

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

Strategie Welt Select

31. Dezember 2022



WBS HÜNICKE
Vermögensverwaltung

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

| | |
|---|----|
| Tätigkeitsbericht Strategie Welt Select | 4 |
| Vermögensübersicht | 7 |
| Vermögensaufstellung | 8 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 16 |
| Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers | 21 |
| Allgemeine Angaben | 24 |

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

Strategie Welt Select

in der Zeit vom 01.01.2022 bis 31.12.2022.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht Strategie Welt Select vom 01.01.2022 bis 31.12.2022

1. Anlageziel

Der Strategie Welt Select strebt einen mittel- bis langfristigen Wertzuwachs an. Um dies zu erreichen, wird weltweit in Aktien mit relativer Stärke und günstiger fundamentaler Bewertung investiert, um die Chancen an den internationalen Aktienmärkten zu nutzen. Um höchste Flexibilität zu gewährleisten, kann die Aktienquote zwischen 25% bis 100% liegen. Zudem kann auch in sogenannte Andere Wertpapiere (z.B. Schuldverschreibungen, Zertifikate usw.), Investmentfonds, Geldmarktinstrumente, Bankguthaben und Derivate investiert 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 Wachstum und Liquidität im Vordergrund der Überlegungen. Trotz sorgfältiger Auswahl der Vermögensgegenstände kann nicht ausgeschlossen werden, dass Kursverluste (z.B. infolge Vermögensverfalls der Aussteller) eintreten. Das Fondsmanagement ist bestrebt, unter Anwendung modernster Analysemethoden die Risiken der Anlage in den Vermögensgegenständen zu minimieren.

2. Anlagepolitik

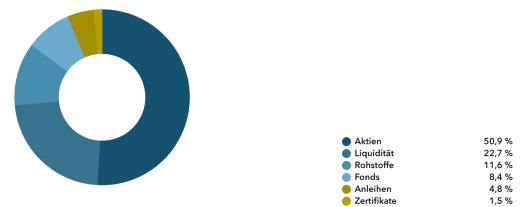
Das Fondsvolumen wurde im Berichtsjahr 2022 vornehmlich in die Assetklassen Aktien, festverzinsliche Wertpapiere und Edelmetalle/Rohstoffe investiert. Basierend auf der jeweiligen Markteinschätzung schwankte der Aktienanteil dabei zwischen 19,75 % und 52,50 % - zum Jahresende lag er bei 51,67 %. Es überwogen die Titel aus dem europäischen Raum, da die entsprechenden Papiere aus unserer Sicht günstigere fundamentale Kennzahlen aufweisen als z.B. Aktien amerikanischer Konzerne. Aufgrund der im Jahresverlauf entstandenen Überbewertung der Aktienmärkte wurde die Nettoaktienquote mittels Optionen und Futures deutlich reduziert. Dies erklärt die im Jahresverlauf vergleichsweise geringe Volatilität. Der Anteil der Assetklassen Rohstoffe/Edelmetalle betrug zum Jahresende 11,78 % vom Fondsvolumen. Zur weiteren Beimischung wurden wie im Vorjahr Teile des Fondsvolumens in Unternehmensanleihen/Rentenfonds mit kurzer Laufzeit bzw. Liquidität gehalten. Der überwiegende Teil der Investments erfolgte in Euro.

Die Wertentwicklung im Jahr 2022 lag bei - 0,62 %.

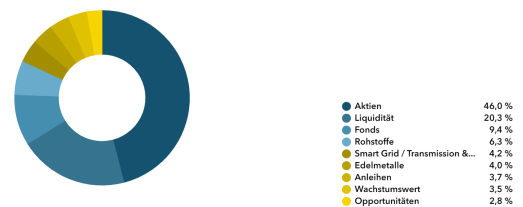
Die diesem Finanzprodukt zugrundeliegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

3. Portfoliostruktur sowie wesentliche Änderungen im Berichtszeitraum

Portfoliostruktur zum 31.12.2022*):



Portfoliostruktur zum 31.12.2021*):



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

4. Wesentliche Risiken im Berichtszeitraum

Die wesentlichen Risiken der im Fonds befindlichen Papiere bestanden in Marktpreisrisiken in Form von Aktienkurs- und Anleihepreisrisiken.

Währungsrisiko

Währungsrisiken waren eher gering, da der Fonds zum überwiegenden Teil in Euro-denominierten Titeln investiert war. US-Dollar-Risiken wurden gegen Euro abgesichert.

Adressenausfallrisiko

Adressenausfallrisiken können niemals ausgeschlossen werden. Diese sind jedoch gering, da das Fondsmangement besonderen Wert auf die Qualität der hinter den Investitionen stehenden Unternehmen legt und da die Titel im Fonds breit diversifiziert sind.

Liquiditätsrisiko Aktien

Das Vermögen des Sondervermögens ist überwiegend in liquiden Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung angelegt. Diese weisen ein verhältnismäßig geringes Adressenausfallrisiko des Emittenten sowie ein hohes tägliches Börsenhandelsvolumen und somit geringes Liquiditätsrisiko auf.

Operationelle Risiken

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

Ex ante und ex post Kontrollen sind Bestandteil des Orderprozesses.

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

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

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

Sonstige Risiken:

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.

5. Wesentliche Quellen des Veräußerungsergebnisses

Die realisierten Gewinne resultierten im Wesentlichen aus der Veräußerung von Aktien und aus Prämieineinnahmen aus Stillhaltergeschäften. Für die realisierten Verluste sind im Wesentlichen Veräußerungen von Aktien ursächlich.

6. Sonstige für den Anleger wesentliche Ereignisse

Mit der Verwaltung des Sondervermögens wurde die Kapitalverwaltungsgesellschaft HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg, betraut.

Das Portfoliomanagement für den Strategie Welt Select ist an die WBS Hünicke Vermögensverwaltung GmbH ausgelagert.

Während des Berichtszeitraums gab es keine wesentlichen Ereignisse.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens ¹⁾ |
|--------------------------------------|--------------------------|--|
| I. Vermögensgegenstände | 22.170.795,97 | 100,17 |
| 1. Aktien | 11.436.953,70 | 51,67 |
| 2. Anleihen | 1.117.911,78 | 5,05 |
| 3. Zertifikate | 2.949.156,40 | 13,32 |
| 4. Investmentanteile | 1.514.890,83 | 6,84 |
| 5. Derivate | -395.157,50 | -1,79 |
| 6. Kurzfristig liquidierbare Anlagen | 384.367,50 | 1,74 |
| 7. Bankguthaben | 5.145.947,53 | 23,25 |
| 8. Sonstige Vermögensgegenstände | 16.725,73 | 0,08 |
| II. Verbindlichkeiten | -37.721,91 | -0,17 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | -37.721,91 | -0,17 |
| III. Fondsvermögen | EUR 22.133.074,06 | 100,00 |

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.12.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|---|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|---------------------|------------|----------------------|------------------------------------|
| | | | | | | im Berichtszeitraum | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 14.584.173,60 | 65,89 |
| Aktien | | | | | | | EUR | 11.436.953,70 | 51,67 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Kon. | | STK | 24.330 | 0 | 0 EUR | 27,3050 | 664.330,65 | 3,00 |
| FR0000120073 | Air Liquide | | STK | 5.610 | 510 | 0 EUR | 134,7000 | 755.667,00 | 3,41 |
| DE0005158703 | Bechtle AG | | STK | 18.180 | 7.320 | 0 EUR | 33,4500 | 608.121,00 | 2,75 |
| DE0005200000 | Beiersdorf | | STK | 6.400 | 6.400 | 0 EUR | 107,4500 | 687.680,00 | 3,11 |
| DE0005419105 | CANCOM | | STK | 22.680 | 8.380 | 0 EUR | 27,7400 | 629.143,20 | 2,84 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom | | STK | 42.500 | 0 | 0 EUR | 19,0840 | 811.070,00 | 3,66 |
| DE000A0Z2ZZ5 | freenet | | STK | 33.970 | 0 | 0 EUR | 20,6600 | 701.820,20 | 3,17 |
| DE0008430026 | Münchener Rückversicherung | | STK | 60 | 0 | 2.600 EUR | 305,9000 | 18.354,00 | 0,08 |
| DE0007037129 | RWE | | STK | 22.800 | 0 | 0 EUR | 41,7300 | 951.444,00 | 4,30 |
| DE0007164600 | SAP | | STK | 7.000 | 0 | 0 EUR | 97,5900 | 683.130,00 | 3,09 |
| GB00B10RZP78 | Unilever | | STK | 15.500 | 0 | 0 EUR | 47,5050 | 736.327,50 | 3,33 |
| KYG875721634 | Tencent Holdings Ltd. | | STK | 17.700 | 3.500 | 0 HKD | 335,2000 | 713.556,03 | 3,22 |
| US0970231058 | Boeing | | STK | 4.200 | 600 | 0 USD | 188,9100 | 743.809,88 | 3,36 |
| US3377381088 | Fiserv | | STK | 6.500 | 6.500 | 0 USD | 101,5000 | 618.496,30 | 2,79 |
| US5797802064 | McCormick & Co. Inc. | | STK | 10.000 | 0 | 0 USD | 84,1400 | 788.787,85 | 3,56 |
| US6541061031 | Nike | | STK | 6.400 | 6.400 | 0 USD | 117,3500 | 704.078,00 | 3,18 |
| US2546871060 | Walt Disney Co., The | | STK | 7.600 | 7.600 | 0 USD | 87,1800 | 621.138,09 | 2,81 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 540.873,50 | 2,44 |
| XS2408458730 | 2,875000000% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2027/2027) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 87,2940 | 261.882,00 | 1,18 |
| DE000A2TEDB8 | 2,875000000% thyssenkrupp AG MTN v.19(23/24) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 98,7420 | 197.484,00 | 0,89 |
| XS0203470157 | 3,082000000% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 81,5075 | 81.507,50 | 0,37 |
| Zertifikate | | | | | | | EUR | 2.606.346,40 | 11,78 |
| DE000A0S9GB0 | Xetra-Gold | | STK | 19.200 | 0 | 0 EUR | 54,6600 | 1.049.472,00 | 4,74 |
| DE000A2UDH55 | XTrackers ETC PLC ETC Z15.05.80 Silber | | STK | 30.847 | 0 | 0 EUR | 29,1341 | 898.699,58 | 4,06 |
| DE000A2T5DZ1 | XTrackers ETC PLC ETC Z21.05.80 Gold | | STK | 13.964 | 0 | 0 EUR | 24,3000 | 339.325,20 | 1,53 |
| DE000A2UDH63 | XTrackers ETC PLC ETC Z29.05.80 Platin | | STK | 14.596 | 0 | 0 EUR | 21,8450 | 318.849,62 | 1,44 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | EUR | 196.382,33 | 0,89 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 196.382,33 | 0,89 |
| XS1939356645 | 2,200000000% General Motors Financial Co. EO-Med.-Term Nts 2019(19/24) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 98,1912 | 196.382,33 | 0,89 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.12.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|------------|----------------------|------------------------------------|
| Nicht notierte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 723.465,95 | 3,27 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 380.655,95 | 1,72 |
| XS1524568679 | 9,022000000% AIV S.A. Compartment 22 EO-Notes 2016(26) | | EUR | 380 | 0 | 0 % | 107,0220 | 380.655,95 | 1,72 |
| Zertifikate | | | | | | | EUR | 342.810,00 | 1,55 |
| XS1650840983 | AIV S.A. Sec.Market NTS06.08.27 Basket | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 114,2700 | 342.810,00 | 1,55 |
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 1.514.890,83 | 6,84 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | EUR | 1.514.890,83 | 6,84 |
| LU1534068801 | Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile FC o.N. | | ANT | 800 | 0 | 0 EUR | 83,1900 | 66.552,00 | 0,30 |
| LU2220514017 | DWS Invnt-DWS Invnt Sh.Dur.Inc. Act. au Port. FC EUR Acc. oN | | ANT | 2.180 | 0 | 1.500 EUR | 98,7100 | 215.187,80 | 0,97 |
| LU1569816132 | JPMorg.Inv.-Gl.Conv.Conserv.Fd A.N.JPM G.C.USD C(acc)EUR h oN | | ANT | 3.575 | 3.575 | 0 EUR | 92,0200 | 328.963,03 | 1,49 |
| LU0338461691 | PVV-PVV Unternehmensanlei.Plus Inhaber-Anteile o.N. | | ANT | 6.100 | 0 | 0 EUR | 41,5200 | 253.272,00 | 1,14 |
| DE000A0MYQX1 | SKAG Euroinvest Corporates | | ANT | 58.800 | 0 | 0 EUR | 11,0700 | 650.916,00 | 2,94 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 17.018.912,71 | 76,89 |
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | EUR | -395.157,50 | -1,79 |
| Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten) | | | | | | | EUR | -353.797,50 | -1,60 |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | | | | EUR | 10.220,00 | 0,05 |
| MDAX Mini Futures 17.03.2023 | | XEUR | EUR Anzahl | 25 | | | | -3.775,00 | -0,02 |
| MDAX Mini Futures 17.03.2023 | | XEUR | EUR Anzahl | 25 | | | | 13.995,00 | 0,06 |
| Optionsrechte | | | | | | | EUR | -364.017,50 | -1,64 |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | | | | | | EUR | -364.017,50 | -1,64 |
| Call DAX 12000,000000000 20.01.2023 | | XEUR | EUR Anzahl | -35 | | EUR | 2.080,1000 | -364.017,50 | -1,64 |
| Zins-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten) | | | | | | | EUR | -41.360,00 | -0,19 |
| Zinsterminkontrakte | | | | | | | EUR | -41.360,00 | -0,19 |
| Euro Bund Futures 08.03.2023 | | XEUR | EUR | 400.000 | | | | -32.640,00 | -0,15 |
| Euro Bund Futures 08.03.2023 | | XEUR | EUR | 400.000 | | | | -8.720,00 | -0,04 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 5.530.315,03 | 24,99 |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 5.145.947,53 | 23,25 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | EUR | 5.145.947,53 | 23,25 |
| Bank: Hamburger Volksbank | | | EUR | 1.973.110,52 | | | | 1.973.110,52 | 8,91 |
| Bank: ODDO BHF-Bank AG | | | EUR | 971.271,99 | | | | 971.271,99 | 4,39 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.12.2022 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--|--|-------|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|---------|----------------------|------------------------------------|
| Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG | | | EUR | 2.201.565,02 | im Berichtszeitraum | | | 2.201.565,02 | 9,95 |
| Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 384.367,50 | 1,74 |
| Gruppenfremde Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 384.367,50 | 1,74 |
| LU0346393704 | Fidelity Fds-Euro Short Ter.Bd Reg. Shares Y Acc. EUR o.N. | ANT | 15.000,00 | 0 | 0 | EUR | 25,6245 | 384.367,50 | 1,74 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 16.725,73 | 0,08 |
| Ansprüche auf Ausschüttung | | | EUR | 6,26 | | | | 6,26 | 0,00 |
| Dividendenansprüche | | | EUR | 2.559,30 | | | | 2.559,30 | 0,01 |
| Zinsansprüche | | | EUR | 14.160,17 | | | | 14.160,17 | 0,06 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -37.721,91 | -0,17 |
| Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾ | | | EUR | -37.721,91 | | | | -37.721,91 | -0,17 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 22.133.074,06 | 100,00 |
| Anteilwert Strategie Welt Select | | | | | | | EUR | 23,86 | |
| Umlaufende Anteile Strategie Welt Select | | | | | | | STK | 927.492,637 | |

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 30.12.2022 | | | | |
|-----------------|-------|----------|---|--------------|
| Hongkong-Dollar | (HKD) | 8,314750 | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,066700 | = | 1 Euro (EUR) |

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

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

| - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag): | | | | |
|--|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| NL0000235190 | Airbus Group SE | STK | 0 | 3.500 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | 0 | 4.000 |
| KYG8208B1014 | JD.com Inc. | STK | 676 | 676 |
| US7134481081 | PepsiCo Inc | STK | 0 | 6.500 |
| IT0004176001 | Prysmian | STK | 31.000 | 62.130 |
| DE000UNSE018 | Uniper | STK | 0 | 24.000 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| DE000DU21377 | Anspruch auf JD.com Inc | STK | 676 | 676 |
| Zertifikate | | | | |
| DE000CE9N8U9 | Commerzbank AG Fakt.1xLongZ.17(17/unl.)VSTO | STK | 0 | 81.300 |
| Investmentanteile | | | | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | |
| LU2190469523 | JPM.Inv.Fd-Glo.Opp.Conv.Inc.Fd Act. Nom. C H EUR Acc. oN | ANT | 0 | 3.300 |

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 | | | | |
| Wertpapier-Terminkontrakte | | | | |
| Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten | | | | |
| Gekaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 1.728 |
| Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe) | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | |
| Gekaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 1.581 |
| DAX Index) | | | | |
| Verkaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 8.833 |
| DAX Index) | | | | |
| Währungsterminkontrakte | | | | |
| Gekaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 13.566 |
| Euro/US-Dollar) | | | | |

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 |
| Optionsrechte | | | | |
| Wertpapier-Optionsrechte | | | | |
| Optionsrechte auf Aktien | | | | |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call) | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 375 |
| Hannover Rück SE | | | | |
| Münchener Rückversicherung | | | | |
| Prysmian | | | | |
| RWE) | | | | |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put) | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 85 |
| Airbus Group SE | | | | |
| Beiersdorf) | | | | |
| Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate | | | | |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | | | |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call) | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 15.385 |
| DAX Index) | | | | |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put) | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 40 |
| DAX Index) | | | | |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) STRATEGIE WELT SELECT

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2022 BIS 31.12.2022

| | EUR | EUR |
|--|------------|----------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller | | 94.485,93 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 112.568,62 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 5.970,02 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | 30.385,95 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -17.998,41 |
| davon negative Habenzinsen | -22.007,23 | |
| 6. Erträge aus Investmentanteilen | | 16.763,65 |
| 7. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -11.934,55 |
| 8. Sonstige Erträge | | 5.329,14 |
| Summe der Erträge | | 235.570,35 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | -29,36 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -351.263,47 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | -13.062,64 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -9.568,26 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | -11.086,04 |
| 6. Aufwandsausgleich | | 1.956,29 |
| Summe der Aufwendungen | | -383.053,48 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | -147.483,13 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 5.063.471,91 |
| 2. Realisierte Verluste | | -2.389.710,48 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 2.673.761,43 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 2.526.278,30 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -1.952.790,48 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -726.355,80 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -2.679.146,28 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -152.867,98 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS STRATEGIE WELT SELECT

| | EUR | EUR |
|---|---------------|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.01.2022) | | 23.817.512,31 |
| 1. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | -1.539.447,62 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 755.954,18 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -2.295.401,80 | |
| 2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | 7.877,35 |
| 3. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -152.867,98 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -1.952.790,48 | |
| davon nicht realisierte Verluste | -726.355,80 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.12.2022) | | 22.133.074,06 |

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS STRATEGIE WELT SELECT ¹⁾

| | insgesamt EUR | je Anteil EUR |
|--|---------------------|------------------|
| I. Für die Wiederanlage verfügbar | 4.915.988,78 | 5,30 |
| 1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | 2.526.278,30 | 2,72 |
| 2. Zuführung aus dem Sondervermögen | 2.389.710,48 | 2,58 |
| II. Wiederanlage | 4.915.988,78 | 5,30 |

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE STRATEGIE WELT SELECT

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR | Anteilwert EUR |
|---------------|---|-------------------|
| 2022 | 22.133.074,06 | 23,86 |
| 2021 | 23.817.512,31 | 24,01 |
| 2020 | 19.643.457,21 | 22,81 |
| 2019 | 21.434.972,02 | 22,32 |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

| | | |
|---|-----|------------------|
| Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure | EUR | 4.770.857,66 |
| Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte | | |
| Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG | | |
| ODDO BHF-Bank AG | | |
| 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 | | 70,00% |
| EUR Short-Term Rate | | 30,00% |
| Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV | | |
| kleinster potenzieller Risikobetrag | | 0,49% |
| größter potenzieller Risikobetrag | | 1,47% |
| durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag | | 0,74% |
| Risikomodell (§10 DerivateV) | | Full-Monte-Carlo |
| Parameter (§11 DerivateV) | | |
| Konfidenzniveau | | 99,00% |
| Haltdauer | | 1 Tage |
| Länge der historischen Zeitreihe | | 1 Jahr |
| Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte | | 1,35 |

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 Strategie Welt Select | EUR | 23,86 |
| Umlaufende Anteile Strategie Welt Select | STK | 927.492,637 |

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 STRATEGIE WELT SELECT

| | |
|---|--------|
| Performanceabhängige Vergütung | 0,00 % |
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 1,75 % |

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 01.01.2022 BIS 31.12.2022

| Transaktionen | Volumen in Fondswährung |
|---|-------------------------|
| Transaktionsvolumen gesamt | 87.519.806,40 |
| Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen | 0,00 |
| Relativ in % | 0,00 % |

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 24.415,71 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 keine 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 % |
|--------------|---|---|
| LU1534068801 | Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile FC o.N. ¹⁾ | 0,12 |
| LU2220514017 | DWS Invt-DWS Invt Sh.Dur.Inc. Act. au Port. FC EUR Acc. oN ¹⁾ | 0,45 |
| LU0346393704 | Fidelity Fds-Euro Short Ter.Bd Reg. Shares Y Acc. EUR o.N. ¹⁾ | 0,30 |
| LU2190469523 | JPM.Inv.Fd-Glo.Opp.Conv.Inc.Fd Act. Nom. C H EUR Acc. oN ¹⁾ | 0,75 |
| LU1569816132 | JPMorg.Inv.-Gl.Conv.Conserv.Fd A.N.JPM G.C.USD C(acc)EUR h oN ¹⁾ | 0,75 |
| LU0338461691 | PVV-PVV Unternehmensanlei.Plus Inhaber-Anteile o.N. ¹⁾ | 0,09 |
| DE000A0MYQX1 | SKAG Euroinvest Corporates ¹⁾ | 0,40 |

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

Strategie Welt Select

Sonstige Erträge

| | | |
|--------------------------|-----|----------|
| Quellensteuer Erstattung | EUR | 4.940,42 |
|--------------------------|-----|----------|

Sonstige Aufwendungen

| | | |
|---------------|-----|----------|
| Depotgebühren | EUR | 8.008,80 |
|---------------|-----|----------|

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

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

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

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

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

ERGEBNISSE DER JÄHRLICHEN ÜBERPRÜFUNG DER VERGÜTUNGSPOLITIK

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

ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN DER FESTGELEGTEN VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2022 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

| | | |
|---|------------|-------------------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer) | EUR | 22.647.706 |
| davon feste Vergütung | EUR | 18.654.035 |
| davon variable Vergütung | EUR | 3.993.671 |
| Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen | EUR | 0 |
| Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt) | | 298 |
| Höhe des gezahlten Carried Interest | EUR | 0 |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risktaker) | EUR | 1.499.795 |
| davon Geschäftsleiter | EUR | 1.129.500 |
| davon Führungskräfte | EUR | 370.295 |

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der WBS Hünicke Vermögensverwaltung GmbH für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

| Portfoliomanager | | WBS Hünicke Vermö- gensverwaltung GmbH |
|--|------------|---|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung | EUR | 794.030,34 |
| 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 | | 8 |

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:

Hamburg, 09. Juni 2023

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 Strategie Welt Select – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 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 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 12.06.2023

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

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

Haftendes Eigenkapital: 548,887 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 28,840 Mio. EUR
Stand: 31.12.2021

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhrentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST