

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

Vermögenspooling Fonds Nr. 2

31. August 2023

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

| | |
|--|----|
| Tätigkeitsbericht Vermögenspooling Fonds Nr. 2 | 4 |
| Vermögensübersicht | 7 |
| Vermögensaufstellung | 8 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 25 |
| Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers | 29 |
| Allgemeine Angaben | 32 |

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

Vermögenspooling Fonds Nr. 2

in der Zeit vom 01.09.2022 bis 31.08.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht Vermögenspooling Fonds Nr. 2 für das Geschäftsjahr vom 01.09.2022 bis 31.08.2023

Anlageziel und Anlagepolitik

Für den konservativ ausgerichteten Mischfonds verfolgt das Fondsmanagement das Anlageziel, einen regelmäßigen Ertrag bei möglichst geringem Risiko zu erreichen. Dazu werden nahezu sämtliche Anlageklassen laufend hinsichtlich ihrer Ertragschancen bewertet und je nach Attraktivität entsprechend für den Fonds erworben. Zudem wird auf eine möglichst optimale Mischung der Anlagekategorien geachtet, so dass in der Gesamtheit das Ertragsniveau des Fonds stabilisiert wird. Bei der einzelnen Investitionsentscheidung spielt das Thema Nachhaltigkeit eine zentrale Rolle.

Das Börsenjahr 2022 bzw. die Börsenmonate 2023 waren durch verschiedene Faktoren gekennzeichnet. Die Aktienbörsen verzeichneten bis zum Frühjahr - entgegen den Prognosen vieler Experten - deutliche Kursgewinne. So stieg beispielweise der DAX von ca. 12.000 Punkten im Oktober 2022 auf zwischenzeitlich über 16.000 Punkte im Mai 2023. Nachlassende Inflationsängste und moderate Wachstumsaussichten beflügelten die Aktienkurse. Hinzu kamen überproportionale Kurssteigerungen bei Aktien die mit der sogenannten „Künstlichen Intelligenz“ in Verbindung gebracht werden. Dem gegenüber steht die Entwicklung am Rentenmarkt. Um die Inflation zu bekämpfen, erhöhten die Notenbanken weltweit die Zinsen und eine Trendwende ist diesbezüglich nicht abzusehen. Steigende Zinsen sorgten somit für deutliche Kursverluste bei Anleihen.

Stiftungsfonds legen traditionell einen wesentlichen Teil der Gelder in Anleihen an, um Ausschüttungen für soziale Projekte zu generieren und sind somit zinssensitiv. Trotzdem erzielte der Fonds seit Jahresbeginn eine positive Performance von ca. 4,37 Prozent und konnte im Geschäftsjahr den Wert erhalten. Die Volatilität im Geschäftsjahr lag trotz der Schwankungen an den Börsen bei 4,64 Prozent. Dies macht ihn unverändert für die Zielgruppe der Stiftungen attraktiv.

Die Zusammensetzung aus Aktien und Anleihen bringt naturgemäß das Risiko von Kursverlusten an den Aktien- bzw. an den Rentenmärkten mit sich. Das Fondsmanagement versucht, diese Risiken durch flexibles Handeln und durch den teilweisen Einsatz von quantitativen Modellen einzugrenzen. So hatte der Fonds am

Geschäftsjahresende eine Aktienquote von 25,81 Prozent und einer Rentenquote von 65,11 Prozent.

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

31.08.2023*

| Produktart | Wert Aktuell Fondswährung | Anteil am Fondsvermögen |
|------------|---------------------------|-------------------------|
| Renten | 44.044.188,14 | 65,11 |
| Aktien | 17.462.797,90 | 25,81 |
| Fonds | 3.349.540,00 | 4,95 |
| Kasse | 2.843.215,33 | 4,2 |
| Derivate | -50.806,00 | -0,08 |

*) Die Differenzen im Vergleich zur Vermögensaufstellung gemäß Jahresbericht betreffen eine abweichende Zuordnung der Vermögensgegenstände zu den oben aufgeführten Produktarten.

31.08.2022*

| Produktart | Wert Aktuell Fondswährung | Anteil am Fondsvermögen |
|------------|---------------------------|-------------------------|
| Renten | 32.971.418,42 | 50,84 |
| Aktien | 15.497.909,49 | 23,90 |
| Kasse | 9.444.302,26 | 14,56 |
| Fonds | 6.968.268,88 | 10,74 |
| Derivate | -26.500,00 | -0,04 |

*) Die Differenzen im Vergleich zur Vermögensaufstellung gemäß Jahresbericht betreffen eine abweichende Zuordnung der Vermögensgegenstände zu den oben aufgeführten Produktarten.

Risikoanalyse

Adressenausfallrisiken:

Grundsätzlich können Adressenausfallrisiken nicht ausgeschlossen werden. Da der Fonds aber ein breit diversifiziertes Portfolio hält, sind die Auswirkungen eher gering.

Zinsänderungsrisiken:

Der Fonds weist infolge der Investition in Renten Zinsänderungsrisiken auf, die sich in Form von Kursänderungen in den jeweiligen Vermögensgegenständen niederschlagen. Mit Fokus der Anlagen auf das kurze bis mittlere Laufzeitensegment ist das Zinsänderungsrisiko grundsätzlich jedoch als gering einzustufen.

Marktpreisrisiken:

Während des Berichtszeitraums bestanden in dem Fonds Marktpreisrisiken, insbesondere in Form von Aktien-, Anleihe-, Währungsrisiken.

Währungsrisiken:

Wegen des Grundsatzes der Diversifikation investiert der Fonds weltweit. Den dadurch bestehenden Währungsrisiken stehen entsprechende Chancen gegenüber.

Liquiditätsrisiken:

Aufgrund der zumeist hohen Liquidität der investierten Papiere war für fast alle eine jederzeitige Liquidierbarkeit gewährleistet.

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 Finanzinstrumen-

ten 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:

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.

Wertentwicklung

Die Wertentwicklung (nach BVI-Methode) betrug für den Berichtszeitraum für den Fonds 2,45 Prozent.

Veräußerungsergebnis

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren aus der Veräußerung von Aktien. Die realisierten Verluste resultieren im Wesentlichen aus den Veräußerungsverlusten Aktien und Renten.

Sonstige Hinweise

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

Das Portfoliomanagement für den Vermögenspooling Fonds Nr. 2 ist ausgelagert an ODDO BHF Trust GmbH und Eyb & Wallwitz Vermögensmanagement GmbH.

Per 01.10.2022 wechselte das Portfoliomanagement von der Warburg Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH auf Eyb & Wallwitz Vermögensmanagement GmbH.

Initiator des Fonds ist die Haus des Stiftens gGmbH.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens ¹⁾ |
|-------------------------------------|--------------------------|--|
| I. Vermögensgegenstände | 67.711.141,08 | 100,09 |
| 1. Aktien | 17.162.038,62 | 25,37 |
| 2. Anleihen | 43.670.961,77 | 64,56 |
| 3. Sonstige Beteiligungswertpapiere | 300.759,28 | 0,44 |
| 4. Investmentanteile | 3.349.540,00 | 4,95 |
| 5. Derivate | -50.806,00 | -0,08 |
| 6. Bankguthaben | 2.882.137,74 | 4,26 |
| 7. Sonstige Vermögensgegenstände | 396.509,67 | 0,59 |
| II. Verbindlichkeiten | -62.205,71 | -0,09 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | -62.205,71 | -0,09 |
| III. Fondsvermögen | EUR 67.648.935,37 | 100,00 |

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|-------------------------------------|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|---------------------|------------|----------------------|------------------------------------|
| | | | | | | im Berichtszeitraum | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 55.862.587,71 | 82,58 |
| Aktien | | | | | | | EUR | 17.162.038,62 | 25,37 |
| CH0210483332 | Cie Financière Richemont | STK | 800 | 0 | 0 | CHF | 126,4500 | 105.578,46 | 0,16 |
| CH0038863350 | Nestlé S.A. | STK | 7.000 | 1.500 | 0 | CHF | 106,3200 | 776.746,86 | 1,15 |
| CH0012549785 | Sonova Holding AG | STK | 400 | 0 | 0 | CHF | 234,0000 | 97.688,25 | 0,14 |
| CH0126881561 | Swiss Re AG | STK | 3.000 | 600 | 0 | CHF | 85,7400 | 268.454,83 | 0,40 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG | STK | 900 | 0 | 300 | CHF | 412,9000 | 387.841,15 | 0,57 |
| DK0060448595 | Coloplast AS | STK | 900 | 0 | 0 | DKK | 785,0000 | 94.794,68 | 0,14 |
| FR0000120073 | Air Liquide | STK | 1.593 | 0 | 0 | EUR | 166,2400 | 264.820,32 | 0,39 |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | 2.000 | 1.650 | 3.000 | EUR | 225,1000 | 450.200,00 | 0,67 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. ²⁾ | STK | 1.200 | 700 | 0 | EUR | 610,7000 | 732.840,00 | 1,08 |
| FR0000120628 | AXA S.A. ²⁾ | STK | 16.000 | 2.000 | 0 | EUR | 27,8700 | 445.920,00 | 0,66 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG | STK | 1.200 | 0 | 0 | EUR | 97,2600 | 116.712,00 | 0,17 |
| DE0005158703 | Bechtle AG | STK | 4.000 | 250 | 0 | EUR | 44,3600 | 177.440,00 | 0,26 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. | STK | 4.000 | 2.000 | 0 | EUR | 59,8800 | 239.520,00 | 0,35 |
| FR0000125338 | Capgemini SE ²⁾ | STK | 3.200 | 0 | 0 | EUR | 171,3500 | 548.320,00 | 0,81 |
| FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain ²⁾ | STK | 6.000 | 12.000 | 6.000 | EUR | 59,6400 | 357.840,00 | 0,53 |
| FR0014003TT8 | Dassault Systemes SE | STK | 3.500 | 0 | 0 | EUR | 36,6500 | 128.275,00 | 0,19 |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG | STK | 20.000 | 17.000 | 0 | EUR | 43,1000 | 862.000,00 | 1,27 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | 14.000 | 0 | 6.000 | EUR | 19,5480 | 273.672,00 | 0,40 |
| FR0000121667 | EssilorLuxottica S.A. | STK | 1.000 | 0 | 0 | EUR | 174,7400 | 174.740,00 | 0,26 |
| DE0006231004 | Infineon Technologies AG | STK | 4.500 | 0 | 0 | EUR | 33,0100 | 148.545,00 | 0,22 |
| FR0000121485 | Kering S.A. | STK | 650 | 400 | 0 | EUR | 498,3000 | 323.895,00 | 0,48 |
| FR0000120321 | L'Oréal | STK | 650 | 0 | 0 | EUR | 410,1000 | 266.565,00 | 0,39 |
| IE00059YS762 | Linde plc Registered Shares EO -, 001 | STK | 880 | 880 | 0 | EUR | 353,2000 | 310.816,00 | 0,46 |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SA ²⁾ | STK | 820 | 450 | 400 | EUR | 804,0000 | 659.280,00 | 0,97 |
| DE0008430026 | Münchener Rückversicherung AG | STK | 1.000 | 400 | 650 | EUR | 357,8000 | 357.800,00 | 0,53 |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC | STK | 25.000 | 10.500 | 0 | EUR | 30,1200 | 753.000,00 | 1,11 |
| DE0007164600 | SAP SE | STK | 1.500 | 0 | 0 | EUR | 128,8400 | 193.260,00 | 0,29 |
| DE0007236101 | Siemens | STK | 1.300 | 0 | 2.000 | EUR | 138,3000 | 179.790,00 | 0,27 |
| DE000A2YN900 | TeamViewer AG | STK | 4.500 | 0 | 0 | EUR | 17,0350 | 76.657,50 | 0,11 |
| FR0000051807 | Téléperformance S.A. | STK | 1.000 | 1.000 | 0 | EUR | 125,2000 | 125.200,00 | 0,19 |
| FR0000124141 | Veolia Environnement S.A. | STK | 12.000 | 6.500 | 0 | EUR | 28,3900 | 340.680,00 | 0,50 |
| FR0000125486 | VINCI ²⁾ | STK | 3.500 | 0 | 1.600 | EUR | 103,4800 | 362.180,00 | 0,54 |
| DE000A1ML7J1 | Vonovia SE | STK | 10.000 | 9.000 | 0 | EUR | 21,0300 | 210.300,00 | 0,31 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer N.V. | STK | 2.500 | 2.500 | 1.500 | EUR | 111,8500 | 279.625,00 | 0,41 |
| GB0009895292 | Astrazeneca | STK | 2.500 | 1.250 | 0 | GBP | 107,3400 | 312.489,08 | 0,46 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group | STK | 5.000 | 1.000 | 0 | GBP | 57,7000 | 335.953,42 | 0,50 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--------------|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|-----------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC | | STK | 1.500 | 0 | 0 | GBP 25,8300 | 45.117,90 | 0,07 |
| GB00B10RZP78 | Unilever PLC | | STK | 6.000 | 6.000 | 0 | GBP 40,6550 | 284.052,40 | 0,42 |
| KYG017191142 | Alibaba Group Holding Ltd. | | STK | 8.500 | 0 | 0 | HKD 90,3500 | 89.548,28 | 0,13 |
| US0028241000 | Abbott Laboratories | | STK | 700 | 0 | 0 | USD 104,4100 | 66.874,37 | 0,10 |
| IE00B4BNMY34 | Accenture PLC | | STK | 800 | 0 | 0 | USD 323,2500 | 236.618,17 | 0,35 |
| US02079K3059 | Alphabet Inc. Cl. A | | STK | 3.600 | 3.600 | 0 | USD 135,8800 | 447.587,15 | 0,66 |
| US0311621009 | Amgen Inc. | | STK | 1.400 | 1.400 | 0 | USD 257,8800 | 330.343,12 | 0,49 |
| US0605051046 | Bank of America Corp. | | STK | 1.500 | 6.000 | 6.000 | USD 29,0400 | 39.857,26 | 0,06 |
| US1912161007 | Coca-Cola Co., The | | STK | 6.000 | 6.000 | 0 | USD 60,4700 | 331.979,14 | 0,49 |
| US2441991054 | Deere | | STK | 800 | 0 | 0 | USD 413,2700 | 302.512,58 | 0,45 |
| US40415F1012 | HDFC Bank Ltd. Reg. Shs (Spons.ADRs)/3 IR 10 | | STK | 4.000 | 0 | 0 | USD 63,6800 | 233.067,98 | 0,34 |
| IE00BTN1Y115 | Medtronic PLC | | STK | 4.000 | 4.000 | 0 | USD 82,3100 | 301.253,55 | 0,45 |
| US5949181045 | Microsoft Corp. | | STK | 2.000 | 1.220 | 500 | USD 328,7900 | 601.683,59 | 0,89 |
| US6541061031 | Nike | | STK | 3.000 | 2.550 | 0 | USD 102,1000 | 280.263,52 | 0,41 |
| US70450Y1038 | PayPal Holdings Inc. | | STK | 7.500 | 7.200 | 500 | USD 63,4200 | 435.218,23 | 0,64 |
| US78409V1044 | S&P Global | | STK | 700 | 70 | 0 | USD 392,3800 | 251.318,51 | 0,37 |
| US79466L3024 | Salesforce Inc. | | STK | 2.200 | 1.800 | 0 | USD 215,0400 | 432.874,00 | 0,64 |
| US8835561023 | Thermo Fisher Scientific | | STK | 600 | 50 | 0 | USD 559,0000 | 306.889,93 | 0,45 |
| US92826C8394 | VISA Inc. Class A | | STK | 1.800 | 800 | 0 | USD 246,2300 | 405.539,39 | 0,60 |

| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 38.399.789,81 | 56,76 |
|--------------------------|--|-----|--|-------|-----|-------|----------|---------------|-------|
| XS2273810510 | 0.0000% Arountown SA EO-MTN 20/26 | EUR | | 100 | 0 | 0 % | 79,5720 | 79.572,00 | 0,12 |
| FR0013516549 | 0.0000% Frankreich EO-OAT 2020(30) | EUR | | 500 | 0 | 0 % | 81,1352 | 405.675,83 | 0,60 |
| XS2402064559 | 0.0000% Hitachi Capital (UK) PLC EO-Med.-T. Nts 2021(21/24) | EUR | | 100 | 0 | 0 % | 94,8285 | 94.828,50 | 0,14 |
| DE000A2BPB50 | 0.0000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 2016/2023 | EUR | | 1.000 | 0 | 500 % | 99,8530 | 998.530,00 | 1,48 |
| DE000A3H3E76 | 0.0000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 2021 (2026) | EUR | | 300 | 0 | 0 % | 91,5425 | 274.627,50 | 0,41 |
| XS2211997155 | 0.0000% STMicroelectronics N.V. DL-Zero Conv. Nts 2020(25) A | USD | | 200 | 0 | 0 % | 117,0900 | 214.273,95 | 0,32 |
| BE0002767482 | 0.1250% GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA 21/31 | EUR | | 200 | 0 | 0 % | 76,5734 | 153.146,77 | 0,23 |
| XS2389757944 | 0.2000% ANZ New Zealand (Itl) (Ldn Br.) EO-Med.-T. Notes 2021(27) | EUR | | 100 | 0 | 0 % | 85,9870 | 85.987,00 | 0,13 |
| XS2292487076 | 0.2500% ACEA S.p.A. EO-MTN 21/30 | EUR | | 100 | 0 | 0 % | 77,8924 | 77.892,36 | 0,12 |
| XS2063423318 | 0.2500% International Bank Rec. Dev. EO-Medium-Term Notes 2019(50) | EUR | | 700 | 500 | 0 % | 46,0000 | 322.000,00 | 0,48 |
| XS2305244241 | 0.2500% LEASEPLAN 21/26 MTN | EUR | | 200 | 0 | 0 % | 90,7440 | 181.488,00 | 0,27 |
| CH0595205524 | 0.2500% UBS Group AG EO-Non-Preferred MTN 2021(28) | EUR | | 400 | 0 | 0 % | 83,4205 | 333.682,13 | 0,49 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--------------|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|-----------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| XS2328981431 | 0.3360% Asahi Group Holdings Ltd. EO-Notes 2021(21/27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 88,2105 | 88.210,50 | 0,13 |
| XS2432567555 | 0.3750% DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(27/28) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 88,7370 | 177.474,00 | 0,26 |
| XS2390400716 | 0.3750% ENEL Finance Intl N.V. EO-MTN 21/29 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 82,2033 | 164.406,63 | 0,24 |
| XS1394055872 | 0.3750% European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2016(26) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 92,8890 | 371.556,00 | 0,55 |
| XS1767931477 | 0.3750% Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H318 v.18(24) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 98,5170 | 394.068,00 | 0,58 |
| XS2182054887 | 0.3750% Siemens Financ.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(26) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 91,8480 | 367.392,00 | 0,54 |
| XS2346206902 | 0.4500% American Tower Corp. EO-Notes 2021(2027) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 87,8240 | 87.824,00 | 0,13 |
| XS2447561403 | 0.5000% BMW Finance N.V. EO-MTN 22/25 | | EUR | 400 | 0 | 100 % | 95,3474 | 381.389,55 | 0,56 |
| BE0002274430 | 0.5000% BNP Paribas Fortis S.A. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 17(24) | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 96,4455 | 289.336,50 | 0,43 |
| XS1639238820 | 0.5000% BNZ Inter. Fund. Ltd. (Ldn Br.) EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2017(24) | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 97,1250 | 291.375,00 | 0,43 |
| FR0013162302 | 0.5000% Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2016(24) | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 96,6784 | 290.035,25 | 0,43 |
| XS2024715794 | 0.5000% Deutsche Telekom AG MTN v.2019(2027) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 91,1486 | 364.594,40 | 0,54 |
| XS2386186063 | 0.5000% Eli Lilly and Company EO-Notes 2021(21/33) | | EUR | 150 | 0 | 0 % | 75,7526 | 113.628,83 | 0,17 |
| FR0013516077 | 0.5000% EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 87,3432 | 349.372,86 | 0,52 |
| XS2047479469 | 0.5000% HELLA GmbH & Co. KGaA Anleihe v.2019(2026/2027) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 88,3675 | 353.470,00 | 0,52 |
| XS2270397016 | 0.5000% POSTE ITALIANE 20/28 MTN | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 83,2255 | 83.225,50 | 0,12 |
| XS1708192684 | 0.5000% Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2017(17/24) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 96,3360 | 385.344,00 | 0,57 |
| XS2126161764 | 0.5000% RELX Finance B.V. EO-Notes 20/28 | | EUR | 400 | 100 | 0 % | 87,1960 | 348.784,00 | 0,52 |
| XS2078692105 | 0.5000% Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2019(26) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 89,4040 | 357.616,00 | 0,53 |
| CH1130818847 | 0.5000% Swiss Life Finance I Ltd. EO-Bonds 2021(21/31) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 75,5845 | 75.584,50 | 0,11 |
| XS2058556536 | 0.5000% Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/28) | | EUR | 400 | 100 | 0 % | 86,8752 | 347.500,88 | 0,51 |
| XS2231259305 | 0.5530% National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/29) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 81,3317 | 162.663,43 | 0,24 |
| XS2085608326 | 0.6250% Fidelity Natl Inform.Svcs Inc. EO-Notes 2019(19/25) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 92,9475 | 371.790,03 | 0,55 |
| FR0014001IP3 | 0.6250% La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(36) | | EUR | 500 | 400 | 0 % | 67,9840 | 339.920,00 | 0,50 |
| XS1615677280 | 0.6250% Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts.v.17(27) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 91,0665 | 364.265,97 | 0,54 |
| XS2436853035 | 0.6250% OP Yrityspankki Oyj EO-Non-Preferred MTN 2022(27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 87,3535 | 87.353,50 | 0,13 |
| DE000A289QR9 | 0.7500% DAIMLER AG.MTN 20/30 | | EUR | 150 | 0 | 0 % | 82,3780 | 123.567,00 | 0,18 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens ¹⁾ |
|--------------|--|-------|--|-----------------------|-------------------|----------------------|---------|--------------------|--|
| | | | | | | im Berichtszeitraum | | | |
| XS2089368596 | 0.7500% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24) | | EUR | 150 | 0 | 0 % | 95,8864 | 143.829,60 | 0,21 |
| FR00140044X1 | 0.7500% La Banque Postale EO- Non-Preferred MTN 2021(31) | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 77,1490 | 385.745,00 | 0,57 |
| FR0014007LP4 | 0.7500% RTE Réseau de Transp.d'Electr. EO-Medium- Term Nts 2022(22/34) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 76,0320 | 152.064,07 | 0,22 |
| XS2433211310 | 0.7500% Snam S.p.A. EO-Med.- T. Nts 2022(22/29) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 83,5097 | 167.019,32 | 0,25 |
| XS2102357105 | 0.8750% BMW Finance N.V. EO- Medium-Term Notes 2020(32) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 81,7535 | 81.753,50 | 0,12 |
| XS1485597329 | 0.8750% HSBC Holdings PLC EO-MTN 16/24 | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 96,8739 | 387.495,80 | 0,57 |
| FR0013457967 | 0.8750% Icade Sante SAS EO- Obl. 2019(19/29) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 77,7690 | 155.538,00 | 0,23 |
| XS2075811781 | 0.8750% SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(27/27) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 87,1825 | 174.365,00 | 0,26 |
| XS1986416268 | 0.8750% Sika Capital B.V. EO- Notes 2019(19/27) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 90,1110 | 360.444,00 | 0,53 |
| FR0013430733 | 0.8750% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 91,2115 | 364.846,00 | 0,54 |
| FR0013534500 | 0.8750% Teréga S.A. EO-Obl. 2020(20/30) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 79,2691 | 79.269,06 | 0,12 |
| DE000A3T0YH5 | 1.0000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15317 v.22(26) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 93,6308 | 374.523,22 | 0,55 |
| XS2432544349 | 1.0000% ESB Finance DAC EO- Medium-Term Nts 2022(22/34) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 75,8074 | 75.807,43 | 0,11 |
| GB00BFWFPL34 | 1.0000% Großbritannien LS- Treasury Stock 2018(24) | | GBP | 290 | 290 | 0 % | 97,4475 | 329.080,35 | 0,49 |
| FR0014007NF1 | 1.0000% Icade S.A. EO-Obl. 2022(22/30) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 79,5706 | 79.570,59 | 0,12 |
| XS1709433509 | 1.0000% PostNL N.V. EO-Notes 2017(17/24) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 96,1045 | 384.418,00 | 0,57 |
| XS2181280335 | 1.0000% Talent Yield European Ltd. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 91,9863 | 183.972,60 | 0,27 |
| XS1751004232 | 1.1250% Banco Santander S.A. EO-Sen.Non-Pref.MTN 2018(25) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 95,9180 | 95.918,00 | 0,14 |
| FR0013460607 | 1.1250% Bureau Veritas SA EO- Notes 2019(19/27) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 89,9675 | 359.870,00 | 0,53 |
| XS1843434280 | 1.1250% Fiserv Inc. EO-Notes 2019(19/27) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 90,4926 | 361.970,47 | 0,54 |
| XS1837288494 | 1.1250% Knorr-Bremse AG Medium Term Notes v.18(25/25) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 95,6505 | 382.602,06 | 0,57 |
| XS1820748538 | 1.1250% LANXESS AG Medium- Term Nts 2018(25/25) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 95,2385 | 380.954,00 | 0,56 |
| XS1914485534 | 1.1250% Stryker Corp. EO-Notes 2018(18/23) | | EUR | 400 | 100 | 0 % | 99,2835 | 397.134,00 | 0,59 |
| DE000A19NS93 | 1.1250% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2017(17/ 25) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 93,3410 | 373.364,00 | 0,55 |
| XS2003442436 | 1.2500% AIB Group PLC EO- Medium-Term Notes 2019(24) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 97,8925 | 195.785,00 | 0,29 |
| XS2167003685 | 1.2500% Citigroup Inc. EO-FLR Med.-T. Nts 2020(20/26) | | EUR | 150 | 0 | 0 % | 94,7280 | 142.092,00 | 0,21 |
| XS2221845683 | 1.2500% Münchener Rückvers.- Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.20(30/ 41) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 77,0582 | 154.116,30 | 0,23 |
| DE000SYM7720 | 1.2500% Symrise AG Anleihe v. 2019(2025) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 94,1215 | 376.486,00 | 0,56 |
| ES00000128H5 | 1.3000% Spanien EO- Obligaciones 2016(26) | | EUR | 155 | 0 | 0 % | 94,1845 | 145.985,98 | 0,22 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--------------|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|-----------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| XS1963836892 | 1.3490% Marsh & McLennan Cos. Inc. EO-Bonds 19/26 | | EUR | 400 | 100 | 0 % | 92,9805 | 371.922,00 | 0,55 |
| XS2180509999 | 1.5000% Ferrari N.V. EO-Notes 2020(20/25) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 96,0995 | 384.398,00 | 0,57 |
| XS1910851242 | 1.5000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23) | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 99,5165 | 298.549,50 | 0,44 |
| DE000A1R0709 | 1.5000% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v. 2014 (2024) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 98,4240 | 393.696,00 | 0,58 |
| XS1395010397 | 1.5000% Mondi Finance PLC EMTN 16/24 | | EUR | 400 | 100 | 0 % | 98,3945 | 393.578,00 | 0,58 |
| XS1458408561 | 1.6250% Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Notes 2016(26) | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 94,0075 | 376.030,00 | 0,56 |
| DE0001102606 | 1.7000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2022 (2032) | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 % | 93,6590 | 936.590,00 | 1,38 |
| AU0000143901 | 1.7500% Australia, Commonwealth of... AD-Treasury Bonds 21(32) | | AUD | 1.000 | 1.000 | 0 % | 82,3750 | 489.526,07 | 0,72 |
| US515110BR44 | 1.7500% Landwirtschaftliche Rentenbank DL-Inh.-Schv.Global 35 v16(26) | | USD | 200 | 0 | 0 % | 92,0809 | 168.507,37 | 0,25 |
| FR0013054897 | 1.7500% Paris, Stadt EO-MTN 15/31 | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 89,4895 | 89.489,50 | 0,13 |
| FR0014009DZ6 | 1.8750% Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 94,0874 | 94.087,39 | 0,14 |
| FR001400AFL5 | 1.8750% Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 92,7086 | 92.708,57 | 0,14 |
| FR0013346822 | 1.8750% Téléperformance SE EO-Obl. 18/25 | | EUR | 400 | 100 | 0 % | 95,5847 | 382.338,65 | 0,57 |
| XS1963837197 | 1.9790% Marsh & McLennan Com. Inc 19/30 | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 88,9186 | 177.837,18 | 0,26 |
| US4581X0CU04 | 2.0000% Inter-American Dev. Bank DL-Medium-Term Nts 2016(26) | | USD | 200 | 0 | 0 % | 92,9530 | 170.103,39 | 0,25 |
| XS2224632971 | 2.0000% TotalEnergies S.E. EO-FLR Notes 20(30/Und.) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 77,9363 | 155.872,50 | 0,23 |
| AT0000A308C5 | 2.0000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(26) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 97,1490 | 388.596,00 | 0,57 |
| XS2125914916 | 2.1250% AbbVie Inc. EO-Notes 2020(20/29) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 91,6592 | 274.977,56 | 0,41 |
| XS1651444140 | 2.1250% Eurofins Scientific S.E. EO-Notes 17/24 | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 98,1895 | 392.758,00 | 0,58 |
| XS1130139667 | 2.1250% Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2014(26) | | EUR | 300 | 200 | 0 % | 95,0810 | 285.243,00 | 0,42 |
| XS1914502304 | 2.1250% Stryker Corp. EO-Notes 2018(18/27) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 93,9354 | 281.806,23 | 0,42 |
| XS1907150780 | 2.1250% Tele2 AB EO-Med.-Term Nts 2018(28/28) | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 92,2180 | 184.436,00 | 0,27 |
| XS2202744384 | 2.2500% CEPESA Finance S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2020(26/26) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 95,1749 | 190.349,87 | 0,28 |
| XS2481287808 | 2.2500% Coloplast Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 94,5621 | 94.562,10 | 0,14 |
| XS2478685931 | 2.2500% UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2022(22/29) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 91,2255 | 91.225,50 | 0,13 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--------------|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|-----------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| DE000BU2Z007 | 2.3000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2023 (2033) | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 % | 98,1152 | 981.151,66 | 1,45 |
| BE6265262327 | 2.3750% Proximus S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(24) | | EUR | 300 | 100 | 0 % | 99,0140 | 297.042,00 | 0,44 |
| XS1599193403 | 2.3750% Rumänien EO-Med.-T. Nts 2017(27) Reg.S | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 92,2535 | 92.253,50 | 0,14 |
| XS2491189408 | 2.5000% A2A S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 96,2802 | 96.280,20 | 0,14 |
| XS2147995372 | 2.5000% Danaher Corp. EO-Notes 2020(20/30) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 92,9981 | 371.992,21 | 0,55 |
| US45906M3D11 | 2.5000% International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2022(32) | | USD | 1.000 | 1.000 | 0 % | 87,4347 | 800.025,03 | 1,18 |
| XS2517103334 | 2.6250% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 22(22/32) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 90,4665 | 361.866,00 | 0,53 |
| XS1914502643 | 2.6250% Stryker Corp. EO-Notes 2018(18/30) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 92,3939 | 277.181,76 | 0,41 |
| XS1492818866 | 2.7500% European Investment Bank ZY-Medium-Term Notes 2016(26) | | PLN | 2.000 | 2.000 | 0 % | 92,4880 | 414.015,69 | 0,61 |
| EU000A3K4DW8 | 2.7500% Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(33) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 96,8206 | 387.282,40 | 0,57 |
| BE6320935271 | 2.8750% Anheuser-Busch InBev Fin. Inc. DL-Notes 2020(20/32) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 93,4371 | 373.748,28 | 0,55 |
| XS2056730323 | 2.8750% Infineon Technologies AG Anleihe v.2019(2025)/und | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 95,6535 | 191.307,00 | 0,28 |
| XS1713462403 | 2.8750% OMV AG EO-FLR Notes 2018(24/Und.) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 98,1020 | 98.102,00 | 0,15 |
| XS1651072099 | 2.8750% Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2017(17/37) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 87,1494 | 261.448,08 | 0,39 |
| XS2577109049 | 2.9000% International Bank Rec. Dev. EO-Medium-Term Notes 2023(33) | | EUR | 1.600 | 1.600 | 0 % | 97,5105 | 1.560.167,78 | 2,31 |
| DE000A1HG1K6 | 3.0000% Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Nts 13(28) Ser.61 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 98,6310 | 197.262,00 | 0,29 |
| XS1428088626 | 3.0000% Kroatien, Republik EO-Notes 2017(27) | | EUR | 300 | 200 | 0 % | 97,9884 | 293.965,33 | 0,43 |
| XS2152062209 | 3.0000% Volkswagen Fin. Services N.V. LS-Medium-Term Notes 2020/25 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 98,5695 | 197.139,00 | 0,29 |
| XS2010039894 | 3.0000% ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 19/29 | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 85,2980 | 255.894,00 | 0,38 |
| US4581X0BX51 | 3.2000% Inter-American Dev. Bank DL-Medium-Term Nts 2012(42) | | USD | 900 | 900 | 0 % | 81,2400 | 669.009,06 | 0,99 |
| XS1843448314 | 3.2500% Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v. 18/49 | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 91,7100 | 275.130,00 | 0,41 |
| XS1109836038 | 3.3750% Hannover Rück SE Sub.-FLR-Bonds.v.14(25/unb.) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 96,2930 | 192.586,00 | 0,28 |
| FR001400D8K2 | 3.3750% VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 96,8295 | 387.318,00 | 0,57 |
| XS1562614831 | 3.5000% Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Medium-Term Notes 2017(27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 97,7305 | 97.730,50 | 0,14 |
| XS2363235107 | 3.5000% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2021/2028) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 90,7500 | 272.250,00 | 0,40 |
| XS2574873266 | 3.5000% E.ON SE Medium Term Notes v.23(23/28) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 99,0285 | 396.114,00 | 0,59 |
| XS2583742239 | 3.6250% Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2023(23/31) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 98,5422 | 394.168,82 | 0,58 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|---|---|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|---------------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| XS2557526345 | 3.6500% Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2022(22/34) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 96,7765 | 387.106,08 | 0,57 |
| XS2167595672 | 3.7500% Eurofins Scientific EO-MTN 20/26 | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 97,7205 | 293.161,50 | 0,43 |
| XS1069439740 | 3.8750% AXA S.A. EO-FLR MTN 14(25/Und.) | | EUR | 150 | 0 | 0 % | 96,6065 | 144.909,75 | 0,21 |
| XS1629774230 | 3.8750% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2017(27/Und.) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 89,1075 | 267.322,50 | 0,40 |
| DE000CZ40LD5 | 4.0000% Commerzbank AG T2 Nachr.MTN S.865 v.2016(26) | | EUR | 150 | 0 | 0 % | 97,9160 | 146.874,00 | 0,22 |
| XS2583742668 | 4.0000% Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2023(23/43) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 95,3315 | 285.994,50 | 0,42 |
| XS2621007660 | 4.1250% Booking Holdings Inc. EO-Notes 2023(23/33) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 99,4920 | 397.968,00 | 0,59 |
| US025816CA56 | 4.2000% American Express Co. DL-Notes 2018(25) | | USD | 400 | 0 | 0 % | 97,4010 | 356.486,41 | 0,53 |
| XS2199351375 | 4.5000% Stellantis N.V. EO-MTN 20/28 | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 101,0810 | 101.081,00 | 0,15 |
| XS2559501429 | 5.0000% Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2022(2022/2029) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 101,6440 | 304.932,00 | 0,45 |
| FR001400FB22 | 5.1250% BPCE S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2023(30/35) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 97,1345 | 291.403,50 | 0,43 |
| US458140CG35 | 5.2000% Intel Corp. DL-Notes 2023(23/33) | | USD | 300 | 300 | 0 % | 100,0485 | 274.632,17 | 0,41 |
| FR001400F2H9 | 7.3750% BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 23(30/Und.) | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 98,4140 | 196.828,00 | 0,29 |
| Sonstige Beteiligungswertpapiere | | | | | | | EUR | 300.759,28 | 0,44 |
| CH0012032048 | Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N. | | STK | 1.100 | 300 | 0 CHF | 261,9750 | 300.759,28 | 0,44 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | EUR | 5.271.171,96 | 7,79 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 5.271.171,96 | 7,79 |
| XS2366741770 | 0.0000% Leasys S.p.A. EO-Notes 2021(24/24) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 96,4190 | 96.419,00 | 0,14 |
| XS2369244087 | 0.1000% Chile, Republik EO-Notes 2021(26/27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 87,4535 | 87.453,50 | 0,13 |
| DE000A3E5QW6 | 0.1250% GEWOBAW Wohnungsbau-AG Berlin EO-MTN v. 21/27 | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 85,4190 | 85.419,00 | 0,13 |
| XS2233088132 | 0.1250% Hamburger Hochbahn 21/31 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 78,8560 | 157.712,00 | 0,23 |
| DE000A3T0X97 | 0.2500% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R. 35413 v.22(25) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 93,5774 | 187.154,77 | 0,28 |
| XS2384723263 | 0.2500% Mondelez Intl Hldgs Nether. BV EO-Notes 2021(21/29) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 81,8150 | 81.815,05 | 0,12 |
| DE000LB2CRG6 | 0.3750% Landesbank Baden-Württemberg MTN 20(27) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 87,7395 | 175.479,00 | 0,26 |
| XS2079716937 | 0.5000% Apple Inc. EO-Notes 2019(19/31) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 80,4646 | 160.929,28 | 0,24 |
| XS2394063437 | 0.5000% Brenntag Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 79,6350 | 318.540,00 | 0,47 |
| XS2242921711 | 0.5000% Rentokil Initial PLC EO-MTN 20/28 | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 84,1680 | 336.672,00 | 0,50 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--------------|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|-----------------|------------------------------------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | |
| XS2270142966 | 0.6250% Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2020(50) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 48,5554 | 48.555,43 | 0,07 |
| XS2227050379 | 0.8750% Royal Schiphol 20/32 | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 78,3135 | 78.313,50 | 0,12 |
| XS2063495811 | 1.1250% Digital Euro Finco LLC EO-Notes 2019(19/28) Reg.S | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 84,5445 | 338.178,00 | 0,50 |
| XS1719267855 | 1.1250% Parker-Hannifin EO-Nts 17/25 | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 95,6921 | 95.692,11 | 0,14 |
| XS2466172280 | 1.2500% Daimler Truck Intl Finance EO-MTN 22/25 | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 95,6865 | 287.059,39 | 0,42 |
| XS2456839369 | 2.0000% BERKSHIRE HATH.FIN. 22/34 | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 82,6168 | 330.467,20 | 0,49 |
| XS2176621170 | 2.1250% ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 20(26/31) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 91,9960 | 91.996,00 | 0,14 |
| XS2489287354 | 2.1250% Sandvik AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/27) | | EUR | 100 | 0 | 0 % | 93,9702 | 93.970,21 | 0,14 |
| XS2489981485 | 2.2640% Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(24/25) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 98,4240 | 196.848,00 | 0,29 |
| XS2463988795 | 2.3750% EQT AB EO-Notes 2022(22/28) Ser. A | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 89,4617 | 178.923,36 | 0,26 |
| DE000A289FK7 | 2.6250% ALLIANZ SUB 20(31)/ und | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 70,6260 | 282.504,00 | 0,42 |
| XS2197076651 | 2.7500% Helvetia Europe EO-FLR Notes 2020(31/41) | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 80,6965 | 161.393,00 | 0,24 |
| XS2050933972 | 3.2500% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Cap.Sec. 2019(26/Und.) | | EUR | 400 | 400 | 0 % | 84,1700 | 336.680,00 | 0,50 |
| XS2575556589 | 3.3750% ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 97,5230 | 292.569,14 | 0,43 |
| XS2388378981 | 3.6250% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2021(29/Und.) | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 65,5130 | 131.026,00 | 0,19 |
| XS2494946820 | 4.3750% Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30) | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 101,1428 | 202.285,52 | 0,30 |
| DE000DL19VZ9 | 4.6250% Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2021(2028) | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 72,2420 | 144.484,00 | 0,21 |
| XS2582389156 | 6.1350% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Notes 2023(23/Und.) | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 97,5445 | 292.633,50 | 0,43 |

| | | | | | | | | | |
|--|---|-----|--|--------|---|-------|------------|---------------------|-------------|
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 3.349.540,00 | 4,95 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | EUR | 3.349.540,00 | 4,95 |
| IE00B4L60045 | iShsIII-EO Corp Bd 1-5yr U.ETF Registered Shares o.N. | ANT | | 20.000 | 0 | 0 EUR | 102,3350 | 2.046.700,00 | 3,03 |
| IE00BZ163G84 | Vanguard EUR Corp.Bond U.ETF Registered Shares EUR Dis.oN | ANT | | 28.000 | 0 | 0 EUR | 46,5300 | 1.302.840,00 | 1,93 |

| | | | | | | | | | |
|---------------------------------|--|--|--|--|--|--|------------|----------------------|--------------|
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 64.483.299,67 | 95,32 |
|---------------------------------|--|--|--|--|--|--|------------|----------------------|--------------|

| | | | | | | | | | | |
|---|--|------|-----|------|--|--|------------|-------------------|--------------|-------|
| Derivate | | | | | | | EUR | -50.806,00 | -0,08 | |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | | | | |
| Derivate auf einzelne Wertpapiere | | | | | | | EUR | -50.806,00 | -0,08 | |
| Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen/Verbindlichkeiten) | | | | | | | EUR | -50.806,00 | -0,08 | |
| Optionsrechte auf Aktien | | | | | | | EUR | -50.806,00 | -0,08 | |
| Call ASML Holding N.V. 650,0000000000 20.10.2023 | | XEUR | STK | -7 | | | EUR | 12,9800 | -9.086,00 | -0,01 |
| Call AXA 29,0000000000 20.10.2023 | | XEUR | STK | -160 | | | EUR | 0,3500 | -5.600,00 | -0,01 |

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.08.2023

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens ¹⁾ |
|--|---------------------|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|---------------------|------------|----------------------|------------------------------------|
| | | | | | | im Berichtszeitraum | | | |
| Call Capgemini 174,000000000 | 20.10.2023 | XEUR | STK | -3 | | EUR | 5,3800 | -1.614,00 | 0,00 |
| Call Capgemini 174,000000000 | 20.10.2023 | XEUR | STK | -17 | | EUR | 5,3800 | -9.146,00 | -0,01 |
| Call LVMH 840,000000000 | 20.10.2023 | XEUR | STK | -5 | | EUR | 16,6300 | -8.315,00 | -0,01 |
| Call Saint Gobain 60,000000000 | 20.10.2023 | XEUR | STK | -60 | | EUR | 2,1700 | -13.020,00 | -0,02 |
| Call Vinci 108,000000000 | 20.10.2023 | XEUR | STK | -35 | | EUR | 1,1500 | -4.025,00 | -0,01 |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 2.882.137,74 | 4,26 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | EUR | 2.227.442,40 | 3,29 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | EUR | 2.227.442,40 | | | | 2.227.442,40 | 3,29 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 73.430,15 | 0,11 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | NOK | 705.382,66 | | | | 61.119,98 | 0,09 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | PLN | 55.000,00 | | | | 12.310,17 | 0,02 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 581.265,19 | 0,86 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | AUD | 10.107,45 | | | | 6.006,51 | 0,01 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | CHF | 261.906,85 | | | | 273.346,40 | 0,40 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | GBP | 8.918,13 | | | | 10.385,01 | 0,02 |
| Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG | | | USD | 318.610,15 | | | | 291.527,27 | 0,43 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 396.509,67 | 0,59 |
| Dividendenansprüche | | | EUR | 19.614,71 | | | | 19.614,71 | 0,03 |
| Zinsansprüche | | | EUR | 376.894,96 | | | | 376.894,96 | 0,56 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -62.205,71 | -0,09 |
| Sonstige Verbindlichkeiten ³⁾ | | | EUR | -62.205,71 | | | | -62.205,71 | -0,09 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 67.648.935,37 | 100,00 |
| Anteilwert Vermögenspooling Fonds Nr. 2 | | | | | | | EUR | 9,438 | |
| Umlaufende Anteile Vermögenspooling Fonds Nr. 2 | | | | | | | STK | 7.167.783,001 | |

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

²⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren. Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind: -50.806,00 EUR.

³⁾ 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 31.08.2023 | | |
|----------------------|-------|----------------|---|--------------|
| Australischer Dollar | (AUD) | 1,682750 | = | 1 Euro (EUR) |
| Britisches Pfund | (GBP) | 0,858750 | = | 1 Euro (EUR) |
| Dänische Krone | (DKK) | 7,452950 | = | 1 Euro (EUR) |
| Hongkong-Dollar | (HKD) | 8,576100 | = | 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Krone | (NOK) | 11,540950 | = | 1 Euro (EUR) |
| Polnischer Zloty | (PLN) | 4,467850 | = | 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken | (CHF) | 0,958150 | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,092900 | = | 1 Euro (EUR) |

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

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 | | | | |
| CH0012221716 | ABB | STK | 0 | 5.000 |
| CH1169360919 | Accelleron Industries Ltd. | STK | 250 | 250 |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG | STK | 0 | 600 |
| US02079K1079 | Alphabet Inc. Class C | STK | 0 | 2.000 |
| ES0109067019 | Amadeus IT Group S.A. | STK | 0 | 2.600 |
| US0231351067 | Amazon.com Inc. | STK | 3.500 | 3.500 |
| US0378331005 | Apple Inc. | STK | 0 | 600 |
| DE0005200000 | Beiersdorf AG | STK | 0 | 1.500 |
| US09857L1089 | Booking Holdings Inc. | STK | 0 | 125 |
| CH0198251305 | Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien SF 6,70 | STK | 0 | 4.000 |
| US2310211063 | Cummins | STK | 0 | 300 |
| FR0000120644 | Danone S.A. | STK | 0 | 800 |
| GB0002374006 | Diageo | STK | 0 | 3.000 |
| ES0127797019 | EDP Renováveis | STK | 0 | 5.000 |
| US5324571083 | Eli Lilly and Company | STK | 0 | 350 |
| DE0006095003 | ENCAVIS AG | STK | 0 | 5.000 |
| SE0009922164 | Essity AB Namn-Aktier B | STK | 0 | 2.500 |
| US5184391044 | Estée Lauder | STK | 0 | 200 |
| CH0030170408 | Geberit AG | STK | 0 | 250 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | 0 | 550 |
| NL0000009165 | Heineken N.V. | STK | 0 | 800 |
| FR0000052292 | Hermes International | STK | 0 | 120 |
| IE0004927939 | Kingspan Group | STK | 0 | 1.500 |
| NL0000009538 | Kon. Philips | STK | 0 | 3.156 |
| FR0010307819 | Legrand | STK | 0 | 1.600 |
| DE0007100000 | Mercedes-Benz Group AG | STK | 0 | 1.700 |
| GB00B1CRLC47 | Mondi Business Paper | STK | 0 | 4.000 |
| DE000A0D6554 | Nordex SE | STK | 0 | 5.500 |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS | STK | 0 | 1.600 |
| DK0060336014 | Novozymes A/S | STK | 0 | 2.200 |
| US68389X1054 | Oracle Corp. | STK | 0 | 1.200 |
| DK0060094928 | Orsted A/S | STK | 0 | 800 |
| NL0013654783 | Prosus N.V. | STK | 0 | 1.300 |
| FI0009003305 | Sampo OYJ Cl.A | STK | 0 | 6.000 |
| FR0000121972 | Schneider Electric | STK | 0 | 1.000 |
| ES0143416115 | Siemens Gamesa Renew. En. S.A. | STK | 0 | 4.000 |

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 |
|---------------------------------|---|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| CH0418792922 | Sika AG | STK | 400 | 1.000 |
| IE00B1RR8406 | Smurfit Kappa Group | STK | 0 | 2.200 |
| SE0000112724 | Svenska Cellulosa | STK | 0 | 7.500 |
| SE0006422390 | Thule Group AB (publ) Namn-Aktier o.N. | STK | 10.000 | 10.000 |
| NO0012470089 | Tomra Systems ASA | STK | 0 | 4.400 |
| DK0061539921 | Vestas Wind Systems AS | STK | 0 | 3.500 |
| AT0000APOST4 | Österreichische Post | STK | 0 | 5.000 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE0001104834 | 0.0000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23) | EUR | 0 | 1.000 |
| DE000A3H3GE7 | 0.0000% HOWOGE Wohnungsbaug.mbH EO-MTN v. 2021(2021/2024) | EUR | 0 | 100 |
| XS2375836553 | 0.0340% BECTON,DICKINS. 21/25 | EUR | 0 | 100 |
| XS2433244089 | 0.1250% E.ON SE Medium Term Notes v.22(25/26) | EUR | 0 | 150 |
| DK0030485271 | 0.1250% EURONEXT 21/26 | EUR | 0 | 100 |
| XS2286441964 | 0.1250% Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-Med.-T. Nts 21(21/27) | EUR | 0 | 150 |
| XS2332234413 | 0.1250% SGS Nederland Holding B.V. EO-MTN 21/27 | EUR | 0 | 100 |
| XS2324836878 | 0.2500% Wolters Kluwer NV (21/28) | EUR | 0 | 100 |
| FR0014007VF4 | 0.3750% BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(26) | EUR | 0 | 100 |
| XS2411311652 | 0.3990% NTT Finance Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/28) | EUR | 0 | 100 |
| XS2441055998 | 0.5000% SBAB Bank AB (publ) EO-Preferred MTN 2022(27) | EUR | 0 | 100 |
| XS2463974571 | 0.6250% ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/24) | EUR | 0 | 200 |
| XS2441244535 | 0.7500% Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Notes 2022(22/25) | EUR | 0 | 150 |
| XS2442768227 | 0.7500% Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(27) | EUR | 0 | 200 |
| XS1678629186 | 0.8750% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2017(22) | EUR | 0 | 200 |
| FR0014009EJ8 | 0.8750% L'Oréal S.A. EO-Notes 2022(22/26) | EUR | 0 | 100 |
| FR0014009KS6 | 0.8750% Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) | EUR | 0 | 200 |
| XS1225626461 | 1.2500% Smiths Group PLC EO-Notes 2015(23/23) | EUR | 100 | 400 |
| DE0001102317 | 1.5000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 13/23 | EUR | 600 | 600 |
| XS1853426549 | 1.5000% Informa PLC EO-MTN 18/23 | EUR | 0 | 150 |
| XS1673102734 | 1.5000% ISS Global A/S EO-Medium-Term Nts 2017(17/27) | EUR | 0 | 150 |
| XS2477935345 | 1.6250% TenneT Holding B.V. 22/26 | EUR | 0 | 100 |
| XS1721244371 | 1.8750% Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2017(23/Und.) | EUR | 0 | 100 |
| DE000A1R07S9 | 2.1250% Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2013 (2023) | EUR | 200 | 200 |
| BE0002597756 | 2.7500% Elia Group EO-FLR Nts 2018(23/Und.) | EUR | 0 | 100 |
| XS2056371334 | 2.8750% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2019(27/Und.) | EUR | 0 | 100 |
| XS1591694481 | 2.9950% TenneT Holding EO-FLR-Nts 17/24/Und. | EUR | 0 | 100 |
| XS1150695192 | 4.8500% Volvo Treasury AB EO-FLR Capit.Secs. 2014(23/78) | EUR | 0 | 100 |

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 |
|---|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------|
| XS1327014749 | 2.6250% Metropolitan Life Global Fdg I LS-Medium-Term Notes 2015(22) | GBP | 0 | 100 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| IE00BZ12WP82 | Linde PLC | STK | 0 | 880 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE0001030872 | 0.0000% Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.22/08 f.23.08.23 | EUR | 750 | 750 |
| XS2385397901 | 0.0000% Comcast Corp. EO-Notes 21/26 | EUR | 0 | 100 |
| XS2345317510 | 0.0500% Svenska Handelsbanken AB EO-Pref.MTN 2021(28) Reg.S | EUR | 0 | 100 |
| FR0014004QX4 | 0.1250% Alstom S.A. EO-Notes 2021(21/27) | EUR | 0 | 100 |
| FR0013534484 | 0.1250% Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/29) | EUR | 0 | 100 |
| XS2331315635 | 0.3750% Enxsis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33) | EUR | 0 | 100 |
| XS2337285519 | 0.5000% Fomento Econom.Mexica.SAB D.CV EO-Notes 2021(21/28) | EUR | 0 | 100 |
| XS2386650274 | 0.8750% ERG S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2021(21/31) | EUR | 0 | 100 |
| XS1223830677 | 1.0000% General Mills Inc. EO-Notes 15/23 | EUR | 400 | 400 |
| XS1143163183 | 1.2500% Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2014(14/23) | EUR | 400 | 400 |
| XS2295335413 | 1.4500% IBERDROLA 21/ 27 | EUR | 0 | 100 |
| XS1115208107 | 1.8750% Morgan Stanley EO-Medium-Term Notes 2014(23) | EUR | 400 | 400 |
| XS0942172296 | 2.0000% European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2013(23) | EUR | 500 | 500 |
| DE000A2LQF20 | 3.6250% Deutsche Rohstoff AG Wandelanleihe 18/23 | EUR | 0 | 175 |
| US912828ZT04 | 0.2500% United States of America DL-Notes 2020(25) | USD | 0 | 800 |
| US917288BK78 | 4.3750% Uruguay, Republik DL-Bonds 2019(19/29-31) | USD | 0 | 200 |
| US345397ZC07 | 5.8411% Ford Motor Credit Co. LLC DL-FLR Notes 2018(23) | USD | 0 | 200 |
| Nicht notierte Wertpapiere | | | | |
| Aktien | | | | |
| SE0017486897 | Atlas Copco AB Namn-Aktier B(fria) Red.Shs. | STK | 0 | 14.000 |
| GB00BWFQGN14 | Spirax-Sarco Engineering PLC Reg. Shares LS -,26923076 | STK | 0 | 600 |
| Investmentanteile | | | | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | |
| DE000A2JF7B0 | ART Top 50 Smart ESG Conver.UI Inhaber-Anteilsklasse I | ANT | 0 | 6.162 |
| LU1829218319 | M.U.L.-Lyx.B.FI.R.EO 0-7Y U.E. Namens-Ant.Acc.EUR(INE)o.N. | ANT | 0 | 22.000 |
| LU0535037997 | Salm-Salm Sustainabil.Convert. Inhaber-Anteile I o.N. | ANT | 0 | 9.191 |
| DE000A12BTT8 | Warburg-Corp.Bds Soci.Resp.-Fd Inhaber-Anteile B | ANT | 0 | 2.750 |

| 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 | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | |
| Verkaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 5.536 |
| ESTX 50 Index (Price) (EUR) | | | | |
| Optionsrechte | | | | |
| Wertpapier-Optionsrechte | | | | |
| Optionsrechte auf Aktien | | | | |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call) | | | | |
| (Basiswerte: | EUR | | | 127 |
| Allianz SE | | | | |
| Alphabet Inc. Class C | | | | |
| Amazon.com Inc. | | | | |
| ASML Holding N.V. | | | | |
| Capgemini SE | | | | |
| Compagnie de Saint-Gobain | | | | |
| Deere | | | | |
| Deutsche Post AG | | | | |
| LVMH Moët Henn. L. Vuitton SA | | | | |
| VINCI | | | | |
| Wolters Kluwer N.V.) | | | | |

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) VERMÖGENS- POOLING FONDS NR. 2

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.09.2022 BIS 31.08.2023

| | EUR | EUR |
|--|---------|---------------------|
| I. Erträge | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller | | 108.175,36 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | | 335.132,67 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | | 146.985,38 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | | 505.112,16 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | | 60.542,89 |
| davon negative Habenzinsen | -610,62 | |
| 6. Erträge aus Investmentanteilen | | 60.058,18 |
| 7. Abzug ausländischer Quellensteuer | | -41.752,73 |
| 8. Sonstige Erträge | | 11.700,64 |
| Summe der Erträge | | 1.185.954,55 |
| II. Aufwendungen | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | | -2.582,62 |
| 2. Verwaltungsvergütung | | -324.590,34 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | | -26.499,57 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | | -10.158,34 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | | -10.099,89 |
| 6. Aufwandsausgleich | | -667,86 |
| Summe der Aufwendungen | | -374.598,62 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | | 811.355,93 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | |
| 1. Realisierte Gewinne | | 1.303.205,86 |
| 2. Realisierte Verluste | | -1.202.448,05 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | | 100.757,81 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 912.113,74 |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | | 346.596,46 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | | 281.581,49 |
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | 628.177,95 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 1.540.291,69 |

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS VERMÖGENSPooling FONDS NR. 2

| | EUR | EUR |
|---|---------------|----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.09.2022) | | 64.855.399,05 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | | -1.314.241,40 |
| 2. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | | 2.526.172,23 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen | 6.635.197,82 | |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen | -4.109.025,59 | |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | 41.313,80 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | | 1.540.291,69 |
| davon nicht realisierte Gewinne | 346.596,46 | |
| davon nicht realisierte Verluste | 281.581,49 | |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.08.2023) | | 67.648.935,37 |

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS VERMÖGENSPoolING FONDS NR. 2 ¹⁾

| | insgesamt EUR | je Anteil EUR |
|---|----------------------|------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | 3.719.947,23 | 0,52 |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | 1.605.385,44 | 0,22 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | 912.113,74 | 0,13 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen | 1.202.448,05 | 0,17 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | -2.214.712,79 | -0,31 |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | 0,00 | 0,00 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | -2.214.712,80 | -0,31 |
| III. Gesamtausschüttung | 1.505.234,43 | 0,21 |
| 1. Endausschüttung | 1.505.234,43 | 0,21 |
| a) Barausschüttung | 1.505.234,43 | 0,21 |

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 VERMÖGENSPoolING FONDS NR. 2

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | Anteilwert |
|---------------|--|------------|
| | EUR | EUR |
| 2023 | 67.648.935,37 | 9,438 |
| 2022 | 64.855.399,05 | 9,408 |
| 2021 | 58.399.671,92 | 10,624 |
| 2020 | 39.914.443,44 | 9,999 |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

| | | |
|--|-----|-------|
| Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure | EUR | 0,00 |
| Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte | | |
| Donner & Reuschel AG | | |
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | | 95,32 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | | -0,08 |
| Dieses Sondervermögen wendet gemäß Derivateverordnung den einfachen Ansatz an. | | |

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 Vermögenspooling Fonds Nr. 2 | EUR | 9,438 |
| Umlaufende Anteile Vermögenspooling Fonds Nr. 2 | STK | 7.167.783,001 |

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 VERMÖGENSPooling FONDS NR. 2

| | |
|---|--------|
| Performanceabhängige Vergütung | 0,00 % |
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 0,56 % |

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 01.09.2022 BIS 31.08.2023

| Transaktionen | Volumen in Fondswährung |
|---|-------------------------|
| Transaktionsvolumen gesamt | 61.754.921,46 |
| Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen | 38.009.654,02 |
| Relativ in % | 61,55 % |

Transaktionskosten: 34.195,72 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 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 % |
|--------------|--|---|
| DE000A2JF7B0 | ART Top 50 Smart ESG Conver.Ul Inhaber-Anteilsklasse I ¹⁾ | 1,17 |
| IE00B4L60045 | iShsIII-EO Corp Bd 1-5yr U.ETF Registered Shares o.N. ¹⁾ | 0,20 |
| LU1829218319 | M.U.L.-Lyx.B.FI.R.EO 0-7Y U.E. Namens-Ant.Acc.EUR(INE)o.N. ¹⁾ | 0,10 |
| LU0535037997 | Salm-Salm Sustainabil.Convert. Inhaber-Anteile I o.N. ¹⁾ | 0,80 |
| IE00BZ163G84 | Vanguard EUR Corp.Bond U.ETF Registered Shares EUR Dis.oN ¹⁾ | 0,09 |
| DE000A12BTT8 | Warburg-Corp.Bds Soci.Resp.-Fd Inhaber-Anteile B ¹⁾ | 0,19 |

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

Vermögenspooling Fonds Nr. 2

Sonstige Erträge

| | | |
|---|-----|----------|
| Erträge aus der Auflösung von Rückstellungen | EUR | 6.725,53 |
| Quellensteuer Erstattung (ohne gebildete Ansprüche) | EUR | 4.975,11 |

Sonstige Aufwendungen

| | | |
|--------------|-----|----------|
| Ratingkosten | EUR | 6.992,09 |
|--------------|-----|----------|

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 Eyb & Wallwitz Vermögensmanagement GmbH für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

| Portfoliomanager | Eyb & Wallwitz Vermögensmanagement GmbH | |
|---|---|---------------------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung | EUR | 4.757.186,57 |
| 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 | | 14 |
| Die Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung umfasst den Aufwandsposten Personalaufwendungen ohne soziale Abgaben des letzten im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlichten Jahresabschlusses. | | |

Das Auslagerungsunternehmen ODDO BHF Trust GmbH hat keine Informationen veröffentlicht.

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 Stimmrechtsvertretern:

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

Hamburg, 07. Dezember 2023

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

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.

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,
Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens Vermögenspooling Fonds Nr. 2 - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. September 2022 bis zum 31. August 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. August 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. September 2022 bis zum 31. August 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 Prüfungsur-

teil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

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

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

Hamburg, den 08.12.2023

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: 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

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- 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)

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

HANSAINVEST