

# Zwischenbericht zum 30. Dezember 2020

Strategie Welt Secur

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Strategie Welt Secur

in der Zeit vom 1. Januar 2020 bis 30. Dezember 2020.

Hamburg, im April 2021

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Dr. Jörg W. Stotz    Nicholas Brinckmann    Andreas Hausladen    Ludger Wibbeke

## So behalten Sie den **Überblick:**

Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2020 .....	4
Vermögensübersicht per 30. Dezember 2020 .....	6
Vermögensaufstellung per 30. Dezember 2020 .....	7
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	12
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers .....	15
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	17

# Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2020

## 1. Anlageziel

Der Strategie Welt Secur strebt als Anlageziel einen mittel- bis langfristigen Wertzuwachs an. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Sondervermögen weltweit in Aktien, Verzinsliche Wertpapiere, Investmentfonds, Geldmarktinstrumente, Bankguthaben. Die Auswahl der Vermögensgegenstände erfolgt nach fundamentalen Kriterien (z.B. relative Stärke des Vermögensgegenstandes zum Vergleichsindex, Dividendenrendite usw.) sowie finanzmathematischer Kennzahlen. Zur Risikominimierung werden die ausgesuchten Titel häufig auch in Form von Optionsstrategien (als Stillhalter) im Fonds abgebildet.

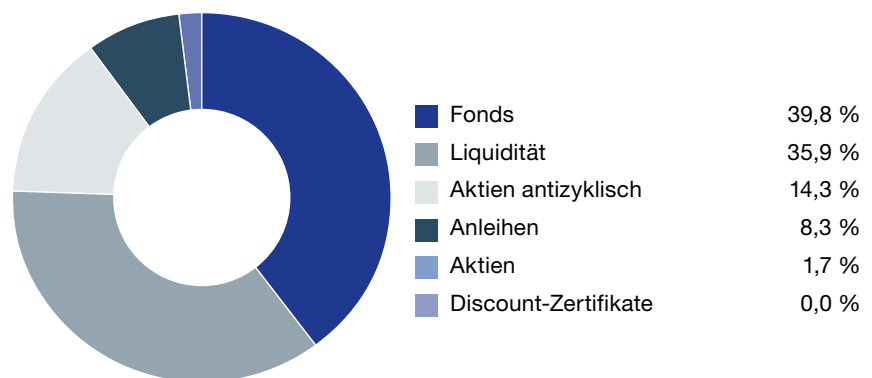
## 2. Anlagepolitik

Das Fondsvolumen wurde im Berichtszeitraum in Aktien und festverzinsliche Wertpapiere investiert. Der Aktienanteil bestand zum größten Teil aus Aktien-Indexfonds und zwei Einzelaktien, wobei der Schwerpunkt auf europäischen Titeln lag. Zum Jahresende betrug die Aktienquote 1,67 %. Auf Teile dieses Aktienbestandes wurden regelmäßig Optionen auf den DAX verkauft und damit Prämieinnahmen generiert (Stillhaltergeschäfte). Der überwiegende Teil der Investments erfolgte in Euro.

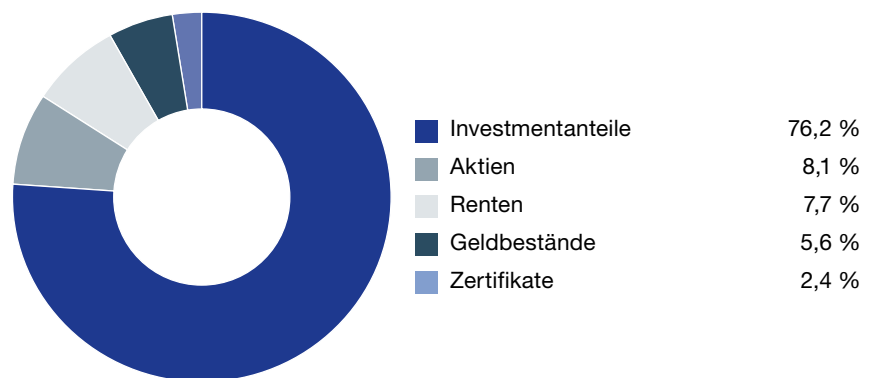
Die Wertentwicklung im Jahr 2020 lag bei 0,45 %.

## 3. Portfoliostruktur sowie wesentliche Änderungen im Berichtszeitraum

### Portfoliostruktur zum 30.12.2020\*)



### Portfoliostruktur zum 31.12.2019



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

## 4. Wesentliche Risiken im Berichtszeitraum

### Marktpreisrisiken

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

### Währungsrisiken

Währungsrisiken wurden durch die ausschließliche Anlage in Euro ausgeschlossen.

### Adressenausfallrisiken

Adressenausfallrisiken können niemals ausgeschlossen werden. Diese sind je

doch gering, da das Fondsmanagement besonderen Wert auf die Qualität der hinter den Investitionen stehenden Unternehmen legt und da die Titel im Fonds breit diversifiziert sind.

#### **Liquiditätsrisiko**

Der Fonds investiert sein Vermögen in Zielfonds. Die Liquidität des Sondervermögens kann eingeschränkt werden, sofern z.B. für die Zielfonds die Rücknahme der Anteilscheine ausgesetzt werden sollte. Das Risiko soll durch eine breite Streuung an Zielfonds sowie eine angemessene Gewichtung eingegrenzt werden.

#### **Operationelle Risiken**

Unter operationellen Risiken wird die Gefahr von Verlusten verstanden, die durch die Unangemessenheit oder das Versagen von internen Verfahren, Menschen und Systemen oder durch externe Ereignisse verursacht werden. Die Gesellschaft unterscheidet hier zwischen Produktrisiken, Personalrisiken, Rechtsrisiken, Risiken aus Kunden- und Geschäftsbeziehungen sowie technischen Risiken. Um diese Risiken zu minimieren wurden u.a. folgende Maßnahmen getroffen:

- Zum Orderprozess gehören ex ante- und ex post-Kontrollen

- Die im Fondsmanagement arbeitenden Mitarbeiter verfügen über langjährige Markterfahrung

- Die Mitarbeiter werden regelmäßig in Bezug auf Rechtsfragen geschult

- Die Geschäfte in Finanzinstrumenten werden ausschließlich über erfahrene und kompetente Partner abgeschlossen. Die Verwahrung der Finanzinstrumente erfolgt über eine renommierte Verwahrstelle mit guter Bonität

#### **Sonstige Risiken**

Die Ausbreitung der Atemwegserkrankung COVID-19 hat aktuell weltweit zu massiven Einschnitten in das öffentliche Leben mit erheblichen Folgen u.a. für die Wirtschaft und deren Unternehmen geführt, die sich derzeit noch nicht abschätzen lassen. Vor diesem Hintergrund lassen sich die mit den Investitionen dieses Fonds verbundenen Risiken derzeit nicht abschließend absehen. Es besteht die Möglichkeit, dass sich die bestehenden Risiken verstärkt und kumuliert realisieren und sich negativ auf das Ergebnis des Fonds auswirken könnten.

## **5. Erläuterung der wesentlichen Quellen des Veräußerungsergebnisses**

Bei den Veräußerungsgeschäften von Aktien, Investmentanteilen, Zertifikaten und Derivaten wurden für den Fonds Gewinne in Höhe von 311.137,39 Euro realisiert. Dem standen realisierte Verluste von 139.553,89 Euro gegenüber. Per Saldo ergibt sich demnach ein Plus von 171.583,50 Euro.

## **6. Sonstige für den Anleger wesentliche Ereignisse**

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

Mit Bekanntmachung vom 12. November 2020 wurden die Verschmelzungsinformationen zur Verschmelzung des OGAW-Sondervermögens „Strategie Welt Secur“ auf das OGAW-Sondervermögen „Strategie Welt Select“ veröffentlicht. Die Verschmelzung erfolgte mit Ablauf des 30.12.2020 24.00 Uhr.

# Vermögensübersicht per 30. Dezember 2020

Fondsvermögen: EUR 3.992.759,59 (4.185.339,82)

Umlaufende Anteile: 177.746 (187.215)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.12.2019
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
1. Aktien	67	1,67	(8,18)
2. Anleihen	329	8,25	(7,86)
3. Zertifikate	1	0,02	(2,42)
4. Sonstige Wertpapiere	2.162	54,14	(74,41)
5. Derivate	0	0,00	(-1,08)
6. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0	0,00	(2,89)
7. Bankguthaben	1.446	36,21	(5,73)
8. Sonstige Vermögensgegenstände	0	0,00	(0,00)
<b>II. Verbindlichkeiten</b>			
	-12	-0,29	(-0,41)
<b>III. Fondsvermögen</b>			
	<b>3.993</b>	<b>100,00</b>	

# Vermögensaufstellung per 30. Dezember 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.12.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
Royal Dutch Shell	GB00B03MLX29		STK	4.500	0	0	EUR 14,810000	66.645,00	1,67
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,000000000% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/ Und.)	XS0203470157		EUR	100	0	0	% 79,116000	79.116,00	1,98
3,750000000% Deutsche Postbank EO-FLR 04/09	DE000A0DHUM0		EUR	100	0	0	% 100,124000	100.124,00	2,51
0,100000000% ING Groep N.V. EO-FLR Bonds 2003(13/ Und.)	NL0000113587		EUR	50	0	0	% 93,673000	46.836,50	1,17
<b>Summe der börsengehandelten Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>292.721,50</b>	<b>7,33</b>
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
9,022000000% AIV S.A. Compartment 22 EO-Notes 2016(26)	XS1524568679		EUR	100	0	0	% 103,296669	103.296,67	2,59
<b>Zertifikate</b>									
Commerzbank AG Fakt.1xLongZ.11(11/unl.)VSTOXX	DE000CZ34KS8		STK	1.000	0	0	EUR 0,880000	880,00	0,02
<b>Summe der an organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>104.176,67</b>	<b>2,61</b>
<b>Investmentanteile</b>									
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
iShares DAX UCITS ETF DE	DE0005933931		ANT	5.100	0	0	EUR 117,220000	597.822,00	14,97
JPM.Inv.Fd-Glo.Opp.Conv.Inc.Fd Act. Nom. C H EUR Acc. oN	LU2190469523		ANT	600	600	0	EUR 110,450000	66.270,00	1,66
Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF I	LU0378438732		ANT	4.800	0	0	EUR 119,260000	572.448,00	14,34
Lyxor Index-Cor.EO Stoxx50(DR) Act. Nom. EUR Dis. oN	LU0908501488		ANT	6.198	6.199	1	EUR 72,350000	448.425,30	11,23
PVV-PVV Unternehmensanlei.Plus Inhaber-Anteile o.N.	LU0338461691		ANT	1.500	0	0	EUR 47,200000	70.800,00	1,77
SKAG Euroinvest Corporates	DE000A0MYQX1		ANT	30.300	0	22.700	EUR 13,400000	406.020,00	10,17
<b>Summe der Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>2.161.785,30</b>	<b>54,14</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>2.558.683,47</b>	<b>64,08</b>

## Vermögensaufstellung zum 30.12.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.12.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			EUR	1.445.854,38				1.445.854,38	36,21
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.445.854,38</b>	<b>36,21</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	95,90				95,90	0,00
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>95,90</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>			<b>EUR</b>	<b>-11.874,16</b>			<b>EUR</b>	<b>-11.874,16</b>	<b>-0,29</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>3.992.759,59</b>	<b>100 2)</b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>22,46</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>177.746</b>	

### Fußnoten:

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

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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



**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
innogy SE Inhaber-Aktien o.N.	DE000A2AADD2	STK	-	5.000	
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Zertifikate</b>					
AIV S.A. Sec.Market NTS06.08.27 Basket	XS1650840983	EUR	-	100	
<b>Investmentanteile</b>					
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>					
ComSta.-FR EURO STOXX 50 U.ETF Inhaber-Anteile I o.N.	LU0488317297	ANT	-	12.600	
Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile FC o.N.	LU1534068801	ANT	-	3.770	
De.Inv.I-Global Short Duration Inhaber-Anteile FCH o.N.	LU1189352500	ANT	-	3.110	
DWS Invt-DWS Invt.Sh.Dur.Inc. Act. au Port. FC EUR Acc. oN	LU2220514017	ANT	3.110	3.110	
Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF	LU0290358497	ANT	-	500	
<b>Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>					
<b>Optionsrechte</b>					
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>					
<b>Optionsrechte auf Aktienindices:</b>					
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: DAX Index		EUR			1.077,11
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: DAX Index		EUR			8,21

## Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertrags- und Aufwandsausgleich)

für den Zeitraum vom 01. Januar 2020 bis 30. Dezember 2020

### I. Erträge

1. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	3.669,61
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR	10.640,64
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-1.503,78*)
4. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	35.575,77
5. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-550,46
6. Sonstige Erträge	EUR	310,60
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>	<b>48.142,38</b>

### II. Aufwendungen

1. Verwaltungsvergütung	EUR	-53.990,94
2. Verwahrstellenvergütung	EUR	-2.265,24
3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-8.025,17
4. Sonstige Aufwendungen	EUR	-1.920,90
5. Aufwandsausgleich	EUR	1.643,78
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>	<b>-64.558,47</b>

### III. Ordentlicher Nettoertrag

**EUR -16.416,09**

### IV. Veräußerungsgeschäfte

<b>1. Realisierte Gewinne</b>	<b>EUR</b>	<b>311.137,39</b>
<b>2. Realisierte Verluste</b>	<b>EUR</b>	<b>-139.553,89</b>
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>	<b>171.583,50</b>

### V. Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes

**EUR 155.167,41**

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-95.092,46
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-48.794,03

### VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes

**EUR -143.886,49**

### VII. Ergebnis des Berichtszeitraumes

**EUR 11.280,92**

\*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen in Höhe von EUR 1.503,78

## Entwicklung des Sondervermögens

			2020
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Berichtszeitraumes</b>			EUR 4.185.339,82
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)			EUR -205.820,15
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	183.943,31	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	-389.763,46	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR 1.959,00
3. Ergebnis des Berichtszeitraumes			EUR 11.280,92
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR	-95.092,46	
davon nicht realisierte Verluste:	EUR	-48.794,03	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Berichtszeitraumes</b>			<b>EUR 3.992.759,59</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt		je Anteil
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>			
1. Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	EUR	155.167,41	0,87
2. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR	139.553,89	0,79
<b>II. Wiederanlage</b>	<b>EUR</b>	<b>294.721,30</b>	<b>1,66</b>

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

## Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert	
2017	EUR	6.224.727,77	EUR	21,95
2018	EUR	3.967.452,41	EUR	19,51
2019	EUR	4.185.339,82	EUR	22,36
2020	EUR	3.992.759,59	EUR	22,46

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 0,00

Der Wert ergibt sich unter Berücksichtigung von Netting- und Hedgingeffekten, der zugrundeliegenden Derivate im Sondervermögen

## Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Fehlanzeige

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	64,08
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

**Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.**

## Angaben nach dem qualifizierten Ansatz

### Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potentieller Risikobetrag	0,48 %
größter potentieller Risikobetrag	2,74 %
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag	1,40 %

### Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde

Full-Monte-Carlo

### Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden

99% Konfidenzniveau, 1 Tag Haltedauer bei einem effektiven historischen Beobachtungszeitraum von einem Jahr

### Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte

Mittelwert	1,03
------------	------

### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

MSCI - World Index	100,00 %
--------------------	----------

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	22,46
Umlaufende Anteile	STK	177.746

### 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

Gesamtkostenquote	1,85 %
-------------------	--------

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

Transaktionskosten	EUR	2.453,74
--------------------	-----	----------

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes	0,00 %
--	--------

## An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Im abgelaufenen Berichtszeitraum 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 Aufwandserstattungen. 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

Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

iShares DAX UCITS ETF DE	0,1500 %
JPM.Inv.Fd-Glo.Opp.Conv.Inc.Fd Act. Nom. C H EUR Acc. oN	0,7500 %
Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF I	0,1200 %
Lyxor Index-Cor.EO Stoxx50(DR) Act. Nom. EUR Dis. oN	0,0700 %
PVV-PVV Unternehmensanlei.Plus Inhaber-Anteile o.N.	0,0900 %
SKAG Euroinvest Corporates	0,4000 %
ComSta.-FR EURO STOXX 50 U.ETF Inhaber-Anteile I o.N.	0,1500 %
Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile FC o.N.	0,1200 %
De.Inv.I-Global Short Duration Inhaber-Anteile FCH o.N.	0,4500 %
DWS Invt-DWS Invt Sh.Dur.Inc. Act. au Port. FC EUR Acc. oN	0,4500 %
Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF	0,1500 %

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

## Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 229,41 Erträge aus der Auflösung von Rückstellung

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 637,90 Kosten für Marktrisikomessung

## Sonstige Informationen

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

## Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2019

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR 13.825.622,49
davon fix:	EUR 10.999.500,77
davon variabel:	EUR 2.826.121,72
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt):	172
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2019 der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risikoträger):	EUR 1.011.750,04

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum 1. Januar bis 31. Dezember 2019 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

## 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 im Auslagerungsfall für das Geschäftsjahr 2018 (Portfoliomanagement WBS Hünicke Vermögensverwaltung GmbH)

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens.

Das Auslagerungsunternehmen hat folgende Informationen selbst veröffentlicht:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung:	EUR	455.901
davon feste Vergütung:	EUR	455.901
davon variable Vergütung:	EUR	0
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	EUR	0

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:

### Verweis

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

Zusammensetzung des Portfolios,  
Portfolioumsätze und Portfolioumsatzkosten:

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.

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

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.

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

Informationen zur Stimmrechtsausübung sind auf der Internetseite der HANSAINVEST erhältlich.

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

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

Hamburg, 06. April 2021

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 Zwischenbericht des Sondervermögens Strategie Welt Secur – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für den Zeitraum vom 1. Januar 2020 bis zum 30. Dezember 2020, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. Dezember 2020, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für den Zeitraum vom 1. Januar 2020 bis zum 30. Dezember 2020, 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 Zwischenbericht 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 Zwischenberichts in Übereinstimmung mit § 104 Abs. 2 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 Zwischenberichts“ 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 Zwischenbericht zu dienen.

## Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Zwischenbericht

Die gesetzlichen Vertreter der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Zwischenberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Zwischenbericht 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 Zwischenberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Zwischenberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür ver-

antwortlich, 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 Zwischenberichts die Fortführung des Sondervermögens 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 Zwischenberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Zwischenbericht als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Zwischenbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 104 Abs. 2 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 Zwischenberichts 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 Zwischenbericht i.S.d. § 104 Abs. 1 KAGB, 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 Zwischenberichts 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.

- 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 aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Zwischenbericht 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 nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH bei der Aufstellung des Zwischenberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Zwischenberichts, einschließlich der Angaben sowie ob der Zwischenbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Zwischenbericht 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 7. April 2021

KPMG AG  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

gez. Werner                      gez. Lüning  
Wirtschaftsprüfer              Wirtschaftsprüfer



# Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

## Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST  
Hanseatische Investment-Gesellschaft  
mit beschränkter Haftung  
Postfach 60 09 45  
22209 Hamburg  
Hausanschrift:  
Kapstadtring 8  
22297 Hamburg

Kunden-Servicecenter:  
Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96  
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70  
Internet: www.hansainvest.com  
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital:  
€ 10.500.000,00  
Eigenmittel:  
€ 15.743.950,10  
(Stand: 31.12.2020)

## Gesellschafter:

SIGNAL IDUNA  
Allgemeine Versicherung AG, Dortmund  
SIGNAL IDUNA  
Lebensversicherung a.G., Hamburg

## Verwahrstelle:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:  
€ 18.445.196,00  
Haftendes Eigenkapital (aufsichtsrecht-  
liche Eigenmittel nach Art. 72 CRR):  
€ 228.453.059,00  
(Stand 31.12.2019)

## Einzahlungen:

UniCredit Bank AG, München  
(vorm. Bayerische Hypo- und  
Vereinsbank)  
BIC: HYVEDEMM300  
IBAN: DE15200300000000791178

## Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),  
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA  
Gruppe, Hamburg  
(zugleich Vorsitzender des Aufsichts-  
rates 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

## Wirtschaftsprüfer:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

## Geschäftsführung:

Dr. Jörg W. Stotz  
(Sprecher, zugleich Aufsichtsrats-  
vorsitzender der HANSAINVEST LUX  
S.A., Mitglied der Geschäftsführung  
der SIGNAL IDUNA Asset Management  
GmbH und der HANSAINVEST Real  
Assets GmbH sowie Mitglied des  
Aufsichtsrates der Aramea Asset  
Management AG)

Nicholas Brinckmann  
(zugleich Sprecher der Geschäftsführung  
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Andreas Hausladen (ab 01.04.2020)

Ludger Wibbeke  
(zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-  
vorsitzender der HANSAINVEST LUX  
S.A. sowie Vorsitzender des  
Aufsichtsrates der WohnSelect  
Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

**HANSAINVEST**  
**Hanseatische Investment-GmbH**

**Ein Unternehmen der**  
**SIGNAL IDUNA Gruppe**

Kapstadtring 8  
22297 Hamburg  
Telefon (040) 3 00 57 - 62 96  
Fax (040) 3 00 57 - 60 70

[service@hansainvest.de](mailto:service@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)