

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

MTS Fonds

30. September 2023

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht MTS Fonds	4
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	14
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	20
Allgemeine Angaben	23

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

MTS Fonds

in der Zeit vom 04.10.2022 bis 30.09.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht MTS Fonds für das Rumpfgeschäftsjahr vom 04.10.2022 bis 30.09.2023

Anlageziel und Anlagepolitik

Ziel des MTS Fonds ist ein Wertzuwachs, der langfristig aktienähnliche Renditen bei geringerem Risiko erzielen soll. Zur Erfüllung der Anlageziele wird weltweit und über verschiedene Branchen in Aktien ETFs investiert. Wird aus strategischen Gründen der Aktienmarkt verlassen, investieren wir in Renten ETFs oder halten Cash Positionen.

Die Anlagestrategie bzw. die Entscheidung über die Höhe der Aktienquote sowie die Gewichtung der verschiedenen Branchen und Ländern wird anhand unterschiedlicher Strategien getroffen. Die einzelnen Teilstrategien werden so ausgewählt, dass diese eine möglichst geringe Korrelation zueinander haben. Aktuell besteht das Portfolio aus den Teil Strategien Makro, Trendfolge, Zyklisch und Saisonalen.

Der Aktienanteil der Makro Strategie wird von den Indikatoren, Zins, Inflation, US-Dollar und Saison bestimmt. Bei der Trendfolge Strategie wird der Anteil der Anlageklassen anhand des gleitenden Durchschnitts bestimmt. Zudem wird aus den selektierten Marktgruppen nur in die jeweils 3 stärksten investiert. Die Saisonalen und zyklischen Strategien verfolgen das Erkennen von sich wiederholenden Mustern in der Börse anhand der Analyse von Saisoncharts. So lassen sich Kauf und Verkauf von Wertpapieren optimieren.

Der Fonds kann bis zu 100% in Aktien (ETF) investieren. Die durchschnittliche Aktienquote liegt aber eher zwischen 40-60%.

Eine Investition in den Fonds sollte als mittel bis langfristige Kapitalanlage betrachtet werden. Der Fonds ist besonders geeignet für Anleger die risikobereit und Kapitalwachstum durch Anlagen in Aktien erzielen möchten.

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.

Portfoliostruktur

30.09.2023 (Datum Rumpfgeschäftsjahresende aktuelles Jahr)



**) Durch Rundung bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen im Vergleich mit der Vermögensaufstellung gemäß Jahresbericht entstanden sein.*

Im Berichtszeitraum wurden Umschichtungen im Einklang mit der Anlagestrategie vorgenommen.

Risikoanalyse

Marktpreisrisiko:

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.

Adressenausfallrisiko Zielfonds:

Der Fonds legt einen Teil seines Vermögens in Zielfonds an, welche ihrerseits in Anleihen investieren. Dadurch ist der Fonds mittelbar von dem Risiko betroffen, dass es zu einem Ausfall der Zins- und Tilgungszahlungen der im Bestand der Zielfonds befindlichen Anleihen kommen kann. In dessen Folge kann es bei den Anleihen zu Kursverlusten kommen. Das Adressenausfallrisiko soll durch die diversifizierte Anlage in einen / mehrere Zielfonds reduziert werden.

Zinsänderungsrisiko Zielfonds:

Das Sondervermögen ist Zinsänderungsrisiken über Zielfonds-Investments in Rentenpapiere ausgesetzt. Sofern die Zielfonds in festverzinsliche Wertpapiere investieren könnte die Möglichkeit bestehen, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Emission einer Anleihe gegeben ist, ändert. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite des festverzinslichen Wertpapiers in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach (Rest-)Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungsrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Liquiditätsrisiko Zielfonds:

Der Fonds investiert einen Teil seines Vermögens in Zielfonds. Die Liquidität des Sondervermögens kann eingeschränkt werden, sofern z.B. für die Zielfonds die Rücknahme der Anteilscheine ausgesetzt werden sollte.

Währungsrisiko Zielfonds:

Die Zielfonds können in Fremdwährung aufgelegt worden sein bzw. in entsprechenden Fremdwährungen investieren. Ferner legen in Euro notierte Zielfonds ganz oder teilweise in Ländern außerhalb des Euroraums an. Das Währungsrisiko soll durch eine Diversifizierung gesteuert und begrenzt werden.

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.

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

Die realisierten Gewinne resultieren aus der Veräußerung von Investmentanteilen. Für die realisierten Verluste sind Veräußerungen von Investmentanteilen ursächlich.

Sonstige Hinweise

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

Das Portfoliomanagement für den MTS Fonds ist ausgelagert an die Signal Iduna Asset Management GmbH.

Als Fondsberater des MTS Fonds agiert die HPC GmbH.

Der Fonds wurde am 04.10.2022 neu aufgelegt.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	805.097,26	101,21
1. Investmentanteile	462.138,09	58,09
2. Bankguthaben	342.959,17	43,11
II. Verbindlichkeiten	-9.593,01	-1,21
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-9.593,01	-1,21
III. Fondsvermögen	EUR 795.504,25	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.09.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
Investmentanteile							EUR		462.138,09	58,09
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR		462.138,09	58,09
LU0292106241	db x-tr.SHORTDAX DAILY ETF	ANT		8.490	8.490	0	EUR	13,6140	115.582,86	14,53
DE000ETFL185	ETFlab Dt.Börse EUROGOV Ge. 1-3	ANT		220	220	0	EUR	73,5280	16.176,16	2,03
DE0006289473	iSh. eb.r.Governm. Ger.1.5-2.5	ANT		770	770	0	EUR	77,0360	59.317,72	7,46
IE00B5BMR087	iShares VII-Core S&P 500 U.ETF	ANT		88	269	181	EUR	425,4700	37.441,36	4,71
IE00BGR7L912	iShs DL Treas.Bd 0-1yr UC.ETF Registered Shares USD (Dist)oN	ANT		9.390	9.390	0	EUR	4,7549	44.648,51	5,61
IE00B4L5Y983	iShsIII-Cor.MSCI Wld UCITS ETF Registered Shs Acc. USD o.N.	ANT		530	530	0	EUR	77,1660	40.897,98	5,14
IE00B53L4350	iShsVII-DJ Indl Average U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	ANT		7	477	470	EUR	375,5000	2.628,50	0,33
IE00B53SZB19	iShsVII-NASDAQ 100 UCITS ETF Registered Shares o.N.	ANT		50	105	55	EUR	791,9000	39.595,00	4,98
LU0274211480	Xtrackers DAX 1C	ANT		730	730	0	EUR	145,0000	105.850,00	13,31
Summe Wertpapiervermögen							EUR		462.138,09	58,09
Bankguthaben							EUR		342.959,17	43,11
EUR - Guthaben bei:							EUR		342.959,17	43,11
Bank: Donner & Reuschel AG			EUR	115.604,99					115.604,99	14,53
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	127.241,42					127.241,42	16,00
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	100.112,76					100.112,76	12,58
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR		-9.593,01	-1,21
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾			EUR	-9.593,01					-9.593,01	-1,21
Fondsvermögen							EUR		795.504,25	100,00
Anteilwert MTS Fonds I							EUR		102,22	
Anteilwert MTS Fonds R							EUR		101,62	
Umlaufende Anteile MTS Fonds I							STK		165,000	
Umlaufende Anteile MTS Fonds R							STK		7.662,000	

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

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

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
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU0411078552	db x-tr.S&P 500 2x LEV.DLY.ETF	ANT	1.369	1.369
LU0292105359	db x-tra.STOXX 600 FOOD & BEVERAGE ETF 1C	ANT	240	240
LU0322250985	db x-trackers CAC 40 ETF Inhaber-Anteile 1D	ANT	335	335
LU0411075376	db x-trackers LEVDAX DAILY ETF 1C	ANT	630	630
DE000ETFLO11	Deka DAX UCITS ETF Inhaber-Anteile	ANT	815	815
DE000ETFLO45	Deka STOXX Eu.Str.Val.20 U.ETF Inhaber-Anteile	ANT	1.530	1.530
DE0002635281	iSh.EO ST.Sel.Div.30 U.ETF DE	ANT	1.780	1.780
DE000A0F5UK5	iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE	ANT	510	510
DE000A0H08K7	iSh.ST.Eu.600 Insuran.U.ETF DE	ANT	710	710
DE000A0H08S0	iSh.ST.Eu.600 Trav.&L.U.ETF DE	ANT	2.000	2.000
DE000A0F5UJ7	iSh.ST.Euro.600 Banks U.ETF DE	ANT	1.650	1.650
IE00B0M62Y33	iShares AEX	ANT	310	310
DE000A0D8Q23	iShares ATX UCITS ETF DE	ANT	130	130
DE0005933931	iShares Core DAX UCITS ETF DE EUR Acc.	ANT	268	268
DE000A0H08J9	iShares ST.Eu.600 In.G.&S.U.ETF DE	ANT	535	535
DE000A0H08M3	iShares ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE	ANT	640	640
DE000A0H08N1	ISHARES STiSh.ST.Eu.600 Pe.&H.G.U.ETF DE	ANT	466	466
DE000A0H08F7	iShares STOXX.Eur.600 Co.&Mat.	ANT	653	653
DE000A0Q4R28	iShares STOXX Europe 600 Automobiles & Parts (DE)	ANT	245	245
DE000A0H08E0	iShares STOXX Europe 600 Chemicals (DE)	ANT	230	230
IE00BJ5JP329	iShs V-MSCI W.C.St.Sec.U.ETF Reg. Shs USD Dis. o.N	ANT	750	750
IE00B42NKQ00	iShs V-S&P 500 Energy Se.U.ETF Registeres Shares o.N.	ANT	460	460
IE00B53L3W79	iShs VII-Co.EO STOXX 50 U.ETF Reg. Shares EUR (Acc) o.N.	ANT	230	230
IE00B643RZ01	Lyxor Epsilon Global Trend Fd Registered Shares I EUR o.N.	ANT	280	280
LU0533033824	MUL-LYX.MSCI Wd.Mats TR UC.ETF Nam.-An. ACC EUR o.N.	ANT	9	9
LU0370038167	NN (L)- Alternative Beta Act.Nominatives P Cap.EUR o.N.	ANT	90	90
IE00B78JSG98	UBS(I)ETF-MSCI USA VALUE U.E. Reg. Shares A Dis. USD o.N.	ANT	325	325
LU0446734369	UBS-ETF-UBS-ETF MSCI EMU V.U.E Inhaber-Ant.(EUR) A-dis o.N.	ANT	875	875
LU0476289540	Xtrackers MSCI Canada Inhaber-Anteile 1C o.N.	ANT	360	360
IE00BCHWNV48	Xtrackers MSCI USA Ind.UC.ETF Registered Shares 1D o.N.	ANT	67	67

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) MTS FONDS I FÜR DEN ZEITRAUM VOM 04.10.2022 BIS 30.09.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		35,99
davon negative Habenzinsen	-0,94	
2. Erträge aus Investmentanteilen		73,23
Summe der Erträge		109,22
II. Aufwendungen		
1. Verwaltungsvergütung		-15,06
2. Verwahrstellenvergütung		-1,26
3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-29,59
4. Sonstige Aufwendungen		-3,60
5. Aufwandsausgleich		-437,96
Summe der Aufwendungen		-487,47
III. Ordentlicher Nettoertrag		-378,25
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		481,63
2. Realisierte Verluste		-43,65
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		437,98
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		59,73
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		90,46
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-125,12
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		-34,66
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		25,07

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) MTS FONDS R FÜR DEN ZEITRAUM VOM 04.10.2022 BIS 30.09.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		1.914,20
davon negative Habenzinsen	-101,08	
2. Erträge aus Investmentanteilen		3.145,72
Summe der Erträge		5.059,92
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-1,65
2. Verwaltungsvergütung		-10.146,57
3. Verwahrstellenvergütung		-698,29
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-9.493,38
5. Sonstige Aufwendungen		-2.798,85
6. Aufwandsausgleich		-3.767,63
Summe der Aufwendungen		-26.906,37
III. Ordentlicher Nettoertrag		-21.846,45
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		33.350,37
2. Realisierte Verluste		-14.035,90
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		19.314,47
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		-2.531,98
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		14.125,51
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-5.775,70
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		8.349,81
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		5.817,83

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS MTS FONDS I

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres (04.10.2022)		0,00
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		16.922,62
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	17.024,85	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-102,23	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-80,78
3. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		25,07
davon nicht realisierte Gewinne	90,46	
davon nicht realisierte Verluste	-125,12	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres (30.09.2023)		16.866,91

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS MTS FONDS R

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres (04.10.2022)		0,00
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		772.920,57
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	773.327,95	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-407,38	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-101,06
3. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		5.817,83
davon nicht realisierte Gewinne	14.125,51	
davon nicht realisierte Verluste	-5.775,70	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres (30.09.2023)		778.637,34

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS MTS FONDS I ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	103,38	0,63
1. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	59,73	0,36
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	43,65	0,26
II. Wiederanlage	103,38	0,63

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

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS MTS FONDS R ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	11.503,92	1,50
1. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	-2.531,98	-0,33
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	14.035,90	1,83
II. Wiederanlage	11.503,92	1,50

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE MTS FONDS I

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	16.866,91	102,22
(Auflegung 04.10.2022)	100,00	100,00

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE MTS FONDS R

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	778.637,34	101,62
(Auflegung 04.10.2022)	100,00	100,00

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		
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		58,09
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00
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 MTS Fonds I	EUR	102,22
Anteilwert MTS Fonds R	EUR	101,62
Umlaufende Anteile MTS Fonds I	STK	165,000
Umlaufende Anteile MTS Fonds R	STK	7.662,000

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	MTS Fonds I	MTS Fonds R
ISIN	DE000A3DCA46	DE000A3DCA53
Währung	Euro	Euro
Fondsauflage	04.10.2022	04.10.2022
Ertragsverwendung	Thesaurierend	Thesaurierend
Verwaltungsvergütung	1,235 % p.a.	1,735 % p.a.
Ausgabeaufschlag	0,00 %	4,00 %
Mindestanlagevolumen	10.000	0

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 MTS FONDS I

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	3,77 %
---	--------

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE MTS FONDS R

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	4,03 %
---	--------

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus, sowie die laufenden Kosten (in Form der veröffentlichten Gesamtkostenquote) der zum Rumpfgeschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Rumpfgeschäftsjahresende. Die angegebene TER bezieht sich auf den Zeitraum von der Auflage des Fonds am 04. Oktober 2022 bis zum Rumpfgeschäftsjahresende am 30. September 2023.

TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 04.10.2022 BIS 30.09.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	3.163.583,73
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	0,00
Relativ in %	0,00 %

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 3.146,36 EUR

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

AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

Im abgelaufenen Rumpfgeschäftsjahr 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 MTS Fonds I sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse MTS Fonds R 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 %
LU0411078552	db x-tr.S&P 500 2x LEV.DLY.ETF ¹⁾	0,40
LU0292106241	db x-tr.SHORTDAX DAILY ETF ¹⁾	0,40
LU0292105359	db x-tra.STOXX 600 FOOD & BEVERAGE ETF 1C ¹⁾	0,15
LU0322250985	db x-trackers CAC 40 ETF Inhaber-Anteile 1D ¹⁾	0,10
LU0411075376	db x-trackers LEVDAX DAILY ETF 1C ¹⁾	0,15
DE000ETFLO11	Deka DAX UCITS ETF Inhaber-Anteile ¹⁾	0,15
DE000ETFLO45	Deka STOXX Eu.Str.Val.20 U.ETF Inhaber-Anteile ¹⁾	0,65
DE000ETF1185	ETFlab Dt.Börse EUROGOV Ge.1-3 ¹⁾	0,15
DE0006289473	iSh. eb.r.Governm. Ger.1.5-2.5 ¹⁾	0,15
DE0002635281	iSh.EO ST.Sel.Div.30 U.ETF DE ¹⁾	0,30
DE000A0F5UK5	iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H08K7	iSh.ST.Eu.600 Insuran.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H08S0	iSh.ST.Eu.600 Trav.&L.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0F5UJ7	iSh.ST.Euro.600 Banks U.ETF DE ¹⁾	0,45
IE00B0M62Y33	iShares AEX ¹⁾	0,30
DE000A0D8Q23	iShares ATX UCITS ETF DE ¹⁾	0,30
DE0005933931	iShares Core DAX UCITS ETF DE EUR Acc. ¹⁾	0,15
DE000A0H08J9	iShares ST.Eu.600 In.G.&S.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H08M3	iShares ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE ¹⁾	0,50
DE000A0H08N1	ISHARES STiSh.ST.Eu.600 Pe.&H.G.U.ETF DE ¹⁾	0,45
DE000A0H08F7	iShares STOXX.Eur.600 Co.&Mat. ¹⁾	0,45
DE000A0Q4R28	iShares STOXX Europe 600 Automobiles & Parts (DE) ¹⁾	0,46
DE000A0H08E0	iShares STOXX Europe 600 Chemicals (DE) ¹⁾	0,45
IE00B5BMR087	iShares VII-Core S&P 500 U.ETF ¹⁾	0,07
IE00BGR7L912	iShs DL Treas.Bd 0-1yr UC.ETF Registered Shares USD (Dist)oN ¹⁾	0,07
IE00BJ5JP329	iShs V-MSCI W.C.St.Sec.U.ETF Reg. Shs USD Dis. oN ¹⁾	0,25
IE00B42NKQ00	iShs V-S&P 500 Energy Se.U.ETF Registeres Shares o.N. ¹⁾	0,15
IE00B53L3W79	iShs VII-Co.EO STOXX 50 U.ETF Reg. Shares EUR (Acc) o.N. ¹⁾	0,10
IE00B4L5Y983	iShsIII-Cor.MSCI Wld UCITS ETF Registered Shs Acc. USD o.N. ¹⁾	0,20
IE00B53L4350	iShsVII-DJ Indl Average U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N. ¹⁾	0,33
IE00B53SZB19	iShsVII-NASDAQ 100 UCITS ETF Registered Shares o.N. ¹⁾	0,33
IE00B643RZ01	Lyxor Epsilon Global Trend Fd Registered Shares I EUR o.N. ¹⁾	1,00
LU0533033824	MUL-LYX.MSCI Wd.Mats TR UC.ETF Nam.-An. ACC EUR o.N. ¹⁾	0,10
LU0370038167	NN (L)- Alternative Beta Act.Nominatives P Cap.EUR o.N. ¹⁾	1,00
IE00B78JSG98	UBS(I)ETF-MSCI USA VALUE U.E. Reg. Shares A Dis. USD o.N. ¹⁾	0,20
LU0446734369	UBS-ETF-UBS-ETF MSCI EMU V.U.E Inhaber-Ant.(EUR) A-dis o.N. ¹⁾	0,25
LU0274211480	Xtrackers DAX 1C ¹⁾	0,01
LU0476289540	Xtrackers MSCI Canada Inhaber-Anteile 1C o.N. ¹⁾	0,15
IE00BCHWNV48	Xtrackers MSCI USA Ind.UC.ETF Registered Shares 1D o.N. ¹⁾	0,02

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

MTS Fonds I

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Quellensteuererstattungsanträge	EUR	3,19
---------------------------------	-----	------

MTS Fonds R

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

Erstattung verauslagte Kosten (Genehmigung der Anlagebedingungen und der Verwahrstelle durch BaFin)	EUR	2.575,60
---	-----	----------

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 Signal Iduna Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2022 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager		Signal Iduna Asset Management GmbH
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	9.884.467,00
davon feste Vergütung	EUR	0,00
davon variable Vergütung	EUR	0,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens		115

Die Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung umfasst den Aufwandsposten Personalaufwendungen ohne soziale Abgaben des letzten im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlichten Jahresabschlusses.

Hamburg, 17. Januar 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 MTS Fonds - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr vom 04. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Rumpfgeschäftsjahr vom 04. Oktober 2022 bis zum 30. September 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 18.01.2024

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

- (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

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

Haftendes Eigenkapital: 575,597 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 28,839 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