

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

# JAHRESBERICHT

FondsSecure Systematik

31. März 2023

**HANSA**INVEST

## Inhaltsverzeichnis

---

Tätigkeitsbericht FondsSecure Systematik	4
Vermögensübersicht	8
Vermögensaufstellung	9
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	20
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	37
Allgemeine Angaben	40

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Jahresbericht informiert Sie über die Entwicklung des offenen inländischen Publikums-AIF (Sons-  
tige Sondervermögen)

FondsSecure Systematik

in der Zeit vom 01.04.2022 bis 31.03.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

## Tätigkeitsbericht FondsSecure Systematik

### Tätigkeitsbericht des FondsSecure Systematik für das Geschäftsjahr vom 01.04.2022 bis 31.03.2023

#### Anlageziel und Anlagepolitik

Der FondsSecure Systematik ist ein flexibler Multi-Asset-Dachfonds, der weltweit in Investmentfonds und sonstige Wertpapiere aus verschiedenen Branchen, Regionen und Segmenten investiert.

Anlageziel ist es, einen mittel- bis langfristig hohen Wertzuwachs zu erwirtschaften. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Fonds in verschiedene Assetklassen insbesondere in Form von Investmentanteilen, ETFs, Einzeltiteln und Zertifikaten. Bei der Auswahl der Vermögensgegenstände stehen die Aspekte Wachstum, Liquidität und / oder Nachhaltigkeit im Vordergrund.

Der Fonds muss mindestens 51% des Wertes des Sondervermögens in Investmentanteile nach § 196 KAGB oder Anteile an gemischten Sondervermögen investieren.

Mindestens 51% müssen in Wertpapieren und Investmentanteilen investiert werden, die unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitskriterien ausgewählt werden und von einem durch die Gesellschaft anerkannten Anbieter für Nachhaltigkeits-Research unter ökologischen und sozialen Aspekten analysiert und positiv bewertet worden sind.

Seit Ende 2012 werden Assetallokation, Titelauswahl und Timing verstärkt nach fundamentalen Aspekten mithilfe eines Multifaktorenmodells bestimmt, in dem das Kriterium „relative Stärke“ eine wichtige Rolle spielt. In der zweiten Hälfte des Geschäftsjahres wurde das selbst entwickelte Analysetool deutlich ausgebaut und es wurde eine Reihe zusätzlicher Parameter implementiert mit dem Ziel, in volatilen Marktphasen mit häufigen kurzfristigen Richtungswechsel Anzeichen für Marktveränderungen rascher erkennen und das Portfolio proaktiv und noch zeitnäher an diese Entwicklungen anpassen zu können. Bei der Selektion der Zielfonds und Einzeltitel werden neben rein finanziellen Aspekten auch Nachhaltigkeitskriterien berücksichtigt.

Der FondsSecure Systematik verlor im abgelaufenen

Geschäftsjahr vom 01.04.2022 bis 31.03.2023 18,39% an Wert.

Im Vergleich dazu büßte der weltweite Aktienindex MSCI World 8,6% ein. Der marktbreite US-Index S&P 500 verlor 10,6% und die Technologie-Börse Nasdaq 12,9%, wogegen der DAX um 7,7% zulegen konnte. Der deutsche Rentenindex REX, der die Entwicklung der Bundesanleihen abbildet, verzeichnete einen Verlust von 7,5%.

Kaum hatte sich die Wirtschaft von den teilweise massiven Einbrüchen durch die Corona-Pandemie einigermaßen erholt, häuften sich 2022 die Krisen wie selten zuvor. Eine rapide ansteigende Inflation, die u.a. durch die langandauernde strikte Lockdown-Politik Chinas verschärften Lieferkettenprobleme und nicht zuletzt der Angriffskrieg Russlands gegen die Ukraine, in dessen Folge die Energie- und Kornpreise explodierten und die Inflation noch stärker angeheizt wurde, schickten die Börsen auf Talfahrt und brachten die Notenbanken in ein Dilemma. Als Währungshüter stehen sie einerseits für den Erhalt der Geldwertstabilität, andererseits laufen sie Gefahr, durch eine zu straffe Geldpolitik eine Wirtschaftsrezession auszulösen. Anfang April 2022 hat die US-Notenbank FED den Leitzins erstmals um 0,25% erhöht. Nachdem die Inflation weiter kletterte und im Sommer 2022 mit über 9% den Peak erreichte, sah sich die FED zu einer Reihe weiterer Zinsschritte genötigt. Sie erhöhte den Leitzins insgesamt neun Mal im Berichtszeitraum von 0,88% auf 4,83%. Deutlich später und zaghafter ging die EZB zu Werke. Von August 2022 bis Ende März 2023 hob sie den Leitzins sechsmal an von 0% bis 3,5%.

Auf die geopolitische Zeitenwende, ausgelöst durch Russlands Krieg gegen die Ukraine folgte somit unvermittelt eine Zinswende, die zusammen mit den übrigen Problemen Rezessionsängste schürten und zu erheblichen Turbulenzen an den Finanzmärkten führten. Die teils starken Kurseinbrüche wurden mehrfach durch kurze Erholungsphasen unterbrochen, da je nach aktueller Datenlage immer wieder Hoffnungen auf ein Abflauen der Inflation und ein Ende der Zinsanhebungen aufkeimten. Zuletzt kam es auch am Jahresbeginn 2023 nochmals zu Kursanstiegen, die aber wie die Rebounds im Vorjahr schon nach wenigen Wochen wie-

der abbrechen. Diese häufigen Richtungswechsel haben Fondsmanager insbesondere von flexiblen Mischfonds und Vermögensverwalter vor große Herausforderungen gestellt.

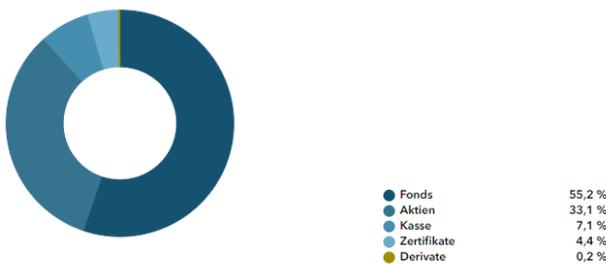
Im Vergleich zum Beginn des Berichtszeitraumes wurde die Fondsquote von 49,9% auf 55,2% ausgebaut. Davon entfallen 18,6% auf Renten-ETFs, während der Anteil der Aktienfonds deutlich reduziert wurde und somit auch die Gesamtk Aktienquote des Fonds. Eine weitere wesentliche Veränderung ist der Aufbau von Positionen bei zyklischen Werten der Automobilbranche (Einzelaktien und ETF) sowie Versicherungsaktien (ETF und Einzeltitel)

Fremdwährungen wurden nicht abgesichert, da deren Gewichtung im Portfolio nicht über das strategisch gewollte Maß hinausging.

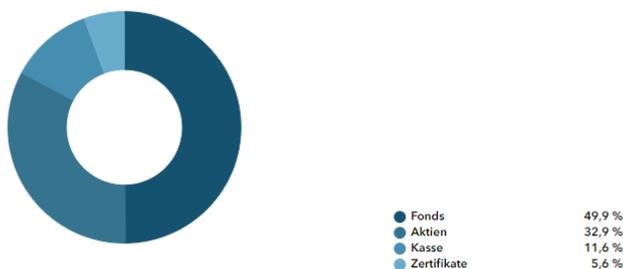
Die Angaben zu den regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten werden im Anhang des Jahresberichts ausgegeben.

**Portfoliostruktur**

per 31.03.2023 \*)

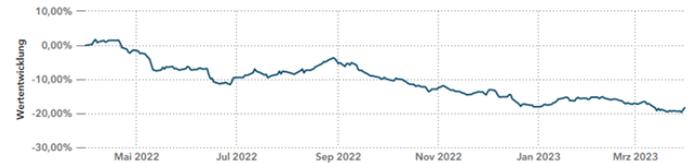


per 31.03.2022 \*)



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

**Wertentwicklung**



Die Wertentwicklung nach BVI des FondsSecure Systematik betrug im Berichtszeitraum -18,39%. Die Volatilität des Investmentvermögens beträgt zum 31.03.2023 für den Berichtszeitraum 8,82%.

**Veräußerungsergebnis**

Das Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften des FondsSecure Systematik im gesamten Berichtsjahr war mit -6.237.121,47 Euro negativ.

Der negative Saldo setzt sich zusammen aus Gewinnen i. H. v. 3.375.221,58 Euro sowie Verlusten i. H. v. -9.612.343,05 Euro.

Die realisierten Gewinne resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von Aktien und Investmentanteilen. Für die realisierten Verluste sind im Wesentlichen Veräußerungen von Futures und Investmentanteilen ursächlich.

**Risikoanalyse**

**Adressenausfallrisiken**

Adressenausfallrisiken bestanden insbesondere durch Investitionen in Wertpapiere nicht staatlich garantierter Emittenten. Dies galt insbesondere für das gehaltene festverzinsliche Wertpapier aus dem Unternehmensbereich bzw. entsprechende Fonds.

**Liquiditätsrisiken**

Mit Ausnahme des offenen Immobilienfonds KanAm SPEZIAL grundinvest Fonds, der 2012 vorläufig

geschlossen wurde (0,0756% des Fondsvermögens), und der Aktie TCS Group Holding PLC, die seit dem 28.02.2022 vom Handel ausgesetzt ist, sind alle Titel zeitnah veräußerbar.

### Zinsänderungs-, Währungs- und Marktpreisrisiken

Sofern in festverzinsliche Wertpapiere investiert wird, 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.

Währungsrisiken ergaben sich indirekt durch den Erwerb von Aktien außerhalb des Euro-Währungsraumes sowie durch den Erwerb von Fremdwährungsanleihen bzw. Fonds, die in solche investieren. Teilabsicherungen des Fremdwährungsanteils wurden nicht vorgenommen.

Die Fremdwährungsquote lag zum 31.03.2023 nominal bei 24,10% des Fondsvermögens.

Marktpreisrisiken des Investmentvermögens resultieren aus den Kursbewegungen der gehaltenen Aktien und Investmentfonds.

### 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. 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 erfahrende 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.

### Anlagegeschäfte während des Berichtszeitraumes

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr abgeschlossenen Geschäfte sowie die sich im Bestand des Sondervermögens befindlichen Finanzinstrumente werden im Jahresbericht ausgewiesen.

### Sonstige Hinweise

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

Das Portfoliomanagement für den FondsSecure Systematik ist seit dem 01. Januar 2023 an die Greiff capital management AG, Freiburg im Breisgau ausgelagert.

Das vorherige Portfoliomanagement wurde durch die Reuss Private Deutschland AG ausgeführt.

Erwähnenswert ist die Tatsache, dass der FondsSecure Systematik mittelbar vom Madoff-Betrugsfall betroffen war. Der Fonds war im Jahr 2008 u. a. in dem zum öffentlichen Vertrieb zugelassenen Publikumsfonds Herald (LUX)-US Absolute Return Fund investiert. Wie sich die Situation heute darstellt, hat die für die Verwahrung des Fondskapitals zuständige Verwahrstelle dieses Fonds (HSBC) diese Aufgabe ohne Kenntnis der Investoren an Dritte übertragen und es dabei offensichtlich versäumt, ihren Kontrollpflichten als Verwahrstelle nachzukommen. Da es sich bei den von HSBC beauftragten Unterverwahrern um Firmen des Ende 2008 verhafteten Finanzbetrügers Bernard Madoff handelte, führte die Auslagerung wichtiger Teile der Verwahrstellenfunktion an Dritte und das Kontrollversagen der Verwahrstelle zum (vorläufigen) Totalverlust des Fondskapitals. Dementsprechend wurde der am Herald (LUX)-US Absolute Return Fund gehaltene Anteil im Dezember 2008 abgeschrieben, was einen Verlust des FondsSecure Systematik in Höhe von ca. 11% zur Folge hatte.

In Folge dessen wurden beim Madoff-Insolvenzverwalter in den USA Ansprüche auf quotale Entschädigung aus der Insolvenzmasse angemeldet, die seitens des Insolvenzverwalters anerkannt und von den zuständigen Gerichten in den USA und Luxemburg bestätigt wurden. Die anteilige Entschädigungszahlung daraus ist dem Fondsvermögen in den letzten Jahren bereits zum größten Teil zugeflossen.

Ferner wurde die HSBC als Verwahrstelle und andere Beteiligte in Luxemburg sowohl handelsrechtlich (durch die amtlichen Liquidatoren des Herald-Fund LUX) als auch zivilrechtlich (von mehreren Dachfonds und Direktanlegern) gerichtlich verklagt.

Diese Bemühungen um Entschädigungsleistungen haben auch zum Erfolg geführt in Form eines Vergleichs. Dementsprechend wurden die daraus zu erwartenden Leistungen bereits in den Vorgeschäftsjahren als Forderung in das Fondsvermögen eingebucht. Aufgrund der zwischenzeitlichen Auszahlung eines maßgeblichen Anteils der Entschädigungsleistung erfolgte in den letzten Geschäftsjahren eine quotale Ausbuchung der Forderung.

Darüber hinaus wurde in den USA ein mit über 4 Mrd. USD ausgestatteter Fonds aufgelegt (Madoff Victim Fund), bei dem im Frühjahr 2014 auch die in 2008 geschädigten Anleger im FondsSecure Systematik einen Antrag auf Entschädigung einreichen konnten. Das Sondervermögen hat bisher Teilauszahlungen über TUSD 1.723 vereinnahmt, eine letzte Auszahlung aus dem Verkauf der Forderungen steht noch aus.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

## Vermögensübersicht

### VERMÖGENSÜBERSICHT

		Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>23.054.394,56</b>	<b>100,17</b>
1. Aktien		7.617.966,20	33,10
2. Zertifikate		1.008.110,00	4,38
3. Investmentanteile		12.713.181,89	55,24
- Immobilienfonds	EUR	16.000,00	0,07
4. Derivate		42.625,00	0,19
5. Bankguthaben		1.658.616,52	7,21
6. Sonstige Vermögensgegenstände		13.894,95	0,06
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-39.233,75</b>	<b>-0,17</b>
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-39.233,75	-0,17
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>23.015.160,81</b>	<b>100,00</b>

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung

### VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
						im Berichtszeitraum				
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>8.626.076,20</b>	<b>37,48</b>	
<b>Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>7.617.966,20</b>	<b>33,10</b>	
CA9628791027	Wheaton Precious Metals Corp.	STK	2.500	2.500	0	CAD	65,1100	110.247,55	0,48	
CH0108503795	Meyer Burger Technology AG	STK	400.000	200.000	500.000	CHF	0,6235	250.288,52	1,09	
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	1.400	1.400	0	DKK	1.079,6000	202.920,07	0,88	
NL0012969182	Adyen N.V.	STK	160	50	0	EUR	1.431,0000	228.960,00	0,99	
DE0008404005	Allianz	STK	800	800	0	EUR	211,8000	169.440,00	0,74	
FR0010220475	Alstom	STK	8.000	8.000	0	EUR	25,0500	200.400,00	0,87	
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	600	0	0	EUR	623,7000	374.220,00	1,63	
FR0000061129	Boiron S.A. Actions Port. EO 1	STK	6.000	0	0	EUR	39,8000	238.800,00	1,04	
CNE100000296	BYD Co. Ltd.	STK	6.000	6.000	0	EUR	26,9450	161.670,00	0,70	
DE0006095003	ENCAVIS AG	STK	10.000	0	3.000	EUR	15,6150	156.150,00	0,68	
DE0005313506	Energiekontor AG Inhaber-Aktien o.N.	STK	2.000	2.000	0	EUR	62,7000	125.400,00	0,54	
NO0010096985	Equinor ASA	STK	6.000	6.000	0	EUR	26,1600	156.960,00	0,68	
DE0005759807	init innova.in traffic sys. AG	STK	7.000	7.000	0	EUR	31,4500	220.150,00	0,96	
IE000S9YS762	Linde plc Registered Shares EO -, 001	STK	800	800	0	EUR	320,6500	256.520,00	1,11	
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG	STK	2.600	2.600	0	EUR	70,9100	184.366,00	0,80	
DE0008430026	Münchener Rückversicherung	STK	320	320	0	EUR	322,4000	103.168,00	0,45	
IT0003073266	Piaggio & C.	STK	50.000	50.000	0	EUR	3,9360	196.800,00	0,86	
FR000131906	Renault	STK	4.600	4.600	0	EUR	37,5800	172.868,00	0,75	
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA	STK	3.800	3.800	0	EUR	48,3200	183.616,00	0,80	
NL0000395903	Wolters Kluwer	STK	2.000	0	1.000	EUR	115,9000	231.800,00	1,01	
NO0010890304	Aker Carbon Capture AS	STK	90.000	90.000	0	NOK	14,1450	112.116,57	0,49	
NO0010081235	NEL ASA	STK	170.000	80.000	0	NOK	13,9800	209.305,40	0,91	
US00287Y1091	AbbVie Inc.	STK	1.500	0	2.300	USD	157,9200	217.082,11	0,94	
US00790R1041	Advanced Drainage Systems Inc. Registered Shares DL -,01	STK	2.200	2.200	0	USD	83,6800	168.709,68	0,73	
US00766T1007	Aecom Technology	STK	2.400	0	1.000	USD	83,5400	183.739,00	0,80	
US00130H1059	AES	STK	5.000	12.000	7.000	USD	23,5700	108.000,37	0,47	
US22788C1053	Crowdstrike Holdings Inc	STK	1.600	2.050	450	USD	131,7200	193.137,83	0,84	
US5324571083	Eli Lilly and Company	STK	560	560	0	USD	340,6900	174.840,91	0,76	
US29355A1079	Enphase Energy Inc.	STK	760	760	0	USD	205,2700	142.966,64	0,62	
US44045A1025	Horizon Technology Finance Registered Shares DL -,001	STK	18.000	18.000	0	USD	11,2400	185.410,56	0,81	
US4592001014	Intl Business Machines	STK	1.600	1.400	600	USD	129,2200	189.472,14	0,82	
US53814L1089	Livent Corp. Registered Shares o.N.	STK	4.200	4.200	0	USD	21,7800	83.830,65	0,36	
US5949181045	Microsoft Corp.	STK	1.100	0	0	USD	284,0500	286.340,73	1,24	
US67066G1040	NVIDIA Corp.	STK	500	500	0	USD	273,8300	125.471,96	0,55	
US6866881021	Ormat Technologies	STK	2.000	2.000	0	USD	84,6900	155.223,61	0,67	
US7475251036	QUALCOMM Inc.	STK	1.600	1.600	0	USD	127,4000	186.803,52	0,81	

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
US7739031091	Rockwell Automation Inc.		STK	300	300	0 USD	287,5300	79.049,67	0,34
US83417M1045	SolarEdge Technologies Inc.		STK	600	600	0 USD	296,0300	162.773,09	0,71
US8725901040	T-Mobile US Inc. Registered Shares DL-,00001		STK	1.800	1.800	0 USD	144,5700	238.476,91	1,04
US8740391003	Taiwan Semiconduct.Manufact.		STK	1.000	1.000	0 USD	92,4700	84.741,57	0,37
US87238U2033	TCS Group		STK	1.400	0	0 USD	0,6386	819,32	0,00
US8835561023	Thermo Fisher Scientific		STK	480	0	280 USD	562,9700	247.640,76	1,08
US9778521024	Wolfspeed Inc. Registered Shares DL-,00125		STK	2.700	3.700	1.000 USD	63,5600	157.269,06	0,68

Zertifikate							EUR	1.008.110,00	4,38
DE000PB8PAL7	BNP Paribas Issuance B.V. OPEN END ETC Palladium		STK	2.000	0	1.400 EUR	128,3750	256.750,00	1,12
JE00B2NFTL95	WisdomTree Comm. Securit. Ltd. ZT08/Und.2X DAILY LONG GOLD		STK	3.000	3.000	0 EUR	56,3200	168.960,00	0,73
DE000A0S9GB0	Xetra-Gold		STK	10.000	0	6.000 EUR	58,2400	582.400,00	2,53

Investmentanteile							EUR	12.697.181,89	55,17
KVG - eigene Investmentanteile							EUR	141.390,00	0,61
DE000A2DHTY3	Perspektive OVID Equ. ESG Fds I		ANT	1.000	0	0 EUR	141,3900	141.390,00	0,61

Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	12.555.791,89	54,55
LU1681048630	AIS-Amundi S&P Global Luxury Namens-Anteile C Cap.EUR o.N.		ANT	4.000	4.000	0 EUR	207,2765	829.106,00	3,60
LU2572257041	AIS-SHORTDAX DAILY(1X)INVERSE Act.Nom. U.ETF EUR Dis. oN		ANT	30.000	207.500	177.500 EUR	13,7580	412.740,00	1,79
FR0010754184	Amundi ETF Gvt Bd EO Br.IG7-10 Actions au Porteur o.N.		ANT	1.600	1.600	0 EUR	229,3100	366.896,00	1,59
FR0010754143	Amundi ETF-GVBDEOBIG 10-15 ETF Actions au Porteur o.N.		ANT	1.500	1.500	0 EUR	245,5000	368.250,00	1,60
LU0292104030	DB X-TRACKERS STOXX 600 TELECOMMUNICATION INDEX ETF 1C		ANT	11.000	11.000	8.000 EUR	69,0600	759.660,00	3,30
DE000A0H08L5	iShares ST.Euro.600 Media U.ETF DE		ANT	25.600	25.600	0 EUR	31,2100	798.976,00	3,47
IE00BF11F458	iShs II-iShs \$ Flt.Ra.Bd U.ETF Reg. Shares EUR Hd Dis. o.N.		ANT	80.000	360.000	280.000 EUR	4,5023	360.184,00	1,56
IE00BZ048462	iShs II-iShs \$ Flt.Ra.Bd U.ETF Reg. Shares USD Unh.Dis. o.N.		ANT	100.000	200.000	100.000 EUR	4,6217	462.170,00	2,01
IE00BSKRJX20	iShs IV-iSh.EO Gv.Bd 20yr T.D. Registered Shares o.N.		ANT	300.000	300.000	0 EUR	3,8520	1.155.600,00	5,02
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Registered Shs EUR Acc. o.N.		ANT	120.000	120.000	0 EUR	8,8500	1.062.000,00	4,61
LU1834987973	Lyxor IF-L.ST.Eu.600 Insuran. Act. Nom. EUR Acc. oN		ANT	10.000	18.000	8.000 EUR	49,3580	493.580,00	2,14
LU1390062245	MUL-L.EO 2-10Y Inf.Expect.U.E. Inhaber-Anteile C EUR o.N.		ANT	7.000	19.000	12.000 EUR	112,6000	788.200,00	3,42
IE00B5NLX835	Source-S.ST.Eur.600 Opt.A+P Registered Shares A o.N.		ANT	1.500	1.500	0 EUR	481,8500	722.775,00	3,14
IE00BMC38736	VanEck Semiconductor UCITS ETF Reg. Shares o. N.		ANT	40.000	40.000	0 EUR	22,8250	913.000,00	3,97
NL0010408704	VanEck Vect.Sus.Wld Eq.Weight Aandelen oop naam o.N.		ANT	15.000	15.000	0 EUR	26,8000	402.000,00	1,75

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
IE00BM67HP23	Xtr.(IE)-MSCI World Consumer Discretionary 1C USD		ANT	17.000	17.000	0 EUR	41,1650	699.805,00	3,04
LU0411078636	Xtr.S&P 500 2x Inverse D.Swap 1C		ANT	1.200.000	1.800.000	600.000 EUR	0,4214	505.680,00	2,20
LU0838782315	Xtrackers DAX Income 1D		ANT	400	7.200	6.800 EUR	111,8800	44.752,00	0,19
IE00BDZVHT63	Fidelity II-MSCI Pac.ex-J.Idx Reg. Shares P USD Acc. o.N.		ANT	120.000	120.000	0 USD	5,6929	626.052,05	2,72
IE00B3VWN518	iShs VII-\$.T.Bd.7-10yrUCETF ACC Registered Shares o.N.		ANT	6.000	6.000	0 USD	142,6500	784.365,84	3,41
<b>Anteile an Immobilien-Sondervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>16.000,00</b>	<b>0,07</b>
<b>Gruppenfremde Immobilien-Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>16.000,00</b>	<b>0,07</b>
DE00A0CARS0	KanAm SPEZIAL grundinvest Fonds		ANT	4.000	0	0 EUR	4,0000	16.000,00	0,07
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>21.339.258,09</b>	<b>92,72</b>
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							<b>EUR</b>	<b>42.625,00</b>	<b>0,19</b>
<b>Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>							<b>EUR</b>	<b>42.625,00</b>	<b>0,19</b>
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>42.625,00</b>	<b>0,19</b>
DAX Future 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	2				23.300,00	0,10
DAX Future 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	2				19.325,00	0,08
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.780.515,63</b>	<b>7,74</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>							<b>EUR</b>	<b>1.780.515,63</b>	<b>7,74</b>
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	1.780.515,63				1.780.515,63	7,74
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>13.894,95</b>	<b>0,06</b>
Dividendenansprüche			EUR	1.994,95				1.994,95	0,01
Sonstige Ansprüche <sup>2)</sup>			EUR	11.900,00				11.900,00	0,05
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-121.899,11</b>	<b>-0,53</b>
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>-121.899,11</b>	<b>-0,53</b>
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	-133.016,31				-121.899,11	-0,53
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-39.233,75</b>	<b>-0,17</b>
Sonstige Verbindlichkeiten <sup>3)</sup>			EUR	-39.233,75				-39.233,75	-0,17
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>23.015.160,81</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert FondsSecure Systematik</b>							<b>EUR</b>	<b>64,10</b>	
<b>Umlaufende Anteile FondsSecure Systematik</b>							<b>STK</b>	<b>359.077,000</b>	

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

<sup>2)</sup> diese beinhalten Forderungen aus Ratingkostenrückerstattungen

<sup>3)</sup> noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

## WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.03.2023		
Dänische Krone	(DKK)	7,448450	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,476450	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	11,354700	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,996450	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,091200	=	1 Euro (EUR)

## MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

## 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
DE000A0HL8N9	2G energy AG	STK	9.600	12.000
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S	STK	40	40
US0028241000	Abbott Laboratories	STK	0	2.800
US00724F1012	Adobe Systems Inc.	STK	0	240
CA0158571053	Algonquin Power&Utilities Corp Registered Shares o.N.	STK	18.000	18.000
US0394831020	Archer-Daniels-Midland	STK	1.600	1.600
DE0006766504	Aurubis	STK	0	1.800
FR0000120628	AXA	STK	0	5.000
US09075V1026	BioNTech SE Nam.-Akt.(sp.ADRs)1/o.N.	STK	0	1.400
US1468691027	Carvana Co.	STK	3.400	3.400
US18915M1071	Cloudflare Inc. Registered Shs Cl.A DL -,001	STK	1.900	4.200
DE000A2GS5D8	Dermapharm Holding SE Inhaber-Aktien o.N.	STK	0	2.800
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK	2.100	2.100
DE0005552004	Deutsche Post	STK	0	3.500
CA25675T1075	Dollarama Inc. Registered Shares o.N.	STK	3.400	3.400
DE0005664809	Evotec	STK	0	6.000
DE000A0Z2ZZ5	freenet	STK	0	12.000
US3635761097	Gallagher & Co., Arthur J. Registered Shares DL 1	STK	1.600	1.600
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA VZO	STK	0	2.400
US4581401001	Intel Corp.	STK	0	4.500
DE000A2NB601	JENOPTIK	STK	0	8.800
US47759T1007	JinkoSolar Holding Co. Ltd.	STK	3.000	3.000
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SA	STK	0	360
DE000A0HGQF5	MagForce AG Inhaber-Aktien o.N.	STK	0	18.500
DE000A3H2200	Nagarro SE	STK	500	1.200
DE0005220909	Nexus	STK	0	1.033
DE000A0D6554	Nordex SE	STK	14.000	14.000
US6700024010	Novavax Inc. Registered Shares DL -,01	STK	0	700
US7170811035	Pfizer	STK	0	3.300
US7170811035	Pfizer	STK	0	4.700
CH0012032113	Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1	STK	0	900
US79466L3024	Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001	STK	0	250
DE0007276503	secunet Security Networks AG Inhaber-Aktien o.N.	STK	900	900
DE0007235301	SGL CARBON	STK	14.000	14.000
DE000A0LR936	Steico	STK	0	3.700
US87918A1051	Teladoc Health Inc.	STK	5.200	7.000

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
DE000TUAG000	TUI	STK	0	50.000
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc.	STK	380	380
FR0004056851	Valneva SE Actions au Porteur EO -,15	STK	0	14.000
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG	STK	0	3.000
FR0004186856	Vetoquinol S.A.	STK	0	2.100
DE000VTSC017	Vitesco Technologies Group AG Namens-Aktien o.N.	STK	1.800	4.000
US2546871060	Walt Disney Co., The	STK	0	3.000
US94106L1098	Waste Management	STK	2.300	2.300
DE0005408686	ÖKOWORLD AG	STK	0	1.800
<b>Zertifikate</b>				
DE000A0V9YZ7	WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT08/Und.2xD.Lng. Gold	STK	0	3.000
<b>Andere Wertpapiere</b>				
US2538681030	Digital Realty Trust Inc. Registered Shares DL -,01	STK	1.600	1.600
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
US0090661010	Airbnb Inc. Registered Shares DL -,01	STK	0	1.200
US2567461080	Dollar Tree	STK	1.400	1.400
US47215P1066	JD.com Inc. R.Shs Cl.A	STK	0	2.400
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	800	800
US92337C1045	Verastem Inc. Registered Shares DL -,0001	STK	0	120.000
<b>Andere Wertpapiere</b>				
CH1220912898	Meyer Burger Technology AG Anrechte	STK	410.000	410.000
DE000A31C3G1	Nordex SE Inhaber-Bezugsrechte	STK	14.000	14.000
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
DE000LS1LUS9	Lang & Schwarz AG konv.Namens-Aktien o.N.	STK	0	10.302
<b>Investmentanteile</b>				
<b>KVG - eigene Investmentanteile</b>				
DE000A2PF1A7	G+G ValueInvesting-DLS Inhaber-Anteile S	ANT	3.000	3.000
LU1136261358	green benefit-Nachhaltigk.Plus Act.au Porteur I o.N.	ANT	400	400
LU0588515584	Millennium Global-M.G.Opport. Namensanteile P I o.N.	ANT	250	250
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
LU2572256829	AIS-Germ.BUND DAILY(1X)INVERSE Act.Nom. U.ETF EUR Dis. oN	ANT	6.900	6.900
FR00110757781	AMUNDI ETF SHORT EURO STOXX 50 DAILY	ANT	130.000	130.000
LU0943665348	AXA World Fds-Gbl Fac.-Sus.Eq. Namens-Anteile ZI Cap.EUR o.N.	ANT	0	3.000
IE00BDCY2C68	Baillie Gif.W.Fds-Pos.Change F Reg. Shares B EUR Acc. o.N.	ANT	40.000	40.000
LU0357130771	BAKERSTEEL Gl.F.-Precious Met. Inhaber-Anteile I2 EUR o.N.	ANT	1.800	1.800
LU0252963896	BGF World Energy D 2 EUR	ANT	32.000	32.000
LU1191324448	BL - Equities Dividend Inhaber-Ant.BI USD Hed.o.N.	ANT	700	700

## 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
LU0252963383	Blackrock Global Funds - World Mining Fund D2 EUR	ANT	10.000	10.000
LU1458428759	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. I Cap. USD o.N.	ANT	0	5.000
LU1458428833	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. IH Cap. EUR o.N.	ANT	5.000	5.000
IE00BHPRPJ85	BNY M.G.Fds-BNY Blockchain In. Registered Acc.Shs W USD o.N.	ANT	0	300.000
FR0010813105	Candriam Diversified Futures Actions Port. I Cap. 3 Déc. oN	ANT	80	80
LU2295992676	Carmignac Ptf.C.Ptf.Ch.N.ECO. Act. Nom. F Unh. EUR Acc. oN	ANT	10.000	10.000
LU0530119774	Comstage ETF Daily Short Bund I	ANT	6.900	6.900
LU0274221281	db x-trackers SMI ETF	ANT	0	4.000
LU1769942407	DWS Inv. - CROCI US Dividends Act. au Port. TFC EUR Acc. oN	ANT	2.500	2.500
LU1308283701	DWS Inv.- CROCI Sectors Plus Inhaber-Anteile XC o.N.	ANT	0	3.600
LU1881476821	DWS Inv.-Enhanc.Commodity Str. Act. au Port. IC EUR Acc. oN	ANT	4.000	4.000
LU0273147834	DWS Invest-Global Agribusiness Inh.-Ant. FC o.N.	ANT	3.000	3.000
IE00B3Q19T94	Euro Stoxx Optimesd Banks Source ETF A	ANT	9.000	20.000
IE00BHZRQY00	Franklin Lib.FTSE Brazil U.ETF Reg. Shares USD Acc. o.N.	ANT	17.940	38.000
DE000A2H8901	FUNDament Total Return Inhaber-Anteile I	ANT	7.400	7.400
IE00B578XK25	GLG Invts-GLG Japan CoreAl.Eq. Regist.Shares I H EUR o.N.	ANT	3.400	3.400
LU1299707155	GS Fds-GS Nort.Am.E.&E.I.Eq.P. Regist. Acc.Shs R EUR o.N.	ANT	50.000	50.000
LU0196034317	Hend.Horiz.Fd-Pan Eur.Prop.Eq. Actions Nom. I2 (Acc.) o.N.	ANT	14.000	14.000
LU0350637061	HERALD(LUX)-US Abs. Ret. EO Nam. Ant. I Cap.	ANT	0	1.969
DE000A0D8Q49	iShares Dow Jones U.S. Select Dividend (DE)	ANT	0	5.000
IE00B6R52143	iShs V-S&P Agribusiness UCITS Registered Shares o.N.	ANT	12.000	12.000
IE00B6SPMN59	iShs VI-E.S&P 500 Min.Vol.U.E. Registered Shares USD o.N.	ANT	0	15.000
LU0129493754	JPMorgan-Emer.Middle East Equ. Actions Nom. C (acc.) DL o.N.	ANT	50.000	50.000
LU0129494729	JPMorgan-Europe Dynam.Techn.Fd A.N. JPM-Eu.Dy.Te.C o.N.	ANT	1.800	1.800
IE00BD4GTV84	LMGF-LM Clear.Infrastr.Value Namens-Ant.A Acc.USD Hed.o.N.	ANT	50.000	50.000
LU2247605236	Luxembourg Sel.-Active Solar Act. Nom. I EUR Acc. oN	ANT	8.000	8.000
LU0405860593	Luxembourg Sel.-Asi.Sol.Win.Fd Inhaber-Anteile A2 o.N.	ANT	200	200
LU0603940916	Lyxor ShortDAX -1x Inverse ETF I	ANT	147.500	147.500
LU0259322260	M.A.-NYSE Arc.Gold Bgs Ind.ETF	ANT	0	7.000
LU1452600270	MUL-Lyx.Core US TIPS(DR)U.ETF Namens-Anteile Dist o.N.	ANT	0	14.000
DE000A0LGNP3	NORD/LB AM Glob.Chall.Ind.-Fds Inhaber Anteilklasse 1	ANT	3.000	3.000
LU0340558823	Pictet - Timber I EUR	ANT	3.000	3.000
DE000A0JDPT1	Pioneer Inv. Aktien Rohstoffe Inhaber-Anteile H	ANT	0	9.000
IE00B3WVRB16	Polar Cap.Fd.-Biotechnology Fd Registered Shares I EUR o.N.	ANT	20.000	20.000
LU0363372490	Robeco GI Consumer Trends Equ. Act. Nom. Class Z EUR o.N.	ANT	0	800
AT0000858956	RT VIF Versicherungs Intl Fds Inhaber-Anteile T o.N.	ANT	5.000	5.000
DE000A112T67	S4A US Long Inhaber-Anteile I	ANT	3.400	3.400

## 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
LU0450104814	SSgA Lux.-Global Man.Vol.Eq.Fd Reg. Shares I o.N.	ANT	0	36.000
IE00BWBXM500	SSGA S.ETF E.II-S.US Fin.S.Se. Registered Shares o.N.	ANT	0	26.000
LU0308790236	STABILITAS-Gold+Res.Spec.Situ. Inhaber-Ant. I Cap. o.N.	ANT	10.000	10.000
LU1858159350	Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Act. Nom. I1 EUR Dis. oN	ANT	2.000	2.000
LU1807298952	Thematica-Future Mobility Inhaber-Ant. Ret.Cap.USD o.N.	ANT	2.400	2.400
LU0629460089	UBS ETF-U.E.-MSCI USA S.R.U.E. Namens-Ant.(USD) A-dis o.N.	ANT	0	5.000
IE00BQQP9F84	VanEck Gold Miners UC.ETF Registered Shares A o.N.	ANT	20.000	20.000
IE00BJGWQN72	WisdomTree Cloud Comp.UCITSETF Registered Shares USD Acc o.N.	ANT	0	24.000
IE00BQZJBQ63	WisdomTree US Eq.Inc.UCITS ETF Registered Shares o.N.	ANT	0	27.000

## DERIVATE

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			416
Nasdaq-100 Index)				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			106.408
DAX Index)				
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
Nasdaq-100 Index)				

## ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) FONDSSECURE SYSTEMATIK

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.04.2022 BIS 31.03.2023

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden inländischer Aussteller		13.640,23
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		111.872,29
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		148,62
davon negative Habenzinsen	-9.543,57	
4. Erträge aus Investmentanteilen		52.093,37
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-25.513,49
6. Sonstige Erträge		36.975,90
<b>Summe der Erträge</b>		<b>189.216,92</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-2.518,95
2. Verwaltungsvergütung		-418.102,69
a) fix	-418.102,69	
b) performanceabhängig	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung		-22.765,93
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-9.579,54
5. Sonstige Aufwendungen		-8.206,49
6. Aufwandsausgleich		15.601,33
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-445.572,27</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>-256.355,35</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		3.375.221,58
2. Realisierte Verluste		-9.612.343,05
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-6.237.121,47</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-6.493.476,82</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-1.424.599,00
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.759.417,66
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>1.334.818,66</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-5.158.658,16</b>

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS FONDSSECURE SYSTEMATIK

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.04.2022)</b>		<b>30.088.550,87</b>
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-1.667.079,92
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	1.867.948,08	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-3.535.028,00	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-247.651,98
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		-5.158.658,16
davon nicht realisierte Gewinne	-1.424.599,00	
davon nicht realisierte Verluste	2.759.417,66	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.03.2023)</b>		<b>23.015.160,81</b>

**VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS FONDSSECURE SYSTEMATIK <sup>1)</sup>**

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>	<b>3.118.866,23</b>	<b>8,69</b>
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-6.493.476,82	-18,08
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	9.612.343,05	26,77
<b>II. Wiederanlage</b>	<b>3.118.866,23</b>	<b>8,69</b>

<sup>1)</sup> Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten

**VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE FONDSSECURE SYSTEMATIK**

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2023	23.015.160,81	64,10
2022	30.088.550,87	78,54
2021	36.194.462,34	83,60
2020	12.501.735,79	60,64

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	1.568.600,00
<b>Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte</b>		
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		
UBS Europe SE		
<b>Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.</b>		
<b>Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)</b>		
MSCI - World Index		90,00%
iBoxx EUR Corporates Total Return Index in EUR		10,00%
<b>Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV</b>		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,99%
größter potenzieller Risikobetrag		2,07%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		1,37%
<b>Risikomodell (§10 DerivateV)</b>		Full-Monte-Carlo
<b>Parameter (§11 DerivateV)</b>		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr

### 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 FondsSecure Systematik	EUR	64,10
Umlaufende Anteile FondsSecure Systematik	STK	359.077,000

### ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

Der Anteilwert wird durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH ermittelt. Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum Handel zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Investmentanteile werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV).

Die bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

Bankguthaben und Festgelder werden mit dem Nominalbetrag und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet. Die Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände erfolgt zu ihrem Markt- bzw. Nominalbetrag.

## ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE FONDSSECURE SYSTEMATIK

Performanceabhängige Vergütung	0,00 %
Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	1,89 %

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 Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

## TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.04.2022 BIS 31.03.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	317.971.284,77
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	0,00
Relativ in %	0,00 %

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 35.468,36 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 FondsSecure Systematik 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 %
LU1681048630	AIS-Amundi S&P Global Luxury Namens-Anteile C Cap.EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,15
LU2572256829	AIS-Germ.BUND DAILY(1X)INVERSE Act.Nom. U.ETF EUR Dis. oN <sup>1)</sup>	0,20
LU2572257041	AIS-SHORTDAX DAILY(1X)INVERSE Act.Nom. U.ETF EUR Dis. oN <sup>1)</sup>	0,30
FR0010754184	Amundi ETF Gvt Bd EO Br.IG7-10 Actions au Porteur o.N. <sup>1)</sup>	0,14
FR0010757781	AMUNDI ETF SHORT EURO STOXX 50 DAILY <sup>1)</sup>	0,30
FR0010754143	Amundi ETF-GVBDEOBIG 10-15 ETF Actions au Porteur o.N. <sup>1)</sup>	0,14
LU0943665348	AXA World Fds-Gbl Fac.-Sus.Eq. Namens-Anteile ZI Cap.EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,19
IE00BDCY2C68	Baillie Gif.W.Fds-Pos.Change F Reg. Shares B EUR Acc. o.N. <sup>1)</sup>	0,50
LU0357130771	BAKERSTEEL Gl.F.-Precious Met. Inhaber-Anteile I2 EUR o.N. <sup>1)</sup>	1,20
LU0252963896	BGF World Energy D 2 EUR <sup>1)</sup>	1,00
LU1191324448	BL - Equities Dividend Inhaber-Ant.BI USD Hed.o.N. <sup>1)</sup>	0,60
LU0252963383	Blackrock Global Funds - World Mining Fund D2 EUR <sup>1)</sup>	1,00
LU1458428759	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. I Cap. USD o.N. <sup>1)</sup>	0,01
LU1458428833	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. IH Cap. EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,75
IE00BHPRPJ85	BNY M.G.Fds-BNY Blockchain In. Registered Acc.Shs W USD o.N. <sup>1)</sup>	0,70

## VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
FR0010813105	Candriam Diversified Futures Actions Port. I Cap. 3 Déc. oN <sup>1)</sup>	1,20
LU2295992676	Carmignac Ptf.C.Ptf.Ch.N.ECO. Act. Nom. F Unh. EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	1,15
LU0530119774	Comstage ETF Daily Short Bund I <sup>1)</sup>	0,20
LU0274221281	db x-trackers SMI ETF <sup>1)</sup>	0,20
LU0292104030	DB X-TRACKERS STOXX 600 TELECOMMUNICATION INDEX ETF 1C <sup>1)</sup>	0,15
LU1769942407	DWS Inv. - CROCI US Dividends Act. au Port. TFC EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	0,59
LU1308283701	DWS Inv.- CROCI Sectors Plus Inhaber-Anteile XC o.N. <sup>1)</sup>	0,75
LU1881476821	DWS Inv.-Enhanc.Commodity Str. Act. au Port. IC EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	0,65
LU0273147834	DWS Invest-Global Agribusiness Inh.-Ant. FC o.N. <sup>1)</sup>	0,75
IE00B3Q19T94	Euro Stoxx Optimised Banks Source ETF A <sup>1)</sup>	0,30
IE00BDZVHT63	Fidelity II-MSCI Pac.ex-J.Idx Reg. Shares P USD Acc. o.N. <sup>1)</sup>	0,06
IE00BHZRQY00	Franklin Lib.FTSE Brazil U.ETF Reg. Shares USD Acc. o.N. <sup>1)</sup>	0,00
DE000A2H8901	FUNDament Total Return Inhaber-Anteile I <sup>1)</sup>	1,25
DE000A2PF1A7	G+G ValueInvesting-DLS Inhaber-Anteile S <sup>1)</sup>	1,10
IE00B578XK25	GLG Invts-GLG Japan CoreAl.Eq. Regist.Shares I H EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,30
LU1136261358	green benefit-Nachhaltigk.Plus Act.au Porteur I o.N. <sup>1)</sup>	0,95
LU1299707155	GS Fds-GS Nort.Am.E.&E.I.Eq.P. Regist. Acc.Shs R EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,75
LU0196034317	Hend.Horiz.Fd-Pan Eur.Prop.Eq. Actions Nom. I2 (Acc.) o.N. <sup>1)</sup>	0,19
LU0350637061	HERALD(LUX)-US Abs. Ret. EO Nam. Ant. I Cap. <sup>1)</sup>	2,00
DE000A0D8Q49	iShares Dow Jones U.S. Select Dividend (DE) <sup>1)</sup>	0,30
DE000A0H08L5	iShares ST.Euro.600 Media U.ETF DE <sup>1)</sup>	0,45
IE00BF11F458	iShs II-iShs \$ Flt.Ra.Bd U.ETF Reg. Shares EUR Hd Dis. o.N. <sup>1)</sup>	0,10
IE00BZ048462	iShs II-iShs \$ Flt.Ra.Bd U.ETF Reg. Shares USD Unh.Dis. o.N. <sup>1)</sup>	0,10
IE00BSKRJX20	iShs IV-iSh.EO Gv.Bd 20yr T.D. Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>	0,15
IE00B6R52143	iShs V-S&P Agribusiness UCITS Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>	0,55
IE00B6SPMN59	iShs VI-E.S&P 500 Min.Vol.U.E. Registered Shares USD o.N. <sup>1)</sup>	0,20
IE00B3VWN518	iShs VII-\$T.Bd.7-10yrUCETF ACC Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>	0,07
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF Registered Shs EUR Acc. o.N. <sup>1)</sup>	0,20
LU0129493754	JPMorgan-Emer.Middle East Equ. Actions Nom. C (acc.) DL o.N. <sup>1)</sup>	0,85
LU0129494729	JPMorgan-Europe Dynam.Techn.Fd A.N. JPM-Eu.Dy.Te.C o.N. <sup>1)</sup>	0,80
DE000A0CARS0	KanAm SPEZIAL grundinvest Fonds <sup>1)</sup>	0,40
IE00BD4GTV84	LMGF-LM Clear.Infrastr.Value Namens-Ant.A Acc.USD Hed.o.N. <sup>1)</sup>	1,50
LU2247605236	Luxembourg Sel.-Active Solar Act. Nom. I EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	1,16
LU0405860593	Luxembourg Sel.-Asi.Sol.Win.Fd Inhaber-Anteile A2 o.N. <sup>1)</sup>	0,60
LU1834987973	Lyxor IF-L.ST.Eu.600 Insuran. Act. Nom. EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	0,30
LU0603940916	Lyxor ShortDAX -1x Inverse ETF I <sup>1)</sup>	0,30
LU0259322260	M.A.-NYSE Arc.Gold Bgs Ind.ETF <sup>1)</sup>	0,70
LU0588515584	Millennium Global-M.G.Opport. Namensanteile P I o.N. <sup>1)</sup>	0,80
LU1390062245	MUL-L.EO 2-10Y Inf.Expect.U.E. Inhaber-Anteile C EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,25
LU1452600270	MUL-Lyx.Core US TIPS(DR)U.ETF Namens-Anteile Dist o.N. <sup>1)</sup>	0,15
DE000A0LGNP3	NORD/LB AM Glob.Chall.Ind.-Fds Inhaber Anteilklasse 1 <sup>1)</sup>	0,40
DE000A2DHTY3	Perspektive OVID Equ. ESG Fds I <sup>1)</sup>	1,12

## VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
LU0340558823	Pictet - Timber I EUR <sup>1)</sup>	0,80
DE000A0JDPT1	Pioneer Inv. Aktien Rohstoffe Inhaber-Anteile H <sup>1)</sup>	0,30
IE00B3WVRB16	Polar Cap.Fd.-Biotechnology Fd Registered Shares I EUR o.N. <sup>1)</sup>	1,17
LU0363372490	Robeco GI Consumer Trends Equ. Act. Nom. Class Z EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,02
AT0000858956	RT VIF Versicherungs Intl Fds Inhaber-Anteile T o.N. <sup>1)</sup>	1,50
DE000A112T67	S4A US Long Inhaber-Anteile I <sup>1)</sup>	1,90
IE00B5NLX835	Source-S.ST.Eur.600 Opt.A+P Registered Shares A o.N. <sup>1)</sup>	0,30
LU0450104814	SSgA Lux.-Global Man.Vol.Eq.Fd Reg. Shares I o.N. <sup>1)</sup>	0,45
IE00BWBXM500	SSGA S.ETF E.II-S.US Fin.S.Se. Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>	0,15
LU0308790236	STABILITAS-Gold+Res.Spec.Situ. Inhaber-Ant. I Cap. o.N. <sup>1)</sup>	2,00
LU1858159350	Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Act. Nom. I1 EUR Dis. oN <sup>1)</sup>	0,15
LU1807298952	Thematica-Future Mobility Inhaber-Ant. Ret.Cap.USD o.N. <sup>1)</sup>	1,50
LU0629460089	UBS ETF-U.E.-MSCI USA S.R.U.E. Namens-Ant.(USD) A-dis o.N. <sup>1)</sup>	0,33
IE00BQQP9F84	VanEck Gold Miners UC.ETF Registered Shares A o.N. <sup>1)</sup>	0,53
IE00BMC38736	VanEck Semiconductor UCITS ETF Reg. Shares o. N. <sup>1)</sup>	0,35
NL0010408704	VanEck Vect.Sus.Wld Eq.Weight Aandelen oop naam o.N. <sup>1)</sup>	0,30
IE00BJGWQN72	WisdomTree Cloud Comp.UCITSETF Registered Shares USD Acc o.N. <sup>1)</sup>	0,40
IE00BQZJBQ63	WisdomTree US Eq.Inc.UCITS ETF Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>	0,29
IE00BM67HP23	Xtr.(IE)-MSCI World Consumer Discretionary 1C USD <sup>1)</sup>	0,25
LU0411078636	Xtr.S&P 500 2x Inverse D.Swap 1C <sup>1)</sup>	0,50
LU0838782315	Xtrackers DAX Income 1D <sup>1)</sup>	0,15

<sup>1)</sup> Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

## WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

### FondsSecure Systematik

#### Sonstige Erträge

Forderung wegen Entschädigungszahlung	EUR	20.841,36
---------------------------------------	-----	-----------

#### Sonstige Aufwendungen

Marktrisiko- Und Liquiditätsmessung	EUR	2.834,68
Researchkosten	EUR	1.952,22

## 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.

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)</b>	<b>EUR</b>	<b>22.647.706</b>
davon feste Vergütung	EUR	18.654.035
davon variable Vergütung	EUR	3.993.671
<b>Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)</b>		<b>298</b>
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker</b>	<b>EUR</b>	<b>1.499.795</b>
davon Führungskräfte	EUR	1.499.795
davon andere Risikoträger	EUR	0

## ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN GEM. § 101 ABS. 3 NR. 3 KAGB

01.04.2022 - Anpassung ESG

01.01.2023 - Wechsel Verwahrstelle und Beteiligte

## ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN

Prozentualer Anteil der schwer liquidierbaren Vermögensgegenstände für die besondere Regelungen gelten	0,00%
Gesamthöhe des Leverage nach der Brutto-Methode im Berichtszeitraum	1,26
Leverage-Umfang nach Brutto-Methode bezüglich ursprünglich festgelegtem Höchstmaß	5,00
Gesamthöhe des Leverage nach der Commitment-Methode im Berichtszeitraum	1,26
Leverage-Umfang nach Commitment-Methode bezüglich ursprünglich festgelegtem Höchstmaß	3,00

## ANGABEN ZU NEUEN REGELUNGEN ZUM LIQUIDITÄTSMANAGEMENT GEM. § 300 ABS. 1 NR. 2 KAGB

Keine Änderungen im Berichtszeitraum.

## ANGABEN ZUM RISIKOPROFIL NACH § 300 ABS. 1 NR. 3 KAGB

Die Anlage in diesen Investmentfonds birgt neben Chancen auf Wertsteigerungen auch Verlustrisiken. Den folgenden Risiken können die Anlagen im Fonds ausgesetzt sein:

Marktrisiko, Zinsrisiko, Kontrahentenrisiko, Konzentrationsrisiko, Derivaterisiko, Liquiditätsrisiko und Währungsrisiko.

Die angegebenen Risiken werden mit Hilfe geeigneter Risikomanagementsysteme überwacht und mit Hilfe eines Limitsystems gesteuert. Weitergehende Informationen sind im Tätigkeitsbericht des Fonds zu finden.

Des Weiteren unterliegt der Fonds dem Kapitalanlagegesetzbuch und dem Investmentsteuergesetz. Mögliche (steuer)rechtliche Änderungen können sich positiv aber auch negativ auf den Fonds auswirken.

## ANGABEN ZUR ÄNDERUNG DES MAX. UMFANGS DES LEVERAGE § 300 ABS. 2 NR. 1 KAGB

Keine Änderungen im Berichtszeitraum.

## 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:

Zusammensetzung des Portfolios,  
Portfolioumsätze und Portfolioumsatzkosten:

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

Einsatz von Stimmrechtsvertretern:

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

### Verweis

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

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.

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.

Informationen zur Stimmrechtsausübung sind auf der Internetseite der HANSAINVEST erhältlich.

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

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

Name des Produkts:

FondsSecure Systematik

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900S8HRHAJSPVC024

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

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

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

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

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

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

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

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

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



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

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

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

Für den Fonds sind folgende ESG-Faktoren maßgeblich:

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

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

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

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

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

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

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

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikatoren zu der dezidierten ESG-Anlagestrategie:

Zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, wurden Kriterien aus den Bereichen Umwelt (Environment), Soziales (Social) und verantwortungsvoller Unternehmensführung (Governance) herangezogen und in einem ESG-Rating zusammengefasst. Entsprechend sind im Rahmen der zuvor genannten

Mindestquote von 51 % nur solche Titel erwerbbar, die ein ESG-Rating von mindestens BB aufwiesen.

Die im Fonds enthaltenen Wertpapiere weisen ein ESG-Rating von mindestens BB (MSCI) in Höhe von 79,80 % auf.

Nachhaltigkeitsindikatoren zu den Ausschlusskriterien:

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

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

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Ein Vergleich ist erst ab dem darauffolgendem Jahr möglich.

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

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

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



## WELCHE SIND DIE HAUPTINVESTITIONEN DIESES FINANZPRODUKTS?

Für Aktien wurden die NACE Branchen berücksichtigt. Die vollständige Liste aller NACE-Codes sind unter "<https://nacev2.com>" einsehbar.

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

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2022 - 31.03.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MUL-Lyx.Core US TIPS(DR)U.ETF Namens-Anteile Dist o.N. (LU1452600270)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,94%	Luxemburg
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und) (DE000A0S9GB0)	Sonstige Finanzdienstleistungen a. n. g.	3,50%	Deutschland
FUNDament Total Return Inhaber-Anteile I (DE000A2H8901)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,43%	Deutschland
Lux.Sel.Fd-Solar + Sust.Energy Inhaber-Anteile A2 o.N. (LU0405860593)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,94%	Luxemburg
green benefit-Nachhaltigk.Plus Act.au Porteur I o.N. (LU1136261358)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,32%	Luxemburg
Luxembourg Sel.-Active Solar Act. Nom. I EUR Acc. oN (LU2247605236)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,12%	Luxemburg
JPMorgan-Emer.Middle East Equ. Actions Nom. C (acc.) DL o.N. (LU0129493754)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,10%	Luxemburg
MUL-L.EO 2-10Y Inf.Expect.U.E. Inhaber-Anteile C EUR o.N. (LU1390062245)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,09%	Luxemburg
Polar Cap.Fd.-Biotechnology Fd Registered Shares I EUR o.N. (IE00B3WVRB16)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,02%	Irland
Robeco GI Consumer Trends Equ. Act. Nom. Class Z EUR o.N. (LU0363372490)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,94%	Luxemburg
GS Fds-GS Nort.Am.E.&E.I.Eq.P. Regist. Acc.Shs R EUR o.N. (LU1299707155)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,78%	Luxemburg
Candriam Diversified Futures Actions Port. I Cap. 3 Déc. oN (FR0010813105)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,66%	Frankreich
DWS Inv.- CROCI Sectors Plus Inhaber-Anteile XC o.N. (LU1308283701)	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,55%	Luxemburg
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01 (US00287Y1091)	Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	1,47%	USA
BNP Paribas Issuance B.V. OPEN END ETC Palladium (DE000PB8PAL7)	Sonstige Finanzdienstleistungen a. n. g.	1,42%	Niederlande



## WIE HOCH WAR DER ANTEIL DER NACHHALTIGKEITSBEZOGENEN INVESTITIONEN?

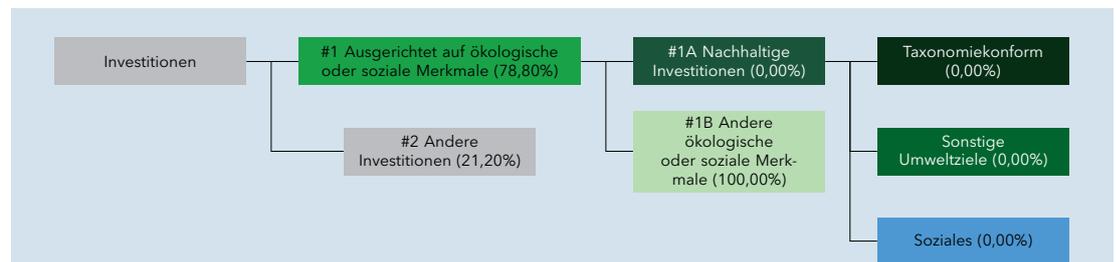
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

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

Die Grundlage der Ermittlung der Werte und der Ausweis beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten für den Bezugszeitraum 01.04.2022 bis 31.03.2023. Dadurch können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen

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



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

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

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

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

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

## ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Nachfolgend werden die größten Sektoren ausgewiesen. Für die Auswertung der Sektoren wurden die NACE Branchen berücksichtigt. Die vollständige Liste aller NACE-Codes sind unter "<https://nacev2.com>" einsehbar.

Es wurden im Berichtszeitraum vom 01.04.2022 bis 31.03.2023 gemäß Art. 54 Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission keine Investitionen in den dort genannten Sektoren durchgeführt. Der Anteil der Investitionen in den Sektoren und Teilsektoren von fossilen Brennstoffe ist somit 0,59 %.

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

Sektor	Anteil
Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	60,43%
Sonstige Finanzdienstleistungen a. n. g.	6,01%
Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	4,28%
Verwaltung und Führung von Unternehmen und Betrieben	4,19%
Herstellung von elektronischen Bauelementen	2,06%
Unternehmensberatung	1,90%
Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- u. ä. Instrumenten und Vorrichtungen	1,41%
Elektrizitätserzeugung	1,28%
Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	1,25%
Verlagswesen	1,18%
Verlegung von Software	1,13%
Sammlung nicht gefährlicher Abfälle	1,11%
Herstellung von Elektromotoren, Generatoren und Transformatoren	1,04%
Beteiligungsgesellschaften	0,98%
Elektrizitätsversorgung	0,92%
Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	0,89%
Herstellung von elektrischen Ausrüstungen	0,87%
Forschung und Entwicklung	0,83%
Herstellung von pharmazeutischen Spezialitäten und sonstigen pharmazeutischen Erzeugnissen	0,77%
Forschung und Entwicklung im Bereich Biotechnologie	0,75%
Sonstiger Einzelhandel mit Waren verschiedener Art	0,71%
Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,59%
Telekommunikation	0,55%
Einzelhandel mit Waren verschiedener Art, Hauptrichtung Nahrungs- und Genussmittel, Getränke und Tabakwaren	0,52%
Datenverarbeitung, Hosting und damit verbundene Tätigkeiten	0,42%
Großhandel mit Holz, Baustoffen, Anstrichmitteln und Sanitärkeramik	0,37%
Rohrleitungstiefbau	0,36%

Sektor	Anteil
Erbringung von Dienstleistungen für die Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,33%
Gesundheitswesen a. n. g.	0,32%
Beratungsdienstleistungen IT	0,32%
Verlegen von sonstiger Software	0,27%
Herstellung von Batterien und Akkumulatoren	0,21%
Herstellung von Filmen und Fernsehprogrammen, deren Verleih und Vertrieb; Kinos	0,19%
Erzeugung und erste Bearbeitung von Kupfer	0,18%
Erbringung von Beratungsleistungen auf dem Gebiet der Informationstechnologie	0,17%
Erbringung sonstiger wirtschaftlicher Dienstleistungen für Unternehmen und Privatpersonen a. n. g.	0,17%
Mit Finanz- und Versicherungsdienstleistungen verbundene Tätigkeiten	0,15%
Sonstige Forschung und Entwicklung im Bereich Natur-, Ingenieur-, Agrarwissenschaften und Medizin	0,13%
Herstellung von elektronischen Bauelementen und Leiterplatten	0,13%
Vermietung, Verpachtung von eigenen oder geleasteten Grundstücken, Gebäuden und Wohnungen	0,13%
Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	0,13%
Güterbeförderung in der Binnenschifffahrt	0,12%
Reisebüros	0,10%
Handel mit Kraftwagen mit einem Gesamtgewicht von 3,5 t oder weniger	0,10%
Schienenfahrzeugbau	0,09%
Herstellung von Industriegasen	0,09%
Herstellung von sonstigen Fahrzeugen a. n. g.	0,08%
Sonstiger NE-Metallerzbergbau	0,07%
Herstellung von Kraftwagen und Kraftwagenmotoren	0,07%
Fondsmanagement	0,05%
Sonstige Post-, Kurier- und Expressdienste	0,02%
Erbringung von sonstigen Dienstleistungen der Informationstechnologie	0,02%
Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Körperpflegemitteln sowie von Duftstoffen	0,02%
Effekten- + Warenbörsen	-0,46%



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

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

Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert 1)?

Ja

In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

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

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

Taxonomekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

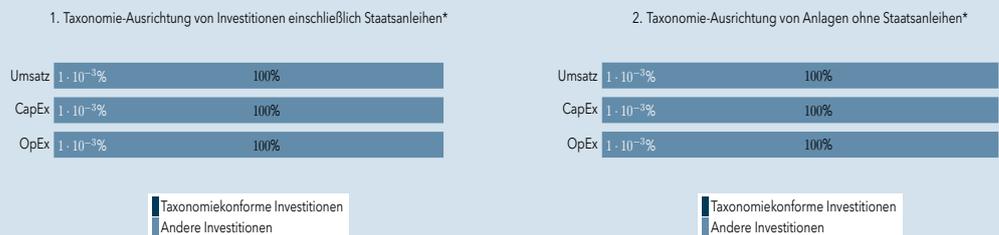
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

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

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

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

**In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



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

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

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



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



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

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



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

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

Andere Investitionen hatten im Berichtszeitpunkt einen durchschnittlichen Anteil von 21,20 %.

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

Im relevanten Zeitraum vom 01.04.2022 bis zum 31.03.2023 gehörten hierzu Investitionen in Bankguthaben und liquide Mittel, die aus Liquiditätszwecken gehalten wurden.



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

Es wurde die Ausrichtung an den vorgegebenen ESG-Faktoren ordnungsgemäß in den Anlageprozess implementiert. Die beworbenen Merkmale wurden im Laufe des relevanten Zeitraums vom 01.04.2022 bis 31.03.2023 durchgehend beachtet. Es wurden keine Verstöße gegen die dargestellten Ausschlusskriterien oder Anlagegrenzen festgestellt.

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

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

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

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

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

<https://www.hansainvest.de>

Hamburg, 20. Juli 2023

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 FondsSecure Systematik - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. April 2022 bis zum 31. März 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. März 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. April 2022 bis zum 31. März 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 21.07.2023

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](mailto:service@hansainvest.de)

Web: [www.hansainvest.de](http://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**

---

UBS Europe SE  
Bockenheimer Landstraße 2-4  
60306 Frankfurt am Main  
Deutschland

Haftendes Eigenkapital: 3.041,000 Mio. EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 446,001 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](mailto:service@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)

**HANSA**INVEST