

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

# JAHRESBERICHT

Strategie Welt Select

31. Dezember 2023

## 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 01.01.2023 bis 31.12.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

# Tätigkeitsbericht Strategie Welt Select vom 01.01.2023 bis 31.12.2023

## 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

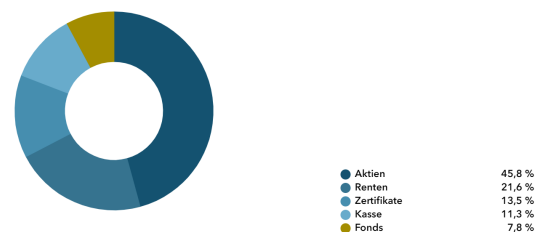
Das Fondsvolumen wurde im Berichtsjahr 2023 vornehmlich in die Assetklassen Aktien, festverzinsliche Wertpapiere und Edelmetalle/Rohstoffe investiert. Basierend auf der jeweiligen Markteinschätzung schwankte der Aktienanteil dabei zwischen 38,33 % und 54,3 % - zum Jahresende lag er bei 46,13 %. Aufgrund der im Jahresverlauf entstandenen Überbewertung der Aktienmärkte wurde die Nettoaktienquote temporär mittels Optionen und Futures deutlich reduziert. Dies erklärt die im Jahresverlauf vergleichsweise geringe Volatilität. Der Anteil der Assetklassen Rohstoffe/Edelmetalle betrug zum Jahresende 12,20 % 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 2023 lag bei 10,94 %.

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

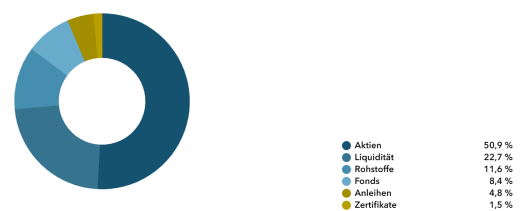
## 3. Portfoliostruktur sowie wesentliche Änderungen im Berichtszeitraum

Portfoliostruktur zum 31.12.2023\*):



*\*) Die Portfoliostruktur berücksichtigt alle Bestandteile der Vermögensaufstellung mit Ausnahme der sonstigen Vermögensgegenstände / sonstige Verbindlichkeiten. Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.*

Portfoliostruktur zum 31.12.2022\*):



*\*) Die Portfoliostruktur berücksichtigt alle Bestandteile der Vermögensaufstellung mit Ausnahme der sonstigen Vermögensgegenstände / sonstige Verbindlichkeiten. Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen 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:

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

Für die realisierten Gewinne sind im Wesentlichen Veräußerungen aus Aktien ursächlich. Für die realisierten Verluste sind im Wesentlichen Veräußerungen von Optionen stockstyled 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 <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>26.675.587,46</b>	<b>100,68</b>
1. Aktien	12.220.888,68	46,13
2. Anleihen	5.723.693,87	21,60
3. Zertifikate	3.600.971,91	13,59
4. Investmentanteile	2.092.280,00	7,90
5. Derivate	-202.740,93	-0,77
6. Bankguthaben	3.188.757,23	12,04
7. Sonstige Vermögensgegenstände	51.736,70	0,20
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-180.601,82</b>	<b>-0,68</b>
1. Kurzfristige Verbindlichkeiten	-82.633,70	-0,31
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-97.968,12	-0,37
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>EUR 26.494.985,64</b>	<b>100,00</b>

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung

### VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
							im Berichtszeitraum			
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>20.575.514,00</b>	<b>77,66</b>
<b>Aktien</b>								<b>EUR</b>	<b>12.220.888,68</b>	<b>46,13</b>
DE0005158703	Bechtle AG		STK	17.300	0	880	EUR	45,4400	786.112,00	2,97
DE0005419105	CANCOM		STK	28.300	5.620	0	EUR	29,7200	841.076,00	3,17
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01		STK	15.000	15.000	0	EUR	59,1600	887.400,00	3,35
NL0000009538	Kon. Philips		STK	37.600	49.099	11.499	EUR	21,1450	795.052,00	3,00
DE0007037129	RWE AG <sup>2)</sup>		STK	20.000	0	2.800	EUR	41,0500	821.000,00	3,10
DE0007164600	SAP SE <sup>2)</sup>		STK	5.500	1.500	3.000	EUR	139,6400	768.020,00	2,90
DE0007165631	Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N.		STK	2.750	2.750	0	EUR	334,7000	920.425,00	3,47
DE0007236101	Siemens <sup>2)</sup>		STK	5.200	5.700	500	EUR	168,4800	876.096,00	3,31
GB00B10RZP78	Unilever PLC		STK	18.000	2.500	0	EUR	43,8500	789.300,00	2,98
US0231351067	Amazon.com Inc.		STK	6.000	7.800	1.800	USD	153,3800	828.558,57	3,13
US3377381088	Fiserv Inc.		STK	6.500	0	0	USD	133,3800	780.561,81	2,95
US5797802064	McCormick & Co. Inc.		STK	12.500	2.500	0	USD	68,2300	767.871,61	2,90
US5949181045	Microsoft Corp.		STK	2.500	2.500	0	USD	375,2800	844.692,54	3,19
US6541061031	Nike		STK	8.150	1.750	0	USD	108,8200	798.490,14	3,01
US2546871060	Walt Disney Co., The		STK	8.800	1.200	0	USD	90,4000	716.233,01	2,70
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>5.096.373,41</b>	<b>19,24</b>
DE0001141794	0.0000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.179 v.2019(24)		EUR	500	500	0	%	99,0660	495.330,00	1,87
XS2102916793	0.1250% Merck Financial Services GmbH MTN v. 2020(25)		EUR	500	500	0	%	95,2500	476.249,95	1,80
XS2199265617	0.3750% Bayer AG MTN-Anleihe v.20(20/24)		EUR	500	500	0	%	98,1390	490.695,00	1,85
XS2443921056	0.6250% Infineon Technologies AG MTN 22/25		EUR	500	500	0	%	96,7255	483.627,52	1,83
DE0001102358	1.5000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 14/24		EUR	500	500	0	%	99,2510	496.255,00	1,87
FR0012969038	1.5000% Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2015(15/25)		EUR	500	500	0	%	97,5310	487.655,00	1,84
XS0857662448	2.3750% McDonald's EO MTN 12/24		EUR	500	500	0	%	98,8320	494.160,00	1,87
XS1062493934	2.8750% AON PLC EO-Notes 2014(14/26)		EUR	500	500	0	%	98,6880	493.440,00	1,86
XS2408458730	2.8750% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2027/2027)		EUR	500	200	0	%	96,4410	482.205,00	1,82
XS0991099630	2.8750% Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2013(13/25)		EUR	500	500	0	%	99,4762	497.380,94	1,88
DE000A2TEDB8	2.8750% thyssenkrupp AG MTN v.19(23/24)		EUR	200	0	0	%	99,6875	199.375,00	0,75
<b>Zertifikate</b>								<b>EUR</b>	<b>3.258.251,91</b>	<b>12,30</b>
JE00B1VS3002	WisdomTree Metal Securiti.Ltd. Physical Palladium ETC 07(unl)		STK	9.000	9.000	0	EUR	94,6200	851.580,00	3,21
DE000A0S9GB0	Xetra-Gold		STK	19.200	0	0	EUR	60,1700	1.155.264,00	4,36



## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
DE000A2UDH55	XTrackers ETC PLC ETC Z15.05.80 Silber		STK	30.847	0	0	EUR	28,3620	874.882,61	3,30
DE000A2T5DZ1	XTrackers ETC PLC ETC Z21.05.80 Gold		STK	13.964	0	0	EUR	26,9640	376.525,30	1,42
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>970.040,46</b>	<b>3,66</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>970.040,46</b>	<b>3,66</b>
XS1939356645	2.2000% General Motors Financial Co. EO-Med.-Term Nts 2019(19/24)		EUR	500	300	0	%	99,4965	497.482,50	1,88
XS1524568679	3.5000% AIV S.A. Compartment 22 EO-Notes 2016(26)		EUR	130	0	250	%	107,8568	129.837,96	0,49
XS1650840983	AIV S.A. Sec.Market NTS06.08.27 Basket		EUR	300	0	0	%	114,2400	342.720,00	1,29
<b>Investmentanteile</b>								<b>EUR</b>	<b>2.092.280,00</b>	<b>7,90</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>								<b>EUR</b>	<b>2.092.280,00</b>	<b>7,90</b>
DE000A0MYQX1	SKAG Euroinvest Corporates		ANT	58.800	0	0	EUR	11,8500	696.780,00	2,63
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF		ANT	10.000	10.000	0	EUR	139,5500	1.395.500,00	5,27
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>23.637.834,46</b>	<b>89,22</b>
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								<b>EUR</b>	<b>-202.740,93</b>	<b>-0,77</b>
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>-143.286,00</b>	<b>-0,54</b>
<b>Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>-143.286,00</b>	<b>-0,54</b>
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>								<b>EUR</b>	<b>-143.286,00</b>	<b>-0,54</b>
Call RWE 40,000000000 16.02.2024		XEUR	STK	-20.000			EUR	1,9200	-38.400,00	-0,14
Call SAP 142,000000000 16.02.2024		XEUR	STK	-5.500			EUR	3,8200	-21.010,00	-0,08
Call Siemens 154,000000000 16.02.2024		XEUR	STK	-5.200			EUR	16,1300	-83.876,00	-0,32
<b>Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>-131.256,50</b>	<b>-0,50</b>
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								<b>EUR</b>	<b>17.650,00</b>	<b>0,07</b>
MDAX Mini Futures 15.03.2024		XEUR	EUR Anzahl	50					17.650,00	0,07
<b>Optionsrechte</b>								<b>EUR</b>	<b>-148.906,50</b>	<b>-0,56</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>								<b>EUR</b>	<b>-148.906,50</b>	<b>-0,56</b>
Call DAX 5th Friday 15900,000000000 29.12.2023		XEUR	Anzahl	-37			EUR	804,9000	-148.906,50	-0,56
<b>Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>								<b>EUR</b>	<b>71.801,57</b>	<b>0,27</b>
<b>Währungsterminkontrakte</b>								<b>EUR</b>	<b>71.801,57</b>	<b>0,27</b>
FUTURES EUR/USD 09/23		XCME	USD	3.125.000					71.801,57	0,27
<b>Bankguthaben</b>								<b>EUR</b>	<b>3.188.757,23</b>	<b>12,04</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>								<b>EUR</b>	<b>2.660.767,42</b>	<b>10,04</b>
Bank: Hamburger Volksbank			EUR	773.110,52					773.110,52	2,92

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
	Bank: ODDO BHF-Bank AG		EUR	221.268,59				221.268,59	0,84
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		EUR	1.666.388,31				1.666.388,31	6,29
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>527.989,81</b>	<b>1,99</b>
	Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		NOK	5.946.274,09				527.989,81	1,99
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>51.736,70</b>	<b>0,20</b>
	Dividendenansprüche		EUR	6.873,01				6.873,01	0,03
	Zinsansprüche		EUR	44.863,69				44.863,69	0,17
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-82.633,70</b>	<b>-0,31</b>
	Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen		USD	-91.781,25				-82.633,70	-0,31
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-97.968,12</b>	<b>-0,37</b>
	Sonstige Verbindlichkeiten <sup>3)</sup>		EUR	-97.968,12				-97.968,12	-0,37
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>26.494.985,64</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert Strategie Welt Select</b>							<b>EUR</b>	<b>26,47</b>	
<b>Umlaufende Anteile Strategie Welt Select</b>							<b>STK</b>	<b>1.001.025,955</b>	

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

<sup>2)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren. Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind: 2.465.116,00 EUR.

<sup>3)</sup> noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellungsvergütung, Verwaltungsvergütung, Performance Fee

## WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per 29.12.2023		
Norwegische Krone	(NOK)	11,262100	=	1 Euro (EUR)	
US-Dollar	(USD)	1,110700	=	1 Euro (EUR)	

## MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XCME	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Kon.	STK	0	24.330
FR0000120073	Air Liquide	STK	0	5.610
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK	0	6.400
US0970231058	Boeing Co.	STK	0	4.200
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK	0	42.500
DE000A0Z2Z5	freenet	STK	0	33.970
KYG596691041	Meituan Registered Shs Cl.B o.N.	STK	1.770	1.770
DE000DU25071	Meituan Registered Shs Cl.B o.N.	STK	1.770	1.770
DE0008430026	Münchener Rückversicherung AG	STK	0	60
KYG875721634	Tencent Holdings Ltd.	STK	0	17.700
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
XS0203470157	3.4890% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	EUR	0	100
<b>Zertifikate</b>				
DE000A2UDH63	XTrackers ETC PLC ETC Z29.05.80 Platin	STK	0	14.596
<b>Investmentanteile</b>				
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
LU1534068801	Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile FC o.N.	ANT	0	800
LU2220514017	DWS Invt-DWS Invt Sh.Dur.Inc. Act. au Port. FC EUR Acc. oN	ANT	0	2.180
IE00BYVQ9F29	iShsVII-NASDAQ 100 UCITS ETF Reg. Shares EUR Hd (Acc) o.N.	ANT	81.000	81.000
LU1569816132	JPMorg.Inv.-Gl.Conv.Conserv.Fd A.N.JPM G.C.USD C(acc)EUR h oN	ANT	0	3.575
LU0338461691	PVV-PVV Unternehmensanlei.Plus Inhaber-Anteile o.N.	ANT	0	6.100
<b>Geldmarktfonds</b>				
<b>Gruppenfremde Geldmarktfonds</b>				
LU0346393704	Fidelity Fds-Euro Short Ter.Bd Reg. Shares Y Acc. EUR o.N.	ANT	0	15.000

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
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>				
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			8.938
Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe)				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			5.368
MDAX Performance-Index)				

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
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			11.303
DAX Index)				
<b>Optionsrechte</b>				
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			160
Ahold Delhaize N.V.				
Beiersdorf AG				
Deutsche Telekom AG				
Kon.				
RWE AG				
SAP SE				
Siemens)				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			6.446
DAX Index)				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			68
DAX Index)				

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

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2023 BIS 31.12.2023

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden inländischer Aussteller		65.165,65
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		94.616,40
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		20.892,21
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		59.075,56
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		98.384,09
davon negative Habenzinsen	-3,53	
6. Erträge aus Investmentanteilen		9.452,06
7. Abzug ausländischer Quellensteuer		-11.177,18
8. Sonstige Erträge		341,20
<b>Summe der Erträge</b>		<b>336.749,99</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-10,33
2. Verwaltungsvergütung		-442.491,82
a) fix	-387.410,67	
b) performanceabhängig	-55.081,15	
3. Verwahrstellenvergütung		-14.406,83
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-9.368,54
5. Sonstige Aufwendungen		-11.058,13
6. Aufwandsausgleich		-19.318,01
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-496.653,66</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>-159.903,67</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		2.845.745,71
2. Realisierte Verluste		-1.280.742,06
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>1.565.003,65</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>1.405.099,98</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		689.576,46
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		452.238,16
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>1.141.814,62</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>2.546.914,60</b>

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS STRATEGIE WELT SELECT

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.01.2023)</b>		<b>22.133.074,06</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		1.863.240,40
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	3.069.694,02	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.206.453,62	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-48.243,42
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.546.914,60
davon nicht realisierte Gewinne	689.576,46	
davon nicht realisierte Verluste	452.238,16	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.12.2023)</b>		<b>26.494.985,64</b>

**VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS STRATEGIE WELT SELECT <sup>1)</sup>**

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Für die Wiederanlage verfügbar</b>	<b>2.685.842,04</b>	<b>2,68</b>
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	1.405.099,98	1,40
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	1.280.742,06	1,28
<b>II. Wiederanlage</b>	<b>2.685.842,04</b>	<b>2,68</b>

<sup>1)</sup> 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
2023	26.494.985,64	26,47
2022	22.133.074,06	23,86
2021	23.817.512,31	24,01
2020	19.643.457,21	22,81

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	4.451.764,61
<b>Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte</b>		
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		
ODDO BHF-Bank AG		
<b>Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.</b>		
<b>Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)</b>		
MSCI - World Index		70,00%
EUR Short-Term Rate		30,00%
<b>Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV</b>		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,74%
größter potenzieller Risikobetrag		1,45%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		1,12%
<b>Risikomodell (§10 DerivateV)</b>		Full-Monte-Carlo
<b>Parameter (§11 DerivateV)</b>		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr
<b>Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte</b>		<b>1,29</b>

### 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	26,47
Umlaufende Anteile Strategie Welt Select	STK	1.001.025,955

### 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	0,23 %
Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	1,74 %

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 01.01.2023 BIS 31.12.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	107.968.516,06
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	0,00
Relativ in %	0,00 %

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 32.340,67 EUR

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

## AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurden keine Pauschalvergütungen an die Kapitalverwaltungsgesellschaft oder an Dritte gezahlt.

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersatzungen.

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

## VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
LU1534068801	Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile FC o.N. <sup>1)</sup>	0,12
LU2220514017	DWS Invt-DWS Invt Sh.Dur.Inc. Act. au Port. FC EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	0,45
LU0346393704	Fidelity Fds-Euro Short Ter.Bd Reg. Shares Y Acc. EUR o.N. <sup>1)</sup>	0,30
IE00BYVQ9F29	iShsVII-NASDAQ 100 UCITS ETF Reg. Shares EUR Hd (Acc) o.N. <sup>1)</sup>	0,36
LU1569816132	JPMorg.Inv.-Gl.Conv.Conserv.Fd A.N.JPM G.C.USD C(acc)EUR h oN <sup>1)</sup>	0,75
LU0338461691	PVV-PVV Unternehmensanlei.Plus Inhaber-Anteile o.N. <sup>1)</sup>	0,09
DE000A0MYQX1	SKAG Euroinvest Corporates <sup>1)</sup>	0,40
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF <sup>1)</sup>	0,15

<sup>1)</sup> Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

## WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

Strategie Welt Select		
<b>Sonstige Erträge</b>		
Kick-Back-Zahlungen	EUR	341,20
<b>Sonstige Aufwendungen</b>		
Depotgebühren	EUR	6.324,62

## 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 Tarifvertrag für das private Versicherungsgewerbe. 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 und die Generalbevollmächtigten 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 2023 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)</b>	<b>EUR</b>	<b>26.098.993</b>
davon feste Vergütung	EUR	21.833.752
davon variable Vergütung	EUR	4.265.241
<b>Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen</b>	<b>EUR</b>	<b>0</b>
<b>Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)</b>		<b>332</b>
<b>Höhe des gezahlten Carried Interest</b>	<b>EUR</b>	<b>0</b>
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen</b>	<b>EUR</b>	<b>1.475.752</b>
davon Geschäftsleiter	EUR	1.105.750
davon andere Führungskräfte	EUR	370.002

## 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 Vermögensverwaltung GmbH	
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>EUR</b>	<b>794.030,34</b>
davon feste Vergütung	EUR	794.030,34
davon variable Vergütung	EUR	0,00
<b>Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen</b>	<b>EUR</b>	<b>0,00</b>
<b>Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens</b>		<b>8</b>

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

## 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 Stimmrechtsvertretern

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 Wertpapierleihegeschäfte abgeschlossen worden.  
Auf der Internetseite der HANSAINVEST sind Informationen zum Umgang mit Interessenkonflikten verfügbar.

Hamburg, 19. April 2024

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 Strategie Welt Select – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsur-

teil zum Jahresbericht zu dienen.

### Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

### Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicher-

heit, 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 Jah-

resberichts 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 22.04.2024

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner  
Wirtschaftsprüfer

Lüning  
Wirtschaftsprüfer

## Allgemeine Angaben

### KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft  
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96

Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70

E-Mail: [info@hansainvest.de](mailto:info@hansainvest.de)

Web: [www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)

Haftendes Eigenkapital: 28,189 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2022

### GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

### AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
  - Vorsitzender
  - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth (bis zum 07.11.2023)
  - stellvertretender Vorsitzender
  - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Dr. Stefan Lemke (ab dem 15.02.2024)
  - stellvertretender Vorsitzender
  - stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, Mitglied des Vorstandes 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 sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG)
- Nicholas Brinckmann (bis zum 10.02.2024)
  - (zugleich Sprecher der Geschäftsführung HANSAINVEST Real Assets GmbH)
- Claudia Pauls (ab dem 01.04.2024)
- 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: 575,597 Mio. EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 28,839 Mio. EUR  
Stand: 31.12.2022

## **WIRTSCHAFTSPRÜFER**

---

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Fuhlentwiete 5  
20355 Hamburg  
Deutschland

**HANSAINVEST**

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der  
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8  
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

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

**HANSA**INVEST