassend und systematisch etwaige nachteilige Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Unter Nachhaltigkeitsfaktoren verstehen wir in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die gesetzlichen Anforderungen hierfür sind neu und sehr detailliert. Ihre sorgfältige Umsetzung verlangt von uns einen erheblichen Aufwand. Zudem liegen im Markt aktuell die maßgeblichen Daten, die zur Feststellung und Gewichtung herangezogen werden müssen, nicht in ausreichendem Umfang vor.

Allerdings verwaltet unser Unternehmen einzelne Investmentfonds, bei denen die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren verbindlich festgelegter Teil der Anlagestrategie ist. Diese Fonds bewerben entweder ökologische und/ oder soziale Merkmale als Teil ihrer Anlagepolitik, oder streben nachhaltige Investitionen im Sinne der Verordnung (EU) 2019/2088 an. Gemäß der eben genannten Verordnung informieren wir in den vorvertraglichen Informationen, in den Jahresberichten und auf unserer Homepage für jeden dieser Fonds über die festgelegten Merkmale oder Nachhaltigkeitsziele sowie darüber, ob und ggf. wie die Berücksichtigung nachteiliger Nachhaltigkeitsauswirkungen Bestandteil der Anlagestrategie ist.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikatoren zu der dezidierten ESG-Anlagestrategie:

Zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, wur-

den Kriterien aus den Bereichen Umwelt (Environment), Soziales (Social) und verantwortungsvoller Unternehmensführung (Governance) herangezogen und in einem ESG-Rating zusammengefasst. Entsprechend sind im Rahmen der zuvor genannten Mindestquote von 51 % nur solche Titel erwerbbar, die ein ESG-Rating von mindestens BB aufwiesen.

Die im Fonds enthaltenen Wertpapiere weisen ein ESG-Rating von mindestens BB (MSCI) in Höhe von 84,82 % auf.

Nachhaltigkeitsindikatoren zu den Ausschlusskriterien:

Der Fonds darf in Aktien investieren, für welche (noch) keine Daten des Datenproviders MSCI ESG Research LLC vorhanden sind und damit aktuell nicht gesagt werden kann, ob gegen die nachfolgend genannten Ausschlusskriterien verstoßen wurde. Sobald für solche Aktien und Anleihen Daten vorhanden waren, wurden die genannten Ausschlusskriterien eingehalten. Sie gelten also für alle Aktien und Anleihen, die entsprechend gescreent werden konnten. Die Daten für die dezidierte ESG-Anlagestrategie als auch die Ausschlusskriterien wurden durch den Datenprovider MSCI zur Verfügung gestellt. Es wurden für den Fonds keine Aktien von Unternehmen erworben, die gemäß den im Verkaufsprospekt dargestellten Ausschlusskriterien ausgeschlossen sind.

Die Grundlage der Berechnungsmethode beruht auf den börsentäglich ermittelten Durchschnittswerten des durchschnittlichen Fondsvolumens.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ein Vergleich ist erst ab dem darauffolgendem Jahr möglich.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



WELCHE SIND DIE HAUPTINVESTITIONEN DIESES FINANZPRODUKTS?

Es wurden die Sektoren anhand der NACE Codes ausgewiesen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten im Vergleich zum kumulierten Fondsvolumen abzüglich der Kasse, da diese keine Hauptinvestition darstellt. Dadurch können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.11.2022 - 31.10.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
United States of America DL-Notes 2019(24) (US9128286R69)	Staatsanleihen	4,22%	USA
Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v. 12(23) (DE0001030542)	Staatsanleihen	4,17%	Deutschland
United States of America DL-Inflation-Prot. Secs 18(23) (US9128284H06)	Staatsanleihen	3,38%	USA
Zomerschoon B.V. EO-FLR Notes 2021(53) (XS2411312387)	Sonst.m.Finanzd.v.T.	2,81%	Niederlande
Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2016(24) (FR0013219573)	KI (ohne Spezial-KI)	2,55%	Frankreich
Vseobecná úverová Banka AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 19(24) (SK4120015108)	KI (ohne Spezial-KI)	2,28%	Slowakei
Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) (DE000BU2Z007)	Staatsanleihen	2,24%	Deutschland
Tschechien KC-Bonds 2020(40) (CZ0001005920)	Staatsanleihen	2,16%	Tschechische Republik
Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2020(25)Reg.S (XS2100269088)	Son. Finanzdienstl.	2,09%	Südkorea
SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24) (XS1637099026)	KI (ohne Spezial-KI)	2,00%	Norwegen
UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2131 v. 22(26) (DE000HV2AY79)	KI (ohne Spezial-KI)	1,95%	Deutschland
Debt Marketplace S.a r.l. EO-FLR Fund Lkd Notes 2023(28) (DE000A3LE0Z0)	Son. Finanzdienstl.	1,91%	Luxemburg
AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/23) (XS1998902479)	Telekommunikation	1,83%	USA
Estland, Republik EO-Bonds 2022(32) (XS2532370231)	Staatsanleihen	1,68%	Estland
Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(24) (XS2555209035)	KI (ohne Spezial-KI)	1,67%	Australien



WIE HOCH WAR DER ANTEIL DER NACHHALTIGKEITSBEZOGENEN INVESTITIONEN?

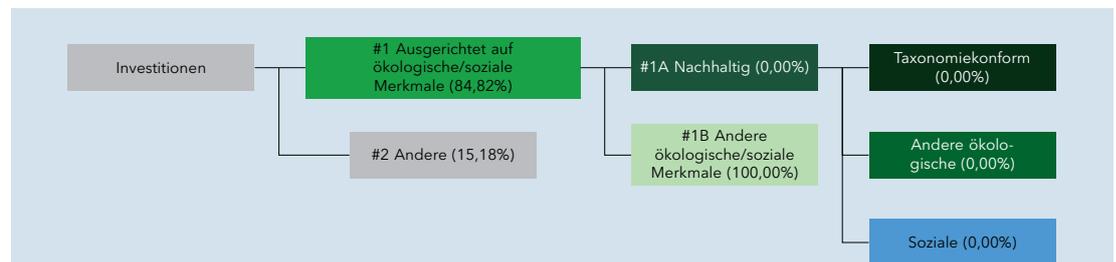
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Mindestanteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erfüllung der beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfolgen, muss 51 % des Wertes des Sondervermögens betragen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten für den relevanten Bezugszeitraum 01.11.2022 bis 31.10.2023. Dadurch können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

In der nachfolgenden graphischen Aufstellung erfolgt eine Aufteilung der Vermögensgegenstände des Fonds in verschiedene Kategorien. Der jeweilige durchschnittliche Anteil am Fondsvermögen wird in Prozent angegeben.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst die Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Nachfolgend werden die Sektoren anhand der NACE Codes ausgewiesen.

Es wurden im Berichtszeitraum vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 gemäß Art. 54 Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission keine Investitionen in den dort genannten Sektoren durchgeführt. Der Anteil der Investitionen in den Sektoren und Teilspektoren von fossilen Brennstoffe ist somit 0,00 %.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswert im Vergleich zum kumulierten Fondsvolumen abzüglich der Kasse, da diese keine Hauptinvestition darstellt. Dadurch können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

Sektor	Anteil
Beteiligungsgesellsch.	1,32%
Drahtl.Telekommunikation	0,06%
Effekten- + Warenbörsen	-0,56%
Elektrizitätserz.	0,46%
Fernsehveranstalter	0,01%
Großh. elektr.Bauteile	0,00%
Grundstücks-+Wohnungsw.	0,26%
Her.v.chem.Grundst.,Dün.	0,02%
Herst. DV-Geräte	0,04%
Herst.el.Bauel.	0,01%
Herst.Teile+Zub. Kraftw.	0,01%
Kauf+Vk eig.Grundst.,G.	1,06%
KI (ohne Spezial-KI)	51,24%
Lebensversicherungen	0,01%
Luftfahrt	0,03%
Son. Finanzdienstl.	6,33%
Sonst.m.Finanzd.v.T.	2,81%
Techn.,ph.+chem.Unters.	0,88%
Telekommunikation	2,45%
Transport in Rohrfernln.	0,03%
Treuhand-+ sonst.Fonds	0,07%
Verw.+Führ. v. Unt.	1,59%
Staatsanleihen	31,88%



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei.

Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirt-

schaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

● **Wurden mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

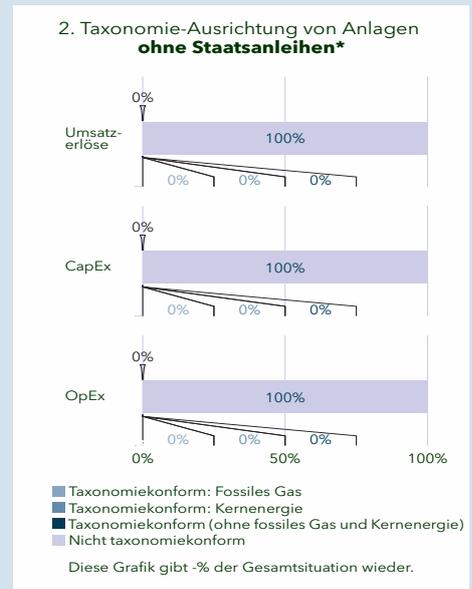
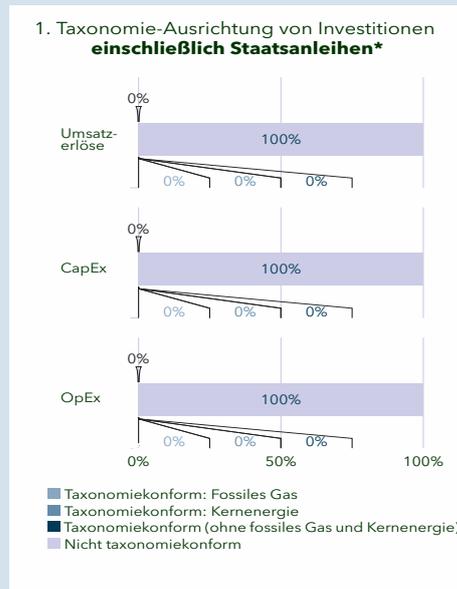
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z.B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in abgesetzter Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Die maßgeblichen Daten, die zur Ermittlung des Anteils der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten herangezogen werden müssen, liegen noch nicht in ausreichendem Umfang vor. Daher wird der folgende Anteil angegeben:

Art der Wirtschaftstätigkeit	Anteil
Ermöglichende Tätigkeiten	0,00%
Übergangstätigkeiten	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Sondervermögen strebt keine nachhaltigen Investitionen an. Insofern wurden keine derartigen Investitionen getätigt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter "Andere Investitionen" können Investitionen in Aktien und Aktien gleichwertige Wertpapiere, Wertpapiere, die keine Aktien und Aktien gleichwertige Wertpapiere sind, Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Investmentanteile, Derivate und sonstige Anlageinstrumente fallen.

Andere Investitionen hatten im Berichtszeitpunkt einen durchschnittlichen Anteil von 15,18 %.

Dabei darf das Finanzprodukt bis zu 49 % des Wertes des Sondervermögens in "Andere Investitionen" investieren, wobei der Portfolioverwalter die Investitionen in "Andere Investitionen" zur Liquiditätserhaltung, zur Absicherung und/oder zur Schaffung einer zusätzlichen Rendite vornehmen kann. Im Berichtszeitraum gehörten hierzu Investitionen in Bankguthaben sowie liquide Mittel (z.B. Sichteinlagen oder Festgelder).

Im relevanten Zeitraum vom 01.11.2022 bis zum 31.10.2023 gehörten hierzu Investitionen in Bankguthaben und liquide Mittel, die aus Liquiditätszwecken gehalten wurden.



WELCHE MASSNAHMEN WURDEN WÄHREND DES BEZUGSZEITRAUMS ZUR ERFÜLLUNG DER ÖKOLOGISCHEN UND/ ODER SOZIALEN MERKMALE ERGRIFFEN?

Es wurde die Ausrichtung an den vorgegebenen ESG-Faktoren ordnungsgemäß in den Anlageprozess implementiert. Die beworbenen Merkmale wurden im Laufe des relevanten Zeitraums vom 01.11.2022 bis 31.10.2023 durchgehend beachtet. Es wurden keine Verstöße gegen die dargestellten Ausschlusskriterien oder Anlagegrenzen festgestellt.

Sofern Daten des Datenproviders für die Bewertung vorhanden waren, erfolgte die Anlage in Wertpapieren im Einklang mit den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Kriterien.

Das Abstimmungsverhalten bei Hauptversammlungen der HANSAINVEST sowie der Umgang mit Aktionärsanträgen kann unter "<https://www.hansainvest.de/unternehmen/compliance/abstimmungsverhalten-bei-hauptversammlungen>" eingesehen werden.

Bei der HANSAINVEST nehmen wir unsere treuhänderische Pflicht gegenüber unseren Kunden sehr ernst und handeln in deren alleinigem Interesse. Wir sind davon überzeugt, dass gute Corporate Governance ein zentraler Faktor für langfristig höhere relative Renditen auf Aktien- und festverzinsliche Anlagen ist. Wir lassen uns bei unseren Anlageentscheidungen daher nicht nur von kurzfristigen finanziellen Zielen leiten. Vielmehr erwarten wir von den Unternehmen, in die wir investieren, auch eine nachhaltige verantwortungsvolle Unternehmensführung, die ESG-relevante Aspekte berücksichtigt. Entsprechend der bereits vollzogenen ESG Integration berücksichtigt die HANSAINVEST im Rahmen der Ausübung der Aktionärsrechte daher auch nichtfinanzielle Kriterien, wie die Rücksichtnahme auf die Umwelt (E für Environment), soziale Kriterien (S für Social), sowie eine verantwortungsvolle Unternehmensführung (G für Governance). Dabei stützen wir uns auf anerkannte nationale und internationale Regelwerke wie beispielsweise die jeweils aktuellen Analyse-Leitlinien für Hauptversammlungen (ALHV) des Bundesverbands Investment und Asset Management e.V. (BVI), des Deutschen Corporate Governance Kodex bzw. der in den jeweiligen Ländern geltenden Kodizes sowie die UN Principles for Responsible Investment (PRI), deren erklärtes Ziel es ist, ein besseres Verständnis der Auswirkungen von Investitionsaktivitäten auf Umwelt-, Sozial und Unternehmensführungsthemen zu schaffen und Investoren bei der Integration dieser Fragestellungen zu unterstützen.

Um mögliche Interessenkonflikte zum Nachteil unserer Anleger zu vermeiden, haben wir verschiedene organisatorische Maßnahmen getroffen und diese in unseren Grundsätzen für den Umgang mit Interessenkonflikten veröffentlicht: Conflicts of Interest Policy

Der Bericht über das Abstimmungsverhalten im Zuge der Ausübung unserer Aktionärsrechte kann über unsere Homepage eingesehen werden:

<https://www.hansainvest.de>

Hamburg, 16. Februar 2024

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,
Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens D&R Zinsen – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. November 2022 bis zum 31. Oktober 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum zum 31. Oktober 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. November 2022 bis zum 31. Oktober 2023, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsur-

teil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* abzugeben
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* bei der Aufstellung des Jahres-

berichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Hamburg, den 19.02.2024

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner
Wirtschaftsprüfer

Lüning
Wirtschaftsprüfer

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 (bis zum 10.02.2024)

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

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

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST