

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global

30. Juni 2024

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global	4
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	18
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	22
Allgemeine Angaben	25

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global

in der Zeit vom 01.07.2023 bis 30.06.2024.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Dr. Jörg W. Stotz, Claudia Pauls, Ludger Wibbeke

Tätigkeitsbericht Geschäftsjahr 2023/2024 (30. Juni 2024)

Anlageziel

Der HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global ist ein dynamisch und global anlegender Mischfonds. Es gibt keinen regionalen Schwerpunkt der Anlagen. Bezogen auf die Assetklassen liegt der Schwerpunkt des Fonds auf Aktien (vollständig - bis 100%). Bis zu 49% des Fondsvermögens können in flüssigen Mitteln, bis zu 10% in Investmentanteilen gehalten werden.

Die Anlagestrategie des Fonds beinhaltet einen aktiven Managementprozess. Dies bedeutet, dass der Fondsmanager die für den Fonds zu erwerbenden Vermögensgegenstände auf Basis eines festgelegten Investitionsprozesses aktiv identifiziert, im eigenen Ermessen auswählt und nicht passiv einen Referenzindex nachbildet. Der Fonds verwendet keinen Referenzwert, weil der Fonds eine benchmarkunabhängige Performance erreichen soll.

Der Fonds strebt als Anlageziel einen möglichst hohen Wertzuwachs an.

In der einzigen Anteilklasse R werden die Erträge des Fonds thesauriert.

Zur Risikosteuerung, Wertsteigerung und Ertragsgenerierung dürfen derivative Instrumente eingesetzt werden. Mittels unseres HAC-Pfadfinder-Absicherungsmechanismus wird deren Art und Umfang bestimmt.

Anlagepolitik

Am Ende des vorherigen Geschäftsjahres, am 30.06.2023 betrug der Aktienanteil am Fondsvermögen ca. 94%, zum 30.06.2024 lag er mit ca. 93% nur geringfügig niedriger.

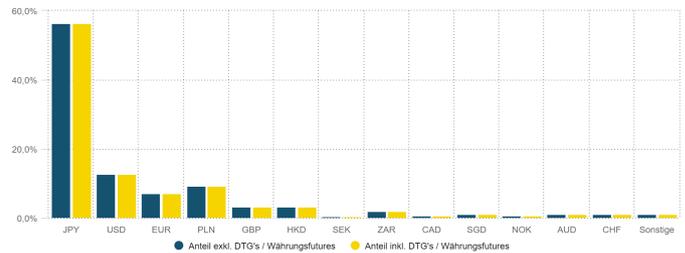
Per 30.06.2023 teilte sich das Fondsvermögen wie folgt auf verschiedene Währungsräume auf: 56% JPY, 13% USD, 9% PLN, 7% EUR, jeweils 3% GBP und HKD sowie jeweils zwischen 1% und 2% ZAR, SGD, CHF und AUD. NOK, RUB und CAD beliefen sich jeweils auf weniger als 1%.

Zum Stichtag am 30.06.2024 teilte sich das Fondsvermögen wie folgt auf verschiedene Währungsräume auf:

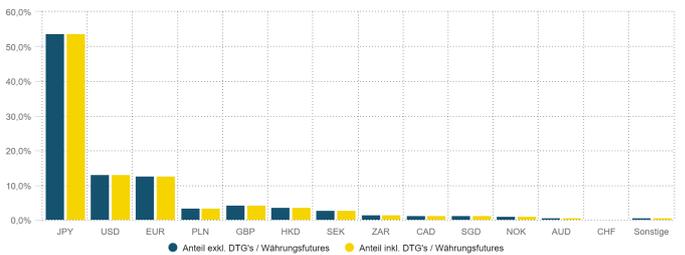
54% JPY, 13% USD, 13% EUR, jeweils 4% GBP, PLN und HKD sowie jeweils zwischen 1% und 2% ZAR, SGD, CAD und NOK. AUD, RUB und CHF beliefen sich jeweils auf weniger als 1%.

Portfoliostruktur

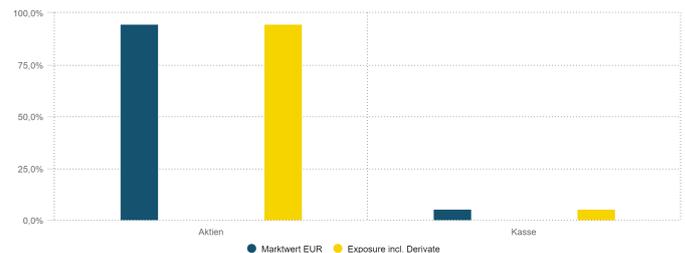
Währungsrisiko per 30.06.2023



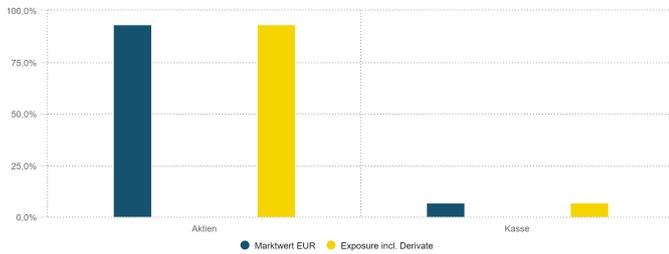
Währungsrisiko per 30.06.2024



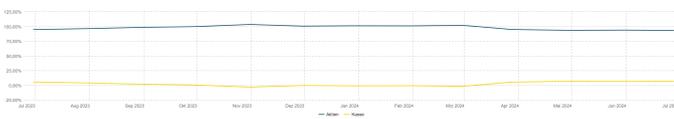
Exposure per 30.06.2023



Exposure per 30.06.2024



Exposureverlauf



Veräußerungsergebnisse

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren jeweils im Wesentlichen aus der Veräußerung von Aktien.

Wesentliche Risiken des Sondervermögens im Berichtszeitraum

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.

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 und Rechtsrisiken 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.

Liquiditätsrisiken

Das Sondervermögen ist breit gestreut und mehrheitlich in Aktien mit niedriger und mittlerer Marktkapitalisierung investiert, die im Regelfall in großen Volumina an den internationalen Börsen gehandelt werden. Daher ist davon auszugehen, dass jederzeit ausreichend Vermögenswerte zu einem angemessenen Verkaufserlös veräußert werden können.

Das Wertpapiervermögen war während des gesamten Berichtszeitraumes (01.07.2023 bis 30.06.2024) breit diversifiziert. Darüber hinaus wurden nur börsengehandelte und damit leicht liquidierbare eingesetzt. Zum Geschäftsjahresende (30.06.2024) betrug die Liquiditätsquote 93,79 %, d.h. dieser Anteil des Fondsvermögens sollte innerhalb eines Tages (sehr liquide: 67,23 %) bzw. innerhalb von 2 bis 10 Tagen (liquide: 26,56%) bzw. nach 10 Tagen (3,94 %) liquidierbar sein. Die übrigen 2,27 % des Fondsvermögens wurden als nicht liquide eingestuft. Ein überschaubarer Teil des Fondsvolumens wird in Anlagen gehalten, die Liquiditätsrisiken unterliegen.

Sonstige Risiken

Die Börsen sind seit Ausbruch geopolitischer Krisen in 2022/23 wie z.B. dem Russland-Ukraine-Krieg bzw. dem Krieg in Israel und Gaza von einer deutlich höheren Volatilität geprägt. Die weitere Entwicklung an den Kapitalmärkten hängt von vielen Faktoren ab: vom weiteren Verlauf der Kampfhandlungen, den wirtschaftlichen Folgen der verhängten Sanktionen, einer weiterhin 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.

Sonstige wesentliche Ereignisse

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH.

Das Portfoliomanagement für den HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global obliegt, nach Beendigung des Auslagerungsvertrages mit der Signal Iduna Asset Management GmbH zum 31.03.2024, der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH.

Als Fondsberater fungiert die HAC VermögensManagement AG, Hamburg.

Weitere wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	10.855.407,01	100,21
1. Aktien	10.077.491,62	93,03
2. Bankguthaben	746.980,91	6,90
3. Sonstige Vermögensgegenstände	30.934,48	0,29
II. Verbindlichkeiten	-22.578,68	-0,21
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-22.578,68	-0,21
III. Fondsvermögen	EUR 10.832.828,33	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum		
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	9.912.383,03	91,50
Aktien							EUR	9.912.383,03	91,50
AU000000MRM7	MMA Offshore Ltd.		STK	37.122	0	0	AUD 2,5600	59.075,82	0,55
CA09076P1045	Bird Construction Inc.		STK	4.500	0	0	CAD 26,6000	81.636,83	0,75
CA5734591046	Martinrea International Inc.		STK	2.800	0	0	CAD 11,5500	22.056,27	0,20
CA6568111067	North American Constr.Gr.Ltd.		STK	1.600	0	0	CAD 26,3400	28.742,71	0,27
GRS495003006	Aegean Airlines S.A.		STK	3.364	0	0	EUR 11,2700	37.912,28	0,35
NL0000334118	ASM International N.V.		STK	208	208	0	EUR 700,0000	145.600,00	1,34
DE0006305006	DEUTZ AG		STK	4.479	0	0	EUR 5,8050	26.000,60	0,24
ES0125140A14	Ercros S.A.		STK	12.992	0	0	EUR 3,4900	45.342,08	0,42
ES0130625512	Grupo Empresarial Ence SA		STK	16.000	0	0	EUR 3,6180	57.888,00	0,53
NL0009269109	Heijmans N.V.		STK	4.719	197	0	EUR 19,1200	90.225,69	0,83
IT0001413837	IMMSI S.p.A.		STK	45.757	0	0	EUR 0,4565	20.888,07	0,19
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	2.629	2.629	0	EUR 33,9900	89.359,71	0,82
PTMEN0AE0005	MOTA-ENGIL SGPS S.A.		STK	38.451	0	0	EUR 3,5100	134.963,01	1,25
AT0000609607	Porr AG		STK	8.820	0	0	EUR 14,2600	125.773,20	1,16
GB00B8VZXT93	Crest Nicholson Holdings PLC		STK	8.855	0	0	GBP 2,3800	24.887,69	0,23
GB0004915632	Kier Group PLC		STK	50.311	0	0	GBP 1,3700	81.395,93	0,75
GB0005630420	Mears Group PLC		STK	16.594	0	0	GBP 3,6800	72.113,75	0,67
NGSEPLAT0008	Seplat Energy PLC Reg. Shares (DI)(WI) NA -,50		STK	28.322	28.322	0	GBP 1,9700	65.888,45	0,61
GB00B29H4253	Tyman PLC		STK	9.095	0	0	GBP 3,5050	37.645,23	0,35
GB00BL6C2002	Wickes Group PLC		STK	37.547	0	0	GBP 1,3600	60.302,22	0,56
KYG2110P1000	China Shineway Pharmac.Grp Ltd		STK	72.000	0	0	HKD 7,8300	67.391,88	0,62
KYG2524A1031	Consun Pharmaceutic.Group Ltd.		STK	193.000	72.000	0	HKD 5,4200	125.046,02	1,15
KYG407691040	Greatview Aseptic Packaging		STK	119.000	0	0	HKD 2,4100	34.282,88	0,32
KYG9463P1081	Wasion Holdings Ltd.		STK	188.000	0	0	HKD 6,4000	143.830,54	1,33
JP3100600000	Ahresty Corp.		STK	11.700	0	0	JPY 720,0000	48.966,78	0,45
JP3101600009	Aisan Industry Co. Ltd.		STK	17.100	5.800	0	JPY 1.398,0000	138.958,93	1,28
JP3125600001	Araya Industrial Co. Ltd.		STK	6.000	0	2.300	JPY 5.320,0000	185.543,64	1,71
JP3118400005	Ashimori Industry Co. Ltd. Registered Shares o.N.		STK	3.500	3.500	0	JPY 2.420,0000	49.234,17	0,45
JP3389640008	Asia Pile Holdings Corp.		STK	29.300	0	0	JPY 977,0000	166.396,95	1,54
JP3779000003	Bando Chemical Industries Ltd. Registered Shares o.N.		STK	4.600	4.600	0	JPY 2.012,0000	53.798,35	0,50
JP3528200003	Chori Co. Ltd.		STK	7.600	0	0	JPY 3.605,0000	159.258,29	1,47
JP3475800003	Daiichi Jitsugyo Co. Ltd.		STK	8.400	5.600	0	JPY 2.465,0000	120.359,23	1,11
JP3487600003	Daitron Co. Ltd.		STK	2.100	0	0	JPY 2.886,0000	35.228,88	0,33
JP3638000004	Doshisha Co. Ltd.		STK	4.200	0	0	JPY 2.350,0000	57.372,05	0,53
JP3130400009	Eagle Industry Co. Ltd.		STK	8.400	3.800	0	JPY 1.923,0000	93.894,85	0,87
JP3457690000	Elematec Corp.		STK	3.100	0	0	JPY 2.007,0000	36.165,32	0,33

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
JP316960008	ENDO Lighting Corp.		STK	11.300	5.300	0	JPY	1.544,0000	101.416,57	0,94
JP368835002	Eslead Corp.		STK	2.800	0	0	JPY	4.560,0000	74.217,46	0,69
JP3161160001	Exedy Corp.		STK	6.100	2.800	0	JPY	3.020,0000	107.082,86	0,99
JP3166950000	F-Tech Inc.		STK	15.800	7.000	0	JPY	641,0000	58.870,58	0,54
JP3824000008	Futaba Industrial		STK	12.100	12.100	0	JPY	877,0000	61.683,38	0,57
JP3307800007	Godō Steel Ltd. Registered Shares o.N.		STK	1.800	1.800	0	JPY	5.160,0000	53.989,01	0,50
JP3131200002	Iino Kaiun Kaisha Ltd.		STK	9.500	0	0	JPY	1.276,0000	70.462,41	0,65
JP3694000005	Japan Pulp & Paper Co. Ltd.		STK	1.000	0	0	JPY	6.130,0000	35.632,28	0,33
JP3386410009	JVC Kenwood Corp.		STK	80.600	0	13.500	JPY	939,0000	439.930,25	4,06
JP3206200002	Kaga Electronics Co. Ltd.		STK	1.200	0	0	JPY	5.680,0000	39.619,84	0,37
JP3211800002	Katakura & Co-op Agri Corp.		STK	5.200	0	0	JPY	1.190,0000	35.969,42	0,33
JP3213800000	Kato Works Co. Ltd. Registered Shares o.N.		STK	5.600	5.600	0	JPY	1.279,0000	41.633,39	0,38
JP3220200004	Kayaba Industry Co. Ltd.		STK	2.200	1.300	0	JPY	5.340,0000	68.288,43	0,63
JP3293350009	Kokusai Pulp & Paper Co. Ltd.		STK	5.800	0	5.700	JPY	830,0000	27.982,68	0,26
JP3305800009	Komori Corp.		STK	11.900	0	0	JPY	1.364,0000	94.350,57	0,87
JP3247400009	Kyoei Steel Ltd.		STK	7.100	3.400	0	JPY	2.106,0000	86.916,03	0,80
JP3981000007	Look Holdings Inc.		STK	2.000	0	1.800	JPY	2.810,0000	32.667,77	0,30
JP3886200009	Mitachi Co. Ltd.		STK	20.300	0	0	JPY	1.122,0000	132.395,15	1,22
JP3894000003	Mitsui Matsushima Co. Ltd.		STK	1.200	0	0	JPY	5.100,0000	35.574,16	0,33
JP3924000007	Mory Industries Inc.		STK	3.500	0	0	JPY	5.400,0000	109.861,37	1,01
JP3664400003	Nichimo Co. Ltd.		STK	4.000	2.000	0	JPY	2.209,0000	51.361,64	0,47
JP3665600007	Nichireki Co. Ltd.		STK	10.000	3.600	0	JPY	2.535,0000	147.353,74	1,36
JP3734400009	Nihon Denkei Co. Ltd.		STK	4.300	0	0	JPY	2.038,0000	50.939,63	0,47
JP3674400001	Nissan Corp.		STK	2.400	0	0	JPY	4.775,0000	66.614,35	0,61
JP3680800004	Nittetsu Mining Co. Ltd.		STK	2.800	1.400	0	JPY	5.090,0000	82.843,61	0,76
JP3970700005	NPR-Riken Corp. Registered Shares o.N.		STK	4.000	4.000	0	JPY	2.849,0000	66.242,33	0,61
JP3170180008	O-Well Corporation		STK	10.000	0	0	JPY	990,0000	57.546,43	0,53
JP3203500008	Onward Kashiyama Co. Ltd.		STK	16.100	0	0	JPY	627,0000	58.678,18	0,54
JP3833600004	Press Kogyo		STK	10.700	10.700	0	JPY	645,0000	40.116,84	0,37
JP3975800008	Ryobi Ltd.		STK	4.300	0	0	JPY	2.291,0000	57.263,35	0,53
JP3975410006	Ryoyo Ryosan Holdings Inc. Registered Shares o.N.		STK	1.980	1.980	0	JPY	2.986,0000	34.366,73	0,32
JP3313200002	Sakai Heavy Industries Ltd.		STK	2.200	0	0	JPY	5.970,0000	76.344,93	0,70
JP3323600001	San-Ai Obbli Co. Ltd.		STK	3.900	0	0	JPY	2.055,0000	46.586,45	0,43
JP3330900006	Sanko Gosei Ltd.		STK	35.600	9.500	0	JPY	720,0000	148.992,94	1,38
JP3424400004	Senshu Electric Co. Ltd		STK	1.500	0	0	JPY	5.330,0000	46.473,10	0,43
JP3369500008	Shirai Electronics Ind. Co.Ltd		STK	26.400	0	9.600	JPY	678,0000	104.043,94	0,96
JP3162640001	SK-Electronics Co. Ltd.		STK	10.900	0	0	JPY	3.210,0000	203.383,03	1,88
JP3405600002	Sumitomo Seika Chem. Co. Ltd.		STK	6.200	0	1.200	JPY	5.330,0000	192.088,82	1,77

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
					im Berichtszeitraum					
JP3345400000	Sun-Wa Technos Corp.		STK	13.900	0	0	JPY	2.295,0000	185.430,29	1,71
JP3448800007	Taiheiyō Kouhatsu Inc.		STK	9.100	0	0	JPY	814,0000	43.057,52	0,40
JP3460000007	Takara Standard Co. Ltd.		STK	4.000	0	0	JPY	1.720,0000	39.991,86	0,37
JP3558000000	Toa Road Corp.		STK	11.000	8.800	0	JPY	1.325,0000	84.721,13	0,78
JP3553200001	Toho Co. Ltd.		STK	8.200	0	0	JPY	3.955,0000	188.513,97	1,74
JP3584600005	Tokyo Tekko Co. Ltd. Registered Shares o.N.		STK	2.100	2.100	0	JPY	5.070,0000	61.888,57	0,57
JP3620600001	Toli Corp.		STK	86.600	19.600	0	JPY	396,0000	199.340,83	1,84
JP3538690003	TSI Holdings Co. Ltd.		STK	9.800	0	0	JPY	976,0000	55.597,99	0,51
JP3154850006	UEX Ltd.		STK	20.500	0	4.600	JPY	1.077,0000	128.337,26	1,18
JP3952550006	Unipres Corp. Registered Shares o.N.		STK	5.800	5.800	0	JPY	1.347,0000	45.412,85	0,42
JP3778280002	Vital KSK Holdings Inc.		STK	23.100	0	0	JPY	1.376,0000	184.762,40	1,71
JP3934350004	Yamae Group Holdings Co. Ltd.		STK	4.400	0	0	JPY	2.516,0000	64.349,70	0,59
NO0003094104	Belships ASA Navne-Aksjer NK 2		STK	15.180	0	0	NOK	25,3000	33.673,44	0,31
NO0010791353	MPC Container Ships ASA		STK	26.744	0	0	NOK	22,8100	53.486,83	0,49
BMG6716L1081	Odfjell Technology Ltd. Registered Shares o.N.		STK	5.842	0	0	NOK	60,5000	30.989,33	0,29
PLARTPR00012	Arctic Paper S.A. Inhaber-Aktien ZY 1		STK	7.223	0	7.655	PLN	24,2600	40.596,33	0,37
PLCNTSL00014	Cognor Holding S.A. Inhaber-Aktien ZY 1,50		STK	67.462	23.391	0	PLN	8,5000	132.848,44	1,23
PLMRBUD00015	Mirbud S.A. Inhaber-Aktien ZY -, 10		STK	40.881	27.295	0	PLN	13,9800	132.405,80	1,22
PLMSTSD00019	Polimex-Mostostal S.A. Inhaber-Aktien ZY 2		STK	87.778	0	0	PLN	3,4900	70.972,39	0,66
RU000A0B88G6	Ashinskiy Metallurgicheskiy Zd Registered Shares RL 1		STK	398.700	0	0	RUB	3,9480	17.135,88	0,16
RU000A0JP2W1	Far-Eastern Energy Co. PJSC Registered Shares RL 1		STK	7.229.000	0	0	RUB	0,1476	11.615,76	0,11
RU000A0B9BV2	KuibyshevAzot PJSC Registered Shares RL 1		STK	6.380	0	0	RUB	58,0000	4.028,39	0,04
RU000A0DKXV5	Mechel PAO Registered Shares RL 10		STK	17.300	0	0	RUB	16,6600	3.137,65	0,03
RU000A0JNMZ0	Quadra - Power Generation PJSC Registered Shares RL -,01		STK	1.457.849.984	0	0	RUB	0,0022	34.391,79	0,32
RU000A0JPR50	Seligdar Registered Shares RL 1		STK	41.600	0	0	RUB	8,9100	4.035,10	0,04
RU000A0B6NK6	TMK PAO Registered Shares RL 10		STK	28.000	0	0	RUB	12,1080	3.690,74	0,03
SE0008321921	BE Group AB		STK	7.848	0	0	SEK	60,2000	41.591,62	0,38
SE0017160773	NCAB Group AB(Publ) Namn-Aktier o.N.		STK	15.300	15.300	0	SEK	84,7000	114.084,12	1,05
SE0015988019	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N.		STK	7.800	7.800	0	SEK	45,5100	31.250,13	0,29
SE0003756758	Sdipotech AB Aktier B Reg.Pref. o.N.		STK	3.907	3.907	0	SEK	329,0000	113.159,14	1,04
SG1DG3000004	Best World International Ltd.		STK	59.300	0	23.000	SGD	2,4900	101.541,79	0,94
SG1I44882534	Food Empire Holdings Ltd. Registered Shares SD -,05		STK	38.600	0	0	SGD	1,0200	27.075,61	0,25
US0063513081	Adams Resources & Energy Inc.		STK	800	0	0	USD	27,9000	20.834,50	0,19
US00191G1031	Arc Document Solutions Inc.		STK	11.200	0	0	USD	2,6100	27.286,47	0,25

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
US16936R1059	China Automotive Systems Inc. Registered Shares DL -,0001		STK	9.300	0	5.600	USD	3,5900	31.164,94	0,29
US3156161024	F5 Inc. Registered Shares o.N.		STK	613	613	0	USD	171,2000	97.960,98	0,90
MHY2685T1313	Genco Shipping & Trading Ltd. Registered Shares DL -,01		STK	3.500	0	0	USD	21,3500	69.751,70	0,64
US3722842081	Genie Energy Ltd. Registered Shares B DL -,01		STK	5.200	0	0	USD	14,4300	70.042,01	0,65
US4663131039	Jabil Circuit		STK	862	862	0	USD	107,9200	86.835,66	0,80
US4824801009	KLA Corp.		STK	187	187	0	USD	814,8700	142.239,05	1,31
US57637H1032	MasterCraft Boat Holdings Inc. Registered Shares DL -,01		STK	2.200	0	0	USD	18,7200	38.443,01	0,35
US69036R8631	Overseas Shipholding Group Inc A		STK	24.500	11.200	0	USD	8,4700	193.703,91	1,79
BMG6891L1054	Pangaea Logistics Sol.Ltd. Registered Shares DL -,0001		STK	17.000	0	0	USD	7,7400	122.822,74	1,13
US7473011093	Quad Graphics Inc. Registered Shares Cl.A		STK	13.800	0	8.200	USD	5,1600	66.468,78	0,61
US7493604000	RCM Technologies Inc. Registered Shares DL -,05		STK	2.500	2.500	0	USD	18,4200	42.985,16	0,40
MHY7388L1039	Safe Bulkers Inc. Registered Shares DL -,001		STK	17.300	0	0	USD	5,8600	94.630,82	0,87
MHY8162K2046	Star Bulk Carriers Corp. Registered Shares New DL -,01		STK	2.621	2.621	0	USD	24,4300	59.769,47	0,55
MHY816691064	Stealthgas Inc. Registered Shares DL -,01		STK	10.700	10.700	0	USD	7,3900	73.810,32	0,68
US86722A1034	Suncoke Energy Inc.		STK	11.500	0	0	USD	9,5400	102.408,29	0,95
MHY8564W1030	Teekay		STK	7.100	7.100	0	USD	9,1200	60.442,45	0,56
ZAE000058723	DRDGold Ltd. Registered Shares o.N.		STK	204.446	0	41.184	ZAR	15,9100	164.458,17	1,52
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	105.033,61	0,97	
Aktien							EUR	105.033,61	0,97	
GB00BQS92151	Prax Exploration & Production Def.Cons.Units 2 Cash paym.		STK	447.845	447.845	0	GBP	0,0000	0,53	0,00
GB00B1GK4645	Vertu Motors PLC		STK	117.999	50.588	0	GBP	0,7470	104.092,17	0,96
US55328R1095	Tingo Group Inc. Registered Shares DL -,001		STK	56.000	36.000	0	USD	0,0180	940,91	0,01
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	60.074,98	0,55	
Aktien							EUR	60.074,98	0,55	
JP3359000001	CMIC Holdings Co. Ltd		STK	3.900	0	0	JPY	2.650,0000	60.074,98	0,55
Summe Wertpapiervermögen							EUR	10.077.491,62	93,03	
Bankguthaben							EUR	746.980,91	6,90	
EUR - Guthaben bei:							EUR	620.673,53	5,73	
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	620.673,53				620.673,53	5,73	
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							EUR	4.352,02	0,04	
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			DKK	4,41				0,59	0,00	

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
					im Berichtszeitraum				
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		NOK	12.126,10				1.063,20	0,01
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		PLN	5.852,13				1.355,79	0,01
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		SEK	21.951,06				1.932,44	0,02
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	121.955,36	1,13
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		AUD	1,03				0,64	0,00
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		CAD	538,45				367,23	0,00
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		CHF	0,46				0,48	0,00
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		GBP	5.477,10				6.468,00	0,06
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		HKD	201.816,52				24.125,15	0,22
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		ILS	1.394,72				346,34	0,00
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		JPY	13.404.919,00				77.919,72	0,72
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		MXN	149,02				7,57	0,00
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		RUB	20.672,24				225,05	0,00
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		SGD	3.864,49				2.657,56	0,02
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		USD	10.532,19				9.831,22	0,09
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		ZAR	126,65				6,40	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	30.934,48	0,29
	Dividendenansprüche		EUR	30.934,48				30.934,48	0,29
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-22.578,68	-0,21
	Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾		EUR	-22.578,68				-22.578,68	-0,21
Fondsvermögen							EUR	10.832.828,33	100,00
Anteilwert HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global R							EUR	29,43	
Umlaufende Anteile HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global R							STK	368.135,430	

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

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellungsvergütung, Verwaltungsvergütung, Performance Fee

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2024		
Australischer Dollar	(AUD)	1,608650	=	1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	(GBP)	0,846800	=	1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,458100	=	1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	(HKD)	8,365400	=	1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	(JPY)	172,035000	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,466250	=	1 Euro (EUR)
Mexikanischer Peso	(MXN)	19,674200	=	1 Euro (EUR)
Neuer Schekel	(ILS)	4,027017	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	11,405250	=	1 Euro (EUR)
Polnischer Zloty	(PLN)	4,316400	=	1 Euro (EUR)
Russischer Rubel	(RUB)	91,858000	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	11,359250	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,960850	=	1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	(SGD)	1,454150	=	1 Euro (EUR)
Südafrikanischer Rand	(ZAR)	19,778500	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,071300	=	1 Euro (EUR)

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
JP3117200000	Asahi Yukizai Corp.	STK	0	1.700
CY1000031710	ASBISc Enterprises PLC Namens-Aktien DL -,20	STK	0	38.031
US07556Q8814	Beazer Homes USA Inc. Registered Shares DL -,01	STK	1.700	9.500
US1200761047	Build-A-Bear Workshop Inc. Registered Shares DL -,01	STK	0	1.500
GB00BLY2F708	Card Factory PLC	STK	0	33.411
BMG2122L1054	China Electr. Huada Tech. Co.	STK	0	196.000
PLCIECH00018	Ciech S.A. Inhaber-Aktien ZY 5	STK	0	24.903
US25065K1043	Destination XL Group Inc. Registered Shares new DL -,01	STK	0	5.300
US2976021046	Ethan Allen Interiors	STK	0	1.200
JP3282400005	Geo Holdings Corp.	STK	0	2.400
JP3385860006	GMB Corp. Registered Shares o.N.	STK	4.200	4.200
GB00B012TP20	Halfords Ltd.	STK	0	13.267
JP3802700009	Helios Techno Holding Co. Ltd.	STK	0	20.900
US4285671016	Hibbett Sports Inc.	STK	0	500
US4424874018	Hovnanian Enterprises Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	STK	500	4.100
GB00B580MF54	Hurricane Energy PLC	STK	0	447.845
CH0023868554	Implenia AG	STK	0	835
JP3142700008	Itoki Corp.	STK	0	50.700
JP3219400003	Kamei Corp.	STK	0	17.500
IT0004552359	KME Group S.p.A.	STK	0	27.169
FR0013153541	Maisons du Monde SAS	STK	0	2.635
JP3895200008	Mitsuba Corp.	STK	8.000	38.800
JP3167260003	MRT Inc.	STK	0	2.900
JP3913400002	Muto Seiko Co.	STK	4.200	20.300
AU000000MYR2	Myer Holdings Ltd.	STK	0	226.854
JP3646400006	Nakayama Steel Works Ltd.	STK	0	5.600
JP3651400008	Namura Shipbuilding Co. Ltd.	STK	10.800	10.800
MX01NE000001	Nemak S.A.B. de C.V.	STK	0	113.900
JP3665000000	Nichirin Co. Ltd.	STK	2.400	14.400
JP3737800007	Nihon Dempa Kogyo Co. Ltd.	STK	0	3.100
AU000000NWH5	NRW Holdings Ltd.	STK	0	17.580
US68162K1060	Olympic Steel Inc.	STK	1.000	5.100
JP3172800009	Onamba Co. Ltd.	STK	0	30.200
IT0005043507	OVS S.p.A.	STK	0	14.292
DK0060700516	Per Aarsleff Holding A/S	STK	0	860
PLPKPCR00011	PKP Cargo S.A. Inhaber-Aktien A,B ZY 50	STK	0	46.200

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
JP3967450002	Rasa Corporation	STK	0	14.200
JP3975400007	Ryosan Co. Ltd. Registered Shares o.N.	STK	1.500	1.500
DE000SAFH001	SAF HOLLAND SE	STK	0	17.889
JP3339400008	Sanyo Shokai	STK	0	21.200
JP3374000002	Shinsho Corp.	STK	0	4.600
FR0013214145	SMCP S.A.S.	STK	0	4.701
JP3544600004	Tay Two Co. Ltd.	STK	0	29.400
JP3546550009	Tera Probe Inc.	STK	0	14.600
US88830R1014	Titan Machinery Inc. Registered Shares DL -,00001	STK	0	900

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Aktien

MHY2187A1507	Eagle Bulk Shipping Inc.	STK	0	1.000
JP3970600007	Riken Corp. Registered Shares o.N.	STK	2.000	2.000
JP3457600009	Takada Corp.	STK	0	3.400
JP3933000006	Yachiyo Industry Co. Ltd.	STK	0	15.100

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

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

Fehlanzeige

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) HAC QUANT MEGATRENDS DYNAMISCH GLOBAL R

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.07.2023 BIS 30.06.2024

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller		1.366,02
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		353.868,47
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		10.779,68
davon negative Habenzinsen	-163,53	
4. Abzug ausländischer Quellensteuer		-46.691,65
Summe der Erträge		319.322,52
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-4.666,89
2. Verwaltungsvergütung		-405.345,98
a) fix	-175.656,07	
b) performanceabhängig	-229.689,91	
3. Verwahrstellenvergütung		-5.130,07
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-8.616,15
5. Sonstige Aufwendungen		-11.940,55
6. Aufwandsausgleich		26.827,11
Summe der Aufwendungen		-408.872,53
III. Ordentlicher Nettoertrag		-89.550,01
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		1.187.198,90
2. Realisierte Verluste		-271.418,59
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		915.780,31
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		826.230,30
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		816.621,23
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		139.212,40
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		955.833,63
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.782.063,93

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS HAC QUANT MEGATRENDS DYNAMISCH GLOBAL R

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.07.2023)		12.341.784,93
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-3.297.785,64
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	828.821,70	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-4.126.607,34	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		6.765,11
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.782.063,93
davon nicht realisierte Gewinne	816.621,23	
davon nicht realisierte Verluste	139.212,40	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (30.06.2024)		10.832.828,33

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS HAC QUANT MEGATRENDS DYNAMISCH GLOBAL R ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	1.097.648,89	2,98
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	826.230,30	2,24
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	271.418,59	0,74
II. Wiederanlage	1.097.648,89	2,98

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE HAC QUANT MEGATRENDS DYNAMISCH GLOBAL R

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2024	10.832.828,33	29,43
2023	12.341.784,93	24,88
2022	10.947.952,77	24,59
(Auflegung 01.03.2022)	25,00	25,00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	0,00
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Fehlanzeige		
Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.		
Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)		
MSCI Emerging Markets in USD		90,00%
JPM - GBI-EM Global Div Composite Index in USD		10,00%
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV		
kleinster potenzieller Risikobetrag		1,71%
größter potenzieller Risikobetrag		2,49%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		2,02%
Risikomodell (§10 DerivateV)		Full-Monte-Carlo
Parameter (§11 DerivateV)		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr
Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte		0,98

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 HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global R	EUR	29,43
Umlaufende Anteile HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global R	STK	368.135,430

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 HAC QUANT MEGATRENDS DYNAMISCH GLOBAL R

Performanceabhängige Vergütung	2,12 %
Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	1,86 %

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 01.07.2023 BIS 30.06.2024

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	8.359.284,81
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	0,00
Relativ in %	0,00 %

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 13.177,69 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 HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global R

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Depotgebühren	EUR	9.081,14
---------------	-----	----------

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 Tarifvertrag für das private Versicherungsgewerbe. 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 und die Generalbevollmächtigten 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 2023 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)	EUR	26.098.993
davon feste Vergütung	EUR	21.833.752
davon variable Vergütung	EUR	4.265.241
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)		332
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen	EUR	1.475.752
davon Geschäftsleiter	EUR	1.105.750
davon andere Führungskräfte	EUR	370.002

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der Signal Iduna Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2023 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager		Signal Iduna Asset Management GmbH
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	11.050.964,00
davon feste Vergütung	EUR	10.193.472,00
davon variable Vergütung	EUR	857.492,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens		124

Das Auslagerungsunternehmen hat die Informationen selbst veröffentlicht. Die Signal Iduna Asset Management GmbH war bis zum 31. März 2024 als externer Portfoliomanager des Fonds tätig.

ANGABEN FÜR INSTITUTIONELLE ANLEGER GEMÄSS § 101 ABS. 2 NR. 5 KAGB I.V.M. § 134C ABS. 4 AKTG

Anforderung

Angaben zu den mittel- bis langfristigen Risiken

Verweis

Informationen zu den mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens werden im Tätigkeitsbericht aufgeführt.

Zusammensetzung des Portfolios,
Portfolioumsätze und Portfolioumsatzkosten

Informationen über die Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten sind im Jahresbericht in den Abschnitten "Vermögensaufstellung", "Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen" und "Angaben zur Transparenz und zur Gesamtkostenquote" verfügbar.

Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen
Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Aktien, die auf einem geregelten Markt gehandelt werden, unterliegen verschiedenen mittel- und langfristigen Risiken.
Die Einschätzung dieser Risiken ist ein grundlegender Bestandteil der Anlagestrategie und -politik.

Einsatz von Stimmrechtsvertretern

Informationen zur Stimmrechtsausübung sind auf der Internetseite der HANSAINVEST erhältlich.

Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit
Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den
Gesellschaften, insbesondere durch Ausnutzung von
Aktionärsrechten

Für das Sondervermögen sind im Berichtszeitraum keine Wertpapierleihegeschäfte abgeschlossen worden.
Auf der Internetseite der HANSAINVEST sind Informationen zum Umgang mit Interessenkonflikten verfügbar.

SONSTIGE INFORMATIONEN - NICHT VOM PRÜFUNGSURTEIL UMFASST

Aufgrund der festgelegten Anlagestrategie wurden Nachhaltigkeitsrisiken im Berichtszeitraum bei den Investitionsentscheidungen nicht berücksichtigt. Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Der Fonds ist damit gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu qualifizieren.

Hamburg, 26. September 2024

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Claudia Pauls

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,
Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens HAC Quant MEGATRENDS dynamisch global - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024, 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.

Die im Abschnitt „Sonstige Informationen“ unseres Vermerks genannten Bestandteile des Jahresberichts haben wir in Einklang mit den deutschen gesetzlichen Vorschriften bei der Bildung unseres Prüfungsurteils zum Jahresbericht nicht berücksichtigt.

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 ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf den Inhalt der im Abschnitt „Sonstige Informationen“ genannten Bestandteile des Jahresberichts.

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 Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die folgenden Bestandteile des Jahresberichts:

- die im Jahresbericht enthaltenen und als nicht vom Prüfungsurteil zum Jahresbericht umfasst gekennzeichneten Angaben.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir in diesem Vermerk weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die oben genannten sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zu den vom Prüfungsurteil umfassten Bestandteilen des Jahresberichts oder zu unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH sind verantwortlich für die Auf-

stellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB 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 vernünftiger-

weise 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 Jahresberichts 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 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 27.09.2024

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: info@hansainvest.de

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 24,958 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2023

GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
 - Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth (bis zum 07.11.2023)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Dr. Stefan Lemke (ab dem 15.02.2024)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, Mitglied des Vorstandes der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Markus Barth

- Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg
- Dr. Thomas A. Lange
 - Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen
- Prof. Dr. Harald Stützer
 - Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach
- Prof. Dr. Stephan Schüller
 - Kaufmann

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- Dr. Jörg W. Stotz
 - (Sprecher, zugleich Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG und der Greiff capital management AG)
- Claudia Pauls (ab dem 01.04.2024)
- Ludger Wibbeke
 - (zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. und Aufsichtsratsvorsitzender der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

VERWAHRSTELLE

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Haftendes Eigenkapital: 673,200 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 28,914 Mio. EUR
Stand: 31.12.2023

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

info@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST