

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

3ik-Strategiefonds II

31. August 2021

**SEHR GEEHRTE ANLEGERIN,
SEHR GEEHRTER ANLEGER,**

Hamburg, im Dezember 2021

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

3ik-Strategiefonds II

in der Zeit vom 01. September 2020 bis 31. August 2021.

Mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

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

SO BEHALTEN SIE DEN ÜBERBLICK

TÄTIGKEITSBERICHT FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR 2020/2021	4
VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 31. AUGUST 2021	6
VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31. AUGUST 2021	7
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	13
VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS	16
KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT, VERWAHRSTELLE UND GREMIEN	18

TÄTIGKEITSBERICHT FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR 2020/2021

GLIEDERUNG

- 1) Anlageziel/Anlagepolitik
- 2) Veräußerungsergebnisse
- 3) Risikoberichterstattung
- 4) Sonstige Hinweise

ANLAGEZIEL / ANLAGEPOLITIK

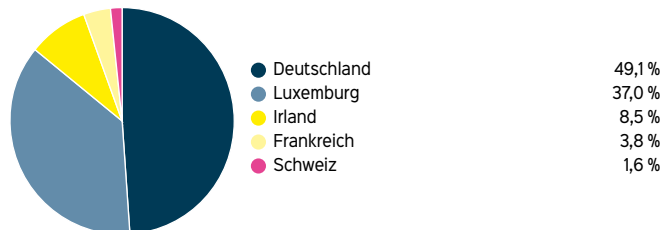
Anlageziel des 3ik-Strategiefonds II ist es, in einem rollierenden Zeitraum von jeweils drei Jahren stets ein positives Ergebnis zu erreichen. Gleichzeitig wird das Ziel verfolgt, den Wertrückgang des 3ik-Strategiefonds II nach einem Höchststand auf maximal 10 % zu begrenzen.

Für den 3ik-Strategiefonds II werden nur Anlagewerte ausgewählt, von denen der Fondsmanager erwartet, dass sie nur mäßigen Wertschwankungen unterliegen. Jede Position wird fortlaufend beobachtet und einer gesonderten Prüfung unterworfen, wenn der Wertrückgang nach dem zuletzt erreichten Höchststand eine Grenze von 5 % überschreitet. Der Fondsmanager wird nach dieser Sonderprüfung entscheiden, ob der jeweilige Wert kurzfristig aus dem Fonds entfernt wird oder die Position in Erwartung einer alsbaldigen Erholung im Investmentvermögen verbleibt. Eine zweite besonders intensive Sonderprüfung erfolgt, wenn eine Einzelposition nach der ersten Prüfung trotz Erwartung einer Werterholung einen weiteren Rückgang von 5 % überschreitet.

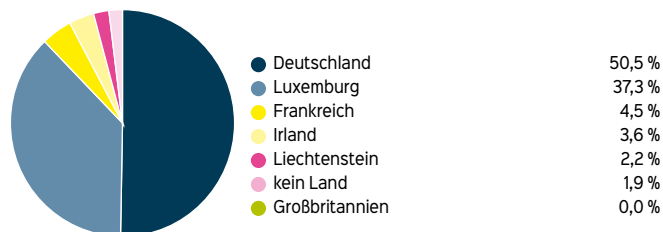
Im Berichtszeitraum wurde die Allokation breit diversifiziert in folgenden Zielfondskategorien vorgenommen: Anleihefonds, Wandelanleihefonds, Mischfonds, Absolute Return Fonds, Aktienfonds. Situativ wurde die genannte Portfolioausrichtung durch diverse taktische Investments via Futures (long und short) und ETFs ergänzt.

Die Portfolioübersicht nach Ländern gestaltete sich wie folgt:

31.08.2021



31.08.2020



WESENTLICHE ANGABEN ÜBER DIE HERKUNFT DES VERÄUSSERUNGSERGEBNISSES

Die Ergebnisse aus Veräußerungsgeschäften wurden im Wesentlichen aus Indexfutures und Investmentfonds erzielt.

RISIKOBERICHTERSTATTUNG

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, Produkt- 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.

Marktpreisrisiko

Gemäß der Anlagestrategie wurden überwiegend solche Anlagewerte ausgewählt, deren Marktpreisrisiko unter normalen Umständen der Zielstellung der Anlagepolitik entspricht und nur mäßige Wertschwankungen erwarten lassen.

Adressenausfallrisiko

Die breite Streuung des Fondsvermögens in Zielfonds reduziert die Auswirkung einer möglichen Insolvenz eines Unternehmens (falls Bestandteil eines Zielfonds) sehr stark.

Zinsänderungsrisiken

Beim 3ik-Strategiefonds II, mit einem Anteil an Rentenfonds, wird eine aktive Durationssteuerung vorgenommen. Je nach Situation werden auch Derivate zur Begrenzung des Zinsänderungsrisikos eingesetzt.

Währungsrisiken

Der 3ik-Strategiefonds II hat nur ein unterdurchschnittliches Währungsexposure. Das Fondsmanagement wird situativ Absicherungen vornehmen.

Liquiditätsrisiken

Bei der Auswahl der Zielfonds wird der jederzeitigen Liquidierbarkeit der Positionen unter normalen Marktumständen einen hohen Stellenwert beigemessen.

Sonstiges Risiko

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

SONSTIGE HINWEISE

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

Das Portfoliomanagement ist ausgelagert an Gies & Heimbürger GmbH.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 31. AUGUST 2021

Fondsvermögen:	EUR 10.713.558,64	(9.642.857,76)
Umlaufende Anteile: Class I	80.313	(81.466)
Class R	292	(313)

VERMÖGENSAUFTEILUNG IN TEUR/%

	Kurswert in Fondswährung	% des Fondsvermögens	% des Fondsvermögens per 31.08.2020
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	437	4,08	(0,00)
2. Zertifikate	146	1,36	(0,00)
3. Sonstige Wertpapiere	10.478	97,80	(99,16)
4. Derivate	-123	-1,15	(-1,10)
5. Bankguthaben	0	0,00	(2,17)
II. Verbindlichkeiten	-224	-2,09	(-0,23)
III. Fondsvermögen	10.714	100,00	

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. AUGUST 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
VARTA AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A0TGJ55	STK	2.000	2.000	2.000	0	EUR 130,750000	261.500,00	2,44
Meyer Burger Technology AG	CH0108503795	STK	420.000	420.000	420.000	0	CHF 0,452200	175.717,26	1,64
Zertifikate									
XTrackers ETC PLC ETC Z15.05.80 Silber	DE000A2UDH55	STK	4.716	4.717	4.717	1	EUR 30,830000	145.394,28	1,36
							EUR	582.611,54	5,44
Investmentanteile									
KVG-eigene Investmentanteile									
Alpora Innovation Select Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2AJHJ1	ANT	2.665	3.000	3.000	335	EUR 170,930000	455.528,45	4,25
Global Internet Leaders 30 Inhaber-Anteile I - II	DE000A2N8168	ANT	1.300	1.300	1.300	0	EUR 422,630000	549.419,00	5,13
TBF ATTILA GLOBAL OPPORTUNITY EUR I	DE000A0YJMM9	ANT	231	0	0	40	EUR 950,670000	219.604,77	2,05
TBF BALANCED Inhaber-Anteile EUR I	DE000A2PEIK7	ANT	3.625	2.500	2.500	1.950	EUR 93,810000	340.061,25	3,17
TBF GLOBAL INCOME I	DE0009781997	ANT	15.550	0	0	4.300	EUR 18,400000	286.120,00	2,67
TBF GLOBAL VALUE EUR R	DE0009781633	ANT	2.080	0	0	3.140	EUR 71,860000	149.468,80	1,40
4Q-GROWTH FONDS USD (R)	DE000A0D9PG7	ANT	1.060	0	0	1.220	USD 186,610000	167.632,71	1,56
Gruppenfremde Investmentanteile									
Atlantis Intl Umb.-Japan Opp. Registered Shares EUR o.N.	IE00B5TB9J06	ANT	6.060	1.750	1.750	1.985	EUR 65,756000	398.481,36	3,72
Bellevue Fds (L)-BB Ada.DI He. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1811047916	ANT	1.390	190	190	0	EUR 308,490000	428.801,10	4,00
Commod.Capit.-Global Mining Fd Inhaber-Anteile P o.N.	LU0459291166	ANT	3.520	0	0	0	EUR 134,400000	473.088,00	4,42
DC Value One AMI I	DE000A0YAX64	ANT	1.345	0	0	355	EUR 240,630000	323.647,35	3,02
DigiTrends Aktienfonds E	DE000A2PWS72	ANT	820	820	820	0	EUR 138,430000	113.512,60	1,06
DUI Wertefinder Inhaber-Anteile I	DE000A0NEBA1	ANT	3.200	0	0	0	EUR 83,890000	268.448,00	2,51
Earth Gold Fund UI Inhaber-Anteile EUR I	DE000A1CUGZ4	ANT	1.000	0	0	0	EUR 103,890000	103.890,00	0,97
Greiff P-22 Inhaber-Anteile I	DE000A2PMXX1	ANT	2.550	0	0	0	EUR 99,170000	252.883,50	2,35
H2O Allegro Act. au Port. I (4 Déc.) o.N.	FR0011006188	ANT	2	0	0	1	EUR 138.158,540000	276.317,08	2,58
H2O Allegro Act. au Port. IC (4 Déc.) o.N.	FR0013535762	ANT	3	3	3	0	EUR 48.968,760000	146.906,28	1,37
HSBC ETFS-H.Hang Seng Tech Reg. Shs HKD Acc. o.N.	IE00BMWXXN31	ANT	23.000	52.200	52.200	29.200	EUR 7,432000	170.936,00	1,60
HSBC GIF-India Fixed Income Namens-Anteile A Cap.EUR o.N.	LU0780248950	ANT	22.300	0	0	0	EUR 14,694000	327.676,20	3,06
Lloyd Fds-Europ.Hidden Champi. Inhaber-Anteils- klasse I	DE000A2PB6A0	ANT	250	120	120	85	EUR 2.120,770000	530.192,50	4,95
Lupus alpha Dividend Champions Inhaber-Anteile	DE000A1JDV61	ANT	700	700	700	0	EUR 321,460000	225.022,00	2,10
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	LU1535992389	ANT	1.780	0	0	1.780	EUR 130,690000	232.628,20	2,17
Luxembourg Sel.-Asi.Sol.Win.Fd Inhaber-Anteile A2 o.N.	LU0405860593	ANT	125	125	125	0	EUR 4.090,980000	511.372,50	4,77
MEDICAL - MEDICAL BioHealth	LU0294851513	ANT	588	65	65	0	EUR 808,720000	475.527,36	4,44
Palad.A.M.I.AG TGV-Paladin One Inhaber-Anlage- aktien	DE000A1W1PH8	ANT	2.470	0	0	250	EUR 225,920000	558.022,40	5,21
Paladin Quant Aktien Global Na Inhaber-Anteile S (a)	DE000A2N68Q2	ANT	250	0	0	140	EUR 1.199,620000	299.905,00	2,80
Squad Aguja Opportunities Inhaber-Anteile I	DE000A2AR9C9	ANT	1.875	0	0	1.325	EUR 178,340000	334.387,50	3,12
Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Act. Nom. II EUR Dis. o.N.	LU1858159350	ANT	2.250	0	0	2.590	EUR 224,140000	504.315,00	4,71

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. AUGUST 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
					im Berichtszeitraum					
TAMAC Qilin-China Champions. Actions Nom.D EUR (INE) o.N.	LU1242508387		ANT	1.785	0	0	EUR	204,530000	365.086,05	3,41
HSBC GIF - Brazil Bond Namens-Anteile A (Cap.) o.N.	LU0254978488		ANT	22.400	0	0	USD	16,778000	318.497,63	2,97
iShs DL Treas.Bd 1-3yr U.ETF Registered Shares USD (Acc)oN	IE00BYXPSP02		ANT	49.000	49.000	0	USD	5,417500	224.963,98	2,10
Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.USD o.N.	LU1378878604		ANT	7.910	2.830	0	USD	66,530000	445.976,53	4,16
Summe der Investmentanteile							EUR	10.478.319,10	97,80	
Summe Wertpapiervermögen							EUR	11.060.930,64	103,24	
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
DAX Future 17.09.2021		XEUR	EUR	Anzahl -1					-3.625,00	-0,04
DAX Future 17.09.2021		XEUR	EUR	Anzahl -1					-3.700,00	-0,04
DAX Future 17.09.2021		XEUR	EUR	Anzahl -1					-2.650,00	-0,03
DAX Future 17.09.2021		XEUR	EUR	Anzahl -1					-200,00	0,00
DAX Future 17.09.2021		XEUR	EUR	Anzahl -1					-2.450,00	-0,02
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-9.855,93	-0,09
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-8.411,02	-0,08
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-8.521,19	-0,08
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-9.601,69	-0,09
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-9.949,15	-0,09
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-11.949,15	-0,11
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-9.533,90	-0,09
E-Mini S&P 500 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-12.139,83	-0,11
E-Mini S&P 500 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-11.959,75	-0,11
E-Mini S&P 500 17.09.2021		XCME	USD	Anzahl -1					-2.637,71	-0,02
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-107.184,32	-1,00	
Zinsderivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte										
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures 21.09.2021		XCBT	USD	-300.000					-6.673,73	-0,06
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures 21.09.2021		XCBT	USD	-200.000					-5.164,19	-0,05
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures 21.09.2021		XCBT	USD	-100.000					503,18	0,00
Summe der Zinsterminkontrakte							EUR	-11.334,74	-0,11	
Sonstige Derivate										
Sonstige Terminkontrakte										
CBOE VIX Future 15.09.2021		XCBO	USD	Anzahl 5					-4.466,10	-0,04
Summe der sonstigen Terminkontrakte							EUR	-4.466,10	-0,04	

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. AUGUST 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2021	Käufe/ Zugänge Ver- käufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
Bankguthaben								
EUR - Guthaben bei:								
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	0,94			0,94	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:								
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			JPY	4,00			0,03	0,00
Summe der Bankguthaben						EUR	0,97	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								
EUR - Kredite			EUR	-48.401,46			-48.401,46	-0,45
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	-144.564,62			-122.512,39	-1,14
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR	-170.913,85	-1,59
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-53.473,96		EUR	-53.473,96	-0,50
Fondsvermögen						EUR	10.713.558,64	100 2)
3ik-Strategiefonds II Class I								
Anteilwert						EUR	132,99	
Umlaufende Anteile						STK	80.313	
3ik-Strategiefonds II Class R								
Anteilwert						EUR	112,18	
Umlaufende Anteile						STK	292	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Zinsen laufendes Konto, Performance Fee

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

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 99,90%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 188.624.749,70 EUR.

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 31.08.2021	
Schweizer Franken	CHF	1,080850	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	129,675000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,180000	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
b) Terminbörsen			
XCBT	CHICAGO BOARD OF TRADE		
XCME	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE		
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		
XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE		

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE,
SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:
KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN, INVESTMENTANTEILEN UND
SCHULDSCHEINDARLEHEN (MARKTZUORDNUNG ZUM BERICHTSSTICHTAG)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Zertifikate					
DB ETC PLC ETC Z 15.06.60 Silber	DE000A1EK0J7	STK	1.000	1.000	
Investmentanteile					
KVG-eigene Investmentanteile					
TBF SPECIAL INCOME EUR I	DE000A1JRQC3	ANT	-	2.020	
Gruppenfremde Investmentanteile					
AI Leaders	DE000A2PF0M4	ANT	-	3.200	
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile EUR o.N.	LI0181468138	ANT	-	100	
Vates - inprimo Parade Inhaber-Anteile A o.N.	LU1098509851	ANT	-	21.100	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Optionsscheine					
Wertpapier-Optionsscheine					
Optionsscheine auf Aktien					
Motif Bio PLC WTS 23.11.21	GB00BZ7Q1F72	STK	-	42.000	
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			12.042,43
Basiswerte: CBOE VOLATILITY IND., Nasdaq-100 Index		USD			1.853,77
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			57.428,77
Basiswerte: S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index		USD			15.649,22
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
JPY/EUR		EUR			248,11
Optionsrechte					
Wertpapier-Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktien					
Gekaufte Verkaufsoptionen(Put):					
Basiswert: Volkswagen Vorzugsaktien		EUR			21,22

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGS- UND AUFWANDSAUSGLEICH)

für den Zeitraum vom 01. September 2020 bis 31. August 2021		3ik-Strategiefonds II Class I	3ik-Strategiefonds II Class R
I. Erträge			
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-595,92	-1,77
davon negative Habenzinsen	EUR	-595,92	-1,77
2. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	22.385,37	68,62
3. Sonstige Erträge	EUR	5.921,45	18,16
Summe der Erträge	EUR	27.710,90	85,01
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	-2.266,57	-8,73
2. Verwaltungsvergütung			
a) fix	EUR	-117.227,76	-537,43
b) performanceabhängig	EUR	-30.228,04	-38,16
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-5.319,92	-19,99
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-8.200,83	-190,96
5. Sonstige Aufwendungen	EUR	-7.088,74	-28,80
6. Aufwandsausgleich	EUR	4.652,84	130,33
Summe der Aufwendungen	EUR	-165.679,02	-693,74
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	-137.968,12	-608,73
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	EUR	1.453.546,91	4.511,67
2. Realisierte Verluste	EUR	-838.503,89	-2.615,57
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	615.043,02	1.896,10
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	477.074,90	1.287,37
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	895.743,77	2.686,68
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-68.577,16	-182,17
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	827.166,61	2.504,51
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.304.241,51	3.791,88

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

2021		3ik-Strategiefonds II Class I	3ik-Strategiefonds II Class R
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres			
	EUR	9.611.568,34	EUR 31.289,42
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-65.826,40	EUR -256,80
2. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	-173.933,16	EUR -2.429,76
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	656.611,64	EUR 9.147,69
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	-830.544,80	EUR -11.577,45
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	4.752,88	EUR 360,73
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.304.241,51	EUR 3.791,88
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR	895.743,77	EUR 2.686,68
davon nicht realisierte Verluste:	EUR	-68.577,16	EUR -182,17
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	10.680.803,17	EUR 32.755,47

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS

Berechnung der Ausschüttung		insgesamt	je Anteil
3ik-Strategiefonds II Class I			
I. Für die Ausschüttung verfügbar			
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR	1.392.406,90	17,34
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	477.074,90	5,94
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR	838.503,89	10,44
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet			
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	-889.020,12	-11,07
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	-1.602.120,47	-19,95
III. Gesamtausschüttung	EUR	216.845,10	2,70
1. Endausschüttung			
a) Barausschüttung	EUR	216.845,10	2,70
3ik-Strategiefonds II Class R			
I. Für die Ausschüttung verfügbar			
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR	1.449,55	4,96
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	1.287,37	4,41
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR	2.615,57	8,96
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet			
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	-4.680,89	-16,03
III. Gesamtausschüttung	EUR	671,60	2,30
1. Endausschüttung			
a) Barausschüttung	EUR	671,60	2,30

3) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung i.H.v. EUR 0,00)

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE

Geschäftsjahr		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert
3ik-Strategiefonds II Class I				
2018	EUR	17.689.975,44	EUR	125,71
2019	EUR	14.804.252,41	EUR	118,77
2020	EUR	9.611.568,34	EUR	117,98
2021	EUR	10.680.803,17	EUR	132,99
3ik-Strategiefonds II Class R				
2018	EUR	157.582,73	EUR	107,64
2019	EUR	126.472,16	EUR	101,26
2020	EUR	31.289,42	EUR	99,97
2021	EUR	32.755,47	EUR	112,18

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure

EUR 5.172.968,22

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG
NIBC Bank N.V.

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 103,24
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -1,11

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.

Angaben nach dem qualifizierten Ansatz

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potentieller Risikobetrag 0,98 %
größter potentieller Risikobetrag 2,47 %
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag 1,54 %

Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde

Full-Monte-Carlo

Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden

99% Konfidenzintervall, 1 Tag Haltedauer bei einem effektiven historischen Beobachtungszeitraum von einem Jahr

Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte

Mittelwert 1,20

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

iBoxx EUR Corporates Total Return Index in EUR 30,00 %
MSCI - World Index 50,00 %
REX Performance Index 20,00 %

Sonstige Angaben

3ik-Strategiefonds II Class I

Anteilwert EUR 132,99
Umlaufende Anteile STK 80.313

3ik-Strategiefonds II Class R

Anteilwert EUR 112,18
Umlaufende Anteile STK 292

	3ik-Strategiefonds II Class I	3ik-Strategiefonds II Class R
Währung	EUR	EUR
Verwaltungsvergütung	1,10% p.a.	1,35% p.a.
Ausgabeaufschlag	5%	5%
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Mindestanlagevolumen	EUR 100	EUR 100

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

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

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

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

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

3ik-Strategiefonds II Class I 2,69 %
3ik-Strategiefonds II Class R 3,35 %

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.

Transaktionskosten EUR 35.660,32
Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.
Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes

3ik-Strategiefonds II Class I 0,28 %
3ik-Strategiefonds II Class R 0,10 %

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte

Pauschalvergütungen

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurden keine Pauschalvergütungen gezahlt.

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandserstattungen.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse 3ik-Strategiefonds II Class I keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung. Die KVG gewährt für die Anteilklasse 3ik-Strategiefonds II Class R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

Die Verwaltungsvergütung für KVG- und Gruppeneigene Investmentanteile beträgt:

Alpora Innovation Select Inhaber-Anteilsklasse I 1,1000 %
Global Internet Leaders 30 Inhaber-Anteile I - II 0,6950 %
TBF ATTILA GLOBAL OPPORTUNITY EUR I 0,9000 %
TBF BALANCED Inhaber-Anteile EUR I 0,7500 %

TBF GLOBAL INCOME I	1,1000 %
TBF GLOBAL VALUE EUR R	0,6000 %
4Q-GROWTH FONDS USD (R)	0,6000 %
TBF SPECIAL INCOME EUR I	0,5600 %
Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:	
Atlantis Intl Umb.-Japan Opp. Registered Shares EUR o.N.	1,5000 %
Bellevue Fds (L)-BB Ada.Di He. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000 %
Commod.Capit.-Global Mining Fd Inhaber-Anteile P o.N.	0,1500 %
DC Value One AMI I	1,0000 %
DigiTrends Aktienfonds E	1,7800 %
DUI Wertefinder Inhaber-Anteile I	1,0000 %
Earth Gold Fund UI Inhaber-Anteile EUR I	0,4500 %
Greiff P-22 Inhaber-Anteile I	1,5000 %
H2O Allegro Act. au Port. I (4 Déc.) o.N.	0,7000 %
H2O Allegro Act. au Port. IC (4 Déc.) o.N.	1,6000 %
HSBC ETFS-H.Hang Seng Tech Reg. Shs HKD Acc. oN	0,5000 %
HSBC GIF-India Fixed Income Namens-Anteile A Cap.EUR o.N.	1,1000 %
Lloyd Fds-Europ.Hidden Champi. Inhaber-Anteilsklasse I	1,4000 %
Lupus alpha Dividend Champions Inhaber-Anteile	1,0000 %
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	1,0000 %
Luxembourg Sel.-Asi.Sol.Win.Fd Inhaber-Anteile A2 o.N.	0,6000 %
MEDICAL - MEDICAL BioHealth	0,1000 %
Palad.A.M.I.AG TGV-Paladin One Inhaber-Anlageaktien	1,5000 %
Paladin Quant Aktien Global Na Inhaber-Anteile S (a)	0,5600 %
Squad Aguja Opportunities Inhaber-Anteile I	1,2300 %
Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Act. Nom. I1 EUR Dis. oN	0,1500 %
TAMAC Qilin-China Champions. Actions Nom.D EUR (INE) o.N.	2,0000 %
HSBC GIF - Brazil Bond Namens-Anteile A (Cap.) o.N.	1,0000 %
iShs DL Treas.Bd 1-3yr U.ETF Registered Shares USD (Acc)oN	0,2000 %
Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.USD o.N.	0,7500 %
AI Leaders	1,1000 %
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile EUR o.N.	1,5000 %
Vates - inprimo Parade Inhaber-Anteile A o.N.	2,1700 %
Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.	

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge

3ik-Strategiefonds II Class I: EUR 5.582,22 Kick-Back Zahlungen

3ik-Strategiefonds II Class R: EUR 17,34 Kick Back Zahlungen

Wesentliche sonstige Aufwendungen

3ik-Strategiefonds II Class I: EUR 6.212,33 Researchkosten

3ik-Strategiefonds II Class R: EUR 25,29 Researchkosten

Sonstige Informationen

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

Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2020

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inklusive Geschäftsführer)	EUR 16.990.377,86
davon feste Vergütung	EUR 13.478.569,31
davon variable Vergütung	EUR 3.511.808,55
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR 0,00
Zahl der Mitarbeiter der KVG (inkl. Geschäftsführung)	225
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR 0,00
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2020 der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risikoträger)	EUR 1.231.250,20
Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum	

vom 1. Januar bis 31. Dezember 2020 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

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

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

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

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

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

Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik

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

Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik

Keine Änderung im Berichtszeitraum

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall für das Geschäftsjahr 2019/2020

(Portfoliomanagement Gies & Heimbürger GmbH)

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens.

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

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung:	EUR 472.700
davon feste Vergütung:	EUR 0
davon variable Vergütung:	EUR 0
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	EUR 0
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens:	12

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:

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.

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

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

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

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.

Hamburg, 03. Dezember 2021

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 3ik-Strategiefonds II – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. September 2020 bis zum 31. August 2021, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. August 2021, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. September 2020 bis zum 31. August 2021, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

GRUNDLAGE FÜR DAS PRÜFUNGSURTEIL

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

von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

VERANTWORTUNG DER GESETZLICHEN VERTRETER FÜR DEN JAHRESBERICHT

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

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

VERANTWORTUNG DES ABSCHLUSSPRÜFERS FÜR DIE PRÜFUNG DES JAHRESBERICHTS

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

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

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

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

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH nicht fortgeführt wird.

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

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

Hamburg, den 6. Dezember 2021

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner	Lüning
Wirtschaftsprüfer	Wirtschaftsprüfer

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT, VERWAHRSTELLE UND GREMIEN

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:

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

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

Gezeichnetes Kapital: € 10.500.000,00
Eigenmittel: € 15.743.950,10
(Stand: 31.12.2020)

GESELLSCHAFTER:

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

VERWAHRSTELLE:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: € 20.500.000,00
Eigenmittel gem. Kapitaladäquanzverordnung (CRR):
€ 277.285.859,14
(Stand: 31.12.2020)

EINZAHLUNGEN:

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

AUFSICHTSRAT:

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

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

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

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

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

Prof. Dr. Stephan Schüller, Kaufmann

WIRTSCHAFTSPRÜFER:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

GESCHÄFTSFÜHRUNG:

Dr. Jörg W. Stotz (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsit-
zender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Ge-
schäftsführung der SIGNAL IDUNA Asset Management
GmbH und der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie
Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Manage-
ment AG)

Nicholas Brinckmann (zugleich Sprecher der Geschäfts-
führung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

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

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon (040) 3 00 57-62 96
Fax (040) 3 00 57-60 70

service@hansainvest.de
www.hansainvest.com

HANSAINVEST