

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

NB Smart Premia

30. September 2023

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht NB Smart Premia	4
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	14
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	18
Allgemeine Angaben	20

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

NB Smart Premia

in der Zeit vom 01.10.2022 bis 30.09.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht NB Smart Premia

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 01.10.2022 bis 30.09.2023

Anlageziel und Anlagepolitik

Der NB Smart Premia ist ein aktiv gesteuerter Fonds, der eine diversifizierte Vereinnahmung unterschiedlicher Risikoprämien umsetzt. Das Anlageziel ist eine Benchmark unabhängige positive Wertentwicklung unter Beachtung der Anlagerisiken und des empfohlenen Mindestanlegehorizonts von 5 Jahren.

Das Anlagekapital wird breit gestreut in verschiedene Prämienarten investiert, um den Einfluss der Entwicklungen einzelner Märkte auf das Portfolio gering zu halten. Zu den investierbaren Prämien zählen unter anderem Covered Call-Writing, systematische Trendfolge, Insurance-Linked-Securities (ILS) sowie Aktienfaktoren. Die Allokationsquote des Fonds variiert in Abhängigkeit von den am Kapitalmarkt erzielbaren Prämien.

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

Portfoliostruktur und Wertentwicklung

Basis der Investitionsstrategie des Fonds bildet die Vereinnahmung von Optionsprämien, welche durch Faktorprämien und alternative Risikoprämien ergänzt wird. Dabei ist die Kombination der unterschiedlichen Risikoprämien im NB Smart Premia nicht statisch, sondern variabel. Der Ansatz zielt nicht auf kurzfristiges Trading, sondern auf die Vereinnahmung robuster Risikoprämien ab. Eine Risikostreuung zur Minimierung der Abhängigkeit von den Entwicklungen einzelner Märkte wird dabei beabsichtigt. In Zeiten extrem niedriger Risikoprämien kann der Fonds temporär eine hohe Liquiditätsquote aufbauen, um bei sich bietenden Gelegenheiten flexibel reagieren zu können.

Die Vereinnahmung von Optionsprämien (Stillhaltergeschäfte) erfolgt vorrangig indirekt über den Einsatz von Discount-Zertifikaten, aber auch direkt über Optionsgeschäfte. Hierbei werden einerseits gedeckte Kaufoptionen (engl. Covered Calls) genutzt, welche über den Kauf von ETFs oder Futures und den gleichzeitigen Verkauf von Call-Optionen abgebildet werden, sowie andererseits synthetische Covered Calls, welche über den Verkauf von Put-Optionen und einer Besicherung (Kassenhaltung oder Anleihen) dargestellt werden. Die Vereinnahmung alternativer Risikoprämien erfolgt größtenteils über die Allokation aktiver Fonds, da eine interne Abbildung derartiger Strategien meist nur bei sehr großen Volumina ökonomisch sinnvoll umsetzbar ist.

Das Geschäftsjahr des Fonds war geprägt durch Unsicherheiten und Schwankungen der weltweiten Märkte, maßgeblich aufgrund hoher Inflationsraten und damit einhergehend gestiegener Notenbankzinsen sowie eines sich abschwächenden Wirtschaftswachstums, aber auch weiterhin durch die Auswirkungen des

Russland-Ukraine-Kriegs. Der Prozess zur strategischen und systematischen Vereinnahmung von Risikoprämien wurde vom Portfoliomanagement dabei konsequent weiterverfolgt.

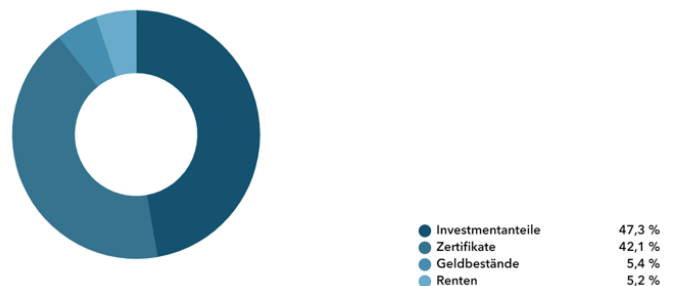
Das ganze Geschäftsjahr über wurden aktiv fällig gewordene Covered-Calls und Zertifikate durch neue Produkte ersetzt bzw. bestehende ausgetauscht, bei denen die Prämien weitestgehend eingenommen waren. Covered Calls wurden dabei erstmalig synthetisch dargestellt, bestehend aus einem Short Put und einer Besicherung. Diese wird durch Anleihen oder auch über entsprechende Kassenhaltung dargestellt und dient bei einer möglichen Ausübung der Option als Mittel zum Kauf der zugrundeliegenden Aktien. Puts können teilweise marktbedingt leicht höhere Renditen bieten als Calls, wenn sich mehr Marktteilnehmer gegen einen Aktienabschwung absichern wollen.

Der Kassenbestand im Betrachtungszeitraum bewegte sich auf üblichen Levels bis zu ca. 10% im Maximum bedingt durch Mittelflüsse im Fonds oder aus taktischen Gründen.

Die Wertentwicklung (nach BVI-Methode) betrug: +5,96% (Anteilklasse V)

Die Vermögensaufteilung zum Geschäftsjahresanfang und -ende entnehmen Sie bitte den nachfolgenden Diagrammen.

Portfoliostruktur 30.09.2023*):



Portfoliostruktur 30.09.2022*):



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

Veräußerungsergebnis

Für die realisierten Gewinne sind im Wesentlichen Veräußerungserwinne von Investmentanteilen und Zertifikaten verantwortlich. Für die realisierten Verluste sind im Wesentlichen Verluste aus Optionen ursächlich.

Risikoanalyse

Die Volatilität des Investmentvermögens betrug: 2,02% (Anteilklasse V).

Die Angaben zur Risikoanalyse erfolgen auf Basis der Daten der Kapitalverwaltungsgesellschaft HANSAINVEST Hanseatische Investmentgesellschaft mbH.

Risikobericht

Marktpreisrisiken:

Marktpreisrisiken resultieren aus der Kursbewegung der gehaltenen Wertpapiere, die starken Schwankungen unterliegen können. Bei festverzinslichen Wertpapieren beeinflussen dabei Zinsänderungen, die Rückzahlungswahrscheinlichkeit der Emittenten sowie eine veränderte Einschätzung der Marktteilnehmer des Emittenten oder des Zinsumfeldes die Preisbildung. Bei Optionen und Discount-Zertifikaten wird das Marktpreisrisiko von der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Basiswertes bzw. der Rückzahlungswahrscheinlichkeit des Emittenten bestimmt. Bei Aktien-Engagements resultiert das zentrale Marktpreisrisiko aus den Kursbewegungen der gehaltenen Aktien bzw. Aktienfonds.

Zinsänderungsrisiken:

Das Zinsänderungsrisiko bezieht sich auf die Kursbewegung eines festverzinslichen Wertpapiers bei Zinsänderungen. Kursbewegungen können aber auch von einer Neueinschätzung der Marktteilnehmer bzgl. der künftigen Entwicklung des Marktzinsniveaus ausgelöst werden. Grundsätzlich hängt das Zinsänderungsrisiko von dem Kupon, den individuellen Ausstattungsmerkmalen sowie der Laufzeit der Anleihe ab. So reagieren bspw. Kurse lang laufender Anleihen stärker auf Zinsänderungen als Kurse kurz laufender Anleihen. Die Zinsänderungsrisiken sind durch geringe Positionsgrößen begrenzt.

Adressenausfallrisiken:

Adressenausfallrisiken bestanden bei festverzinslichen Wertpapieren und Discount-Zertifikaten, wobei das Fondsmanagement die Risiken über die Selektion von Emittenten unzweifelhafter Bonität begrenzte. Adressenausfallrisiken im Sinne von Kontrahentenrisiken bestanden zu keiner Zeit.

Konzentrationsrisiken:

Konzentrationsrisiken in der Anlage bestanden nicht, da auf eine breite Streuung der Portfoliopositionen Wert gelegt wurde.

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.

Liquiditätsrisiken:

Alle im Fonds befindlichen Titel sind zeitnah veräußerbar. Besondere Liquiditätsrisiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Sonstige Risiken:

Seit dem 24.2.2022 führt Russland Krieg gegen die Ukraine („Russland-Ukraine-Krieg“).

Die Börsen sind seit Beginn des Konfliktes von einer deutlich höheren Volatilität geprägt. Die weitere Entwicklung an den Kapitalmärkten hängt von vielen Faktoren ab: vom Verlauf der Kampfhandlungen, den wirtschaftlichen Folgen infolge der gegen Russland und Belarus verhängten Sanktionen, einer weiterhin steigenden bzw. hohen Inflation, der Lage an den Rohstoffmärkten sowie anstehenden geldpolitischen Entscheidungen. Es ist davon auszugehen, dass die Rahmenbedingungen der Weltwirtschaft und an den Börsen weiterhin von erhöhter Unsicherheit geprägt sein werden. Daher unterliegt auch die zukünftige Wertentwicklung dieses Sondervermögens größeren Marktpreisrisiken.

Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investmentgesellschaft mbH. Mit dem Fondsmanagement des

Investmentvermögens war die NATIONAL-BANK AG betraut. Die Verwahrstellenfunktion obliegt dem Bankhaus DONNER & REUSCHEL AG.

Die Käufe- und Verkäufe der ETFs, Fonds, Optionen und Zertifikate erfolgten in der Regel über den Handel der NATIONAL-BANK AG oder über die Donner & Reuschel AG - unter Einhaltung der Best-Execution-Policy des jeweiligen Institutes.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	24.327.930,61	100,09
1. Anleihen	1.366.540,00	5,62
2. Zertifikate	11.032.618,90	45,39
3. Investmentanteile	12.392.612,35	50,98
4. Derivate	-1.888.660,00	-7,77
5. Bankguthaben	1.423.993,13	5,86
6. Sonstige Vermögensgegenstände	826,23	0,00
II. Verbindlichkeiten	-20.976,75	-0,09
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-20.976,75	-0,09
III. Fondsvermögen	EUR 24.306.953,86	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.09.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾	
Börsengehandelte Wertpapiere									EUR	1.366.540,00	5,62
Verzinsliche Wertpapiere									EUR	1.366.540,00	5,62
DE0001104883	0.2000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)		EUR	1.400	1.400	0	%	97,6100	1.366.540,00	5,62	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									EUR	11.032.618,90	45,39
Zertifikate									EUR	11.032.618,90	45,39
DE000PE7Z1S8	BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC.23.05.24 ESTX50 3400		STK	18.500	18.500	0	EUR	32,7000	604.950,00	2,49	
DE000PE051Y1	BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC.25.07.24 ESTX50 3300		STK	18.500	18.500	0	EUR	31,4400	581.640,00	2,39	
DE000KH9HG62	Citigroup Global Mkts Europe DIZ 21.08.24 ESTX50 3300		STK	19.000	19.000	0	EUR	31,2800	594.320,00	2,45	
DE000KG828X7	Citigroup Global Mkts Europe DIZ 22.11.23 ESTX50 3200		STK	18.100	18.100	0	EUR	31,7900	575.399,00	2,37	
DE000DDZ3P25	DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z.23.08.24 ESTX50 3200		STK	20.000	20.000	0	EUR	30,4300	608.600,00	2,50	
DE000DW8WUF2	DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z.24.05.24 ESTX50 3400		STK	18.700	18.700	0	EUR	32,6900	611.303,00	2,51	
DE000DW8WT06	DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z.26.04.24 ESTX50 2800		STK	21.100	21.100	0	EUR	27,2500	574.975,00	2,37	
DE000HG8Q9J2	HSBC Trinkaus & Burkhardt GmbH DIZ 26.04.24 ESTX50 3100		STK	19.400	19.400	0	EUR	30,1400	584.716,00	2,41	
DE000HG5K2X7	HSBC Trinkaus & Burkhardt GmbH DIZ 27.10.23 ESTX50 1800		STK	31.000	0	0	EUR	17,9300	555.830,00	2,29	
DE000LB2N764	Landesbank Baden-Württemberg Disc-Z 24.11.2023 SX5E 2800		STK	21.000	21.000	0	EUR	27,8300	584.430,00	2,40	
DE000LB236L2	Landesbank Baden-Württemberg Disc-Z 26.01.2024 SX5E 3000		STK	19.600	19.600	0	EUR	29,5600	579.376,00	2,38	
DE000LB236M0	Landesbank Baden-Württemberg Disc-Z 26.01.2024 SX5E 3100		STK	18.800	18.800	0	EUR	30,5300	573.964,00	2,36	
DE000SQ1DV28	Société Générale Effekten GmbH DISC.Z.24.11.23 ESTX50 3400		STK	18.000	18.000	0	EUR	33,7700	607.860,00	2,50	
DE000SQ0PWY1	Société Générale Effekten GmbH DISC.Z.27.10.23 ESTX50 2550		STK	18.800	18.800	0	EUR	25,4400	478.272,00	1,97	
DE000UK8CXR6	UBS AG (London Branch) DISC.Z.23.02.24 ESTX50 3100		STK	18.850	18.850	0	EUR	30,4000	573.040,00	2,36	
DE000UK8C705	UBS AG DISC.Z.23.02.24 ESTX50 3200		STK	18.150	18.150	0	EUR	31,3600	569.184,00	2,34	
DE000UK8A2K8	UBS AG DISC.Z.25.10.24 ESTX50 3100		STK	20.000	20.000	0	EUR	29,1800	583.600,00	2,40	
DE000UK8J1Y2	UBS AG DISC.Z.26.07.24 ESTX50 3400		STK	18.850	18.850	0	EUR	32,2900	608.666,50	2,50	
DE000HC5SU54	UniCredit Bank AG HVB DIZ 26.04.24 ESTX50 3300		STK	18.220	18.220	0	EUR	31,9700	582.493,40	2,40	
Investmentanteile									EUR	12.392.612,35	50,98
Gruppenfremde Investmentanteile									EUR	12.392.612,35	50,98
DE000A2PMW03	Torca Vega Income Inhaber-Anteilsklasse I		ANT	13.700	0	0	EUR	84,1500	1.152.855,00	4,74	
LU1681047236	AIS-Amundi EURO STOXX 50 Namens-Ant.C Cap.EUR o.N.		ANT	18.256	18.256	0	EUR	103,0200	1.880.727,56	7,74	
IE00B6TLWG59	GAM STAR Fd PLC-GAM St.Cat Bd. Regist.Shs Inst.Acc.EUR o.N.		ANT	29.000	7.000	0	EUR	15,1470	439.263,00	1,81	
IE00B53L3W79	iShs VII-Co.EO STOXX 50 U.ETF Reg. Shares EUR (Acc) o.N.		ANT	16.000	0	5.000	EUR	150,4600	2.407.360,00	9,90	
IE00B643RZ01	Lyxor Epsilon Global Trend Fd Registered Shares I EUR o.N.		ANT	7.500	500	1.000	EUR	153,8801	1.154.100,75	4,75	
LU0834815101	OptoFlex Inhaber-Ant. I (thes.)EUR o.N.		ANT	815	0	35	EUR	1.498,2400	1.221.065,60	5,02	

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.09.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
LU0951570927	Schroder GAIA-Schr.GAIA Cat Bd Regist.Acc.Shs IF EUR Hed.o.N.		ANT	233	0	0	EUR	1.428,3800	332.812,54	1,37
LU0946790952	XAIA Cr. - XAIA Cr. Debt. Cap. Inhaber-Anteile IT o.N.		ANT	970	0	0	EUR	1.204,0700	1.167.947,90	4,80
LU0380865021	Xtrackers Euro Stoxx 50 1C o.N.		ANT	38.500	11.550	13.700	EUR	68,4800	2.636.480,00	10,85
Summe Wertpapiervermögen								EUR	24.791.771,25	101,99
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								EUR	-1.888.660,00	-7,77
Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)								EUR	-1.888.660,00	-7,77
Optionsrechte								EUR	-1.888.660,00	-7,77
Optionsrechte auf Aktienindices								EUR	-1.888.660,00	-7,77
Call ESTX 50 2600,000000000 15.12.2023		XEUR	Anzahl	-20			EUR	1.592,7000	-318.540,00	-1,31
Call ESTX 50 2700,000000000 15.12.2023		XEUR	Anzahl	-20			EUR	1.493,9000	-298.780,00	-1,23
Call ESTX 50 3100,000000000 15.03.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	1.130,1000	-226.020,00	-0,93
Call ESTX 50 3100,000000000 20.09.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	1.117,5000	-223.500,00	-0,92
Call ESTX 50 3200,000000000 15.03.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	1.035,1000	-207.020,00	-0,85
Call ESTX 50 3200,000000000 21.06.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	992,9000	-198.580,00	-0,82
Call ESTX 50 3300,000000000 15.03.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	940,9000	-188.180,00	-0,77
Call ESTX 50 3300,000000000 15.12.2023		XEUR	Anzahl	-20			EUR	904,0000	-180.800,00	-0,74
Put ESTX 50 3300,000000000 20.09.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	62,9000	-12.580,00	-0,05
Put ESTX 50 3300,000000000 21.06.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	45,2000	-9.040,00	-0,04
Put ESTX 50 3400,000000000 20.09.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	73,9000	-14.780,00	-0,06
Put ESTX 50 3400,000000000 21.06.2024		XEUR	Anzahl	-20			EUR	54,2000	-10.840,00	-0,04
Bankguthaben								EUR	1.423.993,13	5,86
EUR - Guthaben bei:								EUR	1.423.993,13	5,86
Bank: UniCredit Bank AG		EUR		10,17					10,17	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		EUR		1.423.982,96					1.423.982,96	5,86
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	826,23	0,00
Zinsansprüche		EUR		826,23					826,23	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-20.976,75	-0,09
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾		EUR		-20.976,75					-20.976,75	-0,09
Fondsvermögen								EUR	24.306.953,86	100,00
Anteilwert NB Smart Premia V								EUR	107,17	
Umlaufende Anteile NB Smart Premia V								STK	226.799,000	

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

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

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENS-AUFSTELLUNG 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
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Zertifikate				
DE000PD5ZXZ2	BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC 24.08.23 ESTX50 2400	STK	0	24.100
DE000PD5ZZ02	BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC 26.10.23 ESTX50 2550	STK	18.800	18.800
DE000KG825F0	Citigroup Global Mkts Europe DIZ 22.02.23 ESTX50 2300	STK	0	24.000
DE000KG825G8	Citigroup Global Mkts Europe DIZ 22.02.23 ESTX50 2400	STK	0	22.700
DE000KG827H2	Citigroup Global Mkts Europe DIZ 23.08.23 ESTX50 2000	STK	0	28.000
DE000DV99ZU2	DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 25.08.23 ESTX50 2200	STK	0	24.000
DE000DW23HP8	DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 26.05.23 ESTX50 2300	STK	0	26.000
DE000DV9X6T5	DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 28.07.23 ESTX50 2800	STK	0	20.450
DE000GX43QX2	Goldman Sachs Wertpapier GmbH DISC.Z 26.10.22 ESTX50 3400	STK	0	16.500
DE000HG3BUQ0	HSBC Trinkaus & Burkhardt AG DIZ 28.07.23 ESTX50 2400	STK	0	25.000
DE000HG3BUU2	HSBC Trinkaus & Burkhardt GmbH DIZ 28.07.23 ESTX50 2000	STK	0	24.000
DE000LB2KN25	Landesbank Baden-Württemberg Disc-Z 27.01.2023 SX5E 2500	STK	0	24.500
DE000S0N0P7L4	Société Générale Effekten GmbH DISC.Z 26.05.23 ESTX50 2400	STK	0	23.400
DE000S0N0P7Q3	Société Générale Effekten GmbH DISC.Z 26.05.23 ESTX50 2600	STK	0	23.000
DE000UE6U3G5	UBS AG (London Branch) DISC.Z 27.01.23 ESTX50 3300	STK	0	19.000
DE000HB6DL12	UniCredit Bank AG HVB DIZ 28.04.23 ESTX50 2500	STK	0	22.450
DE000HB5GTK4	UniCredit Bank AG HVB DIZ 28.04.23 ESTX50 2600	STK	0	23.000
DE000VX9LB57	Vontobel Financial Products DIZ 22.09.23 ESTX50 3400	STK	18.000	18.000
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU0290358653	db x-tr.II-ITRAXX Eu.ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	ANT	0	5.150
LU0908501215	Lyxor Index-Euro Stoxx 50 (DR) Actions Nom. C-EUR o.N.	ANT	0	12.175
LU0290359032	Xtr.II iTraxx Crossover Swap Inhaber-Anteile 1C o.N.	ANT	0	3.330

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			2.625
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				

**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) NB SMART PREMIA V
FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.10.2022 BIS 30.09.2023**

		EUR
I.	Erträge	
1.	Zinsen aus inländischen Wertpapieren	621,13
2.	Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	23.823,39
3.	Erträge aus Investmentanteilen	349,32
4.	Sonstige Erträge	78,60
Summe der Erträge		24.872,44
II.	Aufwendungen	
1.	Verwaltungsvergütung	-44.734,13
2.	Verwahrstellenvergütung	-9.415,25
3.	Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-10.586,92
4.	Sonstige Aufwendungen	-4.581,77
5.	Aufwandsausgleich	-554,54
Summe der Aufwendungen		-69.872,61
III.	Ordentlicher Nettoertrag	-45.000,17
IV.	Veräußerungsgeschäfte	
1.	Realisierte Gewinne	1.010.356,19
2.	Realisierte Verluste	-916.485,45
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		93.870,74
V.	Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	48.870,57
1.	Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	394.138,49
2.	Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	907.958,99
VI.	Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	1.302.097,48
VII.	Ergebnis des Geschäftsjahres	1.350.968,05

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS NB SMART PREMIA V

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.10.2022)		22.142.226,49
1. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		815.995,97
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	1.785.205,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-969.209,53	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-2.236,65
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.350.968,05
davon nicht realisierte Gewinne	394.138,49	
davon nicht realisierte Verluste	907.958,99	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (30.09.2023)		24.306.953,86

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS NB SMART PREMIA V ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	965.356,02	4,26
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	48.870,57	0,22
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	916.485,45	4,04
II. Wiederanlage	965.356,02	4,26

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE NB SMART PREMIA V

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	24.306.953,86	107,17
2022	22.142.226,49	101,14
2021	22.854.478,04	102,16
(Auflegung 01.10.2020)	15.227.000,00	100,00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	6.149.382,72
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Donner & Reuschel 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)		
MSCI - World Index		90,00%
iBoxx EUR Corporates Total Return Index		10,00%
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,34%
größter potenzieller Risikobetrag		1,14%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		0,49%
Risikomodelle (§10 DerivateV)		Full-Monte-Carlo
Parameter (§11 DerivateV)		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr
Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte		1,75

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 NB Smart Premia V	EUR	107,17
Umlaufende Anteile NB Smart Premia V	STK	226.799,000

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 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 NB SMART PREMIA V

Performanceabhängige Vergütung	0,00 %
Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,53 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus, sowie die laufenden Kosten (in Form der veröffentlichten Gesamtkostenquote) der zum Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.10.2022 BIS 30.09.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	33.483.802,94
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	29.246.399,94
Relativ in %	87,34 %

Transaktionskosten: 3.159,56 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 NB Smart Premia V keine 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 %
DE000A2PMW03	7orca Vega Income Inhaber-Anteilsklasse I ¹⁾	0,25
LU1681047236	AIS-Amundi EURO STOXX 50 Namens-Ant.C Cap.EUR o.N. ¹⁾	0,05
LU0290358653	db x-tr.II-ITRAXX Eu.ETF Inhaber-Anteile 1C o.N. ¹⁾	0,18
IE00B6TLWG59	GAM STAR Fd PLC-GAM St.Cat Bd. Regist.Shs Inst.Acc.EUR o.N. ¹⁾	0,95
IE00B53L3W79	iShs VII-Co.EO STOXX 50 U.ETF Reg. Shares EUR (Acc) o.N. ¹⁾	0,10
IE00B643RZ01	Lyxor Epsilon Global Trend Fd Registered Shares I EUR o.N. ¹⁾	1,14
LU0908501215	Lyxor Index-Euro Stoxx 50 (DR) Actions Nom. C-EUR o.N. ¹⁾	0,07
LU0834815101	OptoFlex Inhaber-Ant. I (thes.)EUR o.N. ¹⁾	0,12
LU0951570927	Schroder GAIA-Schr.GAIA Cat Bd Regist.Acc.Shs IF EUR Hed.o.N. ¹⁾	1,10
LU0946790952	XAIA Cr. - XAIA Cr. Debt. Cap. Inhaber-Anteile IT o.N. ¹⁾	0,50
LU0290359032	Xtr.II iTraxx Crossover Swap Inhaber-Anteile 1C o.N. ¹⁾	0,09
LU0380865021	Xtrackers Euro Stoxx 50 1C o.N. ¹⁾	0,01

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

NB Smart Premia V

Sonstige Erträge

Erträge aus der Auflösung von Rückstellungen	EUR	78,60
--	-----	-------

Sonstige Aufwendungen

Ratingkosten	EUR	3.252,95
--------------	-----	----------

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

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2022 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)	EUR	22.647.706
davon feste Vergütung	EUR	18.654.035
davon variable Vergütung	EUR	3.993.671
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)		298
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risktaker)	EUR	1.499.795
davon Geschäftsleiter	EUR	1.129.500
davon Führungskräfte	EUR	370.295

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der National-Bank AG für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager		National-Bank AG
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	55.028.632,00
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		568

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

Hamburg, 17. Januar 2024

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens NB Smart Premia – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an 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 dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollstän-

digkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

- 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

Hamburg, den 18.01.2024

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner
Wirtschaftsprüfer

Lüning
Wirtschaftsprüfer

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

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie

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: 28,189 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR
Stand: 31.12.2022

GESELLSCHAFTER

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

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
 - Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth
 - 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

- Dr. Jörg W. Stotz
 - (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH, Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Greiff capital management AG (seit 01.03.2023))
- 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)

GESCHÄFTSFÜHRUNG

VERWAHRSTELLE

Donner & Reuschel AG
Ballindamm 27
20095 Hamburg

Haftendes Eigenkapital: 372,400 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 20,500 Mio. EUR
Stand: 31.12.2022

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhrentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de