

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

Greiff Systematic Allocation Fund

31. Oktober 2022

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

| | |
|---|----|
| Tätigkeitsbericht Greiff Systematic Allocation Fund | 4 |
| Vermögensübersicht | 7 |
| Vermögensaufstellung | 8 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 32 |
| Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers | 53 |
| Allgemeine Angaben | 56 |

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

Greiff Systematic Allocation Fund

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 Greiff Systematic Allocation Fund

TÄTIGKEITSBERICHT GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR VOM 01.11.2021 BIS 31.10.2022

Anlageziel und Anlagepolitik

Ziel der Anlagepolitik des Fonds ist es, risikoangemessene Wertzuwächse zu erzielen. Hierzu werden je nach Einschätzung der Wirtschafts- und Kapitalmarktlage und der Börsenaussichten im Rahmen der Anlagepolitik die nach dem KAGB und den Anlagebedingungen zugelassenen Vermögensgegenstände erworben und veräußert.

Für den Fonds ist kein Anlageschwerpunkt festgelegt. Das Sondervermögen soll zu mindestens 25 Prozent seines Wertes in Kapitalbeteiligungen (Aktien und Aktienfonds) in- und ausländischer Aussteller investieren, ein regionaler Schwerpunkt ist nicht vorgesehen. Das Fondsmanagement dieses Fonds strebt an, durch einen digitalisierten Investmentprozess die Aktienquote des Sondervermögens so zu steuern, dass in schwachen Marktphasen Verluste durch eine Reduzierung der Aktienquote verringert werden sollen. Zulässige Vermögensgegenstände sind Wertpapiere (z.B. Aktien, Anleihen, Genussscheine und Zertifikate), Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Investmentanteile, Derivate und sonstige Anlageinstrumente.

Der Fonds richtet sich an alle Arten von Anlegern, die das Ziel der Vermögensbildung bzw. Vermögensoptimierung verfolgen. Die Anleger sollten in der Lage sein, Wertschwankungen und deutliche Verluste zu tragen, und keine Garantie bezüglich des Erhalts ihrer Anlagesumme benötigen.

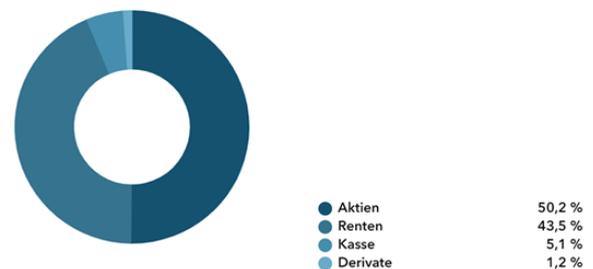
Der Fonds ist unter Umständen für Anleger nicht geeignet, die ihr Kapital innerhalb eines Zeitraums von 5 Jahren aus dem Fonds zurückziehen wollen.

Der Fonds qualifiziert seit dem 01. Oktober 2022 als Finanzprodukt im Sinne der OffiVO, mit dem unter anderem ökologische und/ oder soziale Merkmale i.S.v. Art. 8 Abs. 1 beworben werden. Im Anhang werden die regelmäßigen Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten

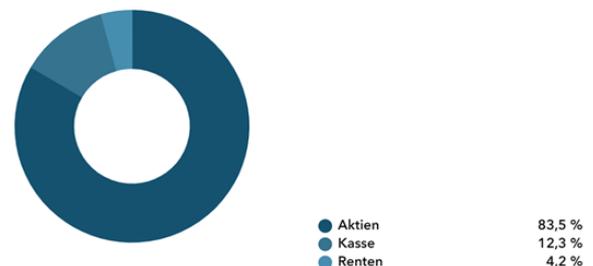
Finanzprodukten beschrieben. Die Angaben beziehen sich nicht auf das gesamte Geschäftsjahr des Fonds, sondern lediglich auf den Zeitraum ab dem 01. Oktober 2022 bis zum Geschäftsjahresende.

Portfoliostruktur*)

31.10.2022



31.10.2021



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

Im Berichtszeitraum wurde im Einklang mit der Anlagestrategie mit steigenden wirtschaftlichen und geopolitischen Risiken die Aktienquote abgebaut und in Anleihen investiert.

Hauptsächlich wurde direkt in Aktien und Anleihen investiert. Geringfügig wurden ETF-Investments verwendet.

Risikoanalyse

Marktpreisrisiko:

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

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.

Liquiditätsrisiko Zertifikate:

Der Fonds investiert sein Vermögen überwiegend in Zertifikate. Die Veräußerung der Zertifikate zu marktgerechten Kursen hängt auch davon ab, dass von den Emittenten ein funktionierender Sekundärmarkt angeboten wird. Das Liquiditätsrisiko soll durch eine angemessene Gewichtung der Emittenten begrenzt werden.

Liquiditätsrisiko Renten:

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.

Liquiditätsrisiko Zielfonds:

Der Fonds investiert einen Teil seines Vermögens in Zielfonds. Die Liquidität des Sondervermögens kann eingeschränkt werden, sofern z.B. für die Zielfonds die Rücknahme der Anteilscheine ausgesetzt werden sollte.

Liquiditätsrisiko Aktien:

Das Sondervermögen ist breit gestreut und mehrheitlich in Aktien mit hoher Marktkapitalisierung investiert, die im Regelfall in großen Volumina an den internationalen Börsen gehandelt werden. Daher ist davon auszugehen, dass jederzeit ausreichend Vermögenswerte zu einem angemessenen Verkaufserlös veräußert werden können.

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:

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 24.2.2022 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.

Veräußerungsergebnis

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

Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist seit dem 01.11.2021 die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH. Es erfolgte eine Übernahme von der Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH.

Die Verwahrstelle ist seit dem 01.11.2021 Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG.

Das Portfoliomanagement für den Greif Systematic Allocation Fund ist ausgelagert an die Greiff capital management AG.

Der Fonds ist seit dem 01.10.2022 gemäß Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu qualifizieren.

Es haben sich keine weiteren wesentlichen Ereignisse ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens ¹⁾ |
|----------------------------------|-------------------------|--|
| I. Vermögensgegenstände | 9.744.471,13 | 100,19 |
| 1. Aktien | 4.879.793,59 | 50,17 |
| 2. Anleihen | 4.198.807,56 | 43,17 |
| 3. Derivate | 115.314,39 | 1,19 |
| 4. Bankguthaben | 516.282,98 | 5,31 |
| 5. Sonstige Vermögensgegenstände | 34.272,61 | 0,35 |
| II. Verbindlichkeiten | -18.256,20 | -0,19 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | -18.256,20 | -0,19 |
| III. Fondsvermögen | EUR 9.726.214,93 | 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 | 6.371.021,93 | 65,50 |
| Aktien | | | | | | | EUR | 4.040.935,15 | 41,55 |
| FR0000120404 | Accor | | STK | 3.167 | 5.718 | 2.551 | EUR 24,2400 | 76.768,08 | 0,79 |
| ES0167050915 | Actividades de Construcción y Servicios | | STK | 3.022 | 10.102 | 7.080 | EUR 25,9500 | 78.420,90 | 0,81 |
| DE000A1EWWW0 | adidas | | STK | 6.000 | 6.000 | 0 | EUR 98,9800 | 593.880,00 | 6,11 |
| FR0000120073 | Air Liquide | | STK | 582 | 582 | 847 | EUR 132,3000 | 76.998,60 | 0,79 |
| DE000A0WMPJ6 | AIXTRON AG | | STK | 2.753 | 5.900 | 3.147 | EUR 24,8900 | 68.522,17 | 0,70 |
| BE0974293251 | Anheuser-Busch InBev | | STK | 1.459 | 1.459 | 0 | EUR 50,6000 | 73.825,40 | 0,76 |
| IT0000062072 | Assicurazioni Generali | | STK | 4.916 | 4.916 | 4.895 | EUR 15,1900 | 74.674,04 | 0,77 |
| ES0113679137 | Bankinter | | STK | 14.057 | 27.974 | 13.917 | EUR 6,1160 | 85.972,61 | 0,88 |
| FR0000130403 | Christian Dior | | STK | 113 | 113 | 0 | EUR 626,5000 | 70.794,50 | 0,73 |
| FR0000045072 | Crédit Agricole | | STK | 8.052 | 15.040 | 6.988 | EUR 9,1860 | 73.965,67 | 0,76 |
| FR0000130452 | Eiffage | | STK | 838 | 838 | 0 | EUR 91,5400 | 76.710,52 | 0,79 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | | STK | 524 | 524 | 535 | EUR 164,8000 | 86.355,20 | 0,89 |
| FR0013451333 | LA FRANCAISE DES JEUX Actions Port. (Prom.) EO -,40 | | STK | 2.275 | 2.275 | 0 | EUR 33,0000 | 75.075,00 | 0,77 |
| FR0000121014 | LVMH | | STK | 110 | 110 | 0 | EUR 639,0000 | 70.290,00 | 0,72 |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp | | STK | 7.876 | 7.876 | 0 | EUR 9,6760 | 76.208,18 | 0,78 |
| FI0009014377 | Orion | | STK | 1.905 | 1.905 | 0 | EUR 46,5500 | 88.677,75 | 0,91 |
| IT0004176001 | Prismian | | STK | 2.703 | 8.405 | 8.972 | EUR 32,9900 | 89.171,97 | 0,92 |
| IT0003828271 | Recordati - Ind.Chim.Farm. | | STK | 1.917 | 3.609 | 3.379 | EUR 38,0300 | 72.903,51 | 0,75 |
| IT0005282865 | Reply S.p.A. Azioni nom. EO 0,13 | | STK | 662 | 1.304 | 642 | EUR 110,1000 | 72.886,20 | 0,75 |
| FR0012757854 | Spie S.A. Actions Nom. EO 0,47 | | STK | 3.410 | 3.410 | 0 | EUR 23,6800 | 80.748,80 | 0,83 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer | | STK | 676 | 1.374 | 698 | EUR 107,5500 | 72.703,80 | 0,75 |
| US00766T1007 | Aecom Technology | | STK | 328 | 328 | 837 | USD 75,2800 | 24.984,15 | 0,26 |
| US0082521081 | Affiliated Managers Group | | STK | 194 | 194 | 217 | USD 124,1600 | 24.372,19 | 0,25 |
| US0116591092 | Alaska Air Group | | STK | 557 | 557 | 0 | USD 44,4600 | 25.057,39 | 0,26 |
| IE00BFRT3W74 | Allegion PLC Registered Shares DL 1 | | STK | 248 | 248 | 276 | USD 104,7700 | 26.290,56 | 0,27 |
| US0441861046 | Ashland Global Holdings Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 232 | 232 | 0 | USD 104,9200 | 24.629,61 | 0,25 |
| US0454871056 | Associated Banc-Corp Registered Shares DL -,01 | | STK | 1.077 | 1.077 | 0 | USD 24,3500 | 26.535,41 | 0,27 |
| US06417N1037 | Bank OZK Registered Shares DL -,01 | | STK | 648 | 648 | 1.037 | USD 42,9800 | 28.180,75 | 0,29 |
| US0774541066 | Belden | | STK | 355 | 355 | 0 | USD 69,6300 | 25.011,28 | 0,26 |
| US0844231029 | Berkley, W.R. | | STK | 717 | 239 | 0 | USD 74,3800 | 53.961,81 | 0,55 |
| US0865161014 | Best Buy | | STK | 354 | 954 | 600 | USD 68,4100 | 24.503,83 | 0,25 |
| US1170431092 | Brunswick | | STK | 342 | 1.017 | 675 | USD 70,6700 | 24.455,27 | 0,25 |
| US12740C1036 | Cadence Bank Registered Shares DL 2,5 | | STK | 857 | 1.871 | 1.014 | USD 27,6500 | 23.976,58 | 0,25 |
| US12769G1004 | Caesars Entertainment Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 633 | 1.012 | 379 | USD 43,7300 | 28.008,79 | 0,29 |
| US1344291091 | Campbell Soup | | STK | 458 | 458 | 0 | USD 52,9100 | 24.519,66 | 0,25 |

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 | | | | | |
| US1638511089 | Chemours Co., The Registered Shares DL -,01 | | STK | 843 | 843 | 0 USD | 28,6300 | 24.420,81 | 0,25 | |
| US2298991090 | Cullen/Frost Bankers | | STK | 163 | 163 | 0 USD | 155,0500 | 25.572,35 | 0,26 | |
| US24906P1093 | Dentsply Sirona Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 779 | 1.469 | 690 USD | 30,8200 | 24.293,01 | 0,25 | |
| US2600031080 | Dover | | STK | 188 | 188 | 0 USD | 130,6900 | 24.860,59 | 0,26 | |
| US23345M1071 | DT Midstream Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 497 | 1.028 | 531 USD | 59,7000 | 30.022,16 | 0,31 | |
| US29275Y1029 | EnerSys | | STK | 374 | 801 | 427 USD | 66,2900 | 25.085,97 | 0,26 | |
| US3030751057 | FactSet Research Systems | | STK | 56 | 56 | 127 USD | 425,4900 | 24.109,52 | 0,25 | |
| US32054K1034 | First Indust.Realty Trust Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 514 | 514 | 693 USD | 47,6300 | 24.771,65 | 0,25 | |
| US3434981011 | Flowers Foods Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 1.405 | 1.405 | 0 USD | 28,7100 | 40.815,09 | 0,42 | |
| US3635761097 | Gallagher & Co., Arthur J. Registered Shares DL 1 | | STK | 367 | 0 | 0 USD | 187,0800 | 69.471,17 | 0,71 | |
| BMG3922B1072 | Genpact Ltd. Registered Shares DL 0,01 | | STK | 505 | 505 | 0 USD | 48,5000 | 24.782,45 | 0,25 | |
| US37959E1029 | Globe Life Inc. Registered Shares DL 1 | | STK | 358 | 358 | 0 USD | 115,5200 | 41.845,76 | 0,43 | |
| US3795772082 | Globus Medical Inc. Registered Shs A New DL -,001 | | STK | 373 | 373 | 0 USD | 67,0000 | 25.286,86 | 0,26 | |
| US3841091040 | Graco | | STK | 371 | 371 | 0 USD | 69,5800 | 26.119,78 | 0,27 | |
| US38526M1062 | Grand Canyon Education Inc. Registered Shares o.N. | | STK | 276 | 276 | 381 USD | 100,6300 | 28.102,68 | 0,29 | |
| US4050241003 | Haemonetics Corp. Registered Shares DL -,01 | | STK | 294 | 931 | 1.283 USD | 84,9500 | 25.270,97 | 0,26 | |
| US42226A1079 | HealthEquity Inc. Registered Shares DL -,0001 | | STK | 423 | 423 | 0 USD | 77,9100 | 33.346,08 | 0,34 | |
| US42824C1099 | Hewlett Packard Enterprise Co. Registered Shares DL -,01 | | STK | 1.749 | 3.465 | 1.716 USD | 14,2700 | 25.253,70 | 0,26 | |
| US4282911084 | Hexcel | | STK | 412 | 871 | 1.049 USD | 55,7000 | 23.220,07 | 0,24 | |
| US4039491000 | HF Sinclair Corp. Registered Shares DL -,01 | | STK | 542 | 542 | 0 USD | 61,1700 | 33.546,64 | 0,34 | |
| US45167R1041 | IDEX Corp. Registered Shares DL -,01 | | STK | 113 | 113 | 0 USD | 222,3100 | 25.418,43 | 0,26 | |
| US45778Q1076 | Insperity Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 214 | 214 | 0 USD | 118,0200 | 25.555,28 | 0,26 | |
| US4601461035 | International Paper | | STK | 709 | 709 | 1.027 USD | 33,6100 | 24.111,60 | 0,25 | |
| US46284V1017 | Iron Mountain Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 488 | 488 | 975 USD | 50,0700 | 24.723,42 | 0,25 | |
| US45073V1089 | ITT Inc. Registered Shares DL 1 | | STK | 357 | 357 | 636 USD | 76,3900 | 27.594,08 | 0,28 | |
| US8326964058 | J.M. Smucker Co. Registered Shares o.N. | | STK | 243 | 0 | 0 USD | 150,6600 | 37.043,79 | 0,38 | |
| US48666K1097 | KB Home | | STK | 830 | 1.587 | 757 USD | 28,8200 | 24.203,78 | 0,25 | |
| US4932671088 | Keycorp | | STK | 1.342 | 1.342 | 1.664 USD | 17,8700 | 24.265,45 | 0,25 | |
| US5218652049 | Lear Corp. Registered Shares new DL -,01 | | STK | 180 | 362 | 182 USD | 138,7100 | 25.263,38 | 0,26 | |
| US5261071071 | Lennox International | | STK | 102 | 206 | 104 USD | 233,5700 | 24.106,18 | 0,25 | |
| US5658491064 | Marathon Oil | | STK | 808 | 808 | 0 USD | 30,4500 | 24.894,87 | 0,26 | |
| US5526901096 | MDU Resources Group | | STK | 908 | 908 | 1.677 USD | 28,4800 | 26.165,98 | 0,27 | |
| US62955J1034 | NOV Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 1.200 | 2.504 | 1.304 USD | 22,4000 | 27.198,22 | 0,28 | |

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⁾ |
|---|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|------------|---------------------|------------------------------------|
| US62944T1051 | NVR Inc. Registered Shares DL -, 01 | | STK | 5 | 5 | 7 USD | 4.237,7500 | 21.439,59 | 0,22 |
| US6800331075 | Old National Bancorp. | | STK | 1.383 | 1.383 | 0 USD | 19,5600 | 27.371,73 | 0,28 |
| US6819361006 | Omega Healthcare Invest. Inc. Registered Shares DL -,10 | | STK | 822 | 1.830 | 1.008 USD | 31,7800 | 26.432,42 | 0,27 |
| US6907421019 | Owens Corning | | STK | 273 | 273 | 0 USD | 85,6100 | 23.648,21 | 0,24 |
| US74164M1080 | Primerica Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 184 | 184 | 225 USD | 144,7000 | 26.940,00 | 0,28 |
| US6936561009 | PVH | | STK | 465 | 465 | 0 USD | 51,3200 | 24.146,31 | 0,25 |
| US7547301090 | Raymond James Financial | | STK | 212 | 756 | 940 USD | 118,1400 | 25.342,18 | 0,26 |
| US74967X1037 | RH Registered Shares DL -,0001 | | STK | 97 | 189 | 92 USD | 253,9300 | 24.922,81 | 0,26 |
| US81211K1007 | Sealed Air | | STK | 504 | 928 | 1.673 USD | 47,6200 | 24.284,61 | 0,25 |
| US8318652091 | Smith, A.O. | | STK | 445 | 445 | 0 USD | 54,7800 | 24.665,69 | 0,25 |
| US8330341012 | Snap-on | | STK | 110 | 233 | 123 USD | 222,0500 | 24.714,66 | 0,25 |
| US87162W1009 | Synnex Corp. Registered Shares DL -,001 | | STK | 269 | 1.629 | 1.360 USD | 91,5100 | 24.907,61 | 0,26 |
| US8851601018 | Thor Industries | | STK | 307 | 307 | 0 USD | 81,4700 | 25.307,39 | 0,26 |
| US91529Y1064 | Unum | | STK | 563 | 2.712 | 2.149 USD | 45,5900 | 25.971,03 | 0,27 |
| US9197941076 | Valley National Bancorp | | STK | 2.021 | 2.021 | 0 USD | 11,8700 | 24.273,27 | 0,25 |
| US9282981086 | Vishay Intertechnology | | STK | 1.157 | 1.157 | 0 USD | 20,9100 | 24.479,28 | 0,25 |
| US9288811014 | Vontier Corp. Registered Shares DL -,0001 | | STK | 1.292 | 2.580 | 1.288 USD | 19,1000 | 24.969,34 | 0,26 |
| US9418481035 | Waters Corp. | | STK | 81 | 174 | 93 USD | 299,1700 | 24.519,65 | 0,25 |
| US9427491025 | Watts Water Technologies | | STK | 176 | 176 | 0 USD | 146,3600 | 26.064,31 | 0,27 |
| US9478901096 | Webster Financial | | STK | 480 | 1.131 | 651 USD | 54,2600 | 26.353,13 | 0,27 |
| US95058W1009 | Wendy's | | STK | 1.452 | 1.452 | 0 USD | 20,7800 | 30.529,76 | 0,31 |
| US96145D1054 | WestRock Co. Registered Shares DL -,01 | | STK | 722 | 722 | 0 USD | 34,0600 | 24.882,44 | 0,26 |
| US98585X1046 | Yeti Holdings Inc. Registered Shares DL-,01 | | STK | 739 | 739 | 0 USD | 32,0800 | 23.987,78 | 0,25 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 2.330.086,78 | 23,96 |
| IT0005454050 | 0,000000000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(24) | EUR | | 300 | 300 | 0 % | 96,8687 | 290.606,09 | 2,99 |
| DE0001102366 | 1,000000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2014 (2024) | EUR | | 300 | 300 | 0 % | 98,4402 | 295.320,68 | 3,04 |
| US912828Z948 | 1,500000000% United States of America DL-Notes 2020(30) | USD | | 600 | 900 | 900 % | 83,9063 | 509.397,45 | 5,24 |
| US912828YB05 | 1,625000000% United States of America DL-Notes 2019(29) | USD | | 600 | 1.500 | 900 % | 85,3711 | 518.290,56 | 5,33 |
| DE0001135044 | 6,500000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 1997 (2027) | EUR | | 600 | 600 | 0 % | 119,4120 | 716.472,00 | 7,37 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | EUR | 2.064.476,79 | 21,23 |
| Aktien | | | | | | | EUR | 838.858,44 | 8,62 |
| US02376R1023 | American Airlines Group | | STK | 1.891 | 3.792 | 1.901 USD | 14,1800 | 27.131,82 | 0,28 |
| US1143401024 | Brooks Automation Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 562 | 562 | 0 USD | 44,4000 | 25.248,20 | 0,26 |

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 | | |
| US22410J1060 | Cracker Barrel Old Coun.St.Inc Registered Shares DL-,01 | | STK | 243 | 512 | 269 USD | 114,2200 | 28.084,04 | 0,29 |
| BMG3198U1027 | Essent Group Ltd. Registered Shares DL -,015 | | STK | 629 | 1.282 | 1.362 USD | 39,5800 | 25.190,55 | 0,26 |
| US3602711000 | Fulton Financial | | STK | 1.354 | 1.354 | 0 USD | 18,2300 | 24.975,63 | 0,26 |
| US3719011096 | Gentex Corp. | | STK | 946 | 1.846 | 900 USD | 26,4900 | 25.356,21 | 0,26 |
| US37637Q1058 | Glacier Bancorp | | STK | 515 | 515 | 0 USD | 57,2800 | 29.848,43 | 0,31 |
| US40637H1095 | Halozyme Therapeutics Inc. Registered Shares DL -,001 | | STK | 546 | 1.429 | 883 USD | 47,8100 | 26.413,30 | 0,27 |
| US8064071025 | Henry Schein | | STK | 338 | 785 | 447 USD | 68,4600 | 23.413,42 | 0,24 |
| US4368932004 | Home Bancshares Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 960 | 960 | 1.547 USD | 25,4900 | 24.760,09 | 0,25 |
| US4461501045 | Huntington Bancshares | | STK | 1.687 | 3.631 | 4.258 USD | 15,1800 | 25.911,83 | 0,27 |
| US45332Y1091 | Inari Medical Inc. Registered Shares DL -,001 | | STK | 309 | 309 | 0 USD | 76,9300 | 24.052,79 | 0,25 |
| US45688C1071 | Ingevity Corp. Registered Shares DL -,01 | | STK | 367 | 367 | 0 USD | 67,2700 | 24.980,36 | 0,26 |
| US4579852082 | Integra Lifescience.Hldgs Corp Registered Shares DL -,01 | | STK | 510 | 996 | 486 USD | 50,2500 | 25.930,89 | 0,27 |
| US48123V1026 | j2 Global Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 318 | 318 | 290 USD | 77,3900 | 24.901,37 | 0,26 |
| US4262811015 | Jack Henry & Associates Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 225 | 0 | 0 USD | 199,0600 | 45.318,73 | 0,47 |
| US46982L1089 | JACOBS SOLUTIONS INC. Registered Shares DL 1 | | STK | 206 | 206 | 0 USD | 115,2200 | 24.016,31 | 0,25 |
| IE00B4Q5ZN47 | Jazz Pharmaceuticals PLC | | STK | 172 | 350 | 178 USD | 143,7900 | 25.024,67 | 0,26 |
| US5128161099 | Lamar Advertising Co. Registered Shares A DL -,001 | | STK | 263 | 263 | 342 USD | 92,2300 | 24.543,65 | 0,25 |
| US5370081045 | Littelfuse | | STK | 112 | 112 | 0 USD | 220,2500 | 24.960,03 | 0,26 |
| US5764852050 | Matador Resources Co. Registered Shares DL -,01 | | STK | 360 | 360 | 0 USD | 66,4500 | 24.205,20 | 0,25 |
| US5893781089 | Mercury Systems Inc. Registered Shares DL -,01 | | STK | 504 | 504 | 0 USD | 48,4000 | 24.682,38 | 0,25 |
| US64110D1046 | NetApp Inc. | | STK | 356 | 719 | 363 USD | 69,2700 | 24.952,06 | 0,26 |
| US6460251068 | New Jersey Resources Corp. Registered Shares DL 2,50 | | STK | 570 | 570 | 833 USD | 44,6400 | 25.746,03 | 0,26 |
| US7075691094 | Penn National Gaming | | STK | 774 | 1.463 | 689 USD | 33,1000 | 25.922,70 | 0,27 |
| US74340E1038 | Progyny Inc. Registered Shares DL -,001 | | STK | 604 | 1.208 | 604 USD | 44,4700 | 27.177,86 | 0,28 |
| US69370C1009 | PTC | | STK | 209 | 438 | 229 USD | 117,8300 | 24.918,01 | 0,26 |
| US84857L1017 | Spire Inc. Registered Shares DL 1 | | STK | 361 | 361 | 0 USD | 69,8100 | 25.499,76 | 0,26 |
| US85208M1027 | Sprouts Farmers Market Inc. | | STK | 930 | 930 | 0 USD | 29,5000 | 27.759,79 | 0,29 |
| US8969452015 | Tripadvisor | | STK | 975 | 975 | 0 USD | 23,6200 | 23.302,13 | 0,24 |
| US9099071071 | United Bankshares | | STK | 669 | 669 | 0 USD | 42,3500 | 28.667,56 | 0,29 |
| US92343E1029 | Verisign | | STK | 128 | 128 | 0 USD | 200,4600 | 25.962,64 | 0,27 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 1.225.618,35 | 12,60 |
| EU000A283859 | 0,000000000% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2020(30) | EUR | | 600 | 900 | 300 % | 80,0705 | 480.423,00 | 4,94 |
| US91282CDJ71 | 1,375000000% United States of America DL-Bonds 2021(31) | USD | | 300 | 1.100 | 800 % | 79,9297 | 242.627,81 | 2,49 |

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 | | | | |
| US91282CCB54 | 1,625000000% United States of America DL-Bonds 2021(31) | | USD | 600 | 600 | 0 % | 82,7813 | 502.567,54 | 5,17 | |
| Nicht notierte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 643.102,43 | 6,61 | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 643.102,43 | 6,61 | |
| US91282CEP23 | 2,875000000% United States of America DL-Bonds 2022(32) S.C-2032 | | USD | 700 | 700 | 0 % | 90,7969 | 643.102,43 | 6,61 | |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 9.078.601,15 | 93,34 | |
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | EUR | 115.314,39 | 1,19 | |
| Wertpapier-Terminkontrakte | | | | | | | EUR | 180.431,40 | 1,86 | |
| Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktien | | | | | | | EUR | 180.431,40 | 1,86 | |
| adidas 16.12.2022 | | XEUR | EUR | -60 | | | EUR | 180.431,40 | 1,86 | |
| Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten) | | | | | | | EUR | 13.260,00 | 0,14 | |
| Optionsrechte | | | | | | | EUR | 13.260,00 | 0,14 | |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | | | | | | EUR | 13.260,00 | 0,14 | |
| Put ESTX 50 3000,000000000 16.12.2022 | | XEUR | EUR | Anzahl | -130 | | EUR | 9,2000 | -11.960,00 | -0,12 |
| Put ESTX 50 3200,000000000 16.12.2022 | | XEUR | EUR | Anzahl | 130 | | EUR | 19,4000 | 25.220,00 | 0,26 |
| Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten) | | | | | | | EUR | -78.377,01 | -0,81 | |
| Währungsterminkontrakte | | | | | | | EUR | -78.377,01 | -0,81 | |
| FUTURES EUR/USD 12/22 | | XCME | USD | | 4.125 | | USD | -61.188,40 | -0,63 | |
| FUTURES EUR/USD 12/22 | | XCME | USD | | 750 | | USD | -13.470,10 | -0,14 | |
| FUTURES EUR/USD 12/22 | | XCME | USD | | 500 | | USD | -3.718,51 | -0,04 | |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 516.282,98 | 5,31 | |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | EUR | 126.011,90 | 1,30 | |
| Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG | | | EUR | | 126.011,90 | | | 126.011,90 | 1,30 | |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 390.271,08 | 4,01 | |
| Verwahrstelle: Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG | | | USD | | 385.704,91 | | | 390.271,08 | 4,01 | |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 34.272,61 | 0,35 | |
| Dividendenansprüche | | | EUR | | 895,89 | | | 895,89 | 0,01 | |
| Zinsansprüche | | | EUR | | 33.376,72 | | | 33.376,72 | 0,34 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -18.256,20 | -0,19 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾ | | | EUR | | -18.256,20 | | | -18.256,20 | -0,19 | |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 9.726.214,93 | 100,00 | |
| Anteilwert Greiff Systematic Allocation Fund I | | | | | | | EUR | 87,97 | | |

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⁾ |
|------|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|------|-----------------|------------------------------------|
| | Anteilwert Greiff Systematic Allocation Fund R | | | | | | EUR | 86,37 | |
| | Umlaufende Anteile Greiff Systematic Allocation Fund I | | | | | | STK | 55.587,000 | |
| | Umlaufende Anteile Greiff Systematic Allocation Fund R | | | | | | STK | 55.997,085 | |

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

| | |
|------|-----------------------------|
| 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 |
|-------------------------------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| ES0125220311 | Acciona | STK | 0 | 595 |
| IE00BD845X29 | Adient | STK | 805 | 805 |
| US00751Y1064 | Advance Auto Parts | STK | 141 | 141 |
| NL0012969182 | Adyen N.V. | STK | 52 | 87 |
| ES0105046009 | AENA S.A. Acciones Port. EO 10 | STK | 598 | 598 |
| US0010841023 | AGCO | STK | 284 | 284 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Kon. | STK | 2.955 | 2.955 |
| NL0013267909 | Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO 2 | STK | 1.870 | 1.870 |
| US0138721065 | Alcoa Corp. Registered Shares o.N. | STK | 446 | 446 |
| US0185223007 | Allete Inc. Registered Shares New o.N. | STK | 528 | 528 |
| US0185811082 | Alliance Data Systems | STK | 909 | 1.263 |
| US0188021085 | Alliant Energy Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 486 | 486 |
| ES0109067019 | Amadeus IT Group S.A. | STK | 1.259 | 1.259 |
| JE00BJ1F3079 | AMCOR PLC | STK | 0 | 2.797 |
| US02553E1064 | Amer. Eagle Outfitters | STK | 1.351 | 1.351 |
| US03073E1055 | AmerisourceBergen | STK | 279 | 279 |
| IT0004056880 | Amplifon | STK | 2.257 | 2.257 |
| US03676B1026 | Antero Midstream Corp. Registered Shares DL-,01 | STK | 2.548 | 2.548 |
| LU1598757687 | ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN | STK | 6.309 | 6.309 |
| US0404131064 | Arista Networks Inc. | STK | 245 | 245 |
| FR0010313833 | Arkema | STK | 1.396 | 1.396 |
| US0427351004 | Arrow Electronics | STK | 0 | 362 |
| NL0000334118 | ASM International | STK | 501 | 804 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | STK | 0 | 164 |
| NL0011872643 | ASR Nederland N.V. Aandelen aan toonder o.N. | STK | 1.849 | 4.485 |
| US04621X1081 | Assurant | STK | 198 | 198 |
| US05329W1027 | Autonation | STK | 278 | 278 |
| US0536111091 | Avery Dennison | STK | 0 | 314 |
| US0538071038 | Avnet | STK | 836 | 836 |
| US0584981064 | Ball Corp. | STK | 0 | 409 |
| US0625401098 | Bank of Hawaii Corp. Registered Shares DL 2 | STK | 323 | 323 |
| IE00BD1RP616 | Bank of Ireland Group PLC Registered Shares EO 1 | STK | 18.630 | 18.630 |
| AT0000BAWAG2 | BAWAG Group AG Inhaber-Aktien o.N. | STK | 0 | 1.634 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke | STK | 1.865 | 1.865 |
| DE0005158703 | Bechtle AG | STK | 1.804 | 1.804 |
| DE0005200000 | Beiersdorf | STK | 895 | 895 |

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 |
|--------------|---|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US0905722072 | Bio-Rad Laboratories Inc. Reg. Shares Class A DL-,0001 | STK | 54 | 54 |
| US09073M1045 | Bio-Techne Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 88 |
| US0997241064 | BorgWarner | STK | 1.381 | 1.381 |
| US1033041013 | Boyd Gaming | STK | 465 | 465 |
| DE000A1DAH0 | Brenntag | STK | 0 | 1.818 |
| US10922N1037 | Brighthouse Financial | STK | 1.261 | 1.261 |
| US1096961040 | Brink s | STK | 527 | 527 |
| US11133T1034 | Broadridge Financial Solutions | STK | 0 | 213 |
| FR0006174348 | Bureau Veritas | STK | 2.910 | 7.871 |
| US13100M5094 | Calix Inc. Registered Shares o.N. | STK | 1.352 | 1.352 |
| CA13645T1003 | Canadian Pacific Railway | STK | 453 | 453 |
| FR0000125338 | Cap Gemini | STK | 429 | 429 |
| DE0005313704 | Carl-Zeiss Meditec | STK | 0 | 537 |
| US1423391002 | Carlisle Cos. Inc. Registered Shares DL 1 | STK | 0 | 310 |
| US1431301027 | Carmax | STK | 286 | 286 |
| FR0000120172 | Carrefour | STK | 8.782 | 8.782 |
| US1488061029 | Catalent Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 595 | 595 |
| US1508701034 | Celanese | STK | 208 | 615 |
| US15189T1079 | Centerpoint Energy | STK | 0 | 2.096 |
| US15872M1045 | ChampionX Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 2.518 | 2.518 |
| US1598641074 | Charles River Labs | STK | 111 | 111 |
| US1699051066 | Choice Hotels Intl Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 213 | 504 |
| FR0000121261 | Cie Génle Éts Michelin | STK | 621 | 621 |
| FR001400AJ45 | Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50 | STK | 2.767 | 2.767 |
| US1727551004 | Cirrus Logic | STK | 329 | 329 |
| US1746101054 | Citizens Financial Group Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 776 |
| US1844961078 | Clean Harbors | STK | 274 | 274 |
| US1858991011 | Cleveland-Cliffs Inc. Registered Shares DL -,125 | STK | 0 | 1.584 |
| US1258961002 | CMS Energy Corp. | STK | 453 | 453 |
| NL0010545661 | CNH Industrial | STK | 18.127 | 18.127 |
| US1940141062 | Colfax Corp. Registered Shares o.N. | STK | 761 | 761 |
| US2003401070 | Comerica | STK | 0 | 448 |
| FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain | STK | 1.395 | 1.395 |
| US2091151041 | Consolidated Edison | STK | 450 | 450 |
| DE0005439004 | Continental | STK | 2.033 | 2.033 |
| US2166484020 | Cooper Companies | STK | 0 | 86 |
| US2220702037 | Coty Inc. Registered Shares Cl.A DL -,01 | STK | 3.029 | 3.029 |

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 |
|--------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| ES0140609019 | Criteria Caixa | STK | 48.941 | 48.941 |
| BE0974259880 | D'leteren Parts Sociales | STK | 516 | 516 |
| US2371941053 | Darden Restaurants | STK | 204 | 676 |
| US2372661015 | Darling International Inc. | STK | 0 | 443 |
| FR0014003TT8 | Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10 | STK | 1.928 | 1.928 |
| US23918K1088 | DaVita | STK | 231 | 556 |
| DE0005140008 | Deutsche Bank | STK | 7.927 | 7.927 |
| DE0005810055 | Deutsche Börse | STK | 5.000 | 5.000 |
| DE0005552004 | Deutsche Post | STK | 0 | 1.989 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom | STK | 5.110 | 5.110 |
| US2576511099 | Donaldson Co. Inc. Registered Shares DL 5 | STK | 516 | 516 |
| US26969P1084 | Eagle Materials Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 241 |
| US2774321002 | Eastman Chemical | STK | 517 | 1.188 |
| PTEDP0AM0009 | EDP - Energias de Portugal | STK | 16.464 | 16.464 |
| ES0127797019 | EDP Renováveis | STK | 7.026 | 7.026 |
| US29084Q1004 | Emcor Group | STK | 0 | 354 |
| IT0003128367 | Enel | STK | 13.850 | 13.850 |
| US29272W1099 | Energizer Holdings Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 871 | 871 |
| US1940145022 | Enovis Corp. Registered Shares o.N. | STK | 254 | 254 |
| US29415F1049 | Envista Holdings Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 635 | 635 |
| US2944291051 | Equifax | STK | 0 | 128 |
| AT0000652011 | Erste Group Bank | STK | 6.031 | 8.957 |
| US29605J1060 | ESAB Corp. Registered Shares DL -,001 | STK | 832 | 832 |
| US29670G1022 | Essential Utilities Inc. Registered Shares DL -,50 | STK | 651 | 651 |
| FR0014000MR3 | Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01 | STK | 984 | 984 |
| NL0006294274 | Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60 | STK | 934 | 934 |
| US29977A1051 | Evercore Inc. Registered Shs A DL -,01 | STK | 236 | 236 |
| BMG3223R1088 | Everest Reinsurance Group | STK | 0 | 136 |
| DE000EVNK013 | Evonik Industries | STK | 6.809 | 6.809 |
| NL0011585146 | Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01 | STK | 0 | 672 |
| ES0118900010 | Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -,20 | STK | 6.590 | 9.990 |
| IT0000072170 | Fincobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33 | STK | 6.776 | 12.248 |
| US31847R1023 | First American Financial Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 428 | 428 |
| US34354P1057 | Flowserve | STK | 0 | 934 |
| US3434121022 | Fluor | STK | 1.927 | 1.927 |
| US34959J1088 | Fortive Corp. | STK | 0 | 482 |
| US35137L2043 | Fox Corp. Registered Shares B DL -,01 | STK | 0 | 1.395 |

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 |
|--------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US3546131018 | Franklin Resources | STK | 1.966 | 1.966 |
| DE0005785802 | Fresenius Medical Care | STK | 1.620 | 1.620 |
| US3029411093 | FTI Consulting | STK | 241 | 241 |
| US3647601083 | Gap | STK | 4.596 | 4.596 |
| US3666511072 | Gartner | STK | 103 | 103 |
| DE0006602006 | GEA | STK | 2.162 | 4.629 |
| US3687361044 | Generac Holdings Inc. Registered Shares o.N. | STK | 107 | 107 |
| US3724601055 | Genuine Parts | STK | 196 | 196 |
| US4108671052 | Hanover Insurance Group Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 251 | 251 |
| US4128221086 | Harley-Davidson | STK | 892 | 892 |
| FR0000052292 | Hermes International | STK | 66 | 66 |
| US4361061082 | HollyFrontier Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 992 | 2.153 |
| US4364401012 | Hologic Inc. | STK | 399 | 399 |
| US4432011082 | Howmet Aerospace Inc. | STK | 755 | 755 |
| DE000A1PHFF7 | HUGO BOSS | STK | 1.416 | 1.416 |
| FI0009000459 | Huhtamäki Oyj | STK | 2.302 | 2.302 |
| US4511071064 | Idacorp Inc. Registered Shares o. N. | STK | 305 | 305 |
| NL0010801007 | IMCD N.V. Aandelen op naam EO -,16 | STK | 0 | 706 |
| ES0148396007 | Industria de Diseño Textil | STK | 5.970 | 5.970 |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG | STK | 2.633 | 2.633 |
| IT0005090300 | Infrastrutt. Wireless Italiane Azioni nom. o.N. | STK | 7.241 | 7.241 |
| US45687V1061 | Ingersoll-Rand Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 1.248 |
| IT0001078911 | Interpump Group S.p.A. Azioni nom. EO 0,52 | STK | 1.962 | 1.962 |
| BMG491BT1088 | Invesco | STK | 1.435 | 1.435 |
| NL0015000LU4 | Iveco Group N.V. Aandelen op naam EUR 1 | STK | 1.120 | 1.120 |
| US4663131039 | Jabil Circuit | STK | 872 | 872 |
| US47233W1099 | Jefferies Financial Group Inc. Registered Shares DL 1 | STK | 826 | 2.903 |
| PTJMT0AE0001 | Jerónimo Martins | STK | 3.778 | 3.778 |
| US48203R1041 | Juniper Networks | STK | 2.014 | 2.014 |
| BE0003565737 | KBC Groep N.V. | STK | 0 | 1.297 |
| US48242W1062 | KBR | STK | 0 | 961 |
| IE0004906560 | Kerry Group | STK | 0 | 817 |
| FI0009000202 | Kesko Oyj | STK | 3.157 | 3.157 |
| US49338L1035 | Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 238 |
| IE0004927939 | Kingspan Group | STK | 0 | 1.137 |
| DE000KBX1006 | Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien o.N. | STK | 1.283 | 1.283 |
| US5002551043 | Kohl's | STK | 1.477 | 1.477 |

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 |
|--------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| NL0000009538 | Kon. Philips | STK | 2.883 | 2.883 |
| NL0000009827 | Koninklijke DSM | STK | 0 | 576 |
| US5010441013 | Kroger | STK | 729 | 729 |
| DE0005470405 | Lanxess | STK | 1.698 | 1.698 |
| US5178341070 | Las Vegas Sands | STK | 776 | 776 |
| US5246601075 | Leggett & Platt | STK | 696 | 1.439 |
| FR0010307819 | Legrand | STK | 1.017 | 2.737 |
| US5260571048 | Lennar | STK | 343 | 343 |
| US5341871094 | Lincoln National Corp. | STK | 924 | 924 |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC | STK | 0 | 347 |
| US5367971034 | Lithia Motors Inc. Registered Shares o.N. | STK | 85 | 85 |
| US5404241086 | Loew's | STK | 0 | 1.083 |
| US55261F1049 | M and T Bank | STK | 219 | 219 |
| US55616P1049 | Macy's Inc. | STK | 1.157 | 1.157 |
| US57164Y1073 | Marriott Vacat.Worldwide Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 217 | 457 |
| US5732841060 | Martin Marietta Materials Inc. | STK | 0 | 175 |
| US5745991068 | Masco | STK | 0 | 575 |
| US5763231090 | Mastec | STK | 327 | 327 |
| IT0000062957 | Mediobanca - Banca di Credito | STK | 8.916 | 18.230 |
| DE0007100000 | Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N. | STK | 0 | 1.238 |
| DE0006599905 | Merck | STK | 0 | 566 |
| US5926881054 | Mettler-Toledo Intl | STK | 0 | 49 |
| US6081901042 | Mohawk Industries | STK | 188 | 188 |
| US60855R1005 | Molina Healthcare Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 0 | 126 |
| US60871R2094 | Molson Coors Brewing | STK | 433 | 433 |
| IT0004965148 | Moncler S.r.l. Azioni n.o.N. | STK | 0 | 1.619 |
| US5534981064 | MSA Safety Inc. Registered Shares o.N. | STK | 430 | 430 |
| DE000A0D9PT0 | MTU Aero Engines | STK | 402 | 402 |
| US6267551025 | Murphy USA Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 251 |
| US62886E1082 | NCR | STK | 784 | 784 |
| FI0009013296 | Neste Oyj | STK | 2.074 | 2.074 |
| US6501111073 | New York Times | STK | 798 | 798 |
| US6512291062 | Newell Rubbermaid | STK | 2.595 | 2.595 |
| US6515871076 | NewMarket | STK | 179 | 179 |
| IT0005366767 | Nexi S.p.A. Azioni nom. o.N. | STK | 8.159 | 13.978 |
| NL0010773842 | NN Group | STK | 1.645 | 1.645 |
| FI0009000681 | Nokia | STK | 33.299 | 33.299 |

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 |
|--------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US6293775085 | NRG Energy | STK | 715 | 715 |
| US6703461052 | Nucor | STK | 0 | 323 |
| IE00BDVJJQ56 | nVent Electric PLC Registered Shares DL -,01 | STK | 1.777 | 1.777 |
| US6802231042 | Old Republic International | STK | 1.152 | 1.152 |
| AT0000743059 | OMV AG | STK | 1.579 | 1.579 |
| FR0000133308 | Orange | STK | 9.344 | 9.344 |
| US70438V1061 | Paylocity Holding Corp. Registered Shares DL -,001 | STK | 150 | 150 |
| US70975L1070 | Penumbra Inc. Registered Shares o.N. | STK | 0 | 130 |
| US7310681025 | Polaris Industries | STK | 274 | 274 |
| IT0003796171 | Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -,51 | STK | 7.270 | 7.270 |
| DE000PSM7770 | ProSiebenSat.1 Media | STK | 6.369 | 6.369 |
| FR0000130577 | Publicis Groupe | STK | 1.476 | 1.476 |
| US7458671010 | Pulte Homes | STK | 597 | 597 |
| DE0006969603 | PUMA SE | STK | 2.057 | 2.057 |
| NL0012169213 | Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -,01 | STK | 1.856 | 4.048 |
| US74762E1029 | Quanta Services | STK | 311 | 730 |
| US74834L1008 | Quest Diagnostics | STK | 0 | 259 |
| US7512121010 | Ralph Lauren | STK | 256 | 545 |
| NL0000379121 | Randstad | STK | 1.543 | 1.543 |
| ES0173093024 | Red Electrica Corporacion | STK | 4.522 | 4.522 |
| US7587501039 | Regal-Beloit | STK | 424 | 424 |
| US7595091023 | Reliance Steel & Alumin. | STK | 0 | 391 |
| FR0000131906 | Renault | STK | 2.415 | 2.415 |
| US7599161095 | RepliGen Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 124 | 124 |
| ES0173516115 | Repsol | STK | 7.122 | 7.122 |
| US7496071074 | RLI Corp. Registered Shares DL 1 | STK | 528 | 528 |
| US7703231032 | Robert Half Int. | STK | 311 | 759 |
| US7739031091 | Rockwell Automation Inc. | STK | 0 | 118 |
| US7757111049 | Rollins Inc. Registered Shares DL 1 | STK | 749 | 749 |
| LR0008862868 | Royal Caribbean Cruises | STK | 397 | 397 |
| FR0013269123 | Rubis S.C.A. Actions Port. Nouv. EO 1,25 | STK | 9.529 | 9.529 |
| IE00BYTBXV33 | Ryanair Holdings | STK | 5.032 | 5.032 |
| FR0000130395 | Rémy Cointreau | STK | 467 | 467 |
| FR0000073272 | Safran | STK | 781 | 781 |
| DE0007164600 | SAP | STK | 819 | 819 |
| FR0013154002 | Sartorius Stedim Biotech | STK | 414 | 662 |
| FR0000121972 | Schneider Electric | STK | 576 | 1.254 |

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

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

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge |
|--------------|---|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| IE00BKVD2N49 | Seagate Technolog.Holdings PLC Registered Shares DL -,00001 | STK | 300 | 300 |
| FR0000121709 | SEB | STK | 667 | 667 |
| DE000SHL1006 | Siemens Healthineers AG | STK | 0 | 2.013 |
| NL0011821392 | Signify N.V. | STK | 2.587 | 2.587 |
| US8305661055 | Skechers U.S.A. Inc. | STK | 657 | 657 |
| US78442P1066 | SLM | STK | 1.806 | 1.806 |
| IE00B1RR8406 | Smurfit Kappa Group | STK | 1.920 | 1.920 |
| BE0003717312 | Sofina | STK | 356 | 356 |
| US8523123052 | STAAR Surgical Co. Registered Shares DL-,01 | STK | 400 | 400 |
| US8545021011 | Stanley Black & Decker | STK | 221 | 485 |
| NL00150001Q9 | Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01 | STK | 0 | 5.231 |
| US85917A1007 | Sterling Bancorp Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 1.405 |
| US8606301021 | Stifel Financial | STK | 0 | 539 |
| NL0000226223 | STMicroelectronics | STK | 2.093 | 2.093 |
| FR0010613471 | Suez S.A. | STK | 0 | 8.431 |
| US87165B1035 | Synchrony Financial Registered Shares DL -,001 | STK | 1.399 | 1.399 |
| US87161C5013 | Synovus Financial Corp. Registered Shares DL 1 | STK | 2.034 | 2.034 |
| US8760301072 | Tapestry | STK | 745 | 745 |
| DE000A2YN900 | TeamViewer AG | STK | 7.917 | 7.917 |
| US87901J1051 | TEGNA Inc. | STK | 0 | 2.386 |
| US8793601050 | Teledyne Technologies Inc. | STK | 70 | 70 |
| US88023U1016 | Tempur-Pedic International | STK | 925 | 2.201 |
| LU0156801721 | Tenaris | STK | 9.984 | 9.984 |
| US88033G4073 | Tenet Healthcare | STK | 414 | 414 |
| US88076W1036 | Teradata | STK | 757 | 757 |
| US8826811098 | Texas Roadhouse Inc. Registered Shares DL-,001 | STK | 384 | 384 |
| US8873891043 | Timken | STK | 424 | 424 |
| US89055F1030 | TopBuild Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 178 |
| US8910921084 | Toro | STK | 347 | 347 |
| US89531P1057 | Trex Co. Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 848 | 848 |
| US9022521051 | Tyler Technologies | STK | 65 | 65 |
| FR0000051807 | Téléperformance S.A. | STK | 253 | 518 |
| FR0000054470 | Ubisoft Entertainment | STK | 3.838 | 3.838 |
| BE0003739530 | UCB S.A. | STK | 0 | 1.141 |
| DE000UNSE018 | Uniper | STK | 0 | 4.070 |
| US9100471096 | United Continental | STK | 650 | 1.371 |
| US9113631090 | United Rentals | STK | 0 | 95 |

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 |
|---------------------------------|---|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US9129091081 | United States Steel | STK | 1.467 | 1.467 |
| US9139031002 | Universal Health Services | STK | 0 | 247 |
| US9202531011 | Valmont Industries | STK | 135 | 284 |
| FR0000124141 | Veolia Environnement S.A. | STK | 2.861 | 2.861 |
| FR0000125486 | VINCI | STK | 1.009 | 1.009 |
| FR0000127771 | Vivendi | STK | 7.544 | 7.544 |
| DE0007664039 | Volkswagen Vorzugsaktien | STK | 455 | 901 |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE Namens-Aktien o.N. | STK | 3.891 | 3.891 |
| US9291601097 | Vulcan Materials | STK | 0 | 253 |
| US9297401088 | WABTEC | STK | 0 | 427 |
| US9553061055 | West Pharmaceutic.Services Inc Registered Shares DL -,25 | STK | 155 | 155 |
| US9581021055 | Western Digital | STK | 564 | 564 |
| US9598021098 | Western Union | STK | 1.619 | 1.619 |
| US9633201069 | Whirlpool | STK | 147 | 315 |
| US9699041011 | Williams-Sonoma | STK | 185 | 397 |
| US9741551033 | Wingstop Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 335 | 335 |
| US98311A1051 | Wyndham Hotels & Resorts | STK | 362 | 858 |
| DE000ZAL1111 | Zalando SE Inhaber-Aktien o.N. | STK | 1.160 | 1.160 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE0001135143 | Bundesrep.Deutschland Anl.v.2000(2030) | EUR | 700 | 700 |
| DE0001102473 | Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) | EUR | 400 | 400 |
| DE0001102507 | Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030) | EUR | 400 | 400 |
| Andere Wertpapiere | | | | |
| US0248351001 | American Campus Communities In Reg.Shs of Benef. Int. DL -,01 | STK | 0 | 780 |
| US03750L1098 | Apartment Income REIT Corp. Registered REIT DL -,01 | STK | 0 | 779 |
| US1011211018 | Boston Properties | STK | 0 | 342 |
| US11120U1051 | Brixmor Property Group Inc. Registered Shares o.N. | STK | 1.177 | 1.177 |
| US1331311027 | Camden Property Trust Reg. Shs of Benef. Int.DL-,01 | STK | 0 | 408 |
| BE0003593044 | Cofinimmo | STK | 0 | 684 |
| US22002T1088 | Corporate Office Prop. Tr.(Md) Registered Shares DL -,01 | STK | 921 | 921 |
| US25960P1093 | Douglas Emmett Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 1.042 | 1.042 |
| US2772761019 | EastGroup Properties Inc. Registered Shares DL -,0001 | STK | 0 | 235 |
| US29476L1070 | Equity Residential | STK | 384 | 384 |
| US30225T1025 | Extra Space Storage Inc. Reg.Shs of Benef. Int. DL -,01 | STK | 0 | 251 |
| ES0618900915 | Ferrovial S.A. Anrechte | STK | 3.400 | 3.400 |
| US42250P1030 | Healthpeak Properties Inc. Registered Shares DL 1 | STK | 0 | 1.092 |
| US44107P1049 | Host Hotels & Resorts | STK | 1.963 | 1.963 |
| US4440971095 | Hudson Pacific Properties Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 1.700 | 1.700 |

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

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

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe / Zugänge | Verkäufe / Abgänge |
|--------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US46590V1008 | JBG Smith Properties Registered Shares DL-,01 | STK | 1.028 | 1.028 |
| US49427F1084 | Kilroy Realty Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 499 | 1.044 |
| US49446R1095 | Kimco Realty | STK | 0 | 3.799 |
| US53223X1072 | Life Storage Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 387 |
| US58463J3041 | Medical Properties Trust Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 1.550 | 1.550 |
| US59522J1034 | Mid-America Apartm. Comm. Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 320 |
| US6374171063 | National Retail Properties Inc Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 779 |
| US7005171050 | Park Hotels & Resorts Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 2.011 | 3.890 |
| US7549071030 | Rayonier | STK | 0 | 910 |
| US8621211007 | Store Capital Corporation Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 1.029 |
| DE000A3MQB30 | Vonovia SE Inhaber-Bezugsrechte | STK | 1.707 | 1.707 |
| US9290421091 | Vornado Realty Trust | STK | 792 | 792 |
| US9621661043 | Weyerhaeuser | STK | 0 | 1.027 |

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Aktien

| | | | | |
|--------------|--|-----|-------|-------|
| US0036541003 | Abiomed Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 101 | 101 |
| US03076C1062 | Ameriprise Financial | STK | 0 | 140 |
| US03743Q1085 | APA Corp. Registered Shares DL -,625 | STK | 650 | 650 |
| US04280A1007 | Arrowhead Pharmaceuticals Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 560 | 560 |
| US0537741052 | Avis Budget | STK | 160 | 160 |
| US0708301041 | Bath & Body Works Inc. Registered Shares DL -,50 | STK | 1.454 | 1.454 |
| US07831C1036 | Bellring Distribution LLC Registered Shares DL -,01 | STK | 999 | 999 |
| US1167941087 | Bruker Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 379 | 379 |
| US12514G1085 | CDW Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 170 | 170 |
| US15118V2079 | Celsius Holdings Inc. Registered Shares o.N. | STK | 257 | 257 |
| US16115Q3083 | Chart Industries Inc. | STK | 152 | 152 |
| US1720621010 | Cincinnati Financial | STK | 294 | 294 |
| US1729081059 | Cintas | STK | 0 | 97 |
| US1255818015 | CIT Group Inc. New Registered Shares DL -,01 | STK | 644 | 644 |
| US12571T1007 | CMC Materials Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 264 | 264 |
| US1924221039 | Cognex Corp. Registered Shares DL -,002 | STK | 1.081 | 1.081 |
| US20602D1019 | Concentrix Corp. Registered Shares DL -,0001 | STK | 369 | 369 |
| US20848V1052 | Consensus Cloud Solutions Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 1 |
| DE0005470306 | CTS Eventim AG & Co. KGaA | STK | 2.735 | 2.735 |
| DE000DTR0CK8 | Daimler Truck Holding AG junge Namens-Aktien o.N. | STK | 619 | 619 |
| US25470F1049 | Discovery Communications | STK | 1.487 | 1.487 |
| US25470M1099 | Dish Network | STK | 975 | 975 |
| FR0010908533 | Edenred | STK | 0 | 1.896 |

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 |
|--------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US29786A1060 | Etsy Inc. | STK | 467 | 667 |
| US3021301094 | Expeditors Intl of Wash. | STK | 247 | 597 |
| US3167731005 | Fifth Third Bancorp | STK | 776 | 776 |
| US33768G1076 | FirstCash Holdings Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 358 | 358 |
| US34959E1091 | Fortinet Inc. | STK | 0 | 252 |
| US35138V1026 | Fox Factory Holding Corp. Registered Shares DL -,001 | STK | 287 | 509 |
| CH0114405324 | Garmin | STK | 257 | 751 |
| US36262G1013 | GXO Logistics Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 643 | 643 |
| US4052171000 | Hain Celestial Group | STK | 0 | 932 |
| BMG4388N1065 | Helen of Troy Ltd. Registered Shares DL -,10 | STK | 0 | 154 |
| US4456581077 | Hunt Transport Services | STK | 0 | 209 |
| US9021041085 | II-VI Inc. Registered Shares o.N. | STK | 448 | 448 |
| US44980X1090 | IPG Photonics Corp. Registered Shares DL -,0001 | STK | 261 | 261 |
| US46269C1027 | Iridium Communications Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 803 | 803 |
| US4771431016 | Jetblue Airways | STK | 6.418 | 6.418 |
| US4851703029 | Kansas City Southern | STK | 0 | 157 |
| US5007541064 | Kraft Heinz Co., The Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 922 |
| US50155Q1004 | Kyndryl Holdings Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 2.350 | 2.350 |
| US5138471033 | Lancaster Colony | STK | 0 | 253 |
| US5150981018 | Landstar Systems Inc. | STK | 0 | 334 |
| US50187A1079 | LHC Group | STK | 249 | 249 |
| US5339001068 | Lincoln Electric Holdings Inc. Registered Shares o.N. | STK | 0 | 440 |
| US55024U1097 | Lumentum Holdings Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 303 | 303 |
| NL0009434992 | Lyondellbasell Industries NV | STK | 289 | 289 |
| US5627501092 | Manhattan Associates Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 442 | 442 |
| US56418H1005 | Manpower | STK | 312 | 312 |
| US57060D1081 | MarketAxess Holdings Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 188 | 188 |
| US5747951003 | Masimo Corp. Registered Shares DL -,001 | STK | 122 | 122 |
| US58506Q1094 | Medpace Holdings Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 394 | 590 |
| US55306N1046 | MKS Instruments | STK | 223 | 223 |
| US6311031081 | NASDAQ OMX Group Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 489 | 811 |
| US6404911066 | Neogen Corp. Registered Shares DL -,16 | STK | 1.891 | 1.891 |
| GB00BWFY5505 | Nielsen Holdings PLC Registered Shares EO-,07 | STK | 1.683 | 1.683 |
| US6795801009 | Old Dominion Freight Line | STK | 0 | 363 |
| US68235P1084 | One Gas Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 489 | 489 |
| US6952631033 | PacWest | STK | 889 | 889 |
| US6988131024 | Papa John's Intl Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 287 | 287 |

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 |
|-----------------------------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| US7127041058 | People's United Financial | STK | 0 | 2.612 |
| US72346Q1040 | Pinnacle Financial Partn. | STK | 338 | 338 |
| US73278L1052 | Pool | STK | 66 | 66 |
| US7374461041 | Post Holdings Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 312 |
| US7392761034 | Power Integrations | STK | 307 | 307 |
| NL0013654783 | Prosus N.V. Registered Shares EO -,05 | STK | 3.543 | 3.543 |
| US74736K1016 | Qorvo Inc. | STK | 489 | 489 |
| US8000131040 | Sanderson Farms Inc. Registered Shares DL 1 | STK | 0 | 331 |
| DE0007165631 | Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N. | STK | 157 | 157 |
| US80874P1093 | Scientific Games | STK | 965 | 965 |
| US7841171033 | SEI Investment Co. Registered Shares DL -,01 | STK | 1.007 | 1.007 |
| US8163001071 | Selective Insurance Group Inc. Registered Shares DL 2 | STK | 0 | 532 |
| US8168501018 | Semtech | STK | 1.160 | 1.160 |
| US82669G1040 | Signature Bank Registered Shares DL -,01 | STK | 268 | 413 |
| US83088M1027 | Skyworks Solutions Inc. | STK | 499 | 499 |
| US8581191009 | Steel Dynamics | STK | 0 | 551 |
| US78486Q1013 | SVB Financial Group Registered Shares DL -,001 | STK | 0 | 59 |
| US87157D1090 | Synaptics | STK | 202 | 202 |
| US87166B1026 | Syneos Health Inc. Registered Shares A DL -,01 | STK | 0 | 406 |
| US88224Q1076 | Texas Capital Bancshares Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 864 | 864 |
| US8941641024 | Travel + Leisure Co. Registered Shares DL -,01 | STK | 610 | 610 |
| US8962391004 | Trimble Inc. | STK | 402 | 980 |
| US90384S3031 | Ulta Salon Cosmet. & Frag.Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 171 |
| US9027881088 | UMB Financial | STK | 312 | 312 |
| US9042141039 | Umpqua Holdings | STK | 1.515 | 1.515 |
| US91307C1027 | United Therapeutics Corp.(Del. Registered Shares DL -,01 | STK | 163 | 163 |
| US9837931008 | XPO Logistics Inc. Registered Shares DL -,001 | STK | 964 | 964 |
| US9892071054 | Zebra Technologies | STK | 81 | 149 |
| Andere Wertpapiere | | | | |
| ES06670509K6 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Anrechte | STK | 4.071 | 4.071 |
| US2227955026 | Cousins Properties Inc. Registered Shares DL 1 | STK | 741 | 1.705 |
| FR0000064578 | Covivio S.A. | STK | 1.053 | 1.053 |
| US2644115055 | Duke Realty Corp. Registered Shares DL -,01 | STK | 0 | 1.013 |
| Nicht notierte Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| US0383361039 | AptarGroup Inc. Registered Shares DL -,01 | STK | 272 | 272 |
| US2243991054 | Crane Co. Registered Shares DL 1 | STK | 335 | 335 |
| US29414B1044 | EPAM Systems Inc. | STK | 92 | 92 |

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 |
|--|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| ES0118900176 | Ferrovial S.A. Acciones Port. Div. EO -,20 | STK | 39 | 39 |
| Investmentanteile | | | | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | |
| DE000ETFL029 | Deka EURO STOXX 50 | ANT | 26.000 | 26.000 |

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 |
|---|---------------------------------------|-----------------|--------------------|------------------|
| Terminkontrakte | | | | |
| Wertpapier-Terminkontrakte | | | | |
| Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktien | | | | |
| Verkaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 1.634 |
| Deutsche Börse) | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | |
| Gekaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 502 |
| ESTX 50 Index (Price) (EUR)) | | | | |
| Verkaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 1.669 |
| ESTX 50 Index (Price) (EUR)) | | | | |
| Währungsterminkontrakte | | | | |
| Gekaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 34.069 |
| Euro/US-Dollar) | | | | |
| Optionsrechte | | | | |
| Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate | | | | |
| Optionsrechte auf Aktienindices | | | | |
| Gekaufte Kaufoptionen (Call) | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 11 |
| CBOE VOLATILITY IND.) | | | | |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND I

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2021 BIS 31.10.2022

| | EUR | EUR |
|--|-----------|----------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller | | 1.430,68 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 57.371,80 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 16.254,40 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | 17.399,04 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -521,37 |
| davon negative Habenzinsen | -3.094,64 | |
| 6. Erträge aus Investmentanteilen | | 8.008,07 |
| 7. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -12.256,48 |
| 8. Sonstige Erträge | | 2.281,58 |
| Summe der Erträge | | 89.967,72 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -49.561,86 |
| 2. Verwahrstellenvergütung | | -3.104,91 |
| 3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -10.606,49 |
| 4. Sonstige Aufwendungen | | -5.266,40 |
| 5. Aufwandsausgleich | | -3.856,35 |
| Summe der Aufwendungen | | -72.396,01 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 17.571,71 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 1.138.547,39 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.247.141,63 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -108.594,24 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -91.022,53 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -814.879,27 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -260.512,43 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.075.391,70 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.166.414,23 |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND R

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.11.2021 BIS 31.10.2022

| | EUR | EUR |
|--|-----------|----------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller | | 1.519,90 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 56.957,18 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 16.058,30 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | 17.092,51 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -559,26 |
| davon negative Habenzinsen | -3.029,22 | |
| 6. Erträge aus Investmentanteilen | | 8.008,80 |
| 7. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -12.012,54 |
| 8. Sonstige Erträge | | 2.264,74 |
| Summe der Erträge | | 89.329,63 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -77.148,49 |
| 2. Verwahrstellenvergütung | | -3.278,05 |
| 3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -11.714,46 |
| 4. Sonstige Aufwendungen | | -5.477,46 |
| 5. Aufwandsausgleich | | 1.234,46 |
| Summe der Aufwendungen | | -96.384,00 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | -7.054,37 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 1.232.832,87 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.340.364,72 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -107.531,85 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -114.586,22 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -852.265,00 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -255.898,51 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.108.163,51 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.222.749,73 |

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

| | EUR | EUR |
|--|-----------|----------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller | | 2.950,58 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 114.328,98 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 32.312,70 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | 34.491,55 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | -1.080,63 |
| davon negative Habenzinsen | -6.123,86 | |
| 6. Erträge aus Investmentanteilen | | 16.016,87 |
| 7. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -24.269,02 |
| 8. Sonstige Erträge | | 4.546,32 |
| Summe der Erträge | | 179.297,35 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Verwaltungsvergütung | | -126.710,35 |
| 2. Verwahrstellenvergütung | | -6.382,96 |
| 3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -22.320,95 |
| 4. Sonstige Aufwendungen | | -10.743,86 |
| 5. Aufwandsausgleich | | -2.621,89 |
| Summe der Aufwendungen | | -168.780,01 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 10.517,34 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 2.371.380,26 |
| 2. Realisierte Verluste | | -2.587.506,35 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | -216.126,09 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -205.608,75 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | -1.667.144,27 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | -516.410,94 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | -2.183.555,21 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -2.389.163,96 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND I

| | EUR | EUR |
|---|-------------|---------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.11.2021) | | 5.970.701,47 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | 99.467,37 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 654.546,83 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -555.079,46 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -6.538,75 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.166.414,23 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -814.879,27 | |
| davon nicht realisierte Verluste | -260.512,43 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2022) | | 4.889.824,51 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND R

| | EUR | EUR |
|---|-------------|---------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.11.2021) | | 6.161.671,83 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | -51.647,43 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 79.447,85 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -131.095,28 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -2.185,76 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -1.222.749,73 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -852.265,00 | |
| davon nicht realisierte Verluste | -255.898,51 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.10.2022) | | 4.836.390,42 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

| | EUR | EUR |
|--|---------------|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 12.132.373,30 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | 47.819,94 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 733.994,68 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -686.174,74 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -8.724,51 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -2.389.163,96 |
| davon nicht realisierte Gewinne | -1.667.144,27 | |
| davon nicht realisierte Verluste | -516.410,94 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | | 9.726.214,93 |

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND I ¹⁾

| | insgesamt EUR | je Anteil EUR |
|---|----------------------|------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | 1.267.338,03 | 22,80 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | 111.218,93 | 2,00 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | -91.022,53 | -1,64 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen | 1.247.141,63 | 22,44 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | -1.267.338,04 | -22,80 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | -533.864,36 | -9,60 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | -733.473,68 | -13,20 |
| III. Gesamtausschüttung | 0,00 | 0,00 |
| 1. Endausschüttung | 0,00 | 0,00 |
| a) Barausschüttung | 0,00 | 0,00 |

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND R ¹⁾

| | insgesamt EUR | je Anteil EUR |
|---|----------------------|------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | 1.310.497,41 | 23,40 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | 84.718,91 | 1,51 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | -114.586,22 | -2,05 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen | 1.340.364,72 | 23,94 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | -1.310.497,40 | -23,40 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | -585.038,84 | -10,45 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | -725.458,56 | -12,96 |
| III. Gesamtausschüttung | 0,00 | 0,00 |
| 1. Endausschüttung | 0,00 | 0,00 |
| a) Barausschüttung | 0,00 | 0,00 |

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND I

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | Anteilwert |
|---------------|--|------------|
| | EUR | EUR |
| 2022 | 4.889.824,51 | 87,97 |
| 2021 | 5.970.722,09 | 110,35 |
| 2020 | 4.057.000,00 | 93,21 |
| 2019 | 16.477.000,00 | 106,57 |

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND R

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | Anteilwert |
|---------------|--|------------|
| | EUR | EUR |
| 2022 | 4.836.390,42 | 86,37 |
| 2021 | 6.161.693,11 | 108,83 |
| 2020 | 6.163.000,00 | 92,36 |
| 2019 | 9.007.000,00 | 106,03 |

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE FÜR DAS GESAMTFONDSVERMÖGEN

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres |
|---------------|--|
| | EUR |
| 2022 | 9.726.214,93 |
| 2021 | 12.132.415,20 |
| 2020 | 10.220.000,00 |
| 2019 | 25.484.000,00 |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

| | | |
|---|-----|------------------|
| Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure | EUR | 260.916,74 |
| 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) | | |
| EURO STOXX 50 Net Return Index In EUR | | 40,00% |
| S&P 500 EUR Hdg (Net TR) | | 35,00% |
| iBoxx EUR Sovereigns 7+ Clean Price Index in EUR | | 25,00% |
| Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV | | |
| kleinster potenzieller Risikobetrag | | 0,41% |
| größter potenzieller Risikobetrag | | 1,61% |
| durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag | | 0,89% |
| 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 | | 0,99 |

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 Greiff Systematic Allocation Fund I | EUR | 87,97 |
| Anteilwert Greiff Systematic Allocation Fund R | EUR | 86,37 |
| Umlaufende Anteile Greiff Systematic Allocation Fund I | STK | 55.587,000 |
| Umlaufende Anteile Greiff Systematic Allocation Fund R | STK | 55.997,085 |

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

| | Greiff Systematic Allocation Fund I | Greiff Systematic Allocation Fund R |
|----------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| ISIN | DE000A2JN5B4 | DE000A2JN5C2 |
| Währung | Euro | Euro |
| Fondsaufgabe | 02.11.2018 | 02.11.2018 |
| Ertragsverwendung | Ausschüttend | Ausschüttend |
| Verwaltungsvergütung | 0,95 % p.a. | 1,40 % p.a. |
| Ausgabeaufschlag | 0,00 % | 3,00 % |
| Mindestanlagevolumen | 100.000 | 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 GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND I

| | |
|---|--------|
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 1,31 % |
|---|--------|

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE GREIFF SYSTEMATIC ALLOCATION FUND R

| | |
|---|--------|
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 1,77 % |
|---|--------|

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 | 120.975.413,55 |
| Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen | 0,00 |
| Relativ in % | 0,00 % |

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 74.632,22 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 für die Anteilklasse I sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse R 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 % |
|--------------|--|---|
| DE000ETFLO29 | Deka EURO STOXX 50 UCITS ETF Inhaber-Anteile ¹⁾ | 0,15 |

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

Greiff Systematic Allocation Fund I

Sonstige Erträge

| | | |
|--------------------------|-----|----------|
| Quellensteuer Erstattung | EUR | 1.799,10 |
|--------------------------|-----|----------|

Sonstige Aufwendungen

| | | |
|---------------------|-----|----------|
| Depotgebühren | EUR | 2.305,43 |
| Performance Messung | EUR | 962,62 |

Greiff Systematic Allocation Fund R

Sonstige Erträge

| | | |
|--------------------------|-----|----------|
| Quellensteuer Erstattung | EUR | 1.801,71 |
|--------------------------|-----|----------|

Sonstige Aufwendungen

| | | |
|---------------------|-----|----------|
| Depotgebühren | EUR | 2.390,22 |
| Performance Messung | EUR | 1.044,14 |

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 Greiff capital management AG für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

| | | |
|--|-------------------------------------|---------------------|
| Portfoliomanager | Greiff capital management AG | |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung | EUR | 2.111.901,00 |
| 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 | | 19 |

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:

Zusammensetzung des Portfolios,
Portfolioumsätze und Portfolioumsatzkosten:

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

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

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

Verweis

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

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.

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.

Informationen zur Stimmrechtsausübung sind auf der Internetseite der HANSAINVEST erhältlich.

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

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Greiff Systematic Allocation Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900SPEV13H9NT1Z39

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

 Ja

 Nein

 Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0%

 Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0% an nachhaltigen Investitionen

 in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

 mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

 in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

 mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

 mit einem sozialen Ziel

 Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0%

 Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.


INWIEWEIT WURDEN DIE MIT DEM FINANZPRODUKT BEWORBENEN ÖKOLOGISCHEN UND/ODER SOZIALEN MERKMALE ERFÜLLT?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Fonds bewirbt unter Berücksichtigung bestimmter Ausschlusskriterien ökologische oder soziale Merkmale oder eine Kombination aus diesen Merkmalen.

Für den Fonds sind folgende ESG-Faktoren maßgeblich:

Mindestens 51% des Wertes des Sondervermögens müssen in Wertpapiere investiert werden, die unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitskriterien ausgewählt werden und von dem Datenprovider MSCI ESG Research LLC unter ökologischen und sozialen Kriterien

analysiert und positiv bewertet werden. Im Rahmen dieser Mindestquote von 51% sind nur solche Titel erwerbbar, die ein ESG Rating von mindestens BB aufweisen. Ferner wurden ESG-Ausschlusskriterien berücksichtigt.

Die Ausrichtung an den vorgegebenen ESG-Faktoren wurde ordnungsgemäß in den Anlageprozess implementiert. Die beworbenen Merkmale wurden im relevanten Zeitraum vom 01. Oktober 2021 bis 31. Oktober 2022 durchgehend beachtet. Es wurden keine Verstöße gegen die im Verkaufsprospekt dargestellten Ausschlusskriterien oder Anlagegrenzen festgestellt.

Der Fonds darf in Aktien und Anleihen investieren, für welche (noch) keine Daten des Datenproviders MSCI ESG Research LLC vorhanden sind und damit aktuell nicht gesagt werden kann, ob gegen die im Verkaufsprospekt genannten Ausschlusskriterien verstoßen wurde. Sobald für solche Aktien und Anleihen Daten vorhanden sind, wurden die genannten Ausschlusskriterien eingehalten. Sie gelten also für 100 % der Aktien und Anleihen, die entsprechend gescreent werden konnten.

Im Berichtszeitraum vom 01. Oktober 2022 bis 31. Oktober 2022 lagen bei den Investitionen in die Aktien von Christian Dior (ISIN FR0000130403) sowie Genpact Ltd. (ISIN BMG3922B1072) keine entsprechende Daten vor.

Die HANSAINVEST berücksichtigt bei der Verwaltung von Vermögensanlagen derzeit noch nicht umfassend und systematisch etwaige nachteilige Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Unter Nachhaltigkeitsfaktoren verstehen wir in diesem Zusammenhang Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte und die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Die gesetzlichen Anforderungen hierfür sind neu und sehr detailliert. Ihre sorgfältige Umsetzung verlangt von uns einen erheblichen Aufwand. Zudem liegen im Markt aktuell die maßgeblichen Daten, die zur Feststellung und Gewichtung herangezogen werden müssen, nicht in ausreichendem Umfang vor.

Allerdings verwaltet unser Unternehmen einzelne Investmentfonds, bei denen die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren verbindlich festgelegter Teil der Anlagestrategie ist. Diese Fonds bewerben entweder ökologische und/ oder soziale Merkmale als Teil ihrer Anlagepolitik, oder streben nachhaltige Investitionen im Sinne der Verordnung (EU) 2019/2088 an. Gemäß der eben genannten Verordnung informieren wir in den vorvertraglichen Informationen, in den Jahresberichten und auf unserer Homepage für jeden dieser Fonds über die festgelegten Merkmale oder Nachhaltigkeitsziele sowie darüber, ob und ggf. wie die Berücksichtigung nachteiliger Nachhaltigkeitsauswirkungen Bestandteil der Anlagestrategie ist.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikatoren zu der dezidierten ESG-Anlagestrategie:

Zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, wurden Kriterien aus den Bereichen Umwelt (Environment), Soziales (Social) und verant-

wortungsvoller Unternehmensführung (Governance) herangezogen und in einem ESG-Rating zusammengefasst. Entsprechend sind im Rahmen der zuvor genannten Mindestquote von 51 % nur solche Titel erwerbbar, die ein ESG-Rating von mindestens BB aufwiesen.

Die im Fonds enthaltenen Wertpapiere weisen ein ESG-Rating von mindestens BB (MSCI) in Höhe von 83,38 % auf.

Nachhaltigkeitsindikatoren zu den Ausschlusskriterien:

Der Fonds darf in Aktien investieren, für welche (noch) keine Daten des Datenproviders MSCI ESG Research LLC vorhanden sind und damit aktuell nicht gesagt werden kann, ob gegen die nachfolgend genannten Ausschlusskriterien verstoßen wurde. Sobald für solche Aktien und Anleihen Daten vorhanden waren, wurden die genannten Ausschlusskriterien eingehalten. Sie gelten also für alle Aktien und Anleihen, die entsprechend gescreent werden konnten. Die Daten für die dezidierte ESG-Anlagestrategie als auch die Ausschlusskriterien wurden durch den Datenprovider MSCI zur Verfügung gestellt. Es wurden für den Fonds keine Aktien oder Anleihen von Unternehmen erworben, die gemäß Verkaufsprospekt ausgeschlossen wurden.

Die Grundlage der Berechnungsmethode beruht auf den börsentäglich ermittelten Durchschnittswerten des durchschnittlichen Fondsvolumens.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Ein Vergleich ist erst ab dem darauffolgendem Jahr möglich.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



WIE WURDEN BEI DIESEM FINANZPRODUKT DIE WICHTIGSTEN NEGATIVEN AUSWIRKUNGEN AUF NACHHALTIGKEITSAUSWIRKUNGEN BERÜCKSICHTIGT?

Die Ausschlusskriterien werden zudem im Verkaufsprospekt definiert und aufgeführt.

Im Folgenden wird ausgeführt, welche Nachhaltigkeitsauswirkungen („PAI“) das Sondervermögen im Rahmen seiner Investitionsentscheidungen berücksichtigte und durch welche Maßnahmen (Ausschlusskriterien) beabsichtigt wurde, diese zu vermeiden, bzw. zu verringern:

Im Besonderen wurden PAIs berücksichtigt, die im Kontext ökologischer und sozialer Nachhaltigkeit zu betrachten sind. Hierzu wurden die u.g. Ausschlusskriterien Nr. (2) und (4) - (8) für Unternehmen sowie die Ausschlusskriterien Nr. (9) und (10) für Staaten sowie die Ausschlusskriterien Nr. (14) und (16) für Investmentanteile herangezogen.

Die unter Ausschlusskriterium Nr. (2) und Nr. (12) genannten Konventionen, die sich konkret auf die jeweils genannten Waffenkategorien beziehen, verbieten den Einsatz, die Produktion, die Lagerung und die Weitergabe der jeweiligen Waffenkategorie. Darüber hinaus beinhalten die Konventionen Regelungen zur Zerstörung von Lagerbeständen kontroverser Waffen, sowie der Räumung von kontaminierten Flächen und Komponenten der Opferhilfe.

Die mit Ausschlusskriterien Nr. (4), (5), (7) und (14) aufgegriffene Begrenzung der Stromerzeugung durch fossile Brennstoffe ist im ökologischen Kontext als ein wesentlicher Faktor für die Einschränkung von Treibhausgas- und CO²-Emissionen einzuordnen. Die Ausschlusskriterien Nr. (8) und Nr. (16) greifen den UN Global Compact, sowie die OECD Leitsätze für Multinationale Unternehmen auf.

Der UN Global Compact verfolgt mit den dort aufgeführten 10 Prinzipien die Vision, die Wirtschaft in eine inklusivere und nachhaltigere Wirtschaft umzugestalten. Die 10 Prinzipien des UN Global Compact lassen sich in vier Kategorien Menschenrechte (Prinzipien 1 und 2), Arbeitsbedingungen (Prinzipien 3 -6), Ökologie (Prinzipien 7-9) und Anti-Korruption (Prinzip 10) unterteilen.

Entsprechend der Prinzipien 1 - 2 haben Unternehmen sicherzustellen, dass sie die international anerkannten Menschenrechte respektieren und unterstützen, sie im Rahmen ihrer Tätigkeit also nicht gegen die Menschenrechte verstoßen. Die Prinzipien 3 - 6 sehen vor, dass die Unternehmen die internationalen Arbeitsrechte respektieren und umsetzen.

Im Rahmen der Prinzipien 7 - 9 werden Anforderungen an die ökologische Nachhaltigkeit gestellt, die unter den folgenden Schlagworten zusammengefasst werden können: Vorsorge, Förderung von Umweltbewusstsein sowie Entwicklung und Anwendung nachhaltiger Technologien. Das Prinzip 10 etabliert unter anderem den Anspruch, dass Unternehmen Maßnahmen gegen Korruption ergreifen müssen.

Mit den OECD-Leitsätzen für Multinationale Unternehmen wird das Ziel verfolgt, weltweit

die verantwortungsvolle Unternehmensführung zu fördern. Die OECD-Leitsätze für Unternehmen stellen hierzu einen Verhaltenskodex in Hinblick auf Auslandsinvestitionen und für die Zusammenarbeit mit ausländischen Zulieferern auf.

Der Freedom House Index wird jährlich durch die NGO Freedom House veröffentlicht und versucht die politischen Rechte sowie bürgerlichen Freiheiten in allen Ländern und Gebieten transparent zu bewerten. Zur Bewertung politischer Rechte werden insbesondere die Kriterien Wahlen, Pluralismus und Partizipation sowie die Regierungsarbeit herangezogen. Die bürgerlichen Freiheiten werden anhand der Glaubens-, Versammlungs- und Vereinigungsfreiheit sowie der Rechtsstaatlichkeit und der jeweiligen individuellen Freiheit des Bürgers im jeweiligen Land beurteilt.

Mit dem Abkommen von Paris hat sich im Dezember 2015 die Mehrheit aller Staaten auf ein globales Klimaschutzabkommen geeinigt. Konkret verfolgt das Pariser Abkommen drei Ziele:

- Langfristige Begrenzung der Erderwärmung auf deutlich unter zwei Grad Celsius im Vergleich zum vorindustriellen Niveau. Im Übrigen sollen sich die Staaten bemühen, den Temperaturanstieg auf 1,5 % im Vergleich zum vorindustriellen Niveau zu begrenzen.
- Treibhausgasemissionen zu mindern
- die Finanzmittelflüsse mit den Klimazielen in Einklang zu bringen.

Dies vorausgeschickt, soll in den folgenden Tabellen jeweils aufgezeigt werden, durch welche Ausschlusskriterien wesentliche nachteilige Auswirkungen auf welche Nachhaltigkeitsfaktoren abgemildert wurden. Die Auswahl der Nachhaltigkeitsfaktoren beruht auf der im final vorliegenden delegierten Verordnung zur Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Für Aktien oder Anleihen von Unternehmen:

| Nachhaltigkeitsfaktor/ PAI | Berücksichtigt durch | Begründung |
|--|--|--|
| <p>1 Treibhausgasemissionen (GHG Emissions)</p> <p>2 CO2 Fußabdruck (Carbon Footprint)</p> <p>3 Treibhausgasintensität der im Portfolio befindlichen Unternehmen (GHG intensity of investee companies)</p> | <p>Ausschlusskriterien Nr. (4), (5), (7) und (8) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (14) und (16) bezogen auf Investmentanteile</p> | <p>Durch die in den Ausschlusskriterien Nr. (4), (5) und (7) bei Aktien und Anleihen für Unternehmen und (14) für Investmentanteile genannte Umsatzschwelle hinsichtlich Unternehmen, welche Umsatz mit der Stromerzeugung aus fossilen Brennstoffen erwirtschaften, sowie durch den Ausschluss von Unternehmen, welche schwere Kontroversen mit den UN Global Compact und damit ebenfalls mit den Prinzipien 7-9 des UN Global Compacts aufweisen, kann davon ausgegangen werden, dass mittelbar weniger Emissionen ausgestoßen werden.</p> |
| <p>4. Exposition zu Unternehmen aus dem Sektor der Fossilen Brennstoffe (Exposure to companies active in the fossile fuel sector)</p> | <p>Ausschlusskriterien Nr. (4), (5) und (7) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (14) bezogen auf Investmentanteile</p> | <p>Investitionen in Aktivitäten im Bereich fossile Brennstoffe sind für den Fonds aufgrund der in den Ausschlusskriterien verankerten Umsatzschwellen begrenzt, wodurch eine entsprechende Exposition teilweise vermieden wird.</p> |
| <p>5. Anteil von nichterneuerbarer Energie an Energieverbrauch und -produktion (Share of non-renewable energy consumption and production)</p> | <p>Ausschlusskriterien Nr. (4) - (6) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (14) bezogen auf Investmentanteile</p> | <p>Durch die in den Ausschlusskriterien beinhalteten Umsatzschwellen wird die Investition in als besonders problematisch eingestuften Energiequellen beschränkt.</p> <p>Der Anteil von nicht-erneuerbaren Energien am Energieverbrauch wird damit indirekt berücksichtigt, da anzunehmen ist, dass die Begrenzung der Investitionen zu einem verminderten Angebot nicht erneuerbarer Energie führen wird.</p> |

| | | |
|---|---|---|
| 6. Energieverbrauchsintensität pro Branche mit hohen Klimaauswirkungen (Energy consumption intensity per high impact climate sector) | Ausschlusskriterium Nr. (8) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (16) bezogen auf Investmentanteile | Die Prinzipien 7-9 des UN Global Compact halten Unternehmen an die Umwelt vorsorglich, innovativ und zielgerichtet im Rahmen ihrer Tätigkeiten zu schützen. Insbesondere der mit Prinzip 9 UN Global Compact verfolgte Ansatz, innovative Technologien zu entwickeln, kann zu einer Verringerung der Energieintensität beitragen. Entsprechend wird erwartet, dass Unternehmen, welche keine schwerwiegenden Verstöße mit dem UN Global Compact aufweisen, beschränkte negative Auswirkungen auf die Energieverbrauchsintensität pro Branche haben. |
| 7. Aktivitäten mit nachteiligen Auswirkungen auf artenreiche Gebiete (Activities negatively affecting biodiversity-sensitive areas) 8. Schadstoffausstoß in Gewässer (Emissions to water) 9. Sondermüll (Hazardous waste) | Ausschluss-kriterium Nr. (8) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (16) bezogen auf Investmentanteile | Insbesondere wird in Prinzip 7 des UN Global Compact der Vorsorgeansatz postuliert. Es wird davon ausgegangen, dass Unternehmen welche keine schwerwiegenden Verstöße mit dem UN Global Compact aufweisen, nur beschränkte negative Auswirkungen auf geschützte Gebiete und die dort beheimateten Arten, und nur beschränkte negative Auswirkungen an anderen Orten durch Schadstoff-belastetes Abwasser oder durch Sondermüll entfalten. |
| 10. Verstöße gegen den UN Global Compact oder die OECD Leitlinien für multinationale Unternehmen (Violations of UNGC and OECD Guidelines for MNE) | Ausschlusskriterium Nr. (8) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (16) bezogen auf Investmentanteile | Schwerwiegende Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD Leitlinien für multinationale Unternehmen werden durch das Ausschlusskriterium Nr. 8 fortlaufend überwacht. |
| 11. Mangelnde Prozesse und Compliancemechanismen um Einhaltung des UN Global Compacts oder der OECD Leitlinien für multinationale Unternehmen zu überwachen (Lack of processes and compliance mechanisms to monitor compliance with UNGC and OECD Guidelines) | Ausschlusskriterium Nr. (8) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (16) bezogen auf Investmentanteile | Unternehmen, bei denen schwerwiegende Verstöße gegen die genannten Vereinbarung auftreten, haben erkennbar nicht ausreichend Strukturen geschaffen, um die Einhaltung der Normen sicherstellen zu können, so dass davon ausgegangen werden kann, dass der Ausschluss zu einer Beschränkung der negativen Auswirkungen führt. |

| | | |
|--|--|--|
| 12. Unbereinigte geschlechtsspezifische Lohnlücke (Unadjusted gender pay gap) 13. Geschlechterdiversität im Aufsichtsrat oder Geschäftsführung (Board gender diversity) | Ausschlusskriterium Nr. (8) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (16) bezogen auf Investmentanteile | Da Prinzip 6 des UN Global Compact auf die Abschaffung aller Formen von Diskriminierung am Arbeitsplatz abzielt und zudem im Rahmen der Prinzipien 3-6 auf die ILO Kernarbeitsnormen verwiesen wird ist davon auszugehen, dass der Ausschluss schwerwiegender Verstöße zu einer Beschränkung negativer Auswirkungen führt. |
| 14. Exposition zu kontroversen Waffen (Exposure to controversial weapons) | Ausschlusskriterium Nr. (2) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (12) bezogen auf Investmentanteile | Über das Ausschlusskriterium Nr. (2) bezogen auf Aktien und Anleihen für Unternehmen und Nr. (12) bezogen auf Investmentanteile wird eine Investition in Unternehmen, welche Umsatz mit kontroversen Waffen, bspw. Antipersonenminen erwirtschaften, ausdrücklich ausgeschlossen. |

Für Anleihen von Staaten:

| Nachhaltigkeitsfaktor/ PAI | Berücksichtigt durch | Begründung |
|---|------------------------------|---|
| Treibhausgasintensität (GHG Intensity) | Ausschlusskriterium Nr. (10) | Da der Portfoliomanager durch Anwendung des Ausschlusskriteriums Nr. (10) nur in Anleihen von Staaten investiert, die das Pariser Abkommen ratifiziert haben, ist sichergestellt, dass nur in Staaten investiert wird, welche Maßnahmen treffen, um die Treibhausgasintensität zu minimieren. Daher lässt sich davon ausgehen, dass mittelbar eine Beschränkung negativer Auswirkungen auf die Treibhausgasintensität von Staatenerfolgt. |
| Im Portfolio befindliche Anleihen von Ländern, die sozialen Verstößen ausgesetzt sind (Investee countries subject to social violations) | Ausschlusskriterium Nr. (9) | Durch Anwendung des Ausschlusskriterium Nr. (9) investiert der Portfoliomanager für das Sondervermögen nicht in Staatsanleihen, welche auf Grundlage bestehender Informationen, Analysen und Experteninterviews als „unfrei“ klassifiziert werden. [Die Klassifizierung ist in „frei“, „teilweise frei“ und „unfrei“ unterteilt.] So wird sichergestellt, dass der Portfoliomanager wenigstens keine Anleihen von Staaten investiert, welche definitiv sozialen Verstößen ausgesetzt sind. Entsprechend wird das PAI insofern berücksichtigt, als dass eine Beschränkung negativer erfolgt. |

Für Investmentanteile:

Das Fondsmanagement strebte an für das Sondervermögen nur in Investmentanteile solcher Fonds zu investieren, die im Rahmen ihrer jeweiligen Anlagestrategie die zuvor genannten PAI berücksichtigen.

Konkrete Daten liegen dem Portfolioverwalter aktuell noch nicht vor, Entsprechend kann eine Bewertung etwaiger Investmentanteile in Hinblick auf das Einhalten der PAI aktuell noch nicht getroffen werden.

Sobald dem Portfolioverwalter entsprechende Daten vorliegen, wird der Portfoliomanager diese bei seinen Investitionsentscheidungen entsprechend berücksichtigen.

Investmentanteile lagen im relevanten Bezugszeitraum vom 01.10.2022 bis zum 31.10.2022 nicht vor.

Die genaue Funktionsweise der Titelauswahl wird auf der Homepage der Gesellschaft unter

<https://www.hansainvest.com/deutsch/fondswelt/fondsuebersicht/>

dargestellt.

**WELCHE SIND DIE HAUPTINVESTITIONEN DIESES FINANZPRODUKTS?**

Es wurden die Sektoren anhand des Branchen Typs Stoxx Sectors ausgewiesen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten im Vergleich zum kumulierten Fondsvolumen abzüglich der Kasse, da diese keine Hauptinvestition darstellt. Dadurch können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.11.2021 - 31.10.2022

| Größte Investitionen | Sektor | In % der Vermögenswerte | Land |
|--|--|-------------------------|-----------------------------|
| Bundesrep.Deutschland Anl.v.1997 (2027) (DE0001135044) | Staatsanleihen | 6,19% | Deutschland |
| United States of America DL-Notes 2019(29) (US912828YB05) | Staatsanleihen | 5,91% | USA |
| United States of America DL-Notes 2020(30) (US912828Z948) | Staatsanleihen | 5,40% | USA |
| Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2020(30) (EU000A283859) | Staatsanleihen | 4,66% | Europäische Gemeinschaft EG |
| United States of America DL-Bonds 2021(31) (US91282CCB54) | Staatsanleihen | 3,95% | USA |
| Deka EURO STOXX 50 UCITS ETF Inhaber-Anteile (DE000ETFL029) | Fonds | 3,90% | Eurozone |
| Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N. (DE0005810055) | Investmentbanken und Broker | 3,38% | Deutschland |
| United States of America DL-Bonds 2021(31) (US91282CDJ71) | Staatsanleihen | 2,80% | USA |
| Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029) (DE0001102473) | Staatsanleihen | 2,75% | Deutschland |
| United States of America DL-Bonds 2022(32) S.C-2032 (US91282CEP23) | Staatsanleihen | 2,00% | USA |
| Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12 (FR0006174348) | Industrielle Unterstützungsdienste | 1,07% | Frankreich |
| Legrand S.A. Actions au Port. EO 4 (FR0010307819) | Elektronische und elektrische Ausrüstung | 1,05% | Frankreich |
| Bundesrep.Deutschland Anl.v.2000(2030) (DE0001135143) | Staatsanleihen | 1,03% | Deutschland |
| adidas AG Namens-Aktien o.N. (DE000A1EWWW0) | Persönliche Güter | 0,71% | Deutschland |
| UCB S.A. Actions au Porteur de Cap.o.N. (BE0003739530) | Pharma-, Biotechnologie | 0,68% | Belgien |



WIE HOCH WAR DER ANTEIL DER NACHHALTIGKEITSBEZOGENEN INVESTITIONEN?

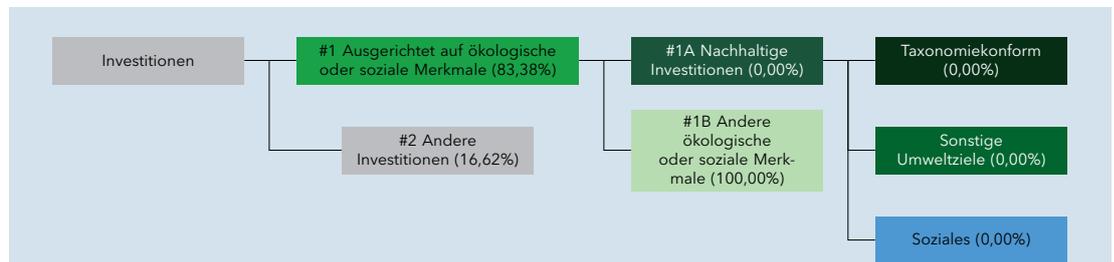
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Mindestanteil der Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erfüllung der beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfolgen, muss 51 % des Wertes des Sondervermögens betragen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den börsentäglichen Durchschnittswerten für den relevanten Bezugszeitraum vom 01.10.22 bis 31.10.2022. Dadurch können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

In der nachfolgenden graphischen Aufstellung erfolgt eine Aufteilung der Vermögensgegenstände des Fonds in verschiedene Kategorien. Der jeweilige durchschnittliche Anteil am Fondsvermögen wird in Prozent angegeben.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst die Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Nachfolgend werden die Sektoren anhand des Branchen Typs Stoxx Sectors ausgewiesen.

Es wurden zum Stichtag 31.10.2022 1,13% der Investitionen im Bereich fossile Brennstoffe getätigt. Der Anteil der Investitionen in Sektoren und Teilsektoren der fossilen Brennstoffe wurde auf Grundlage von Daten des STOXX Sectors berechnet. Dieser Anteil beinhaltet Unternehmen, die im Sinne von Artikel 54 der Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 vom 6. April 2022 Einkünfte aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Herstellung, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel von fossilen Brennstoffen erzielen.

Die Grundlage der Ermittlung der Werte beruht auf den Werten des Wertpapiervermögens zum Geschäftsjahresende. Durch Rundungen können Abweichungen zur Vermögensübersicht im Jahresbericht entstehen.

| Sektor | Anteil |
|--|--------|
| Staatsanleihen | 43,51% |
| Persönliche Güter | 7,80% |
| Kasse und Derivate | 6,32% |
| Banken | 5,93% |
| Bau und Baustoffe | 3,70% |
| Reisen und Freizeit | 3,49% |
| Nicht-Lebensversicherung | 3,18% |
| Elektronische und elektrische Ausrüstung | 2,48% |
| Pharma-, Biotechnologie | 2,19% |
| Software und Computerdienstleistungen | 1,79% |
| Technologie-Hardware und Ausrüstung | 1,73% |
| Chemikalien | 1,55% |
| Industrielle Unterstützungsdienste | 1,49% |
| Medizinische Geräte und Dienstleistungen | 1,28% |
| Öl, Gas und Kohle | 1,13% |
| Nahrungsmittel | 1,05% |
| Industrieunternehmen allgemein | 1,04% |
| Immobilienfonds (REITs) | 1,03% |
| Lebensversicherung | 0,97% |
| Gesundheitsdienstleister | 0,86% |
| Getränke | 0,76% |
| Freizeitgüter | 0,76% |
| Medien | 0,75% |
| Gas, Wasser und kombinierte Versorgung | 0,53% |
| Industrietechnik | 0,52% |
| Automobile und Teile | 0,52% |
| Investmentbanken und Broker | 0,51% |
| Einzelhandel | 0,51% |
| Industriematerialien | 0,49% |
| Haushaltswaren und Wohnungsbau | 0,47% |
| Elektrizität | 0,31% |
| Verbraucherdienste | 0,29% |
| Körperpflege-, Drogerie- und Lebensmittelgeschäfte | 0,29% |
| Telekommunikationsausrüstung | 0,26% |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 0,25% |
| Finanz-Kreditdienste | 0,25% |



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds trägt nicht zu einem oder mehreren Umweltzielen gem. Art 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) bei.

Die dem Fonds zugrundeliegenden Investitionen sind nicht, d.h. zu 0 %, auf Wirtschaftstätigkeiten ausgerichtet, die gem. Art. 3 Verordnung (EU) 2020/852 („Taxo-

nomieverordnung“) als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten eingestuft sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert 1)?

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen - siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

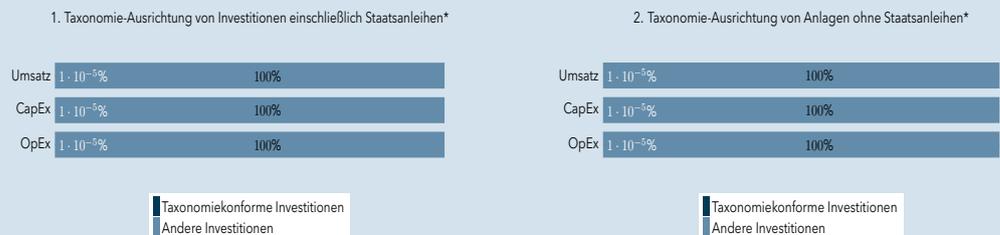
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Die maßgeblichen Daten, die zur Ermittlung des Anteils der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten herangezogen werden müssen, liegen noch nicht in ausreichendem Umfang vor. Daher wird der folgende Anteil angegeben:

| Art der Wirtschaftstätigkeit | Anteil |
|------------------------------|--------|
| Ermöglichende Tätigkeiten | 0,00% |
| Übergangstätigkeiten | 0,00% |

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Das Sondervermögen strebt keine nachhaltigen Investitionen an. Insofern wurden keine derartigen Investitionen getätigt.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Unter "Andere Investitionen" können Investitionen in Aktien und Aktien gleichwertige Wertpapiere, Wertpapiere, die keine Aktien und Aktien gleichwertige Wertpapiere sind, Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Investmentanteile, Derivate und sonstige Anlageinstrumente fallen.

Andere Investitionen hatten im Berichtszeitpunkt einen durchschnittlichen Anteil von 16,62 %.

Dabei darf das Finanzprodukt bis zu 49 % des Wertes des Sondervermögens in "Andere Investitionen" investieren, wobei der Portfolioverwalter die Investitionen in "Andere Investitionen" zur Liquiditätserhaltung, zur Absicherung und/oder zur Schaffung einer zusätzlichen Rendite vornehmen kann. Im Berichtszeitraum gehörten hierzu Investitionen in Bankguthaben sowie liquide Mittel (z.B. Sichteinlagen oder Festgelder).

Im relevanten Zeitraum vom 01.10.2022 bis 31.10.2022 gehörten hierzu Investitionen in Bankguthaben und liquide Mittel, die aus Liquiditätszwecken gehalten wurden sowie Derivate, die aus Absicherungsgründen gehalten wurden.



WELCHE MASSNAHMEN WURDEN WÄHREND DES BEZUGSZEITRAUMS ZUR ERFÜLLUNG DER ÖKOLOGISCHEN UND/ ODER SOZIALEN MERKMALE ERGRIFFEN?

Es wurde die Ausrichtung an den vorgegebenen ESG-Faktoren ordnungsgemäß in den Anlageprozess implementiert. Die beworbenen Merkmale wurden im Laufe des relevanten Zeitraums vom 01.10.22 bis 31.10.22 durchgehend beachtet. Es wurden keine Verstöße gegen die dargestellten Ausschlusskriterien oder Anlagegrenzen festgestellt.

Sofern Daten des Datenproviders für die Bewertung vorhanden waren, erfolgte die Anlage in Wertpapieren im Einklang mit den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Kriterien.

Das Abstimmungsverhalten bei Hauptversammlungen der HANSAINVEST sowie der Umgang mit Aktionärsanträgen kann unter "<https://www.hansainvest.de/unternehmen/compliance/abstimmungsverhalten-bei-hauptversammlungen>" eingesehen werden.

Bei der HANSAINVEST nehmen wir unsere treuhänderische Pflicht gegenüber unseren Kunden sehr ernst und handeln in deren alleinigem Interesse. Wir sind davon überzeugt, dass gute Corporate Governance ein zentraler Faktor für langfristig höhere relative Renditen auf Aktien- und festverzinsliche Anlagen ist. Wir lassen uns bei unseren Anlageentscheidungen daher nicht nur von kurzfristigen finanziellen Zielen leiten. Vielmehr erwarten wir von den Unternehmen, in die wir investieren, auch eine nachhaltige verantwortungsvolle Unternehmensführung, die ESG-relevante Aspekte berücksichtigt. Entsprechend der bereits vollzogenen ESG Integration berücksichtigt die HANSAINVEST im Rahmen der Ausübung der Aktionärsrechte daher auch nichtfinanzielle Kriterien, wie die Rücksichtnahme auf die Umwelt (E für Environment), soziale Kriterien (S für Social), sowie eine verantwortungsvolle Unternehmensführung (G für Governance). Dabei stützen wir uns auf anerkannte nationale und internationale Regelwerke wie beispielsweise die jeweils aktuellen Analyse- Leitlinien für Hauptversammlungen (ALHV) des Bundesverbands Investment und Asset Management e.V. (BVI), des Deutschen Corporate Governance Kodex bzw. der in den jeweiligen Ländern geltenden Kodizes sowie die UN Principles for Responsible Investment (PRI), deren erklärtes Ziel es ist, ein besseres Verständnis der Auswirkungen von Investitionsaktivitäten auf Umwelt-, Sozial und Unternehmensführungsthemen zu schaffen und Investoren bei der Integration dieser Fragestellungen zu unterstützen.

Um mögliche Interessenkonflikte zum Nachteil unserer Anleger zu vermeiden, haben wir verschiedene organisatorische Maßnahmen getroffen und diese in unseren Grundsätzen für den Umgang mit Interessenkonflikten veröffentlicht: [Conflicts of Interest Policy](#)

Der Bericht über das Abstimmungsverhalten im Zuge der Ausübung unserer Aktionärsrechte kann unter folgendem Link eingesehen werden:

<https://www.hansainvest.de>

Hamburg, 25. April 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 Greiff Systematic Allocation Fund – 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.

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 „Verantwor-

tung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

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

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

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher - beabsichtigter oder unbeabsichtigter - falscher Darstellungen im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* nicht fortgeführt wird.
- 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 26.04.2023

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