

# Halbjahresbericht zum 31. Januar 2021

Aramea OptionsStrategien

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Aramea OptionsStrategien

in der Zeit vom 1. August 2020 bis 31. Januar 2021.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 19,40% in der R-Class.  
Die I-Class wurde zum 9. November 2020 aufgelöst.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des  
Sondervermögens im Detail per Ende Januar darstellte. Wenn Sie darüber hinaus einen  
aktuellen Einblick in den Fonds bekommen und unsere Einschätzung der Märkte  
kennlernen möchten, besuchen Sie unseren Internetauftritt: Unter [www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)  
veröffentlichen wir regelmäßig einen Kommentar des Fondsmanagements. Abseits  
dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre  
HANSAINVEST-Geschäftsführung

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

Hamburg, im März 2021

## So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 31. Januar 2021 .....	4
Vermögensaufstellung per 31. Januar 2021 .....	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	8
Wichtige Mitteilung an unsere Anleger .....	9
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	10

# Vermögensübersicht per 31. Januar 2021

Fondsvermögen: EUR 585,13 (4.893.903,60)

Umlaufende Anteile: Class R 110,34 (982)

Class I \*) 0 (50.000)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.07.2020
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
<b>1. Anleihen</b>	0	0,00	(83,84)
<b>2. Derivate</b>	0	0,00	(-0,37)
<b>3. Bankguthaben</b>	11	1.937,60	(6,43)
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	2	307,62	(10,40)
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	-13	-2.145,22	(-0,30)
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>0</b>	<b>100,00</b>	

\*) Die Anteilklasse I wurde zum 09.11.2020 aufgelöst

# Vermögensaufstellung per 31. Januar 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	11.338,67				11.338,67	1.937,80
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>11.338,67</b>	<b>1.937,80</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Sonstige Ansprüche			EUR	1.800,00				1.800,00	307,62
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>1.800,00</b>	<b>307,62</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>									
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen			CHF	-1,29				-1,20	-0,20
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-1,20</b>	<b>-0,20</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>			<b>EUR</b>	<b>-12.552,34</b>			<b>EUR</b>	<b>-12.552,34</b>	<b>-2.145,22</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>585,13</b>	<b>100 2)</b>
<b>Aramea OptionsStrategien R</b>									
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>110,34</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>4</b>	

## Fußnoten:

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

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen 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 4.725.524,60 EUR.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 29.01.2021	
Schweizer Franken	CHF	1,077050	= 1 Euro (EUR)

## 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>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,375000000% Aktia Bank PLC EO-Cov. MTN 18/23	XS1827629384	EUR	-	100	
0,155000000% Asahi Group Holdings Ltd. EO-Notes 2020(20/24)	XS2242747181	EUR	100	100	
1,000000000% B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2015(22/22)	XS1324928750	EUR	-	100	
0,750000000% Bayer AG MTN-Anleihe v.20(20/27)	XS2199266003	EUR	-	100	
0,750000000% Banco Com. Português SA (BCP) EO-Obr. Hipotecarias 17/22	PTBCPIOM0057	EUR	-	100	
0,000000000% Bank of Nova Scotia, The EO-FLR MTN 19/21	XS1937716022	EUR	-	200	
0,125000000% BMW Finance N.V. EO-MTN 17/21	XS1548436556	EUR	-	100	
0,625000000% British Telecommunications PLC EMTN 16/21	XS1377680381	EUR	-	100	
0,500000000% Capgemini SE EO-Nts 16/21	FR0013218138	EUR	-	100	
0,625000000% Capgemini SE EO-Notes 2020(20/25)	FR0013519048	EUR	-	100	
0,500000000% China Development Bank EO-Medium-Term Notes 2016(21)	XS1422314689	EUR	-	200	
0,875000000% Covestro AG Medium Term Notes v.20(20/25)	XS2188805688	EUR	-	100	
1,250000000% CRH SMW Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2020(20/26)	XS2168478068	EUR	-	100	
0,200000000% Daimler Intl Finance B.V. EO-MTN 17/21	DE000A19NY87	EUR	-	100	
0,250000000% Dexia Crédit Local S.A. EO-Med.-T. Nts 2018(23) Reg.S	XS1829348793	EUR	-	100	
0,375000000% Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(21)	XS1557095459	EUR	-	100	
0,869000000% FCE Bank PLC EO-Medium-Term Notes 2017(21)	XS1548776498	EUR	-	100	
1,000000000% Givaudan SA SF-Anl. 2020(27)	XS2126169742	EUR	-	100	
1,625000000% Glencore Finance Europe EO-MTN 14/21/22	XS1110430193	EUR	-	100	
0,079000000% Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2017(22/23)	XS1691349523	EUR	-	100	
0,500000000% Imperial Brands Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/21)	XS1558013014	EUR	-	100	
0,250000000% Jyske Realkredit A/S EO-Cov. Bonds 2016(23)	XS1435774903	EUR	-	100	
0,750000000% Lloyds Banking Group PLC EO-MTN 16/21	XS1517181167	EUR	-	100	
0,625000000% McKesson Corp. EO-Notes 2017(17/21)	XS1567173809	EUR	100	200	
1,000000000% Mondelez International Inc. EO-Notes 2015(15/22)	XS1197269647	EUR	-	100	
0,500000000% Orange S.A. EO-MTN 19/22	FR0013396496	EUR	-	200	
0,625000000% PKO Bank Hipoteczny EO-Mortg.-Cov.-MTN 17/23	XS1588411188	EUR	-	100	
0,875000000% Santander Consumer Finance SA EO-Medium-Term Nts 2017(22)	XS1550951641	EUR	-	100	
0,000000000% Schleswig-Holstein, Land FLR-Landesschatz.v.15(21) A.1	DE000SHFM477	EUR	-	100	
1,500000000% Sky Ltd. EO-Medium-Term Notes 2014(21)	XS1109741246	EUR	-	100	
0,273000000% Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 2017(24)	XS1616341829	EUR	-	100	
1,491000000% TOTAL CAP.INTL 20/27 MTN	XS2153406868	EUR	-	200	
0,750000000% Vivendi S.A. EO-Bonds 2016(16/21)	FR0013176302	EUR	-	100	
0,750000000% Volkswagen Bank GmbH Med.Term.Nts. v.17(23)	XS1734548487	EUR	-	50	
0,250000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(20)	XS1692348847	EUR	-	100	

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,000000000% Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 19(21)	FR0013398278	EUR	-	200	
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,500000000% AbbVie Inc. EO-Notes 2020(20/21) 144A	XS2117754247	EUR	-	100	
<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 Aktienindex-Terminkontrakte:</b>					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: E-Mini S&P 500 Index Futures		USD			73,92
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: E-Mini S&P 500 Index Futures		USD			50,69
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>					
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte:</b>					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: 30-Year U.S. Treasury Bond		USD			51,53
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: 30-Year U.S. Treasury Bond		USD			18,41

# 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 %)	0,00
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

## Sonstige Angaben

### Aramea OptionsStrategien R

Anteilwert	EUR	110,34
Umlaufende Anteile	STK	4

## 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.

## An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

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 Aramea OptionsStrategien R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

## 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

# Wichtige Mitteilung an unsere Anleger

## Kündigung der Verwaltung des Sondervermögens Aramea OptionsStrategien (Aramea OptionsStrategien I ISIN: DE000A2H68U6 Aramea OptionsStrategien R ISIN: DE000A2H68T8)

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH kündigt ihr Verwaltungsrecht an dem Sondervermögen **Aramea OptionsStrategien** gemäß § 99 Abs. 1 des Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) in Verbindung mit § 21 Abs. 1 der Allgemeinen Anlagebedingungen mit Wirkung zum 30. April 2021, 24:00 Uhr.

Mit Wirksamwerden der Kündigung geht das Verfügungsrecht über das Sonder-

vermögen gemäß § 100 Abs. 1 Nr. 2 KAGB in Verbindung mit § 21 Abs. 2 der Allgemeinen Anlagebedingungen auf die Verwahrstelle, die DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, über, die das Sondervermögen abwickelt und den Liquidationserlös an die Anteilinhaber verteilt.

Anteile des Sondervermögens können bis zum Orderannahmeschluss am 23. April 2021 zurückgegeben werden.

Ab sofort werden keine Anteilscheine für dieses Sondervermögen mehr ausgegeben.

Hamburg, den 28.10.2020

Die Geschäftsleitung

# 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](http://www.hansainvest.com)  
E-Mail: [service@hansainvest.de](mailto: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](mailto:service@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)