

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

VAB Strategie BASIS

30. September 2023

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht VAB Strategie BASIS	4
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	15
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	20
Allgemeine Angaben	23

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

VAB Strategie BASIS

in der Zeit vom 01.10.2022 bis 30.09.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht VAB Strategie BASIS

Tätigkeitsbericht VAB Strategie BASIS für das Geschäftsjahr vom 01.10.2022 bis 30.09.2023.

1. Anlageziel und Anlageergebnis im Berichtszeitraum

Das Ziel der Anlagepolitik ist es, einen langfristig attraktiven und risikoadjustierten Ertrag in Euro zu erwirtschaften.

Zur Verwirklichung dieses Zieles wird die Gesellschaft für das Sondervermögen vorwiegend in weltweite Indexfonds, Aktien, Anlagezertifikate (Bonus-, Discount- und Indexzertifikate), Optionen und Anleihen investieren. Hierbei wird besonderer Wert auf eine breite Streuung auf Länder- bzw. Branchenebene gelegt. Um möglichst hohe Flexibilität zu gewährleisten, kann bis zu 100% des Fondsvermögens als Liquidität gehalten werden. Dabei wird stets auf eine breite Streuung des Risikos geachtet. Dennoch muss entsprechend der jeweiligen Marktsituation mit stärkeren Anteilspreisschwankungen gerechnet werden. Bei der Auswahl der Anlagewerte stehen die Aspekte Sicherheit, Ertragspotential und Liquidität im Vordergrund der Überlegungen. Bei sämtlichen Anlagen in Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten und Investmentanteilen ist jedoch zu berücksichtigen, dass trotz sorgfältiger Auswahl der Vermögensgegenstände nicht ausgeschlossen werden kann, dass Verluste infolge Vermögensverfalls der Aussteller oder aufgrund von Kursverlusten eintreten. Die Gesellschaft ist bestrebt, unter Anwendung modernster Analysemethoden die Risiken der Anlage in den Vermögensgegenständen zu minimieren und die Chancen zu erhöhen. Für das Sondervermögen können Aktien und Aktien gleichwertige Papiere, andere Wertpapiere (z.B. verzinsliche Wertpapiere, Schuldverschreibungen, Zertifikate), Bankguthaben, Geldmarktinstrumente, Anteile an anderen Investmentvermögen, Derivate zu Investitions- und Absicherungszwecken sowie sonstige Anlageinstrumente erworben werden.

Der VAB Strategie BASIS investierte vorwiegend in Anlagezertifikate auf Indizes, Anleihen, Index-ETF's und Aktien. Durch die aktuelle Situation an den Rentenmärkten lag der Fokus vermehrt auf der Aktienseite.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investi-

tionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Der Fonds ist damit gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu qualifizieren.

2. Anlagepolitik im Berichtszeitraum

Das Fondsmanagement behielt im Berichtszeitraum die grundsätzlich auf realen Kapitalerhalt ausgerichtete Struktur des Fonds bei. Aktien, Anleihen und flexible Rentenfonds bildeten den Investitionsschwerpunkt. Der Anteil an Staatsanleihen nahm tendenziell zu. Der Anteil an Aktienanleihen, Einzelaktien, ETFs und Investmentfonds wurde flexibel an die Marktentwicklungen angepasst. Kurzfristige Liquidität wurde in Form von Kasse gehalten und als strategische Position eingesetzt. Die Aktien-Neutralquote von ca. 25,00%-30,00% blieb unverändert, wurde je nach Marktlage angepasst.

3. Wesentliche Risiken im Betrachtungszeitraum

Adressenausfallrisiken: Grundsätzlich können Adressenausfallrisiken nicht ausgeschlossen werden. Da der Fonds ein breit diversifiziertes Portfolio aus Anleihen hält und die Emittenten täglich überprüft werden, sind die Auswirkungen als eher gering anzusehen.

Zinsänderungsrisiken: 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.

Marktpreisrisiken: Marktpreisrisiken resultieren aus den Kursbewegungen der gehaltenen Finanzinstrumente. Die Kurs- oder Marktpreisentwicklung hängt ins-

besondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird.

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

Liquiditätsrisiken: Da der Großteil der Investitionen in Standardaktien, Anleihen einzelner Schuldner mit hohem täglichem Umsatz, andere Investmentfonds sowie in Exchange Traded Funds (ETFs) erfolgt, ist eine jederzeitige Liquidierbarkeit der Produkte grundsätzlich gewährleistet.

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 wesentliche Risiken im Berichtszeitraum:

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.

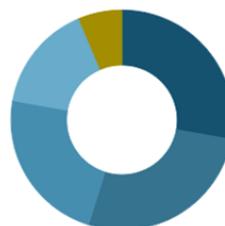
Marktrisiko:

	Fonds				Vergleichsvermögen			
	Mio EUR 29.09.2023	Anteil NaV 29.09.2023	Delta 1 Jahr	Delta 1 Jahr	Mio EUR 29.09.2023	Anteil NaV 29.09.2023	Delta 1 Jahr	Delta 1 Jahr
VaR Gesamt	0,2903	3,27 %	-0,0536	-15,64 %	0,3792	4,27 %	-0,1276	-29,19 %
VaR Aktien	0,2066	2,33 %	-0,0362	-14,90 %	0,3591	4,04 %	-0,1334	-27,08 %
VaR Zins	0,1191	1,34 %	-0,0381	-24,22 %	0,0001	0,00 %	0,0000	50,00 %
VaR Devisen	0,1135	1,28 %	-0,0087	-7,15 %	0,1877	2,11 %	-0,0259	-12,12 %
Stress Gesamt	2,2677	25,53 %	-0,1115	-4,69 %	2,7015	30,41 %	-0,3014	-10,04 %
Stress Aktien	1,7042	19,19 %	-0,0419	-2,40 %	2,1095	23,75 %	-0,2354	-10,04 %
Stress Zins	0,1701	1,92 %	-0,0523	-23,50 %	0,0003	0,00 %	-0,0000	-12,96 %
Stress Devisen	0,3934	4,43 %	-0,0171	-4,16 %	0,5862	6,60 %	-0,0654	-10,04 %

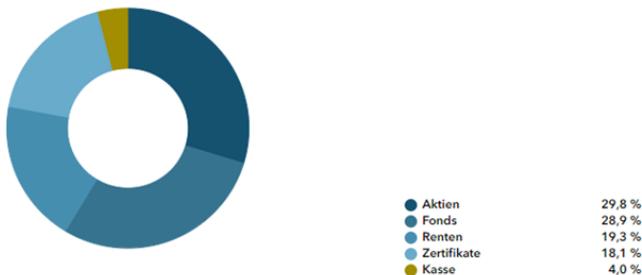
4. Struktur der Portfolios im Hinblick auf die Anlageziele

Die Struktur des Investmentvermögens hat sich im Vergleich zum vorherigen Geschäftsjahr nicht wesentlich geändert. Das Fondsvermögen war überwiegend in Anleihen, Aktien, Investmentfonds, Indexfonds und Zertifikaten investiert.

Portfoliostruktur zum 30.09.2022*



● Aktien	27,8 %
● Fonds	27,1 %
● Renten	22,9 %
● Zertifikate	15,8 %
● Kasse	6,3 %

Portfoliostruktur zum 30.09.2023*

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

5. Veräußerungsergebnisse

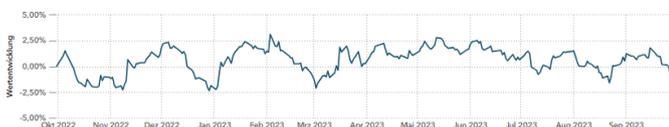
Die Ergebnisse aus Veräußerungsgeschäften betragen +203.901,86 Euro und setzten sich wie folgt zusammen:

Summe „Realisierte Gewinne“ in Höhe von 308.978,65 Euro abzüglich der Summe „Realisierte Verluste“ von 105.076,79 Euro.

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

6. Performance

Im abgelaufenen Geschäftsjahr 01. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023 betrug die Wertentwicklung -2,07%.

**7. Transaktionen**

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

8. Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens

betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg.

Das Fondsmanagement ist an die Vermögensanlage AltBayern AG, Regensburg, ausgelagert.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse hat es nicht gegeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	8.988.142,46	101,19
1. Aktien	2.642.827,04	29,75
2. Anleihen	1.701.981,98	19,16
3. Zertifikate	1.607.475,63	18,10
4. Investmentanteile	2.566.461,81	28,89
5. Bankguthaben	455.770,21	5,13
6. Sonstige Vermögensgegenstände	13.625,79	0,15
II. Verbindlichkeiten	-105.422,64	-1,19
1. Kurzfristige Verbindlichkeiten	-78.085,20	-0,88
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-27.337,44	-0,31
III. Fondsvermögen	EUR 8.882.719,82	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			
Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	5.168.168,65	58,18
Aktien								EUR	2.642.827,04	29,75
CH0009002962	Barry Callebaut		STK	80	80	0	CHF	1.430,0000	118.163,51	1,33
CH0038863350	Nestlé S.A.		STK	2.674	0	0	CHF	102,9000	284.206,58	3,20
CH0012005267	Novartis AG		STK	1.909	0	0	CHF	93,7100	184.777,56	2,08
FR000120644	Danone S.A.		STK	3.000	3.000	0	EUR	51,4500	154.350,00	1,74
DE0008430026	Münchener Rückversicherung AG		STK	500	0	2.000	EUR	374,3000	187.150,00	2,11
DE0007164600	SAP SE		STK	1.000	0	1.000	EUR	121,4800	121.480,00	1,37
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	15.813	4.500	800	EUR	21,8200	345.039,66	3,88
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.		STK	1.000	0	0	EUR	20,7100	20.710,00	0,23
US02079K3059	Alphabet Inc. Cl. A		STK	1.600	0	1.700	USD	132,3100	200.412,76	2,26
US0231351067	Amazon.com Inc.		STK	2.000	0	0	USD	125,9800	238.530,72	2,69
US1890541097	Clorox		STK	1.000	0	1.100	USD	128,6200	121.764,65	1,37
US1912161007	Coca-Cola Co., The		STK	2.500	2.500	0	USD	55,8100	132.088,42	1,49
US1941621039	Colgate-Palmolive		STK	2.000	2.000	0	USD	71,3100	135.018,46	1,52
US4878361082	Kellogg Co.		STK	300	300	0	USD	59,2000	16.813,41	0,19
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Registered Shares DL -,01		STK	4.700	4.700	0	USD	31,4600	139.981,07	1,58
US5949181045	Microsoft Corp.		STK	600	0	700	USD	313,6400	178.153,93	2,01
US7134481081	PepsiCo Inc		STK	400	400	0	USD	169,5000	64.186,31	0,72
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	1.701.981,98	19,16
DE0001102481	0.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2019 (2050)		EUR	510	0	0	%	44,4229	226.556,89	2,55
AT0000A2EJ08	0.7500% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(51)		EUR	270	0	0	%	49,6884	134.158,74	1,51
US912810SR05	1.1250% United States of America DL-Bonds 2020(40)		USD	250	0	0	%	56,8359	134.516,57	1,51
US91282CDJ71	1.3750% United States of America DL-Bonds 2021(31)		USD	50	50	0	%	77,8945	36.871,41	0,42
BE0000338476	1.6000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(47) Ser. 78		EUR	270	0	0	%	63,4767	171.387,18	1,93
US912810SJ88	2.2500% United States of America DL-Notes 19/49		USD	400	0	0	%	61,5078	232.917,97	2,62
US912810SK51	2.3750% United States of America DL-Notes 2019(49)		USD	400	0	0	%	63,2422	239.485,70	2,70
US912810RC45	3.6250% United States of America DL-Notes 2013(43)		USD	360	0	0	%	82,7500	282.022,15	3,17
US912810FT08	4.5000% US Treasury 06/36		USD	260	0	0	%	99,1563	244.065,37	2,75
Zertifikate								EUR	823.359,63	9,27
DE000A0S9GB0	Xetra-Gold		STK	14.538	0	0	EUR	56,6350	823.359,63	9,27

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⁾
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								EUR	784.116,00	8,83
Zertifikate								EUR	784.116,00	8,83
DE000EWGOLD1	Boerse Stuttgart Securities Gold IHS 12/Open End	STK		13.800	0	0	EUR	56,8200	784.116,00	8,83
Investmentanteile								EUR	2.566.461,81	28,89
Gruppenfremde Investmentanteile								EUR	2.566.461,81	28,89
DE000ETFL219	Deka Dt.B.EUROG.Ger.10+ U.ETF	ANT		1.962	0	0	EUR	101,0550	198.269,91	2,23
DE000ETFL151	Deka iB.EO L.Sov.D.7-10 U.ETF Inhaber-Anteile	ANT		3.314	0	0	EUR	102,8150	340.728,91	3,84
LU0306115196	Dual Return-Vision Microfinan. Actions au Porteur I-EUR o.N.	ANT		3.479	0	0	EUR	153,3600	533.539,44	6,01
DE000A0D8Q31	iSh. eb.r.Governm. Ger.10.5+	ANT		691	0	0	EUR	117,9150	81.479,27	0,92
IE00BZCQB185	iShs IV-iShs MSCI India UC.ETF	ANT		57.000	0	0	EUR	7,2560	413.592,00	4,66
IE00BD8PGZ49	iShsIV-DL Treas.Bd 20+yr U.ETF Reg.Shares EUR Hdgd (Dist)oN	ANT		71.000	0	0	EUR	3,0528	216.748,80	2,44
LU1545768357	RV Bond Select Inhaber-Anteile o.N.	ANT		4.298	0	0	EUR	75,4900	324.456,02	3,65
LU0952581584	Xtrackers II Japan Gov.Bond Inhaber-Anteile 1C o.N.	ANT		27.957	0	0	EUR	8,1318	227.340,73	2,56
IE00BKM4GZ66	iShs-Co.MSCI Em.Mar.IMI UC.ETF Registered Shares o.N.	ANT		8.300	0	0	USD	29,3100	230.306,73	2,59
Summe Wertpapiervermögen								EUR	8.518.746,46	95,90
Bankguthaben								EUR	455.770,21	5,13
EUR - Guthaben bei:								EUR	323.340,54	3,64
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	323.340,54					323.340,54	3,64
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								EUR	132.429,67	1,49
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			HKD	9.746,39					1.178,68	0,01
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	138.640,42					131.250,99	1,48
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	13.625,79	0,15
Dividendenansprüche			EUR	1.767,06					1.767,06	0,02
Zinsansprüche			EUR	11.858,73					11.858,73	0,13
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								EUR	-78.085,20	-0,88
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen								EUR	-78.085,20	-0,88
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	-75.598,19					-78.085,20	-0,88
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-27.337,44	-0,31
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾			EUR	-27.337,44					-27.337,44	-0,31
Fondsvermögen								EUR	8.882.719,82	100,00
Anteilwert VAB Strategie BASIS								EUR	35,87	

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			
Umlaufende Anteile VAB Strategie BASIS						STK		247.651,000	

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

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

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.09.2023			
Hongkong-Dollar	(HKD)	8,268900	=	1 Euro (EUR)	
Schweizer Franken	(CHF)	0,968150	=	1 Euro (EUR)	
US-Dollar	(USD)	1,056300	=	1 Euro (EUR)	

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
US30303M1027	Meta Platforms Inc. Cl.A	STK	0	600
Verzinsliche Wertpapiere				
XS1325825211	2.1500% Booking Holdings Inc. EO-Notes 15/22	EUR	0	200

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte: CBOE VOLATILITY IND.)	EUR			19
Optionsrechte				
Wertpapier-Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktien				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte: Vonovia SE)	EUR			0
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte: Johnson & Johnson PepsiCo Inc Vonovia SE Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.)	EUR			6
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte: CBOE VOLATILITY IND.)	EUR			8
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte: S&P 500 Index)	EUR			95
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte: E-Mini S&P 500)	EUR			31

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) VAB STRATEGIE BASIS

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.10.2022 BIS 30.09.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller		6.585,23
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		35.596,74
3. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		48.862,99
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		12.867,71
davon negative Habenzinsen	-89,14	
5. Erträge aus Investmentanteilen		24.228,16
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-9.603,35
7. Sonstige Erträge		587,61
Summe der Erträge		119.125,09
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-4.893,06
2. Verwaltungsvergütung		-23.410,11
a) fix	-23.410,11	
3. Verwahrstellenvergütung		-3.743,62
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-10.516,46
5. Portfoliomanagementvergütung		-177.916,77
6. Sonstige Aufwendungen		-5.404,95
7. Aufwandsausgleich		2.712,11
Summe der Aufwendungen		-223.172,86
III. Ordentlicher Nettoertrag		-104.047,77
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		308.978,65
2. Realisierte Verluste		-105.076,79
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		203.901,86
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		99.854,09
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		128.039,21
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-390.909,71
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-262.870,50
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-163.016,41

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS VAB STRATEGIE BASIS

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.10.2022)		9.873.385,15
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		-493.428,00
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-334.767,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	880.886,60	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.215.653,60	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		546,08
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-163.016,41
davon nicht realisierte Gewinne	128.039,21	
davon nicht realisierte Verluste	-390.909,71	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (30.09.2023)		8.882.719,82

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS VAB STRATEGIE BASIS ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	1.638.287,62	6,62
1. Vortrag aus dem Vorjahr	1.433.356,74	5,79
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	99.854,09	0,40
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	105.076,79	0,42
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-1.390.636,61	-5,62
1. Der Wiederanlage zugeführt	-58.228,64	-0,24
2. Vortrag auf neue Rechnung	-1.332.407,97	-5,38
III. Gesamtausschüttung	247.651,00	1,00
1. Endausschüttung	247.651,00	1,00
a) Barausschüttung	247.651,00	1,00

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE VAB STRATEGIE BASIS

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	8.882.719,82	35,87
2022	9.873.385,15	38,59
2021	12.703.016,90	45,27
2020	13.921.131,40	43,57

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	0,00
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Fehlanzeige		
Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.		
Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)		
MSCI - World Index		55,00%
JP Morgan GBI Global Bond Index in EUR		25,00%
FTSE EPRA/NAREIT Global Index in EUR		15,00%
1MEUR		5,00%
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV		
kleinster potenzieller Risikobetrag		1,36%
größter potenzieller Risikobetrag		1,92%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		1,66%
Risikomodell (§10 DerivateV)		Full-Monte-Carlo
Parameter (§11 DerivateV)		
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 VAB Strategie BASIS	EUR	35,87
Umlaufende Anteile VAB Strategie BASIS	STK	247.651,000

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 VAB STRATEGIE BASIS

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	2,57 %
---	--------

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 01.10.2022 BIS 30.09.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	2.864.657,99
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	2.864.657,99
Relativ in %	100,00 %

Transaktionskosten: 5.010,21 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 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 %
DE000ETFL219	Deka Dt.B.EUROG.Ger.10+ U.ETF ¹⁾	0,15
DE000ETFL151	Deka iB.EO L.Sov.D.7-10 U.ETF Inhaber-Anteile ¹⁾	0,15
LU0306115196	Dual Return-Vision Microfinan. Actions au Porteur I-EUR o.N. ¹⁾	0,18
DE000A0D8Q31	iSh. eb.r.Governm. Ger.10.5+ ¹⁾	0,16
IE00BZCQB185	iShs IV-iShs MSCI India UC.ETF ¹⁾	0,65
IE00BKM4GZ66	iShs-Co.MSCI Em.Mar.IMI UC.ETF Registered Shares o.N. ¹⁾	0,18
IE00BD8PGZ49	iShsIV-DL Treas.Bd 20+yr U.ETF Reg.Shares EUR Hdgd (Dist)oN ¹⁾	0,10
LU1545768357	RV Bond Select Inhaber-Anteile o.N. ¹⁾	1,20
LU0952581584	Xtrackers II Japan Gov.Bond Inhaber-Anteile 1C o.N. ¹⁾	0,05

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

VAB Strategie BASIS		
Sonstige Erträge		
Quellensteuer Erstattungen	EUR	572,03
Sonstige Aufwendungen		
Depotgebühren	EUR	3.006,57

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
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)		298
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker	EUR	1.499.795
davon Führungskräfte	EUR	1.499.795
davon andere Risikoträger	EUR	0

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der Vermögensanlage AltBayern AG für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager		Vermögensanlage AltBayern AG
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	538.800,00
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		5

Das Auslagerungsunternehmen hat die Informationen selbst veröffentlicht (im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlichter Jahresabschluss)

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

Per 01.07.2023 kam es aufgrund von Rechtssprechung zu einer Änderung der AABen.

ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN

Prozentualer Anteil der schwer liquidierbaren Vermögensgegenstände für die besondere Regelungen gelten	0,00%
Gesamthöhe des Leverage nach der Brutto-Methode im Berichtszeitraum	0,98
Leverage-Umfang nach Brutto-Methode bezüglich ursprünglich festgelegtem Höchstmaß	5,00
Gesamthöhe des Leverage nach der Commitment-Methode im Berichtszeitraum	0,98
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, Derivatrisiko, 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:

Hamburg, 18. Januar 2024

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

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.

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,
Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens VAB Strategie BASIS – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. 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 Geschäftsjahr vom 01. 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 19.01.2024

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

Donner & Reuschel AG
Ballindamm 27
20095 Hamburg

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

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhlentwiete 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