

Jahresbericht zum 30. November 2020

D&R SpeedLab eQuant Income



DONNER & REUSCHEL
PRIVATBANK SEIT 1798

HANSAINVEST

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

D&R SpeedLab eQuant Income

in der Zeit vom 1. Dezember 2019 bis 30. November 2020.

Hamburg, im März 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 Geschäftsjahr 2019/2020	4
Vermögensübersicht per 30. November 2020	7
Vermögensaufstellung per 30. November 2020	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	13
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	16
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	18

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2019/2020

Anlageziele

Ziel der Anlagepolitik des D&R SpeedLab eQuant Income ist es, langfristig einen positiven Wertzuwachs zu erzielen.

Der Fonds investiert hierfür global und flexibel grundsätzlich in folgende Anlageklassen: Renten sowie dazugehörige Währungen. Als Basisinvestment wird durch das Management in einen Korb aus europäischen Anleihen und Geldmarktinstrumenten investiert. Ergänzend erfolgt eine Investition in liquide Future Kontrakte auf anerkannte Renten- und Geldmarktindizes. Diese Investitionen in liquide Future Kontrakte werden täglich nach einer optimierten Strategie, die die Attraktivität jedes eingesetzten Renten- und Geldmarktindex ermittelt, angepasst. Neben den aufgeführten Anlagemöglichkeiten darf das Management bis zu 49 Prozent des Vermögens in Aktien, flüssige Mittel, Festgelder sowie gleichwertige Instrumente investieren. Aus der Kombination des Basisportfolios, der Investitionen in Future Kontrakte auf Renten- und Geldmarktindizes sowie weiterer Anlagen ergibt sich das gesamte Portfolio des Sondervermögens.

Die maximalen Anlagegrenzen für die jeweiligen Vermögensgegenstände sind entsprechend der Besonderen Anlagebedingungen wie folgt ausgestattet:

Verzinsliche Wertpapiere mindestens 51 %
Aktien und Aktien
gleichwertige Wertpapiere maximal 49 %

Geldmarktinstrumente maximal 49 %
Bankguthaben maximal 49 %
Investmentanteile maximal 10 %
Derivate dürfen zu Absicherungs- und Spekulationszwecken erworben werden.

Portfoliostruktur sowie wesentliche Änderungen im Berichtszeitraum

Die Grundstruktur des Portfolios besteht aus den Investitionen in Derivate (auf Rentenindizes), Anleihen (Floater und kurzlaufende Papiere) sowie Kontokorrentguthaben. Eine Allokation von Aktien erfolgte im Berichtszeitraum nicht.

Der überwiegende Teil der Anlagen wurde in Euro denominiert getätigt. Ausnahme bilden gemäß Anlagestrategie die Investitionen in Future Kontrakte in Fremdwährung. Hier erfolgt die Abrechnung in der jeweiligen Währung.

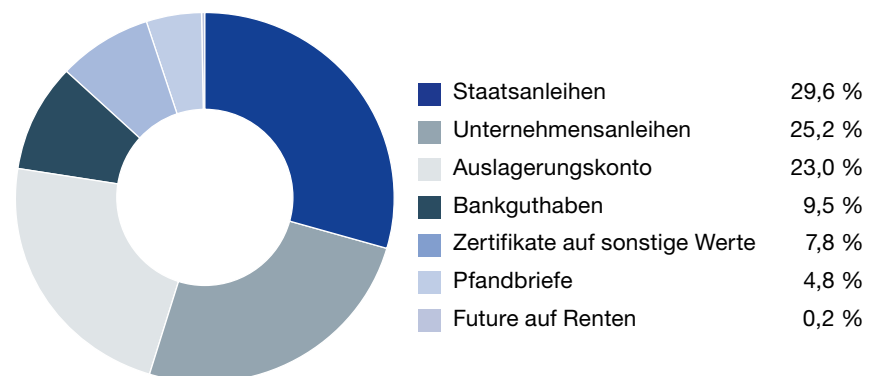
Das Geschäftsjahr startete mit einer Anleihenquote (ohne Derivate) auf Basis der

Einzeltitle von 61 %. Diese wurde während des Geschäftsjahres nahezu unverändert beibehalten. Zum Geschäftsjahresende beträgt die Anleihenquote (ohne Derivate) auf Basis der Einzeltitle knapp 60 %.

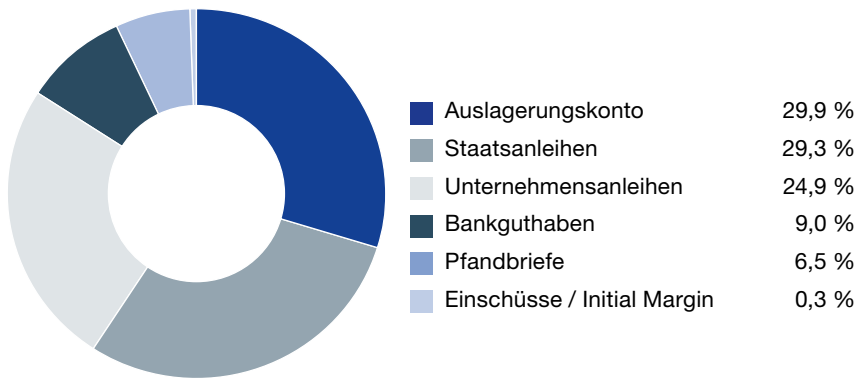
Investiert wurde Long(positive Position)- und Short(negative Position) auf folgende Indizes über liquide Future Kontrakte:

Euro-Schatz Future	Deutschland
Restlaufzeit	1,75 -2,25 Jahre
Euro-Bobl Future	Deutschland
Restlaufzeit	4,50 – 5,50 Jahre
Euro-Bund Future	Deutschland
Restlaufzeit	8,50 – 10,50 Jahre
Euro-BTP Future	Italien
Restlaufzeit	8,50 – 11 Jahre
Euro-OAT Future	Frankreich
Restlaufzeit	8,50 – 10,50 Jahre
Long UK Gilt Future	Großbritannien
Restlaufzeit	8,75 und 13 Jahre

Struktur des Portfolios zum Geschäftsjahresende 30.11.2020



Struktur des Portfolios zum Geschäftsjahresende-Vorjahr 30.11.2019



Wesentliche Risiken des Sondervermögens im Berichtszeitraum

Adressenausfallrisiken

Der D&R SpeedLab eQuant Equity investierte im Berichtszeitraum in Future Kontrakte, die an der EUREX (einem Handelsplatz für Derivate) oder an vergleichbar regulierten Märkten gelistet sind. Direkte Adressenausfallrisiken ergaben sich dadurch nicht. Darüber hinaus investierte der Fonds die vorhandene Liquidität direkt in Floating Rate Notes bzw. kurzlaufende Anleihen. Ein nennenswertes Adressenausfallrisiko lag auch bei diesen Anlagen nicht vor. Grund hierfür sind die gewählten Emittenten wie z.B. Kreditanstalt für Wiederaufbau, diverse deutsche Bundesländer sowie die European Investment Bank. Darüber hinaus erfolgte im Berichtszeitraum eine Investition in ein Zertifikat der Banca Credinvest, Schweiz. Hier bestand ebenfalls ein entsprechendes Adressenausfallrisiko.

Liquiditätsrisiken

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.

Zinsänderungsrisiken

Sofern in festverzinsliche Wertpapiere investiert wird, könnte die Möglichkeit bestehen, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Emission einer Anleihe gegeben ist, ändert. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite des festverzinslichen Wertpapiers in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach (Rest-)Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungsrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Währungs- und sonstige Risiken

Im Berichtszeitraum war der D&R SpeedLab eQuant Income geringfügigen Währungsrisiken ausgesetzt, da getätigte Transaktionen in Anleihen Futures teilweise auf Indizes in Fremdwährung basierten. Es handelt sich im Berichtszeitraum um die Währungen USD = United States Dollar sowie GBP = Britisches Pfund.

Marktpreisrisiko

Marktpreisrisiken resultieren aus den Kursbewegungen der gehaltenen Finanzinstrumente. Die Kurs- oder Marktpreisentwicklung hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird.

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 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 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.

Wesentliche Angaben über die Herkunft des Veräußerungsergebnisses

Anteilkategorie P:

Mit Future-Kontrakten sowie Anleihen konnte ein Gewinn von 1.806.137,88 Euro erzielt werden. Dem stehen Verluste von 1.641.857,42 Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Gewinn von 164.280,46 Euro ergibt.

Anteilkategorie I:

Mit Future-Kontrakten sowie Anleihen konnte ein Gewinn von 1.751.847,11 Euro

erzielt werden. Dem stehen Verluste von 1.587.692,49 Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Gewinn von 164.154,62 Euro ergibt.

Anteilkategorie V:

Mit Future-Kontrakten sowie Anleihen konnte ein Gewinn von 4.363.532,40 Euro erzielt werden. Dem stehen Verluste von 3.971.276,33 Euro gegenüber, so dass sich per Saldo ein Gewinn von 392.256,07 Euro ergibt.

Die realisierten Gewinne resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von Derivaten. Für die realisierten Verluste sind ebenfalls im Wesentlichen Veräußerungen von Derivaten ursächlich.

Wertentwicklung des D&R SpeedLab eQuant Income im abgelaufenen Geschäftsjahr

Im Berichtszeitraum vom 01.12.2019 bis 30.11.2020 ergaben sich nachfolgende Wertentwicklungen der einzelnen Anteilklassen:

D&R SpeedLab eQuant Income P: +1,27 %

D&R SpeedLab eQuant Income I: +1,86 %

D&R SpeedLab eQuant Income V: +2,65 %

Sonstige für den Anleger wesentliche Ereignisse

Das Portfoliomanagement ist weiterhin an die DONNER & REUSCHEL Luxemburg S.A., Luxemburg ausgelagert. Die mit der Verwaltung des Sondervermögens beauftragte Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg. Die Verwaltungsgesellschaft und der Portfoliomanager gehören der Signal Iduna Gruppe an.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht per 30. November 2020

Fondsvermögen: EUR 26.237.476,03 (26.865.556,40)

Umlaufende Anteile: I-Klasse 62.396 (66.226)

P-Klasse 64.006 (68.150)

V-Klasse 145.571 (150.164)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 30.11.2019
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	15.638	59,60	(60,90)
2. Zertifikate	2.043	7,79	(0,00)
3. Derivate	58	0,22	(-0,30)
4. Bankguthaben	8.492	32,36	(39,42)
5. Sonstige Vermögensgegenstände	44	0,17	(0,15)
II. Verbindlichkeiten	-37	-0,14	(-0,17)
III. Fondsvermögen	26.238	100,00	

Vermögensaufstellung per 30. November 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.11.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,000000000% Berlin, Land FLR-Landessch.v.13(2021) A.411	DE000A1TNF42		EUR	500	0	0	% 100,491500	502.457,50	1,92
0,016000000% Berlin, Land FLR-Landessch.v.19(2022) A.511	DE000A2NB9S8		EUR	500	0	0	% 100,746500	503.732,50	1,92
0,026000000% Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.19(23)	DE000A2AAWK7		EUR	500	500	0	% 101,361000	506.805,00	1,93
0,100000000% Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.12(23)	DE0001030542		EUR	500	500	0	% 103,034500	556.509,94	2,12
0,000000000% DNB Boligkredit A.S. EO-FLR M.-T. Pfandbr. 14/21	XS1137512742		EUR	1.250	0	0	% 100,463500	1.255.793,75	4,79
0,000000000% European Investment Bank EO-FLR Med.-Term Nts 2014(24)	XS1133551405		EUR	500	0	0	% 102,094000	510.470,00	1,95
0,000000000% European Investment Bank EO-FLR MTN 13/21	XS0907250509		EUR	1.000	0	0	% 100,093500	1.000.935,00	3,81
0,375000000% European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2015(22)	XS1271698612		EUR	1.000	1.000	0	% 101,372666	1.013.726,66	3,86
0,000000000% Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.150 v.14(22)	DE000A11QH42		EUR	500	0	0	% 100,903500	504.517,50	1,92
3,500000000% K.F.W. 06/21	DE0002760980		EUR	2.000	0	0	% 102,458500	2.049.170,00	7,81
0,202000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau FLR-MTN v.2019(2023)	DE000A2TSTQ2		EUR	1.000	0	0	% 102,010000	1.020.100,00	3,89
2,750000000% Niedersachsen, Land Landessch.v.11(21) Ausg.212	DE0001590545		EUR	500	0	0	% 102,663500	513.317,50	1,96
0,000000000% Niedersachsen, Land Landessch.v.17(22) Ausg.867	DE000A2DAHGO		EUR	750	250	0	% 100,660231	754.951,73	2,88
0,000000000% Schleswig-Holstein, Land FLR-Landes-schatz.v.15(21) A.1	DE000SHFM477		EUR	500	0	0	% 100,473500	502.367,50	1,91
1,125000000% Hessen, Land Schatzanw. S.1402 v.2014(2021)	DE000A1RQBY4		EUR	500	0	0	% 101,749328	508.746,64	1,94
0,000000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau FLR-MTN v.2018(2023)	DE000A2GSNU4		EUR	500	0	0	% 101,374500	506.872,50	1,93
0,500000000% Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2014 (2021)	DE000RLP0603		EUR	500	0	0	% 100,843000	504.215,00	1,92
0,000000000% Schleswig-Holstein, Land FLR-Landes-schatz.v.15(23) A.2	DE000SHFM469		EUR	1.000	400	0	% 101,342500	1.013.425,00	3,86
0,348000000% Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2018(2021)	DE000A14JY62		EUR	1.900	0	0	% 100,524500	1.909.965,50	7,28
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	15.638.079,22	59,60
Nicht notierte Wertpapiere									
Zertifikate									
Banca Crediinvest. Z. Speedlab AI Bond AMC 20/25	CH0516551717		STK	21.000	21.000	0	EUR 97,267154	2.042.610,23	7,79
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR	2.042.610,23	7,79
Summe Wertpapiervermögen							EUR	17.680.689,45	67,39

Vermögensaufstellung zum 30.11.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.11.2020	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum						
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)											
Zins-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten											
Zinsterminkontrakte											
Euro Bund Futures 08.12.2020		XEUR	EUR	6.000.000						72.000,00	0,28
Euro-BOBL-Futures 08.12.2020		XEUR	EUR	-16.000.000						1.600,00	0,01
Euro-Schatz-Future 08.12.2020		XEUR	EUR	22.000.000						-2.200,00	-0,01
BTP Italien 08.12.2020		XEUR	EUR	-4.000.000						-9.490,00	-0,04
OAT 08.12.2020		XEUR	EUR	6.000.000						-4.020,00	-0,02
Long Gilt Futures (No.7) 29.03.2021		IFEU	GBP	-5.000.000						0,00	0,00
Summe der Zinsterminkontrakte									EUR	57.890,00	0,22
Bankguthaben											
EUR - Guthaben bei:											
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	2.356.295,58						2.356.295,58	8,98
Bank: National-Bank AG			EUR	3.287.855,21						3.287.855,21	12,53
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	2.756.012,14						2.756.012,14	10,50
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:											
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	45,78						38,33	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			GBP	82.499,86						92.147,73	0,35
Summe der Bankguthaben									EUR	8.492.348,99	32,36
Sonstige Vermögensgegenstände											
Zinsansprüche			EUR	43.706,57						43.706,57	0,17
Summe sonstige Vermögensgegenstände									EUR	43.706,57	0,17
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-37.158,98					EUR	-37.158,98	-0,14
Fondsvermögen									EUR	26.237.476,03	100 2)
D&R SpeedLab eQuant Income I											
Anteilwert									EUR	94,99	
Umlaufende Anteile									STK	62.396	
D&R SpeedLab eQuant Income P											
Anteilwert									EUR	93,37	
Umlaufende Anteile									STK	64.006	
D&R SpeedLab eQuant Income V											
Anteilwert									EUR	98,47	
Umlaufende Anteile									STK	145.571	

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 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 11.571.056.508,47 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 30.11.2020	
Britisches Pfund		GBP	0,895300	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar		USD	1,194450	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel				
b) Terminbörsen				
XEUR		EUREX DEUTSCHLAND		
IFEU		INTERCONTINENTAL EXCHANGE		

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,000000000% Bremen, Freie Hansestadt FLR-LandSchatz.A.188 v.13(20)	DE000A1K0V76	EUR	-	500	
0,000000000% Nordrhein-Westfalen, Land FLR-Landessch.v.15(20) R.1381	DE000NRWOHM6	EUR	-	500	
0,100000000% LfA Förderbank Bayern Inh.-Schv.R.1162 v.15(19)	DE000LFA1628	EUR	-	1.000	
0,000000000% NATIXIS Pfandbriefbank AG FLR-MTN-HPF Ser.17 v.14(20)	DE000A1YC1M5	EUR	-	500	
0,001000000% Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatz-anw.A.1 16(20)	DE000A1YQCJ9	EUR	-	800	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswerte: Bundesrep.Deutschland Euro-SCHATZ synth. Anleihe, 8,5-10,5Yr. French Government Bonds (synth. Anleihe), Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe, Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe), Italien		EUR			2.729.148,47
Basiswert: Großbritannien Long Gilt synth.Anleihe		GBP			289.520,29
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswerte: 8,5-10,5Yr. French Government Bonds (synth. Anleihe), Bundesrep.Deutschland Euro-SCHATZ synth. Anleihe, Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe, Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe), Italien		EUR			2.427.760,13
Basiswert: Großbritannien Long Gilt synth.Anleihe		GBP			259.591,75

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

für den Zeitraum vom 01. Dezember 2019 bis 30. November 2020	D&R SpeedLab eQuant Income I	D&R SpeedLab eQuant Income P	D&R SpeedLab eQuant Income V
I. Erträge			
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR 23.136,97	23.317,82	64.152,85
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR 788,35	794,88	2.191,01
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR -9.942,01*)	-9.957,38*)	-27.603,79*)
4. Sonstige Erträge	EUR 369,52	369,59	81,19
Summe der Erträge	EUR 14.352,84	14.524,91	38.821,26
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR 247,95	252,18	578,26
2. Verwaltungsvergütung	EUR -53.186,59	-90.669,23	-21.287,22
3. Verwahrstellenvergütung	EUR -2.954,32	-3.022,19	-7.094,06
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR -3.113,12	-3.163,70	-5.654,12
5. Sonstige Aufwendungen	EUR -132,02	-134,23	-320,10
6. Aufwandsausgleich	EUR 477,66	2.203,92	-4.901,10
Summe der Aufwendungen	EUR -58.660,44	-94.533,25	-38.678,34
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR -44.307,60	-80.008,34	142,92
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	EUR 1.751.847,11	1.806.137,88	4.363.532,40
2. Realisierte Verluste	EUR -1.587.692,49	-1.641.857,42	-3.971.276,33
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR 164.154,62	164.280,46	392.256,07
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR 119.847,02	84.272,12	392.398,99
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR 12.561,71	13.013,77	32.144,18
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR -21.704,02	-21.273,45	-58.281,53
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR -9.142,31	-8.259,68	-26.137,35
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR 110.704,71	76.012,44	366.261,64

*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen in Höhe von EUR 10.990,67 in der Anteilklasse I, EUR 11.018,32 in der Anteilklasse P sowie in Höhe von EUR 30.506,13 in der Anteilklasse V

Entwicklung des Sondervermögens 2020

	D&R SpeedLab eQuant Income I	D&R SpeedLab eQuant Income P	D&R SpeedLab eQuant Income V
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR 6.176.123,29	EUR 6.283.693,32	EUR 14.405.739,79
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR -356.293,00	EUR -377.997,14	EUR -418.125,89
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR 0,00	EUR 11.181,69	EUR 1.651.231,11
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR -356.293,00	EUR -389.178,83	EUR -2.069.357,00
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR -3.506,20	EUR -5.742,47	EUR -19.394,46
3. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR 110.704,71	EUR 76.012,44	EUR 366.261,64
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR 12.561,71	EUR 13.013,77	EUR 32.144,18
davon nicht realisierte Verluste:	EUR -21.704,02	EUR -21.273,45	EUR -58.281,53
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR 5.927.028,80	EUR 5.975.966,15	EUR 14.334.481,08

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt		je Anteil
D&R SpeedLab eQuant Income V			
I. Für die Ausschüttung verfügbar			
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR	12.683,72	0,09
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	392.398,99	2,70
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR	3.971.276,33	27,28
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet			
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	-2.226.186,87	-15,29
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	-2.150.172,16	-14,77
III. Gesamtausschüttung	EUR	0,00	0,00
1. Endausschüttung			
a) Barausschüttung	EUR	0,00	0,00

3) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung i.H.v. EUR 0,00)

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt		je Anteil
D&R SpeedLab eQuant Income I			
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	119.847,02	1,51
2. Zuführung aus dem Sondervermögen 4)	EUR	1.587.692,49	20,50
II. Wiederanlage	EUR	1.707.539,51	22,01
D&R SpeedLab eQuant Income P			
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	84.272,12	1,32
2. Zuführung aus dem Sondervermögen 4)	EUR	1.641.857,42	25,65
II. Wiederanlage	EUR	1.726.129,54	26,97

4) 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	
D&R SpeedLab eQuant Income I				
Auflegung 15.01.2018	EUR	5.000.000,00	EUR	100,00
2018	EUR	8.145.029,07	EUR	96,05
2019	EUR	6.176.123,29	EUR	93,26
2020	EUR	5.927.028,80	EUR	94,99
D&R SpeedLab eQuant Income P				
Auflegung 15.01.2018	EUR	5.000.000,00	EUR	100,00
2018	EUR	7.119.084,55	EUR	95,53
2019	EUR	6.283.693,32	EUR	92,20
2020	EUR	5.975.966,15	EUR	93,37
D&R SpeedLab eQuant Income V				
Auflegung 31.05.2018	EUR	500.000,00	EUR	100,00
2018	EUR	15.574.234,58	EUR	98,08
2019	EUR	14.405.739,79	EUR	95,93
2020	EUR	14.334.481,08	EUR	98,47

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 82.735.923,35

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 67,39
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,22

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 0,10 %
größter potentieller Risikobetrag 1,65 %
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag 0,88 %

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 3,20

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

EURO STOXX 50 Index In EUR 25,00 %
iBoxx EUR Eurozone Total Return Index in EUR 75,00 %

Sonstige Angaben

D&R SpeedLab eQuant Income I

Anteilwert EUR 94,99
Umlaufende Anteile STK 62.396

D&R SpeedLab eQuant Income P

Anteilwert EUR 93,37
Umlaufende Anteile STK 64.006

D&R SpeedLab eQuant Income V

Anteilwert EUR 98,47
Umlaufende Anteile STK 145.571

	D&R SpeedLab eQuant Income I	D&R SpeedLab eQuant Income P	D&R SpeedLab eQuant Income V
Währung	EUR	EUR	EUR
Verwaltungsvergütung	0,90% p.a.	1,50% p.a.	0,15% p.a.
Ausgabeaufschlag	3%	3%	3%
Ertragsverwendung	thesaurierend	thesaurierend	ausschüttend
Mindestanlagevolumen	EUR 5.000.000	-	-

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

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

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

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

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

D&R SpeedLab eQuant Income I	1,00 %
D&R SpeedLab eQuant Income P	1,60 %
D&R SpeedLab eQuant Income V	0,24 %

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

Transaktionskosten EUR 301.811,10

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

D&R SpeedLab eQuant Income I	0,00 %
D&R SpeedLab eQuant Income P	0,00 %

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 Aufwandserstattungen.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse I keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse P sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse V keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge:

D&R SpeedLab eQuant Income I: EUR 339,37	Erträge aus zu hohen Abgrenzungen der Portfoliomanagementvergütung
D&R SpeedLab eQuant Income P: EUR 339,37	Erträge aus zu hohen Abgrenzungen der Portfoliomanagementvergütung
D&R SpeedLab eQuant Income V: EUR 81,19	Erträge aus der Auflösung von Rückstellungen

Wesentliche sonstige Aufwendungen:

D&R SpeedLab eQuant Income I: EUR 132,02	Kosten Marktrisikomessung
D&R SpeedLab eQuant Income P: EUR 134,23	Kosten Marktrisikomessung
D&R SpeedLab eQuant Income V: EUR 320,10	Kosten 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 2019 (Portfoliomanagement DONNER & REUSCHEL Luxemburg S.A.)

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	2.410.887
davon feste Vergütung:	EUR	0
davon variable Vergütung:	EUR	0
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	EUR	0

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens: 27

Hamburg, 04. März 2020

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 D&R SpeedLab eQuant Income – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Dezember 2019 bis zum 30. November 2020, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. November 2020, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Dezember 2019 bis zum 30. November 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 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 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 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.

INVEST 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 05. März 2021

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner 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:
€ 20.059.012,13
(Stand: 31.12.2019)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 24.100.000,00
Eigenmittel gem.
Kapitaladäquanzverordnung (CRR):
€ 267.959.000,00
(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
www.hansainvest.de