

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



HanseMerkur Strategie ausgewogen

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. APRIL 2024

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

ASSET MANAGEMENT:



HanseMerkurTrust

Halbjahresbericht HanseMerkur Strategie ausgewogen

Vermögensübersicht zum 30.04.2024

| Anlageschwerpunkte | Tageswert in EUR | % Anteil am Fondsvermögen |
|----------------------------------|----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 49.727.867,07 | 100,26 |
| 1. Investmentanteile | 45.117.812,50 | 90,97 |
| EUR | 43.539.396,07 | 87,78 |
| USD | 1.578.416,43 | 3,18 |
| 2. Bankguthaben | 2.551.972,75 | 5,15 |
| 3. Geldmarktfonds | 2.043.200,00 | 4,12 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | 14.881,82 | 0,03 |
| II. Verbindlichkeiten | -129.981,81 | -0,26 |
| III. Fondsvermögen | 49.597.885,26 | 100,00 |

Halbjahresbericht

HanseMercur Strategie ausgewogen

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2024 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------------|----------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen | | | | | | | EUR | 45.117.812,50 | 90,97 |
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 45.117.812,50 | 90,97 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | EUR | 45.117.812,50 | 90,97 |
| Amundi I.S.-A.PRIM.EURO GOVIES Nam.-Ant.UC.ETF DR EUR Acc.oN | LU2089238898 | ANT | 245.000 | 203.000 | 86.000 | EUR | 17,244 | 4.224.780,00 | 8,52 |
| ARERO - Der Weltfonds Inhaber-Anteile o.N. | LU0360863863 | ANT | 5.250 | 0 | 0 | EUR | 267,940 | 1.406.685,00 | 2,84 |
| BRFIDF-iShs Eu.I.G.C.B.In.(IE) Reg.D Acc.Shares EUR o.N | IE00BDRK7J14 | ANT | 360.000 | 0 | 0 | EUR | 10,147 | 3.652.920,00 | 7,37 |
| BRISF-iShs De.World Ind.Fd(IE) Reg.Units EUR Inst.Acc. o.N. | IE00B62WCL09 | ANT | 79.000 | 0 | 0 | EUR | 42,833 | 3.383.807,00 | 6,82 |
| BRISF-iShs Europe Index Fd(IE) Reg. Shs EUR Inst. Acc. o.N. | IE00B4K9F548 | ANT | 211.855 | 0 | 0 | EUR | 26,730 | 5.662.884,15 | 11,42 |
| Deka MSCI Europe UCITS ETF Inhaber-Anteile | DE000ETFL284 | ANT | 140.000 | 0 | 70.000 | EUR | 17,216 | 2.410.240,00 | 4,86 |
| iShs VI-E.MSCI Eur.Min.Vol.U.E Reg. Shares EUR (Acc) o.N. | IE00B86MWN23 | ANT | 41.238 | 0 | 0 | EUR | 57,230 | 2.360.050,74 | 4,76 |
| iShsII-Core MSCI Europe U.ETF Registered Shares o.N. | IE00B1YZSC51 | ANT | 35.000 | 0 | 95.000 | EUR | 31,710 | 1.109.850,00 | 2,24 |
| iShsIII-Core EO Govt Bd U.ETF Registered Shares o.N. | IE00B4WXJJ64 | ANT | 54.000 | 7.000 | 0 | EUR | 109,285 | 5.901.390,00 | 11,90 |
| JPMorg.I.-Global Balanced Fund Namens-Anteile C o.N. | LU0079555370 | ANT | 1.300 | 0 | 0 | EUR | 1.803,630 | 2.345.242,05 | 4,73 |
| L&G Euro High Alpha Corp.Bd Fd Act. Nom. I EUR Acc. oN | LU1003761993 | ANT | 1.800.000 | 0 | 0 | EUR | 0,957 | 1.723.320,00 | 3,47 |
| M+G(L)IF1-M+G(L)Inc.Alloc. Act.Nom. CI Acc. EO o.N. | LU1582985542 | ANT | 185.000 | 0 | 0 | EUR | 11,217 | 2.075.163,50 | 4,18 |
| MUL Amundi EUR GovBond 10-15Y UCITS ETF Inh.Anteile Acc | LU1650489385 | ANT | 8.000 | 8.000 | 0 | EUR | 191,635 | 1.533.080,00 | 3,09 |
| Swisscanto(LU)Ptf-Sust.Bal.EUR Act. Nom. DA EUR Dis. oN | LU1813277669 | ANT | 14.630 | 0 | 0 | EUR | 127,450 | 1.864.593,50 | 3,76 |
| Vang.Inv.S.-European Stk.Index Reg. Shs.EUR Acc o.N. | IE0007987708 | ANT | 124.700 | 0 | 0 | EUR | 31,158 | 3.885.390,13 | 7,83 |
| Amundi Index Solu.-A.PRIME GL. Nam.-Ant.UC.ETF DR USD Acc.oN | LU2089238203 | ANT | 57.000 | 0 | 0 | USD | 29,605 | 1.578.416,43 | 3,18 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 45.117.812,50 | 90,97 |

Halbjahresbericht HanseMerkur Strategie ausgewogen

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2024 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------------|---------------------|------------------------------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 4.595.172,75 | 9,26 |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 2.551.972,75 | 5,15 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG | | | EUR | 2.551.972,75 | | % | 100,000 | 2.551.972,75 | 5,15 |
| Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 2.043.200,00 | 4,12 |
| Gruppenfremde Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 2.043.200,00 | 4,12 |
| ERSTE RESERVE CORPORATE Inhaber-Ant.EUR(I01)A o.N. | AT0000A2CMU5 | | ANT | 20.000 | 0 | 0 EUR | 102,160 | 2.043.200,00 | 4,12 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 14.881,82 | 0,03 |
| Zinsansprüche | | | EUR | 3.451,24 | | | | 3.451,24 | 0,01 |
| Quellensteueransprüche | | | EUR | 11.430,58 | | | | 11.430,58 | 0,02 |

Halbjahresbericht HanseMerkur Strategie ausgewogen

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2024 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|-----------------------------------|------|-------|---|-----------------------|--------------------|--|------------|----------------------|------------------------------|
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -129.981,81 | -0,26 |
| Verwaltungsvergütung | | | EUR | -61.476,50 | | | | -61.476,50 | -0,12 |
| Verwahrstellenvergütung | | | EUR | -8.674,11 | | | | -8.674,11 | -0,02 |
| Anlageberatungsvergütung | | | EUR | -49.181,20 | | | | -49.181,20 | -0,10 |
| Prüfungskosten | | | EUR | -10.050,00 | | | | -10.050,00 | -0,02 |
| Veröffentlichungskosten | | | EUR | -600,00 | | | | -600,00 | 0,00 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 49.597.885,26 | 100,00 1) |
| Anteilwert | | | EUR | | | | | 163,99 | |
| Ausgabepreis | | | EUR | | | | | 163,99 | |
| Anteile im Umlauf | | | STK | | | | | 302.436 | |

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Halbjahresbericht HanseMerkur Strategie ausgewogen

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

| | | | |
|-----|-------|-----------------------------|---------------|
| USD | (USD) | per 30.04.2024 1,0691000 | = 1 EUR (EUR) |
|-----|-------|-----------------------------|---------------|

Halbjahresbericht
HanseMerkur Strategie ausgewogen

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
 - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):**

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

Investmentanteile

Gruppenfremde Investmentanteile

| | | | | | |
|--|--------------|-----|--------|--------|--|
| BGF - ESG Multi-Asset Fund Act. Nom. I2 EUR Acc. oN | LU1822773989 | ANT | 0 | 90.000 | |
| Xtrackers II EUR Over.Rate Sw. Inhaber-Anteile 1C o.N. | LU0290358497 | ANT | 15.000 | 15.000 | |

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

Halbjahresbericht HanseMerkur Strategie ausgewogen

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

| | |
|---|-------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | 90,97 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | 0,00 |

Sonstige Angaben

| | | |
|-------------------|-----|---------|
| Anteilwert | EUR | 163,99 |
| Ausgabepreis | EUR | 163,99 |
| Anteile im Umlauf | STK | 302.436 |

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Halbjahresbericht HanseMerkur Strategie ausgewogen

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 2. Mai 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht

HanseMerkur Strategie ausgewogen

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968
Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–
Eigenmittel: EUR 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan
Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt, Glauburg
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlwagen, Wehrheim

2. Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG

Hausanschrift:

Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 10 10 40
60010 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 21 61-0
Telefax: 069 / 21 61-1340
www.hal-privatbank.com

Rechtsform: Aktiengesellschaft
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 599 (Stand: 31.12.2022)

3. Asset Management-Gesellschaft

HanseMerkur Trust AG

Postanschrift:

Neue Rabenstraße 3
20354 Hamburg

Telefon +49 40 49 29 39-0
Telefax +49 40 49 29 39-199
www.hmt-ag.de

4. Vertrieb

HanseMerkur Lebensversicherung AG

Postanschrift:

Siegfried-Wedells-Platz 1
20354 Hamburg

Telefon (040) 4119 - 0
Telefax (040) 4119 - 3257
www.hansemerkur.de

5. Anlageausschuss

Dr. Björn Engelke
HanseMerkur Lebensversicherung AG, Hamburg

Raik Mildner
HanseMerkur Trust AG, Hamburg

Alexander Oelze
HanseMerkur Lebensversicherung AG, Hamburg

WKN / ISIN: A1JGB2 / DE000A1JGB21