

# Jahresbericht zum 30. Juni 2020

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds

in der Zeit vom 08. August 2019 bis 30. Juni 2020.

Hamburg, im Oktober 2020

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

## So behalten Sie den **Überblick:**

Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2019/2020 .....	4
Vermögensübersicht per 30. Juni 2020 .....	6
Vermögensaufstellung per 30. Juni 2020 .....	7
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	12
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers .....	15
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	17

# Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2019/2020

## Anlageziel und Anlagepolitik

Der Fonds Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds verfolgt das Ziel, einen soliden und konstanten Wertzuwachs für Ausschüttungen bei stark verminderter Volatilität im Vergleich zu den gängigen Indizes zu erreichen. Im Rahmen des Investmentprozesses werden substanzstarke Firmen mit einem nachhaltigen Geschäftsmodell, das Umsatz- und Ergebnisresilienz in konjunkturellen Schwächephasen gewährleistet, identifiziert. Verschiedene Faktoren dienen als Leistungsnachweise und induzieren auch in schwierigen Marktphasen eine stabile Entwicklung des Unternehmens.

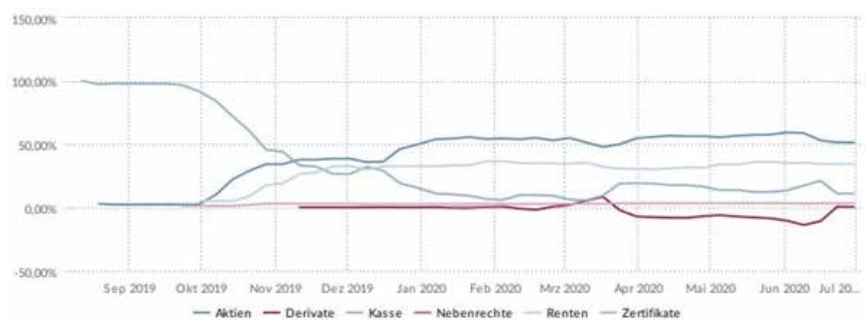
Um das Anlageziel zu erreichen, investiert der Fonds in Aktien, verzinsliche Wertpapiere, Bankguthaben, Geldmarktinstrumente und Gold (XETRA-Gold Zertifikat). Das Fondsmanagement darf für den Fonds Derivatgeschäfte zum Zwecke der Absicherung, einsetzen.

## Portfoliostruktur

Die Anlagestrategie des Fonds beinhaltet einen aktiven Managementprozess. Der Fonds bildet weder einen Wertpapierindex ab, noch orientiert er sich an einem festgelegten Vergleichsmaßstab. Dies bedeutet, der Fondsmanager identifiziert die zu erwerbenden Vermögensgegenstände aktiv auf Basis eines festgelegten Investitionsprozesses. Gründe für An- oder Verkauf ergeben sich aus den Daten der quantitativen Indikationen der Modelle des Anlageberaters in Verbindung mit öffentlich verfügbaren Informationen insbesondere über Unternehmen, Regionen,

Staaten oder Wirtschaftszweige. Hierbei spielt insbesondere die jeweils aktuelle Markt- oder Nachrichtenlage zu Politik, Wirtschaft und Konjunktur eine Rolle. Im Rahmen des Investitionsprozesses werden auch die mit dem An- oder Verkauf verbundenen möglichen Risiken berücksichtigt. Als strategischer Grundsatz ist die Vermeidung von Risiken die oberste Leitlinie. Hieraus ergeben sich seit Auflage des Fonds am 08. August 2020 folgende Veränderungen der Assetklassen:

## Assetgruppen-Allokation im Zeitverlauf



Quelle: HANSAINVEST

Im Hinblick auf das vorrangige Ziel des langfristigen Vermögenserhalts folgten wir den kurzfristigen, auf eine schnelle Erholung der Wirtschaft spekulierenden Aufwärtsbewegungen an den Aktienmärkten nicht, sondern blieben unserem strategischen Grundsatz treu, die Renditeoptimierung hinter den Vermögenserhalt zu stellen.

Die im abgelaufenen Rumpfgeschäftsjahr abgeschlossenen Geschäfte sowie die sich im Bestand des Sondervermögens befindlichen Finanzinstrumente werden im Jahresbericht ausgewiesen.

## Risikoanalyse

Im Berichtszeitraum bestanden keine wesentlichen Risiken

- Das Marktrisiko wird durch die quantitativen Modelle täglich verfolgt. Marktpreisrisiken resultieren aus den Kursbewegungen der gehaltenen Finanzinstrumente. Die Kurs- oder Marktpreisentwicklung hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärk-

te ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird.

- Aufgrund der weitreichenden Diversifikation mit einer Gewichtung von max. 10 % je Einzelengagement besteht kein Klumpenrisiko.
- Das Währungsrisiko ist gering, da der Fonds stetes über 90 % in Euro investiert ist. Die Fremdwährungen bestehen in erster Linie aus CHF.

- Das Liquiditätsrisiko ist aufgrund der zeitnahen Veräußerungsmöglichkeit gering.
- 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.
- 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 festverzins-

liche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

- 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.
- Sonstige Risiken: Die Ausbreitung der Atemwegserkrankung COVID-19 hat aktuell weltweit zu massiven Einschnitten in das öffentliche Leben mit erheblichen Folgen u.a. für die Wirtschaft und deren Unternehmen geführt, die sich derzeit noch nicht abschätzen lassen. Vor diesem Hintergrund lassen sich die mit den Investitionen dieses Fonds verbundenen Risiken derzeit nicht abschließend absehen. Es besteht die Möglichkeit,

dass sich die bestehenden Risiken verstärkt und kumuliert realisieren und sich negativ auf das Ergebnis des Fonds auswirken könnten.

## Wertentwicklung

Die Wertentwicklung (nach BVI-Methode) betrug für den Berichtszeitraum für den Fonds Werte & Sicherheit – Nachhaltiger Stiftungsfonds (Anteilklassen SBA / P) -7,93 % / -8,40 %. (Quelle HANSA-INVEST, Stichtag 30.06.2020)

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von Aktien und Derivaten. Das Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften für den Berichtszeitraum betrug insgesamt für beide Anteilklassen: -279.195,34 Euro

## Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment GmbH.

Der Fonds wurde zum 08. August 2019 neu aufgelegt.

Das Portfoliomanagement ist an die SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH ausgelagert.

# Vermögensübersicht per 30. Juni 2020

Fondsvermögen: EUR 10.998.111,55 \*)

Umlaufende Anteile: (P)-Klasse 76.258

(SBA)-Klasse 43.584

Vermögensaufteilung in TEUR/%		
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
1. Aktien	5.636	51,25
2. Anleihen	3.735	33,96
3. Zertifikate	351	3,19
4. Derivate	40	0,36
5. Bankguthaben	1.201	10,92
6. Sonstige Vermögensgegenstände	59	0,54
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		
	-24	-0,22
<b>III. Fondsvermögen</b>		
	<b>10.998</b>	<b>100,00</b>

\*) Der Fonds wurde per 08.08.2019 aufgelegt

# Vermögensaufstellung per 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Aktien</b>										
Allianz	DE0008404005		STK	1.395	1.395	0	EUR	180,220000	251.406,90	2,29
Andritz	AT0000730007		STK	2.800	2.800	0	EUR	33,780000	94.584,00	0,86
Assicurazioni Generali	IT0000062072		STK	11.047	11.047	0	EUR	13,420000	148.250,74	1,35
Bayerische Motoren Werke	DE0005190003		STK	2.850	2.850	0	EUR	56,710000	161.623,50	1,47
Cie Génle Étis Michelin	FR0000121261		STK	1.976	1.976	0	EUR	93,700000	185.151,20	1,68
Continental	DE0005439004		STK	1.700	1.700	0	EUR	87,220000	148.274,00	1,35
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006062144		STK	4.621	4.621	0	EUR	34,320000	158.592,72	1,44
Daimler	DE0007100000		STK	4.000	4.000	0	EUR	35,910000	143.640,00	1,31
Deutsche Post	DE0005552004		STK	6.275	6.275	0	EUR	31,870000	199.984,25	1,82
Deutsche Telekom	DE0005557508		STK	19.745	19.745	0	EUR	14,805000	292.324,73	2,66
Enagas	ES0130960018		STK	8.400	8.400	0	EUR	21,790000	183.036,00	1,66
Evonik Industries	DE000EVNK013		STK	8.746	8.746	0	EUR	23,060000	201.682,76	1,83
Gerresheimer	DE000A0LD6E6		STK	1.371	5.571	4.200	EUR	81,350000	111.530,85	1,01
Hannover Rück SE	DE0008402215		STK	1.270	1.270	0	EUR	151,800000	192.786,00	1,75
Iberdrola	ES0144580Y14		STK	22.203	22.204	1	EUR	10,180000	226.026,54	2,06
Orange	FR0000133308		STK	22.700	22.700	0	EUR	10,685000	242.549,50	2,21
Red Electrica Corporacion	ES0173093024		STK	17.200	17.200	0	EUR	16,555000	284.746,00	2,59
Schneider Electric	FR0000121972		STK	2.518	2.518	0	EUR	98,600000	248.274,80	2,26
Siemens	DE0007236101		STK	2.894	2.894	0	EUR	103,700000	300.107,80	2,73
Société Générale	FR0000130809		STK	7.474	7.474	0	EUR	14,914000	111.467,24	1,01
Software AG Namens-Aktien o.N.	DE000A2GS401		STK	3.300	3.300	0	EUR	34,660000	114.378,00	1,04
Stora Enso	FI0009005961		STK	17.933	17.933	0	EUR	10,625000	190.538,13	1,73
Suez S.A.	FR0010613471		STK	22.060	22.060	0	EUR	10,435000	230.196,10	2,09
UPM Kymmene	FI0009005987		STK	11.528	11.528	0	EUR	25,620000	295.347,36	2,69
Veolia Environnement	FR0000124141		STK	14.634	14.634	0	EUR	20,230000	296.045,82	2,69
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039		STK	1.810	1.810	0	EUR	134,580000	243.589,80	2,21
Kühne & Nagel Internat.	CH0025238863		STK	1.293	1.293	0	CHF	156,250000	189.123,57	1,72
Novartis	CH0012005267		STK	2.450	2.450	0	CHF	83,370000	191.206,65	1,74
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
1,875000000% Air France-KLM S.A. EO-Obl. 2020(20/25)	FR0013477254		EUR	200	200	0	%	83,519000	167.038,00	1,52
0,500000000% Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 20(30/31)	DE000A28RSR6		EUR	100	100	0	%	101,115900	101.115,90	0,92
2,750000000% Deutsche Bank AG Nachr.-MTN v. 15/25	DE000DB7XJJ2		EUR	295	295	0	%	99,542000	293.648,90	2,67
2,625000000% K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.17/23	XS1591416679		EUR	300	300	0	%	89,372500	268.117,50	2,44
1,125000000% Schaeffler AG MTN v. 19/22	DE000A2YB699		EUR	300	300	0	%	97,528500	292.585,50	2,66
4,000000000% SoftBank Group Corp. EO-Notes 18/23	XS1811213781		EUR	279	279	0	%	102,105000	284.872,95	2,59
1,301000000% Allianz SE FLR-Sub. MTN.v.2019(2029/2049)	DE000A2YPFA1		EUR	300	300	0	%	96,637500	289.912,50	2,64

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum						
0,000000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2050)	DE0001102481		EUR	250	710	460	%	100,923644	252.309,11	2,29	
4,625000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2014(26/Und.)	XS1048428442		EUR	300	300	0	%	104,312000	312.936,00	2,85	
3,000000000% ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/29)	XS2010039894		EUR	300	300	0	%	90,113500	270.340,50	2,46	
<b>Zertifikate</b>											
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0		STK	6.925	6.925	0	EUR	50,675000	350.924,38	3,19	
<b>Summe der börsengehandelten Wertpapiere</b>									<b>EUR</b>	<b>8.520.266,20</b>	<b>77,48</b>
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>											
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>											
0,950000000% Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	XS2010039035		EUR	200	200	0	%	96,603833	193.207,67	1,76	
1,600000000% Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(29/unb.)	XS2010039548		EUR	200	200	0	%	97,543000	195.086,00	1,77	
4,000000000% Otto (GmbH & Co KG) Sub.-FLR-Nts.v.18(25/unb.)	XS1853998182		EUR	291	291	0	%	99,557000	289.710,87	2,63	
3,500000000% DIC Asset AG Inh.-Schuld v.2018(2021/2023)	DE000A2NBZG9		EUR	292	292	0	%	101,356500	295.960,98	2,69	
4,000000000% Europcar Mobility Group S.A. EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1983375871		EUR	299	299	0	%	76,202500	227.845,48	2,07	
<b>Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere</b>									<b>EUR</b>	<b>1.201.811,00</b>	<b>10,92</b>
<b>Summe der Wertpapiere</b>									<b>EUR</b>	<b>9.722.077,20</b>	<b>88,40</b>
<b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b>											
<b>Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten</b>											
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>											
DAX Future 18.09.2020		XEUR	EUR	Anzahl -12					37.087,50	0,34	
ESTX 50 Index Futures 18.09.2020		XEUR	EUR	Anzahl -35					2.800,00	0,02	
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>									<b>EUR</b>	<b>39.887,50</b>	<b>0,36</b>
<b>Bankguthaben</b>											
<b>EUR - Guthaben bei:</b>											
Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln			EUR	650.942,04					650.942,04	5,92	
Bank: Norddeutsche Landesbank -GZ-			EUR	7,36					7,36	0,00	
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	34,63					34,63	0,00	
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:</b>											
Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln			CHF	587.821,56					550.265,91	5,00	
<b>Summe der Bankguthaben</b>									<b>EUR</b>	<b>1.201.249,94</b>	<b>10,92</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>											
Zinsansprüche			EUR	46.225,83					46.225,83	0,42	
Dividendenansprüche			EUR	12.987,61					12.987,61	0,12	
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>									<b>EUR</b>	<b>59.213,44</b>	<b>0,54</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>									<b>EUR</b>	<b>-24.316,53</b>	<b>-0,22</b>
<b>Fondsvermögen</b>									<b>EUR</b>	<b>10.998.111,55</b>	<b>100,2)</b>
<b>Werte &amp; Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)</b>											
<b>Anteilwert</b>									<b>EUR</b>	<b>91,60</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>									<b>STK</b>	<b>76.258</b>	
<b>Werte &amp; Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)</b>											
<b>Anteilwert</b>									<b>EUR</b>	<b>92,07</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>									<b>STK</b>	<b>43.584</b>	

### Fußnoten:

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

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 30.06.2020	
Schweizer Franken	CHF	1,068250	= 1 Euro (EUR)
<b>Marktschlüssel</b>			
<b>b) Terminbörsen</b>			
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		

## Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Helvetia Holding AG Namens-Aktien SF 0,02	CH0466642201	STK	1.621	1.621	
Roche Holding AG Inhaber-Aktien SF 1	CH0012032113	STK	746	746	
Swiss Life	CH0014852781	STK	440	440	
Acciona	ES0125220311	STK	2.135	2.135	
Arkema	FR0010313833	STK	2.300	2.300	
Sampo	FI0009003305	STK	9.524	9.524	
Iberdrola Anrechte	ES06445809J6	STK	21.800	21.800	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
2,450000000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(50)	IT0005398406	EUR	250	250	
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Iberdrola S.A. Acciones Port. Em.1/20 EO -,75	ES0144583210	STK	404	404	
<b>Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			22.309,41

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

für den Zeitraum vom 08. August 2019 bis 30. Juni 2020		Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf. (P)		Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf. (SBA)	
<b>I. Erträge</b>					
1. Dividenden inländischer Aussteller		EUR	23.773,26		14.424,91
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	75.676,47		43.883,75
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	20.382,46		12.490,73
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	22.424,64		11.948,88
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	-8.913,53**)		-3.518,73**)
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	-11.578,03		-6.808,44
<b>Summe der Erträge</b>		<b>EUR</b>	<b>121.765,27</b>		<b>72.421,10</b>
<b>II. Aufwendungen</b>					
1. Verwaltungsvergütung		EUR	-116.865,95		-36.265,83
2. Verwahrstellenvergütung		EUR	-12.336,07		-5.814,80
3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-5.216,30		-3.225,80
4. Sonstige Aufwendungen		EUR	-3.879,44		-1.995,89
5. Aufwandsausgleich		EUR	-9.236,91		-14.784,94
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>EUR</b>	<b>-147.534,67</b>		<b>-62.087,26</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>EUR</b>	<b>-25.769,40</b>		<b>10.333,84</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>					
<b>1. Realisierte Gewinne</b>		<b>EUR</b>	<b>1.065.585,87</b>		<b>629.379,38</b>
<b>2. Realisierte Verluste</b>		<b>EUR</b>	<b>-1.242.340,45</b>		<b>-731.820,14</b>
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>EUR</b>	<b>-176.754,58</b>		<b>-102.440,76</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>-202.523,98</b>		<b>-92.106,92</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		EUR	159.773,61		47.678,42
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		EUR	-600.644,70		-345.006,33
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>-440.871,09</b>		<b>-297.327,91</b>
<b>VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>-643.395,07</b>		<b>-389.434,83</b>

\*\*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen i.H.v. EUR 8.913,53 in der Anteilklasse (P) sowie i.H.v. EUR 3.518,73 in der Anteilklasse (SBA)

## Entwicklung des Sondervermögens 2020

		Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf. (P)		Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf. (SBA)	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres</b>		EUR	0,00	EUR	0,00
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR	7.619.739,42	EUR	4.386.694,64
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	7.619.739,42		EUR	4.386.694,64
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	0,00		EUR	0,00
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR	8.963,85	EUR	15.543,54
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR	-643.395,07	EUR	-389.434,83
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR	159.773,61		EUR	47.678,42
davon nicht realisierte Verluste:	EUR	-600.644,70		EUR	-345.006,33
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>6.985.308,20</b>	<b>EUR</b>	<b>4.012.803,35</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt	je Anteil
<b>Werte &amp; Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)</b>		
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR 0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR -202.523,98	-2,66
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR 1.242.340,45	16,29
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR 0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR -925.429,47	-12,14
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>EUR 114.387,00</b>	<b>1,50</b>
1. Endausschüttung		
a) Barausschüttung	EUR 114.387,00	1,50
<b>Werte &amp; Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)</b>		
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR 0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR -92.106,92	-2,11
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR 731.820,14	16,79
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR -571.905,30	-13,12
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR -2.431,92	-0,06
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>EUR 65.376,00</b>	<b>1,50</b>
1. Endausschüttung		
a) Barausschüttung	EUR 65.376,00	1,50

3) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung i.H.v. EUR 316.910,98 in der Anteilscheinklasse (P) sowie i.H.v. EUR 157.482,92 in der Anteilscheinklasse (SBA))

## Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert	
<b>Werte &amp; Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)</b>				
Auflegung 08.08.2019	EUR	500.000,00	EUR	100,00
2020	EUR	6.985.308,20	EUR	91,60
<b>Werte &amp; Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)</b>				
Auflegung 08.08.2019	EUR	1.500.000,00	EUR	100,00
2020	EUR	4.012.803,35	EUR	92,07

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 4.801.650,00

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

## Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Kreissparkasse Köln

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 88,40  
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,36

**Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.**

## Sonstige Angaben

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)

Anteilwert EUR 91,60  
Umlaufende Anteile STK 76.258

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)

Anteilwert EUR 92,07  
Umlaufende Anteile STK 43.584

	Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)	Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)
<b>Währung</b>	EUR	EUR
<b>Verwaltungsvergütung</b>	1,82% p.a.	1,22% p.a.
<b>Ausgabeaufschlag</b>	5,00%	0,00%
<b>Ertragsverwendung</b>	ausschüttend	ausschüttend
<b>Mindestanlagevolumen</b>	-	EUR 100.000

## Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

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

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

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

## Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P) 1,93 %  
Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA) 1,44 %

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

Transaktionskosten EUR 17.740,51

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P) 0,00 %

## An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

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

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersatzungen. Die KVG gewährt in der Anteilklasse (P) sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

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

### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge:

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P): EUR 0,00

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA): EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen:

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P): EUR 2.088,76 Kosten BaFin

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA): EUR 1.109,31 Kosten für die Erstattung von Quellensteuer

### Sonstige Informationen

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

### Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2019

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR 13.825.622,49
davon fix:	EUR 10.999.500,77
davon variabel:	EUR 2.826.121,72
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt):	172
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2019 der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risikoträger):	EUR 1.011.750,04

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum 1. Januar bis 31. Dezember 2019 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

### Beschreibung, wie die Vergütungen und ggf. sonstige Zuwendungen berechnet wurden

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen des § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

### Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

### Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik

Keine Änderung im Berichtszeitraum.

### Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall für das Geschäftsjahr 2018 (Portfoliomanagement Signal Iduna Asset Management GmbH)

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens.

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

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung:	EUR	8.917.233
davon feste Vergütung:	EUR	0
davon variable Vergütung:	EUR	0
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	EUR	0

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens: 104

## Angaben nach § 134c Abs. 4 AktG

### Anforderung

Angaben zu den mittel- bis langfristigen Risiken:

Angaben über die Zusammensetzung  
des Portfolios:  
der Portfolioumsätze:

Portfolioumsatzkosten:

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

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

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

### Verweis

Beschreibung der wesentlichen Risiken im Tätigkeitsbericht

Vermögensaufstellung im Jahresbericht  
Vermögensaufstellung sowie Darstellung der während des Geschäftsjahres  
abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung  
erscheinen.

Transaktionskosten im Anhang im Jahresbericht

Verkaufsprospekt des Sondervermögens

Internetseite der HANSAINVEST

Für das Sondervermögen sind im Berichtszeitraum keine Wertpapierleihegeschäfte  
abgeschlossen worden.

Hamburg, 09. Oktober 2020

HANSAINVEST  
Hanseatische Investment-GmbH  
Geschäftsführung

(Dr. Jörg W. Stotz) (Nicholas Brinckmann) (Ludger Wibbeke)

# Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg

## Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr vom 8. August 2019 bis zum 30. Juni 2020, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2020, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Rumpfgeschäftsjahr vom 8. August 2019 bis zum 30. Juni 2020, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

## Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere

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

## Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

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

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür ver-

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

## Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

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

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH abzugeben.

- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH nicht fortgeführt wird.

INVEST Hanseatische Investment-GmbH nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Hamburg, den 13. Oktober 2020

KPMG AG  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner Lüning  
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüfer



# Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

## Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST  
Hanseatische Investment-Gesellschaft  
mit beschränkter Haftung  
Postfach 60 09 45  
22209 Hamburg  
Hausanschrift:  
Kapstadtring 8  
22297 Hamburg

Kunden-Servicecenter:  
Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96  
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70  
Internet: www.hansainvest.com  
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital:  
€ 10.500.000,00  
Eigenmittel:  
€ 20.059.012,13  
(Stand: 31.12.2019)

## Gesellschafter:

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

## Verwahrstelle:

Kreissparkasse Köln  
Kernkapital:  
€ 2.029.435.168,42  
Eigenmittel:  
€ 2.459.365.812,20  
(Stand: 31.12.2019)

## Einzahlungen:

UniCredit Bank AG, München  
(vorm. Bayerische Hypo- und  
Vereinsbank)  
BIC: HYVEDEMM300  
IBAN: DE15200300000000791178

## Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),  
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA  
Gruppe, Hamburg  
(zugleich Vorsitzender des Aufsichts-  
rates der SIGNAL IDUNA Asset  
Management GmbH)

Dr. Karl-Josef Bierth  
(stellvertretender Vorsitzender),  
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA  
Gruppe, Hamburg

Markus Barth,  
Vorsitzender des Vorstandes der  
Aramea Asset Management AG,  
Hamburg

Dr. Thomas A. Lange,  
Vorsitzender des Vorstandes der  
National-Bank AG, Essen

Prof. Dr. Harald Stützer,  
Geschäftsführender Gesellschafter der  
STUETZER Real Estate Consulting  
GmbH, Gerolsbach

Prof. Dr. Stephan Schüller,  
Kaufmann

## Wirtschaftsprüfer:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

## Geschäftsführung:

Dr. Jörg W. Stotz  
(Sprecher, zugleich Aufsichtsrats-  
vorsitzender der HANSAINVEST LUX  
S.A., Mitglied der Geschäftsführung  
der SIGNAL IDUNA Asset Management  
GmbH und der HANSAINVEST Real  
Assets GmbH sowie Mitglied des  
Aufsichtsrates der Aramea Asset  
Management AG)

Nicholas Brinckmann  
(zugleich Sprecher der Geschäftsführung  
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Andreas Hausladen (ab 01.04.2020)

Ludger Wibbeke  
(zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-  
vorsitzender der HANSAINVEST LUX  
S.A. sowie Vorsitzender des  
Aufsichtsrates der WohnSelect  
Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

**HANSAINVEST**  
**Hanseatische Investment-GmbH**

**Ein Unternehmen der**  
**SIGNAL IDUNA Gruppe**

Kapstadtring 8  
22297 Hamburg  
Telefon (040) 3 00 57 - 62 96  
Fax (040) 3 00 57 - 60 70

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