

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

ÖKOBASIS SDG - Investments for Future

30. November 2022

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

| | |
|---|----|
| Tätigkeitsbericht ÖKOBASIS SDG - Investments for Future | 4 |
| Vermögensübersicht | 7 |
| Vermögensaufstellung | 8 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 18 |
| Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers | 32 |
| Allgemeine Angaben | 34 |

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

ÖKOBASIS SDG - Investments for Future

in der Zeit vom 01.12.2021 bis 30.11.2022.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht des ÖKOBASIS SDG - Investments for Future für den Zeitraum vom 01.12.2021 bis zum 30.11.2022

1 Anlageziele und Anlagestrategie

Der ÖKOBASIS SDG - Investments for Future wurde am 18. Dezember 2020 aufgelegt. Die Anlageziele des Fonds sind eine Reduzierung von Preisrückgängen in den Abwärtstrends der globalen Aktienmärkte und eine Partizipation an den Aufwärtsbewegungen der Märkte.

Der Fonds investiert in die Unternehmen mit den größten Beiträgen zu den nachhaltigen Entwicklungszielen der Vereinten Nationen (SDG), beachtet umfassende Ausschlusskriterien (Negativlisten) und orientiert sich an einem Positiv-Scoring von Best in Class-Berechnungen. Das nachhaltige Anlageuniversum wird anhand von Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungskriterien durch die Steyler Ethik Bank bestimmt. Über die möglichst breite Verteilung der Unternehmen auf die 17 SDGs wird ein hoher Diversifikationsgrad nach SDGs, Regionen und Branchen angestrebt.

Aus dem Anlageuniversum von aktuell 60 Aktien wählt der Fondsmanager Grohmann & Weinrauter VermögensManagement GmbH dreißig Aktien über einen ersten Risikomanagement-Algorithmus aus, der die Aktien vermeidet, die sich - im relativen Vergleich der Aktien untereinander - in den größeren Abwärtstrends befinden. Die zweite Risikomanagementebene des Fonds vergleicht die Wertentwicklung jeder investierten Aktie mit der Wertentwicklung von Anleihen und errechnet über diesen Vergleich die jeweiligen Investitionsquoten der Aktien. Der Fonds kann mit hohen Investitionsquoten in Aktien und während langfristiger Abwärtstrends der Aktienmärkte auch ausschließlich in Anleihen investiert sein. Die Steuerung der Chancen und Risiken (Aktien, Anleihen, Währungen) folgt diszipliniert und prozyklisch dem Verlauf der Märkte (Quantitative Analysen).

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.

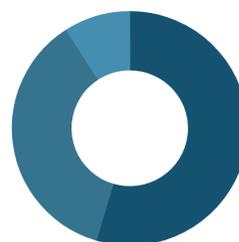
1 Anlagepolitik und -ergebnis

Der Fonds startete - nach einem Rumpfgeschäftsjahr im

Jahr der Fondsaufgabe - im Dezember 2021 in seinen neuen Berichtszeitraum. Das Hoch im Fondspreis wurde in den ersten Januartagen 2022 erreicht, einem Zeitpunkt, an dem sich der lange Aufwärtstrend der internationalen Aktienmärkte nach dem Corona-Crash bereits abgeflacht hatte. Der Handlungsdruck auf die Zentralbanken war durch steigende Inflationsraten zunehmend größer geworden und führte zu einem Wechsel in der Geldpolitik. An die Stelle einer Anti-Deflationspolitik mit einer Ausweitung der Liquidität und historisch niedrigen Zinsen trat eine Anti-Inflationspolitik. Bereits mit der Erwartung einer restriktiveren Geldpolitik änderte sich das Klima an den Börsen. Auch der ÖKOBASIS SDG - Investments for Future konnte sich den fallenden Marktpreisen an den Aktienbörsen im Jahr 2022 nicht entziehen, reagierte aber mit seinen beiden Risikomanagement-Strategien systematisch auf das veränderte Marktumfeld. Über die Berechnung von Drawdown-Scores wurden Investitionen in Aktien vermieden, die sich im Vergleich zu den kursstabileren Aktien in ausgehnteren Abwärtstrends befanden. Die zweite Risikomanagementebene des Fonds senkte die Investitionsquote der Aktien im schwachen Marktumfeld während der Jahrestiefs im Oktober 2022 auf ca. 47 %. Per Saldo konnte sich der Fonds mit diesen Maßnahmen in einem schwachen Aktien- und Anleihenjahr gut behaupten.

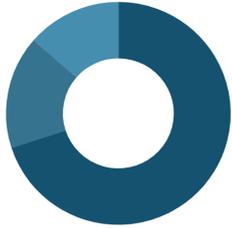
Portfoliostuktur:

30.11.2022



| | |
|----------|--------|
| ● Aktien | 54,6 % |
| ● Renten | 36,3 % |
| ● Kasse | 9,1 % |

30.11.2021



● Aktien 70,0 %
 ● Kasse 16,4 %
 ● Renten 13,6 %

Der Anteilwert der Anlageklasse R des ÖKOBASIS SDG - Investments for Future fiel im Berichtszeitraum um 9,22 %. Der Anteilwert der Anteilklasse S fiel um 8,62 %. Die Berechnung erfolgt gemäß Bundesverband Investment und Asset Management e.V. - BVI. Wir weisen darauf hin, dass historische Daten zu Wertentwicklungen des Fonds keine Prognose auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zulassen.

Quellen des Veräußerungsergebnisses

Die für die Veränderungen des Fondspreises im Berichtszeitraum relevanten Veräußerungsgewinne und -verluste (Netto-Veräußerungsgewinn) wurden im Wesentlichen durch Aktienveräußerungen erzielt. Die entsprechenden Beträge können der Ertrags- und Aufwandsrechnung entnommen werden.

1 Wesentliche Risiken im Berichtszeitraum

Zinsänderungsrisiken

Zinsänderungsrisiken sind für den Fonds nur dann relevant, wenn er im Verlauf von schwachen Aktienmärkten in Anleihen investiert ist. Im Berichtszeitraum wurde die Liquidität vorzugsweise als Kontoguthaben sowie Bundesanleihen gehalten.

Währungsrisiken

Der Fonds war im Berichtszeitraum auch in Fremdwährungsaktien investiert und unterlag damit dem Risiko von Kursverlusten aus fallenden Währungen gegen den Euro.

Sonstige Marktpreisrisiken

Der ÖKOBASIS SDG - Investments for Future war entsprechend seiner Anlagestrategie mit überschaubaren Portfolioquoten in Aktien investiert, damit aber trotz systematischer Sicherungsstrategien grundsätzlich den entsprechenden Marktpreisrisiken ausgesetzt.

Operationelle Risiken

Unter operationellen Risiken wird die Gefahr von Verlusten verstanden, die durch die Unangemessenheit oder das Versagen von internen Verfahren, Menschen und Systemen oder durch externe Ereignisse verursacht werden. Beim operationellen Risiko differenziert die Gesellschaft zwischen technischen Risiken, Personalrisiken, Produktrisiken und Rechtsrisiken sowie Risiken aus Kunden- und Geschäftsbeziehungen und hat hierzu u.a. die folgenden Vorkehrungen getroffen:

Ex ante und ex post Kontrollen sind Bestandteil des Orderprozesses.

Rechts- und Personalrisiken werden durch Rechtsberatung und Schulungen der Mitarbeiter minimiert.

Darüber hinaus werden Geschäfte in Finanzinstrumenten ausschließlich über kompetente und erfahrene Kontrahenten abgeschlossen. Die Verwahrung der Finanzinstrumente erfolgt durch eine etablierte Verwahrstelle mit guter Bonität.

Die Ordnungsmäßigkeit der für das Sondervermögen relevanten Aktivitäten und Prozesse wird regelmäßig durch die Interne Revision überwacht.

Liquiditätsrisiken

Aufgrund des Schwerpunktinvestments in Aktien mit hoher Liquidität ist für den größten Teil des Portfolios weder mit Liquiditätsrisiken noch mit einer zu breiten Stellung von Geld- und Briefkursen zu rechnen. Sie können jedoch nicht grundsätzlich ausgeschlossen werden. Sofern ein Anteil des Portfolios in marktengere Titel des Anlageuniversums investiert wird, werden Käufe und Verkäufe - sofern notwendig - marktschonend vorgenommen.

Aufgrund der Anlagepolitik ist das Sondervermögen

den Rentenmärkten inhärenten Liquiditätsrisiken ausgesetzt. Um diese Liquiditätsrisiken zu begrenzen, achtet das Fondsmanagement auf ein ausreichendes Emissionsvolumen der einzelnen Anleihen sowie einen hohen Diversifikationsgrad im Sondervermögen.

Bonitäts- und Adressenausfallrisiken

Aufgrund des Schwerpunktinvestments in liquide Aktien und einem Aktienselektionsmodell, das Aktien in etablierten Abwärtstrends grundsätzlich meidet, ist nur mit einer relativ geringen Wahrscheinlichkeit mit Adressenausfallrisiken zu rechnen. Sie können jedoch nicht grundsätzlich ausgeschlossen werden.

Risiken aus der Verwendung eines Trendfolgemodells

Weitere mögliche Risiken im Hinblick auf das erwirtschaftete Ergebnis ergeben sich für diesen Fonds in Seitwärtsbewegungen des Marktes aus der Verwendung von prozyklischen Trendfolgemodellen. Trendfolger gehen bei jeder durch eigens entwickelte Algorithmen definierten Markttrichtungsänderung von einer Trendwende aus und disponieren entsprechend konsequent. Nicht jede Änderung führt aber zu einer Trendwende, sondern stellt sich von Fall zu Fall in der Rückbetrachtung als Korrektur im Trend heraus. Die entsprechend eingegangenen Positionen werden als sogenannte Fehlsignale - häufig mit Verlust - glattgestellt. Eine Häufung dieser Fehlsignale wird als Seitwärtsbewegung bezeichnet. Die Verteilung der Handelssignale auf ca. 30 Aktien senkt das Potential der Auswirkung von Seitwärtsbewegungen (Diversifikation) auf den Fondspreis.

Sonstige Risiken

Die Ausbreitung der Atemwegserkrankung COVID-19 hat weltweit zu massiven Einschnitten in das öffentliche Leben mit erheblichen Folgen u.a. für die Wirtschaft und deren Unternehmen geführt. In diesem Zusammenhang kam es zu hohen Kursschwankungen an den Kapitalmärkten. Die weiteren Auswirkungen von COVID-19 auf die Realwirtschaft bzw. die Finanzmärkte sind auch weiterhin mit Unsicherheiten behaftet.

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.

4. Wesentliche Ereignisse im Berichtszeitraum

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

Als Portfolioverwalter ist die Grohmann & Weinrauter VermögensManagement GmbH eingesetzt.

Wesentliche Ereignisse mit Relevanz für den ÖKOBASIS SDG - Investments for Future waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens ¹⁾ |
|----------------------------------|--------------------------|--|
| I. Vermögensgegenstände | 14.568.226,33 | 100,17 |
| 1. Aktien | 7.941.261,27 | 54,60 |
| 2. Anleihen | 5.278.353,15 | 36,29 |
| 3. Bankguthaben | 1.338.537,78 | 9,20 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | 10.074,13 | 0,07 |
| II. Verbindlichkeiten | -24.547,02 | -0,17 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | -24.547,02 | -0,17 |
| III. Fondsvermögen | EUR 14.543.679,31 | 100,00 |

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.11.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 30.11.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|-------------------------------------|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|---------------------|------------|----------------------|-----------------|------------------------------------|
| | | | | | | im Berichtszeitraum | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 13.219.614,42 | 90,90 | |
| Aktien | | | | | | | EUR | 7.941.261,27 | 54,60 | |
| AU000000BXB1 | Brambles | | STK | 46.151 | 71.675 | 65.420 | AUD | 12,0200 | 359.412,37 | 2,47 |
| CA31890B1031 | First Cap. Real Estate Inv.Tr. Reg. Trust Units o.N. | | STK | 19.325 | 7.333 | 19.258 | CAD | 17,1700 | 236.037,88 | 1,62 |
| CH0435377954 | SIG Group AG Namens-Aktien SF-,01 | | STK | 9.446 | 26.554 | 33.609 | CHF | 20,0600 | 192.294,26 | 1,32 |
| ES0127797019 | EDP Renováveis | | STK | 10.287 | 15.197 | 4.910 | EUR | 21,7300 | 223.536,51 | 1,54 |
| DE0006095003 | ENCAVIS AG | | STK | 15.872 | 19.676 | 3.804 | EUR | 19,0900 | 302.996,48 | 2,08 |
| ES0105079000 | Grenergy Renovables S.A. | | STK | 8.111 | 8.111 | 0 | EUR | 32,1800 | 261.011,98 | 1,79 |
| FR0000121964 | Klépierre | | STK | 12.789 | 24.614 | 27.055 | EUR | 22,2800 | 284.938,92 | 1,96 |
| FI0009000665 | Metsä Board Oyj Registered Shares Cl.B EO 1,70 | | STK | 23.196 | 70.990 | 47.794 | EUR | 8,4350 | 195.658,26 | 1,35 |
| DE000A0DJ6J9 | SMA Solar Technology AG | | STK | 6.255 | 6.974 | 719 | EUR | 58,3000 | 364.666,50 | 2,51 |
| ES0165386014 | Solaria Energia Y Medio Ambi. Acciones Port. EO -,01 | | STK | 12.248 | 17.917 | 5.669 | EUR | 16,6750 | 204.235,40 | 1,40 |
| GB00B39J2M42 | United Utilities Group | | STK | 11.865 | 18.990 | 42.724 | GBP | 10,2600 | 141.060,14 | 0,97 |
| JP3116700000 | Asahi Holdings Inc. Registered Shares o.N. | | STK | 8.100 | 13.800 | 5.700 | JPY | 2.040,0000 | 115.354,81 | 0,79 |
| SG1M51904654 | CapitaMall Trust | | STK | 161.758 | 44.924 | 167.182 | SGD | 2,0800 | 236.499,94 | 1,63 |
| SG1T22929874 | Keppel REIT | | STK | 114.617 | 144.015 | 521.408 | SGD | 0,9000 | 72.509,26 | 0,50 |
| US0304201033 | American Water Works | | STK | 1.597 | 758 | 1.857 | USD | 147,1400 | 226.893,82 | 1,56 |
| US1011371077 | Boston Scientific | | STK | 8.036 | 5.304 | 7.632 | USD | 44,5000 | 345.292,33 | 2,37 |
| US1307881029 | California Water Service Group Registered Shares o.N. | | STK | 5.529 | 7.899 | 10.263 | USD | 63,1500 | 337.137,40 | 2,32 |
| CA1366351098 | Canadian Solar Inc. | | STK | 9.583 | 9.583 | 0 | USD | 33,8200 | 312.940,72 | 2,15 |
| US15135B1017 | Centene Corp. | | STK | 3.988 | 409 | 2.955 | USD | 84,4200 | 325.077,93 | 2,24 |
| US0367521038 | Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 724 | 115 | 615 | USD | 515,3600 | 360.276,77 | 2,48 |
| US3364331070 | First Solar Inc. | | STK | 2.737 | 6.890 | 4.153 | USD | 161,8100 | 427.629,00 | 2,94 |
| US6687711084 | Gen Digital Inc. | | STK | 10.873 | 8.930 | 15.817 | USD | 22,6200 | 237.481,06 | 1,63 |
| US4601461035 | International Paper | | STK | 2.946 | 2.946 | 0 | USD | 36,3300 | 103.343,97 | 0,71 |
| US60855R1005 | Molina Healthcare Inc. Registered Shares DL -,001 | | STK | 1.131 | 0 | 632 | USD | 322,7200 | 352.432,12 | 2,42 |
| US71363P1066 | Perdoceo Education Corp. | | STK | 29.374 | 45.821 | 16.447 | USD | 14,3600 | 407.290,73 | 2,80 |
| US7843051043 | SJW Group | | STK | 5.438 | 2.758 | 4.419 | USD | 73,6800 | 386.879,58 | 2,66 |
| US8581552036 | Steelcase Inc. Registered Shares Class A o.N. | | STK | 13.376 | 36.166 | 22.790 | USD | 8,2200 | 106.165,91 | 0,73 |
| US86272C1036 | Strategic Education Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 5.059 | 5.685 | 626 | USD | 80,3000 | 392.253,85 | 2,70 |
| US86333M1080 | Stride Inc. Registered Shares DL -,0001 | | STK | 8.366 | 11.192 | 2.826 | USD | 35,8000 | 289.193,07 | 1,99 |
| US9621661043 | Weyerhaeuser | | STK | 4.590 | 11.257 | 6.667 | USD | 31,7600 | 140.760,30 | 0,97 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 5.278.353,15 | 36,29 | |
| DE0001104834 | 0,0000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23) | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 99,6505 | 1.993.010,00 | 13,70 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.11.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 30.11.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|---|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| DE000A2LQSP7 | 0,000000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN.v.2019 (2024) | | EUR | 1.293 | 1.293 | 0 % | 96,9989 | 1.254.195,45 | 8,62 |
| DE000A2DAJ57 | 0,125000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 2017 (2024) | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 96,0589 | 480.294,38 | 3,30 |
| DE000A2LQJ0 | 0,125000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 2018 (2023) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 98,0477 | 392.190,66 | 2,70 |
| DE000A2LQH10 | 0,250000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 18/25 | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 94,3703 | 377.481,33 | 2,60 |
| DE000A11QTD2 | 0,625000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 2015 (2025) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 96,4563 | 385.825,33 | 2,65 |
| DE000A30VM45 | 1,613000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(24) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 98,8390 | 395.356,00 | 2,72 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 13.219.614,42 | 90,90 |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 1.338.537,78 | 9,20 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | EUR | 1.287.429,05 | 8,85 |
| Bank: Landesbank Baden-Württemberg | | | EUR | 1.000.000,00 | | | | 1.000.000,00 | 6,88 |
| Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln | | | EUR | 287.429,05 | | | | 287.429,05 | 1,98 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 7.310,19 | 0,05 |
| Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln | | | SEK | 79.831,25 | | | | 7.310,19 | 0,05 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 43.798,54 | 0,30 |
| Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln | | | AUD | 8.907,73 | | | | 5.771,31 | 0,04 |
| Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln | | | JPY | 714.891,00 | | | | 4.990,69 | 0,03 |
| Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln | | | USD | 34.214,29 | | | | 33.036,54 | 0,23 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 10.074,13 | 0,07 |
| Dividendenansprüche | | | EUR | | | | | 6.248,79 | 0,04 |
| Zinsansprüche | | | EUR | | | | | 3.825,34 | 0,03 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -24.547,02 | -0,17 |
| Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾ | | | EUR | -24.547,02 | | | | -24.547,02 | -0,17 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 14.543.679,31 | 100,00 |
| Anteilwert ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S | | | | | | | EUR | 91,31 | |
| Anteilwert ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R | | | | | | | EUR | 91,17 | |
| Umlaufende Anteile ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S | | | | | | | STK | 140.164,000 | |
| Umlaufende Anteile ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R | | | | | | | STK | 19.145,696 | |

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

²⁾ 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 30.11.2022 | | |
|----------------------|-------|----------------|---|--------------|
| Australischer Dollar | (AUD) | 1,543450 | = | 1 Euro (EUR) |
| Britisches Pfund | (GBP) | 0,863000 | = | 1 Euro (EUR) |
| Japanischer Yen | (JPY) | 143,245000 | = | 1 Euro (EUR) |
| Kanadischer Dollar | (CAD) | 1,405750 | = | 1 Euro (EUR) |
| Schwedische Krone | (SEK) | 10,920550 | = | 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken | (CHF) | 0,985400 | = | 1 Euro (EUR) |
| Singapur-Dollar | (SGD) | 1,422650 | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,035650 | = | 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 | | | | |
| DK0061802139 | ALK-Abelló AS | STK | 24.786 | 24.786 |
| SE0000862997 | BillerudKorsnäs AB | STK | 0 | 23.616 |
| US1255231003 | Cigna Corp. Registered Shares DL 1 | STK | 1.903 | 1.903 |
| US12621E1038 | CNO Financial Group | STK | 7.668 | 7.668 |
| FR0013467479 | Constellium SE Actions au Port. EO -,02 | STK | 4.079 | 28.148 |
| US23918K1088 | DaVita | STK | 3.063 | 6.017 |
| US28176E1082 | Edwards Lifesciences | STK | 624 | 5.196 |
| SE0009922164 | Essity AB Namn-Aktier B | STK | 13.130 | 27.581 |
| SE0011166974 | Fabege AB Namn-Aktier SK 15,41 | STK | 0 | 28.881 |
| JP3270000007 | Kurita Water Industries | STK | 0 | 9.300 |
| DE000LEG1110 | LEG Immobilien | STK | 0 | 3.220 |
| AT0000644505 | Lenzing | STK | 3.926 | 3.926 |
| US52736R1023 | Levi Strauss & Co. | STK | 0 | 15.950 |
| GB00B1CRLC47 | Mondi Business Paper | STK | 6.138 | 20.891 |
| NO0003054108 | Mowi ASA | STK | 4.665 | 21.344 |
| US75886F1075 | Regeneron Pharmaceuticals Inc. | STK | 778 | 778 |
| US8068821060 | Schnitzer Steel Industries | STK | 0 | 8.757 |
| CH0012549785 | Sonova | STK | 355 | 1.647 |
| SE0000112724 | Svenska Cellulosa | STK | 36.348 | 53.208 |
| US88025T1025 | Tenable Holdings Inc. Registered Shares DL-,01 | STK | 8.170 | 8.170 |
| NO0005668905 | Tomra Systems | STK | 0 | 8.305 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE0001104792 | 0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v. 20(22) | EUR | 0 | 750 |
| DE0001104800 | 0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v. 20(22) | EUR | 250 | 1.000 |
| DE0001104818 | 0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v. 20(22) | EUR | 500 | 1.250 |
| Nicht notierte Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| DK0060027142 | ALK-Abelló | STK | 607 | 607 |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE S

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.12.2021 BIS 30.11.2022

| | EUR | EUR |
|--|------------|----------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 146.978,03 |
| 2. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 695,61 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -12.379,99 |
| davon negative Habenzinsen | -13.775,08 | |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -21.082,74 |
| Summe der Erträge | | 114.210,91 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | -192,37 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -156.129,82 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | -15.498,38 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -8.503,71 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | -7.149,29 |
| 6. Aufwandsausgleich | | 3.164,80 |
| Summe der Aufwendungen | | -184.308,77 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | -70.097,86 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 506.656,96 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.599.793,03 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -1.093.136,07 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.163.233,93 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -94.419,50 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | 54.942,96 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -39.476,54 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.202.710,47 |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE R

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.12.2021 BIS 30.11.2022

| | EUR | EUR |
|--|-----------|--------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 20.240,61 |
| 2. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 88,15 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -1.788,47 |
| davon negative Habenzinsen | -1.966,88 | |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -2.936,98 |
| Summe der Erträge | | 15.603,31 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | -27,75 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -36.116,43 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | -2.351,62 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -2.010,14 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | -1.120,99 |
| 6. Aufwandsausgleich | | 4.828,11 |
| Summe der Aufwendungen | | -36.798,82 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | -21.195,51 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 69.630,65 |
| 2. Realisierte Verluste | | -219.479,27 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -149.848,62 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -171.044,13 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -16.553,87 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | 13.447,29 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -3.106,58 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -174.150,71 |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH)**FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.12.2021 BIS 30.11.2022**

| | EUR | EUR |
|--|------------|----------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 167.218,64 |
| 2. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 783,76 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -14.168,46 |
| davon negative Habenzinsen | -15.741,96 | |
| 4. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -24.019,72 |
| Summe der Erträge | | 129.814,22 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | -220,12 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -192.246,25 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | -17.850,00 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -10.513,85 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | -8.270,28 |
| 6. Aufwandsausgleich | | 7.992,91 |
| Summe der Aufwendungen | | -221.107,59 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | -91.293,37 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 576.287,61 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.819.272,30 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -1.242.984,69 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.334.278,06 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -110.973,37 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | 68.390,25 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -42.583,12 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.376.861,18 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE S

| | EUR | EUR |
|---|-------------|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.12.2021) | | 14.415.963,49 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -142.826,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | -253.223,13 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 312.317,23 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -565.540,36 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -19.053,24 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.202.710,47 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -94.419,50 | |
| davon nicht realisierte Verluste | 54.942,96 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (30.11.2022) | | 12.798.150,65 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE R

| | EUR | EUR |
|---|-------------|---------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.12.2021) | | 2.232.402,09 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | -290.670,54 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 489.967,75 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -780.638,29 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -22.052,18 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -174.150,71 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -16.553,87 | |
| davon nicht realisierte Verluste | 13.447,29 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (30.11.2022) | | 1.745.528,66 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

| | EUR | EUR |
|--|---------------|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 16.648.365,58 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -142.826,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | -543.893,67 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 802.284,98 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -1.346.178,65 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -41.105,42 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.376.861,18 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -110.973,37 | |
| davon nicht realisierte Verluste | 68.390,25 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 14.543.679,31 |

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE S ¹⁾

| | insgesamt EUR | je Anteil EUR |
|---|----------------------|------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | 1.070.011,46 | 7,63 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | 633.452,36 | 4,52 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | -1.163.233,93 | -8,30 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen | 1.599.793,03 | 11,41 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | -1.070.011,46 | -7,63 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | 0,00 | 0,00 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | -1.070.011,46 | -7,63 |
| III. Gesamtausschüttung | 0,00 | 0,00 |
| 1. Endausschüttung | 0,00 | 0,00 |
| a) Barausschüttung | 0,00 | 0,00 |

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

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE R ¹⁾

| | insgesamt EUR | je Anteil EUR |
|--|------------------|------------------|
| I. Für die Wiederanlage verfügbar | 48.435,14 | 2,53 |
| 1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | -171.044,13 | -8,93 |
| 2. Zuführung aus dem Sondervermögen | 219.479,27 | 11,46 |
| II. Wiederanlage | 48.435,14 | 2,53 |

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE S

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | Anteilwert |
|------------------------|--|------------|
| | EUR | EUR |
| 2022 | 12.798.150,65 | 91,31 |
| 2021 | 14.415.963,49 | 100,92 |
| (Auflegung 18.12.2020) | 12.379.500,00 | 100,00 |

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE R

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | Anteilwert |
|------------------------|--|------------|
| | EUR | EUR |
| 2022 | 1.745.528,66 | 91,17 |
| 2021 | 2.232.402,09 | 100,43 |
| (Auflegung 18.12.2020) | 686.000,00 | 100,00 |

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE FÜR DAS GESAMTFONDSVERMÖGEN

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR |
|------------------------|---|
| 2022 | 14.543.679,31 |
| 2021 | 16.648.365,58 |
| (Auflegung 18.12.2020) | 13.065.500,00 |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

| | | |
|--|-----|-------|
| Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure | EUR | 0,00 |
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | | 90,90 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | | 0,00 |
| Dieses Sondervermögen wendet gemäß Derivateverordnung den einfachen Ansatz an. | | |

ZUSÄTZLICHE ANHANGANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 BETREFFEND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

SONSTIGE ANGABEN

| | | |
|--|-----|-------------|
| Anteilwert ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S | EUR | 91,31 |
| Anteilwert ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R | EUR | 91,17 |
| Umlaufende Anteile ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S | STK | 140.164,000 |
| Umlaufende Anteile ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R | STK | 19.145,696 |

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

| | ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S | ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R |
|----------------------|---|---|
| ISIN | DE000A2QAYC6 | DE000A2QAYD4 |
| Währung | Euro | Euro |
| Fondsauflage | 18.12.2020 | 18.12.2020 |
| Ertragsverwendung | Ausschüttend | Thesaurierend |
| Verwaltungsvergütung | 1,15% p.a. | 1,75% p.a. |
| Ausgabeaufschlag | 0,00% | 3,00% |
| Mindestanlagevolumen | 50.000 | 0 |

ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

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

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

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

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

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE S

| | |
|---|--------|
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 1,38 % |
|---|--------|

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE ÖKOBASIS SDG - INVESTMENTS FOR FUTURE R

| | |
|---|--------|
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 2,02 % |
|---|--------|

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.12.2021 BIS 30.11.2022

| Transaktionen | Volumen in Fondswährung |
|--|-------------------------|
| Transaktionsvolumen gesamt | 37.884.141,61 |
| Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen | 0,00 |
| Relativ in % | 0,00 % |
| Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor. | |

Transaktionskosten: 28.467,54 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 ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

ÖKOBASIS SDG - Investments for Future S

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

| | | |
|--|-----|----------|
| Gebühren Commission de Surveillance du Secteur Financier (Aufsichtskommission Luxemburg) | EUR | 4.881,89 |
|--|-----|----------|

ÖKOBASIS SDG - Investments for Future R

Sonstige Erträge

Keine sonstigen Erträge

Sonstige Aufwendungen

| | | |
|--|-----|--------|
| Gebühren Commission de Surveillance du Secteur Financier (Aufsichtskommission Luxemburg) | EUR | 768,11 |
|--|-----|--------|

BESCHREIBUNG, WIE DIE VERGÜTUNGEN UND GGF. SONSTIGE ZUWENDUNGEN BERECHNET WURDEN

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen des § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

ERGEBNISSE DER JÄHRLICHEN ÜBERPRÜFUNG DER VERGÜTUNGSPOLITIK

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN DER FESTGELEGTEN VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2021 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

| | | |
|---|------------|-------------------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer) | EUR | 19.375.239 |
| davon feste Vergütung | EUR | 15.834.736 |
| davon variable Vergütung | EUR | 3.540.503 |
| Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen | EUR | 0 |
| Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt) | | 263 |
| Höhe des gezahlten Carried Interest | EUR | 0 |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risktaker) | EUR | 1.273.467 |

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der Grohmann & Weinrauter VermögensManagement GmbH für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

| Portfoliomanager | Grohmann & Weinrauter VermögensManagement GmbH | |
|--|--|-------------------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung | EUR | 752.863,00 |
| 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 | | 15 |

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 Stimmrechtsberatern:

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:

ÖKOBASIS SDG - Investments for Future

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900UV6RPCBSTF266

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: 0%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0% 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: 0%

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 ISS ESG unter ökologischen und sozialen Kriterien analysiert und positiv bewertet werden. Im Rahmen dieser Mindestquote von 51% sind nur solche Titel erwerbbar, die ein SDG Solution Score von mindestens 1,5 aufweisen. Ferner wurden ESG-Ausschlusskriterien berücksichtigt.

Die Ausrichtung an den vorgegebenen ESG-Faktoren wurde ordnungsgemäß in den Anlageprozess implementiert. Im Berichtszeitraum wurden die nachfolgenden ESG relevanten Grenzen verletzt:

- Investition in ein Wertpapier mit einer Stammzellenforschung (ESG-ISS) - max 0% - ESG (vom 23.02.2022 bis zum 02.03.2022);

Die Rückführung der genannten Grenzverletzung erfolgte durch die Veräußerung des entsprechenden Wertpapiers. Ursächlich für die Grenzverletzung war eine Änderungen im Rating von ISS.

Es wurden keine weiteren Verstöße gegen die im Verkaufsprospekt dargestellten Ausschlusskriterien oder Anlagegrenzen festgestellt.

Der Fonds darf in Aktien und Anleihen investieren, für welche (noch) keine Daten des Datenproviders ISS ESG 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, werden die genannten Ausschlusskriterien eingehalten.

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.

Die im Fonds enthaltenen Wertpapiere weisen für den Zeitraum vom 04.08.2022 bis zum 30.11.2022 ein SDG Solution Score von mindestens 1,5 (ISS-ESG) in Höhe von 64,21 % auf.

Für den Zeitraum vom 01.12.2021 bis zum 03.08.2022 wird ein Mindestanteil von nachhaltigen ESG-Investitionen in Höhe von 79,71 % ausgewiesen.

Die Grundlage für die verschiedenen Ausweise sind Änderungen in der Anlagegrenzüberwachung.

Nachhaltigkeitsindikatoren zu den Ausschlusskriterien:

Der Fonds darf in Aktien und Anleihen investieren, für welche (noch) keine Daten des Datenproviders ISS ESG vorhanden sind und damit aktuell nicht gesagt werden kann, ob gegen die oben genannten Ausschlusskriterien verstoßen wurde. Sobald für solche Aktien und Anleihen Daten vorhanden sind, werden die genannten Ausschlusskriterien eingehalten. Die Daten für die dezidierte ESG-Anlagestrategie als auch die Ausschlusskriterien wurden durch den Datenprovider ISS zur Verfügung gestellt. Es wurden für den Fonds keine weiteren Aktien oder Anleihen von Unternehmen erworben, die gemäß Verkaufsprospekt 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?

Es wurden die Sektoren anhand des Branchen Typs Stoxx Sectors ausgewiesen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten 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: 01.12.2021 - 30.11.2022

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|---|--|-------------------------|----------------|
| Bundesrep. Deutschland Bundesschatzanw. v. 21(23) (DE0001104834) | Staatsanleihen | 9,68% | Deutschland |
| Bundesrep. Deutschland Bundesschatzanw. v. 20(22) (DE0001104818) | Staatsanleihen | 7,23% | Deutschland |
| Bundesrep. Deutschland Bundesschatzanw. v. 20(22) (DE0001104800) | Staatsanleihen | 3,80% | Deutschland |
| Centene Corp. Registered Shares DL -,001 (US15135B1017) | Gesundheitsdienstleister | 3,32% | USA |
| Molina Healthcare Inc. Registered Shares DL -,001 (US60855R1005) | Gesundheitsdienstleister | 3,22% | USA |
| CapitaLand Integrated Comm.Tr. Registered Units o.N. (SG1M51904654) | Immobilienfonds (REITs) | 2,90% | Singapur |
| SJW Group Registered Shares DL 3,125 (US7843051043) | Gas, Wasser und kombinierte Versorgung | 2,74% | USA |
| Boston Scientific Corp. Registered Shares DL -,01 (US1011371077) | Medizinische Geräte und Dienstleistungen | 2,72% | USA |
| Keppel REIT Registered Units o.N. (SG1T22929874) | Immobilienfonds (REITs) | 2,63% | Singapur |
| United Utilities Group PLC Registered Shares LS -,05 (GB00B39J2M42) | Gas, Wasser und kombinierte Versorgung | 2,52% | Großbritannien |

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--|-------------------------|------|
| NortonLifeLock Inc. Registered Shares DL -,01 (US6687711084) | Software und Computerdienstleistungen | 2,43% | USA |
| California Water Service Group Registered Shares o.N. (US1307881029) | Gas, Wasser und kombinierte Versorgung | 2,43% | USA |
| Stride Inc. Registered Shares DL -,0001 (US86333M1080) | Verbraucherdienste | 2,39% | USA |
| American Water Works Co. Inc. Registered Shares DL -,01 (US0304201033) | Gas, Wasser und kombinierte Versorgung | 2,35% | USA |
| Edwards Lifesciences Corp. Registered Shares DL 1 (US28176E1082) | Medizinische Geräte und Dienstleistungen | 2,25% | USA |



WIE HOCH WAR DER ANTEIL DER NACHHALTIGKEITSBEOZUGENEN INVESTITIONEN?

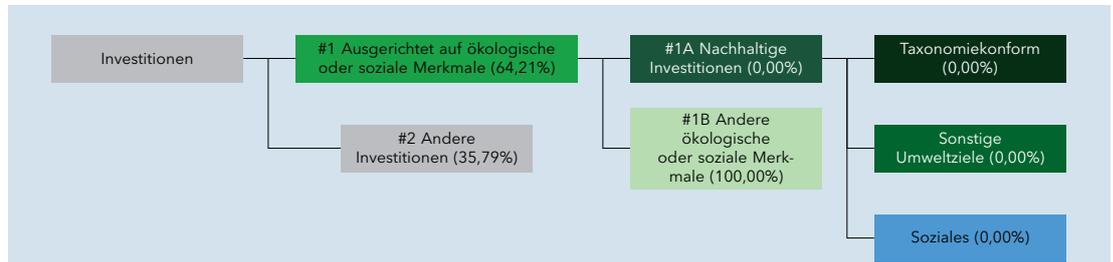
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● 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 beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten für den Bezugszeitraum vom 04.08.2022 bis 30.11.2022. Grundlage des Ausweises für den gewählten Bezugszeitraum sind die Änderungen in der Anlagegrenzüberwachung. 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 Sektoren anhand des Branchen Typs Stoxx Sectors ausgewiesen.

Es wurden zum Stichtag 30.11.2022 0,00 % der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Der Anteil der Investitionen in Sektoren und Teilsektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Grundlage von Daten des STOXX Sectors berechnet. Dieser Anteil beinhaltet Unternehmen, die im Sinne von Artikel 54 der Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 vom 6. April 2022 Einkünfte aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Herstellung, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel von fossilen Brennstoffen erzielen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den Werten des Wertpapiervermögens zum Geschäftsjahresende. Durch Rundungen können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

| Sektor | Anteil |
|--|--------|
| Alternative Energien | 9,00% |
| Edelmetalle und Abbau | 0,79% |
| Elektrizität | 5,42% |
| Gas, Wasser und kombinierte Versorgung | 7,51% |
| Gesundheitsdienstleister | 7,14% |
| Haushaltswaren und Wohnungsbau | 0,73% |
| Immobilienfonds (REITs) | 6,67% |
| Industriematerialien | 2,06% |
| Industrieunternehmen allgemein | 3,79% |
| Kasse | 9,08% |
| Medizinische Geräte und Dienstleistungen | 2,37% |
| Software und Computerdienstleistungen | 1,63% |
| Staatsanleihen | 13,70% |
| Verbraucherdienste | 7,49% |
| Kreditinstitute | 22,62% |



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?

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe nach-

folgende Erläuterung. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonmiekonformität 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.

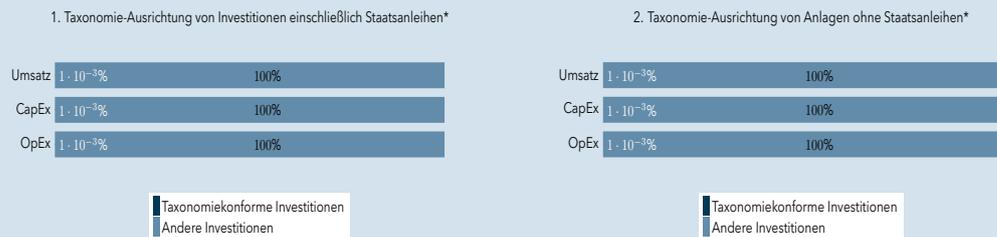
Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonmie 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 CO₂-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 35,79 %.

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 relevanten Zeitraum vom 01.12.2021 bis zum 30.11.2022 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 01.12.2021 bis 30.11.2022 durchgehend beachtet. Die Anlagegrenzverletzung wurde oben beschrieben. Es wurden keine weiteren 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 unter folgendem Link eingesehen werden:

<https://www.hansainvest.de>

Hamburg, 23. Mai 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 ÖKOBASIS SDG - Investments for Future – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Dezember 2021 bis zum 30. November 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. November 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Dezember 2021 bis zum 30. November 2022, 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 Prüfungsurteil 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 des Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens 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 – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen 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 Überein-

stimmung 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 Verstößen oder Unrichtigkeiten 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 - beabsichtigter oder unbeabsichtigter - falscher Darstellungen 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 wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts, 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 Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Hamburg, den 24.05.2023

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

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 22,659 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2021

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

Kreissparkasse Köln
Neumark 18-24
50667 Köln
Deutschland

Haftendes Eigenkapital: 2.573,500 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 2.142,800 Mio. EUR
Stand: 31.12.2021

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