

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

ABSOLUTE Volatility

31. Oktober 2022

HANSAINVEST

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

ABSOLUTE Volatility

in der Zeit vom 01.11.2021 bis 31.10.2022.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht ABSOLUTE Volatility

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2021 / 2022

Der vorliegende Tätigkeitsbericht informiert Sie über die Entwicklung des ABSOLUTE Volatility (im Folgenden auch das „Sondervermögen“) für den Berichtszeitraum 01.11.2021 - 31.10.2022.

Anlageziele

Das Anlageziel des ABSOLUTE Volatility ist das Erwirtschaften einer positiven und vom vorherrschenden Konjunktur- und Zinszyklus unabhängigen Performance. Das Sondervermögen strebt den Wertzuwachs durch die systematische Vereinnahmung von Volatilitätsrisikoprämien an. Es diversifiziert über Assetklassen, Regionen und Handelsfrequenzen. Eine kontinuierliche und regelbasierte Steuerung des Portfoliorisikos soll Verluste bei Marktverwerfungen konsequent begrenzen und zu einer stetigen am ZIELERTRAG ausgerichteten Wertsteigerung führen.

Anlagepolitik

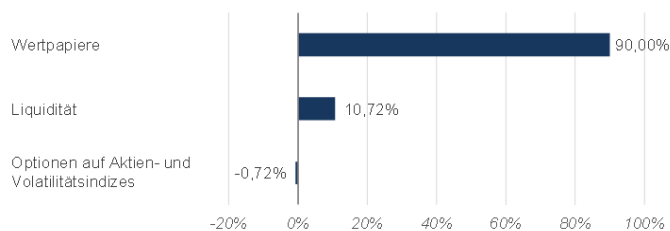
Das Portfoliomanagement setzt die Anlagestrategie dynamisch auf täglicher Basis um. Dabei werden im Wesentlichen liquide derivative Finanzinstrumente wie beispielsweise börsengehandelte Index-Futures und -Optionen eingesetzt. Die Asset-Allokation wird auf Grundlage eines mathematischen Modells festgelegt und die Transaktionen durch das Portfoliomanagement implementiert.

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

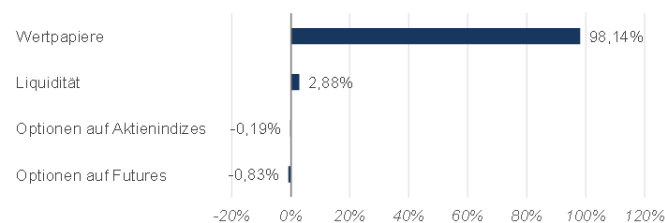
Das Basisportfolio des Sondervermögens wird in auf Euro lautende variabel verzinsliche Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit einem geringen Ausfallrisiko („Investment Grade“) angelegt.

Portfoliostruktur *)

Zum 31.10.2022 stellt sich die Portfoliostruktur des ABSOLUTE Volatility wie folgt dar:



Zum 31.10.2021 stellt sich die Portfoliostruktur des ABSOLUTE Volatility wie folgt dar:



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

Risikoanalyse

Marktpreisrisiken:

Marktpreisrisiken bestehen dahingehend, dass die im Sondervermögen befindlichen Derivate und Wertpapiere abhängig von den Entwicklungen der Kapitalmärkte sind. Darüber hinaus besteht bei den eingesetzten Optionen ein Risiko aus der Veränderung der impliziten Volatilität, welche die Marktpreise erheblich beeinflussen kann. Starke Veränderungen in den Marktpreisen können zu Verlusten im Sondervermögen führen. Die systematische Begrenzung von Marktpreisrisiken ist Teil der implementierten Risikosteuerung im ABSOLUTE Volatility.

Adressenausfallrisiko:

Adressenausfallrisiken resultieren aus dem möglichen Ausfall von Zins- und Tilgungszahlungen der Einzelinvestments in **Renten**, die so weit wie möglich diversifiziert werden, um Konzentrationsrisiken zu verringern.

Dies betrifft nicht nur die Auswahl der Schuldner, sondern auch die Auswahl der Sektoren und Länder.

Zinsänderungsrisiko:

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.

Währungsrisiko:

Die Finanzinstrumente können in einer anderen Währung als der Währung des Sondervermögens angelegt sein. Der Fonds erhält die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der anderen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert solcher Anlagen und somit auch der Wert des Fondsvermögens.

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.

Kredit- und Liquiditätsrisiken:

Kredit- und Liquiditätsrisiken spielen eine untergeordnete Rolle. Das Sondervermögen investiert ausschließlich in liquide, börsengehandelte Derivate und in Wertpapiere mit geringem Ausfallrisiko, die kurzfristig veräußerbar sind.

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.

Sonstige Risiken:

Die Ausbreitung der Atemwegserkrankung COVID-19 hat weltweit zu massiven Einschnitten in das öffentliche Leben mit erheblichen Folgen u.a. für die Wirtschaft und deren Unternehmen geführt. In diesem Zusammenhang kam es zu hohen Kursschwankungen an den Kapitalmärkten. Die weiteren Auswirkungen von COVID-19 auf die Realwirtschaft bzw. die Finanzmärkte sind auch weiterhin mit Unsicherheiten behaftet.

Seit dem 24.02.2022 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.

Veräußerungsergebnis

Das Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften in beiden Anteilklassen resultiert im Wesentlichen aus Gewinnen und Verlusten aus dem Handel mit Optionen.

Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Sondervermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg. Das Portfoliomanagement für den ABSOLUTE Volatility ist an die SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH, Hamburg ausgelagert. Hierbei handelt es sich um eine Schwester-gesellschaft der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH. Als Fondsberater ist die ABSOLUTE Asset Management GmbH, Frankfurt am Main tätig.

Weitere sonstige wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	4.823.846,58	100,23
1. Anleihen	4.326.909,64	89,91
2. Derivate	-34.732,37	-0,72
3. Bankguthaben	527.143,10	10,95
4. Sonstige Vermögensgegenstände	4.526,21	0,09
II. Verbindlichkeiten	-11.281,13	-0,23
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-11.281,13	-0,23
III. Fondsvermögen	EUR 4.812.565,45	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	4.326.909,64	89,91
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	4.326.909,64	89,91
XS1820768130	0,827000000% Swedbank Hypotek AB EO-FLR Med.-T.Cov.Bds 2018(23)		EUR	600	0	0 %	100,1860	601.116,00	12,49
DE000A30VVE6	1,403000000% Deutsche Bank AG FLR-MTN-HPF v.22(27)		EUR	1.000	1.000	0 %	99,5445	995.445,14	20,68
DE000A2DADA2	1,693000000% Mainz, Stadt FLR-Inh.-Schuld.v.2017 (2024)		EUR	700	0	0 %	100,7925	705.547,50	14,66
DE000A2TSTQ2	1,928000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau FLR-MTN v.2019(2023)		EUR	500	600	100 %	100,4800	502.400,00	10,44
DE000A289K97	1,948000000% Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2027)A.523		EUR	700	0	0 %	103,1310	721.917,00	15,00
DE000A1KRJJ1	2,358000000% ING-DiBa AG FLR-Hyp.-Pfandbr. v.2012(2024)		EUR	800	0	0 %	100,0605	800.484,00	16,63
Summe Wertpapiervermögen							EUR	4.326.909,64	89,91
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							EUR	-34.732,37	-0,72
Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	-34.732,37	-0,72
Optionsrechte							EUR	-34.732,37	-0,72
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	-34.732,37	-0,72
Call CBOE VIX 60,000000000 16.11.2022		XCBO	Anzahl	191		USD	0,0750	1.449,46	0,03
Call CBOE VIX 65,000000000 21.12.2022		XCBO	Anzahl	213		USD	0,2450	5.280,28	0,11
Call CBOE VIX 75,000000000 21.12.2022		XCBO	Anzahl	185		USD	0,1850	3.463,02	0,07
Call CBOE VIX 80,000000000 18.01.2023		XCBO	Anzahl	196		USD	0,3050	6.048,77	0,13
Put S&P 500 2300,000000000 20.01.2023		XCBO	Anzahl	39		USD	3,0750	12.134,47	0,25
Put S&P 500 2350,000000000 16.12.2022		XCBO	Anzahl	41		USD	0,7750	3.215,12	0,07
Put S&P 500 2525,000000000 16.12.2022		XCBO	Anzahl	42		USD	1,2250	5.205,91	0,11
Put S&P 500 2700,000000000 18.11.2022		XCBO	Anzahl	42		USD	0,2750	1.168,67	0,02
Put S&P 500 3050,000000000 16.12.2022		XCBO	Anzahl	-22		USD	5,3000	-11.798,04	-0,25
Put S&P 500 3050,000000000 20.01.2023		XCBO	Anzahl	-22		USD	15,0500	-33.501,97	-0,70
Put S&P 500 3225,000000000 16.12.2022		XCBO	Anzahl	-22		USD	9,8500	-21.926,54	-0,46
Put S&P 500 3325,000000000 18.11.2022		XCBO	Anzahl	-21		USD	2,5750	-5.471,52	-0,11
Bankguthaben							EUR	527.143,10	10,95
EUR - Guthaben bei:							EUR	439.756,36	9,14
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	439.756,36				439.756,36	9,14
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	87.386,74	1,82
Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	86.364,32				87.386,74	1,82
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	4.526,21	0,09
Zinsansprüche			EUR	4.526,21				4.526,21	0,09

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.10.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.10.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-11.281,13	-0,23
	Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾		EUR	-11.281,13				-11.281,13	-0,23
	Fondsvermögen						EUR	4.812.565,45	100,00
	Anteilwert ABSOLUTE Volatility I						EUR	918,87	
	Anteilwert ABSOLUTE Volatility P						EUR	912,61	
	Umlaufende Anteile ABSOLUTE Volatility I						STK	3.849,000	
	Umlaufende Anteile ABSOLUTE Volatility P						STK	1.398,000	

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

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.10.2022

US-Dollar	(USD)	0,988300	=	1 Euro (EUR)
-----------	-------	----------	---	--------------

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
------	--------------------------------

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

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzurordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS1137512742	0,000000000% DNB Boligkredit A.S. EO-FLR M.-T. Pfandbr. 14/21	EUR	0	800
DK0009515603	0,309000000% Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Anl. per 2022	EUR	0	800

DERIVATE

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Terminkontrakte				
Wertpapier-Terminkontrakte				
Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			5.042
Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe)				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			8.556
Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe)				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			1.048
ESTX 50 Index (Price) (EUR))				
Währungsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			877
Euro/US-Dollar)				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			7.012
Euro/US-Dollar)				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			111
CBOE VOLATILITY IND.)				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			279
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
S&P 500 Index)				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			836
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
S&P 500 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
Optionsrechte auf Zins-Derivate				
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte: Euro Bund Futures)	EUR			77
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte: Euro Bund Futures)	EUR			191
Optionsrechte auf Devisen-Derivate				
Optionsrechte (Verkauf)				
Optionsrechte auf Devisenterminkontrakte				
(Basiswährungen: Euro FX Futures)	EUR			297

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) ABSOLUTE VOLATILITY I

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2021 BIS 31.10.2022

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		5.337,47
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		1.611,58
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		388,04
davon negative Habenzinsen	-735,78	
4. Sonstige Erträge		3.015,67
Summe der Erträge		10.352,76
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-1,45
2. Verwaltungsvergütung		-21.413,76
a) fix	-21.413,76	
3. Verwahrstellenvergütung		-1.911,08
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-6.790,95
5. Sonstige Aufwendungen		-1.223,40
6. Aufwandsausgleich		-574,04
Summe der Aufwendungen		-31.914,68
III. Ordentlicher Nettoertrag		-21.561,92
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		661.535,26
2. Realisierte Verluste		-1.033.114,67
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-371.579,41
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-393.141,33
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		137.864,25
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-79.813,95
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		58.050,30
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-335.091,03

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) ABSOLUTE VOLATILITY P

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2021 BIS 31.10.2022

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		1.853,50
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		562,52
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		238,42
davon negative Habenzinsen	-189,60	
4. Sonstige Erträge		509,04
Summe der Erträge		3.163,48
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-0,27
2. Verwaltungsvergütung		-8.393,29
a) fix	-8.393,29	
3. Verwahrstellenvergütung		-453,99
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-2.127,07
5. Sonstige Aufwendungen		-360,62
6. Aufwandsausgleich		-5.886,56
Summe der Aufwendungen		-17.221,80
III. Ordentlicher Nettoertrag		-14.058,32
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		254.845,89
2. Realisierte Verluste		-388.372,03
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-133.526,14
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-147.584,46
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		43.853,76
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-36.371,78
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		7.481,98
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-140.102,48

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH)**FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2021 BIS 31.10.2022**

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		7.190,97
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		2.174,10
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		626,46
davon negative Habenzinsen	-925,38	
4. Sonstige Erträge		3.524,71
Summe der Erträge		13.516,24
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-1,72
2. Verwaltungsvergütung		-29.807,05
a) fix	-29.807,05	
3. Verwahrstellenvergütung		-2.365,07
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-8.918,02
5. Sonstige Aufwendungen		-1.584,02
6. Aufwandsausgleich		-6.460,60
Summe der Aufwendungen		-49.136,48
III. Ordentlicher Nettoertrag		-35.620,24
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		916.381,15
2. Realisierte Verluste		-1.421.486,70
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-505.105,55
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-540.725,79
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		181.718,01
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-116.185,73
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		65.532,28
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-475.193,51

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS ABSOLUTE VOLATILITY I

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.11.2021)		3.734.966,89
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		126.586,78
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	126.586,78	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		10.278,89
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		-335.091,03
davon nicht realisierte Gewinne	137.864,25	
davon nicht realisierte Verluste	-79.813,95	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2022)		3.536.741,53

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS ABSOLUTE VOLATILITY P

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.11.2021)		800.497,70
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		559.162,59
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	643.893,31	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-84.730,72	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		56.266,11
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		-140.102,48
davon nicht realisierte Gewinne	43.853,76	
davon nicht realisierte Verluste	-36.371,78	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2022)		1.275.823,92

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		4.535.464,59
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		685.749,37
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	770.480,09	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-84.730,72	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		66.545,00
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		-475.193,51
davon nicht realisierte Gewinne	181.718,01	
davon nicht realisierte Verluste	-116.185,73	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		4.812.565,45

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS ABSOLUTE VOLATILITY I ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	639.973,34	166,27
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-393.141,33	-102,14
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	1.033.114,67	268,41
II. Wiederanlage	639.973,34	166,27

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

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS ABSOLUTE VOLATILITY P ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	240.787,57	172,24
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-147.584,46	-105,57
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	388.372,03	277,81
II. Wiederanlage	240.787,57	172,24

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE ABSOLUTE VOLATILITY I

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2022	3.536.741,53	918,87
2021	3.734.966,89	1.006,46
18.05.2021 Auflegung	1.000,00	1.000,00

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE ABSOLUTE VOLATILITY P

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2022	1.275.823,92	912,61
2021	800.497,70	1.004,39
18.05.2021 Auflegung	1.000,00	1.000,00

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE FÜR DAS GESAMTFONDSVERMÖGEN

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres
	EUR
2022	4.812.565,45
2021	4.535.464,59
18.05.2021 Auflegung	2.000,00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	1.080.290,14
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG		
Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.		
Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)		
S&P 500 Index		100,00%
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,09%
größter potenzieller Risikobetrag		4,33%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		1,13%
Risikomodell (§10 DerivateV)		Full-Monte-Carlo
Parameter (§11 DerivateV)		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr
Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte		1,68

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 ABSOLUTE Volatility I	EUR	918,87
Anteilwert ABSOLUTE Volatility P	EUR	912,61
Umlaufende Anteile ABSOLUTE Volatility I	STK	3.849,000
Umlaufende Anteile ABSOLUTE Volatility P	STK	1.398,000

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	ABSOLUTE Volatility I	ABSOLUTE Volatility P
ISIN	DE000A2QJK43	DE000A2QJK50
Währung	Euro	Euro
Fondsaufgabe	18.05.2021	18.05.2021
Ertragsverwendung	Thesaurierend	Thesaurierend
Verwaltungsvergütung	0,60%p.a.	0,99%p.a.
Ausgabeaufschlag	0,00%	0,00%
Mindestanlagevolumen	500.000	0

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 Tagesschlusskursen des betroffenen 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 ABSOLUTE VOLATILITY I

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,88 %
---	--------

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE ABSOLUTE VOLATILITY P

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	1,34 %
---	--------

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 01.11.2021 BIS 31.10.2022

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	52.092.571,27
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	0,00
Relativ in %	0,00 %

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 30.561,28 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 in der Anteilklasse I keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

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

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

ABSOLUTE Volatility I

Sonstige Erträge

Erträge aus Performance Fee Rückbuchungen	EUR	2.968,51
---	-----	----------

Sonstige Aufwendungen

Depotgebühren	EUR	715,50
---------------	-----	--------

ABSOLUTE Volatility P

Sonstige Erträge

Erträge aus Performance Fee Rückbuchungen	EUR	497,42
---	-----	--------

Sonstige Aufwendungen

Depotgebühren	EUR	199,04
---------------	-----	--------

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 Vergütungssysteme 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 FESTGELEGTE VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2021 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)	EUR	19.375.239
davon feste Vergütung	EUR	15.834.736
davon variable Vergütung	EUR	3.540.503
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)		263
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risktaker)	EUR	1.273.467

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der Signal Iduna Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager		Signal Iduna Asset Management GmbH
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	10.827.355,00
davon feste Vergütung	EUR	0,00
davon variable Vergütung	EUR	0,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens		108

Hamburg, 24. Februar 2023

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 ABSOLUTE Volatility - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. November 2021 bis zum 31. Oktober 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. November 2021 bis zum 31. Oktober 2022, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

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

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

teil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

Die gesetzlichen Vertreter der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung 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.
- 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 27.02.2023

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner
Wirtschaftsprüfer

Lüning
Wirtschaftsprüfer

Allgemeine Angaben

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

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

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

E-Mail: service@hansainvest.de

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 22,659 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2021

- 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

- (zugleich Sprecher der Geschäftsführung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

- Ludger Wibbeke

- (zugleich stellvertretender Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger

- Vorsitzender

- Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)

- Dr. Karl-Josef Bierth

- stellvertretender Vorsitzender

- Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg

- Markus Barth

- Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg

- Dr. Thomas A. Lange

- Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen

- Prof. Dr. Harald Stützer

VERWAHRSTELLE

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

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

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhlentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon (040) 3 00 57-62 96

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST