



BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Halbjahresbericht 28.02.2022

Hanseatische Investment-GmbH in Kooperation mit der Sparkasse Bremen

Stark. Fair. Hanseatisch.

HANSAINVEST



Die Sparkasse Bremen
Finanzdienstleistung

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Inhaltsverzeichnis

- 4** Vermögensübersicht per 28. Februar 2022
- 5** Vermögensaufstellung per 28. Februar 2022
- 18** Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV
- 20** Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien



BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Sehr geehrte Anlegerin,
sehr geehrter Anleger,

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

BremenKapital Zertifikate

in der Zeit vom 01. September 2021 bis 28. Februar 2022.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 2,58 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Februar darstellte. Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

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

Hamburg, im April 2022

.....



BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensübersicht zum 28.02.2022

Fondsvermögen:	EUR	136.947.520,16	(134.143.730,12)
Umlaufende Anteile:		3.205.317	(3.110.138)

Vermögen aufteilung in TEUR / %	Kurswert in Fondswährung	% des Fondsvermögens	% des Fondsvermögens per 31.08.2021
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	134.538	98,20	(89,66)
2. Zertifikate	5.531	4,09	(6,96)
3. Derivate	-8.351	-6,11	(-6,00)
4. Bankguthaben	5.014	3,66	(9,30)
5. Sonstige Vermögensgegenstände	386	0,28	(0,21)
II. Verbindlichkeiten			
	-170	-0,12	(-0,13)
<hr/>			
III. Fondsvermögen	136.948	100,00	

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
1,000000000% Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2017(27)	XS1520344745		EUR	2.500	0	0 %	102,001500	2.550.037,50	1,86
0,010000000% Brandenburg, Land Schatz-anw. v.2020(2028)	DE000A289NL9		EUR	995	0	0 %	96,487000	960.045,65	0,70
0,010000000% Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.250 v.20(28)	DE000A289K30		EUR	2.000	2.000	0 %	96,228000	1.924.560,00	1,41
0,500000000% Finnland, Republik EO-Bonds 17/27	FI4000278551		EUR	3.000	0	0 %	101,764625	3.052.938,75	2,23
0,250000000% Frankreich EO-OAT 2016(26)	FR0013200813		EUR	3.000	0	0 %	100,476500	3.014.295,00	2,20
0,200000000% Irland EO-Treasury Bonds 20/27	IE00BKFVC568		EUR	4.000	1.000	0 %	99,826000	3.993.040,00	2,92
0,375000000% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1501554874		EUR	3.000	0	0 %	98,832500	2.964.975,00	2,17
0,950000000% Litauen, Republik EO-MTN 17/27	XS1619567677		EUR	5.000	0	0 %	100,297500	5.014.875,00	3,66
0,950000000% Nordrhein-Westfalen, Land MTN LSA v.18(28) Reihe 1456	DE000NRW0K03		EUR	3.500	1.000	0 %	102,295176	3.580.331,16	2,61
1,000000000% OMV AG EO-Medium-Term Notes 2017(26)	XS1734689620		EUR	3.000	1.000	0 %	100,931500	3.027.945,00	2,21
2,625000000% PepsiCo Inc. EO-Med.-Term Notes 2014(14/26)	XS1061714165		EUR	4.000	2.000	0 %	108,185000	4.327.400,00	3,16
0,875000000% Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2018(28)	XS1851229218		EUR	2.200	0	0 %	100,529500	2.211.649,00	1,61
0,000000000% Republic of Iceland EUR Long 7-year	XS2293755125		EUR	4.000	1.000	0 %	94,830000	3.793.200,00	2,77

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
2,000000000% Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2015(26/26)	XS1301052202		EUR	3.000	1.000	0	%	104,743500	3.142.305,00	2,29
1,250000000% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27)	SI0002103685		EUR	3.000	0	0	%	105,019080	3.150.572,40	2,30
0,250000000% Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2019(26)	BE6313645127		EUR	1.900	0	0	%	99,560000	1.891.640,00	1,38
0,500000000% Österreich, Republik EO-Bundesanl. 17/27	AT0000A1VGK0		EUR	3.000	0	0	%	101,839000	3.055.170,00	2,23
Summe der börsengehandelten Wertpapiere								EUR	51.654.979,46	37,71

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,375000000% Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2018(18/28)	FR0013346137		EUR	2.000	0	0	%	102,229000	2.044.580,00	1,49
0,800000000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81	BE0000341504		EUR	3.000	0	0	%	103,283579	3.098.507,37	2,26
1,200000000% Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2018(18/28)	XS1900752814		EUR	2.500	500	0	%	102,038500	2.550.962,50	1,86
0,250000000% BNP CRLNFI 21/26 National Grid	XS2237713271		EUR	2.500	0	0	%	94,106229	2.352.655,73	1,72
0,400000000% BNP PAR. ISS. 21/28	XS2337873702		EUR	3.000	3.000	0	%	93,354989	2.800.649,67	2,05
0,500000000% BNP PAR. ISS. 21/28	XS2337874262		EUR	3.000	3.000	0	%	93,233742	2.797.012,26	2,04
5,000000000% BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH Nachkaufanleihe 21(26)	DE000PF99F55		STK	535	535	0	%	904,170000	483.730,95	0,35
0,250000000% BNP Paribas Issuance B.V. EO-Cred.Lkd M.-T. Cts 21/26	XS2237713198		EUR	2.500	0	0	%	92,528106	2.313.202,65	1,69
1,000000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Credit Linked MTN 2021(27)	XS2387491827		EUR	1.500	1.500	0	%	95,212116	1.428.181,74	1,04

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
0,650000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Credit Linked MTN 2021(27)	XS2387492551		EUR	1.500	1.500	0	%	95,041520	1.425.622,80	1,04
1,270000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Credit Linked MTN 21/27	XS2387492122		EUR	1.500	1.500	0	%	95,246822	1.428.702,33	1,04
0,300000000% Deka-Bank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(27)EON	DE000DK0Y8Q8		EUR	3.400	1.700	0	%	94,440000	3.210.960,00	2,34
0,220000000% DekaBank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(27)Heineken	DE000DK0Y8R6		EUR	3.000	1.500	0	%	94,940000	2.848.200,00	2,08
0,260000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 AVIVA	DE000DD5AVX8		EUR	2.000	0	0	%	96,050000	1.921.000,00	1,40
0,180000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 IBM	DE000DD5AV19		EUR	2.000	0	0	%	96,480000	1.929.600,00	1,41
0,190000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 Volvo	DE000DD5AVW0		EUR	2.000	0	0	%	95,960000	1.919.200,00	1,40
0,640000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 21/26	XS2061859703		EUR	2.400	0	0	%	93,289034	2.238.936,82	1,63
0,470000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 21/26	XS2061862756		EUR	2.000	0	0	%	95,169012	1.903.380,24	1,39
0,500000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 21/26	XS2061862244		EUR	2.000	0	0	%	94,695242	1.893.904,84	1,38
0,070000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25)	XS2305763869		EUR	2.100	0	0	%	94,138154	1.976.901,23	1,44
0,020000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25)	XS2305760923		EUR	2.100	0	0	%	94,191351	1.978.018,37	1,44
1,500000000% Leonteq Fix Kupon Exp. 22/23 auf NASDAQ 100	CH1150260748		EUR	500	500	0	%	98,430000	492.150,00	0,36
0,230000000% Nordea Bank Abp EO-FLR Cred. Lkd MTN 2022(27)	XS2430062104		EUR	2.500	2.500	0	%	94,558456	2.363.961,40	1,73
0,375000000% Ontario, Provinz EO-Medium-Term Notes 2020(27)	XS2153608141		EUR	2.500	0	0	%	98,476460	2.461.911,50	1,80

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
0,350000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26)	XS2277941519		EUR	2.000	0	0	%	95,701797	1.914.035,94	1,40
0,460000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26)	XS2277944455		EUR	2.000	0	0	%	95,760456	1.915.209,12	1,40
0,280000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26)	XS2277942087		EUR	2.000	0	0	%	95,459813	1.909.196,26	1,39
0,220000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 21/26	XS2277779588		EUR	2.000	0	0	%	94,042830	1.880.856,60	1,37
1,050000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Lkd Notes 2022(27)	XS2436216159		EUR	1.500	1.500	0	%	95,286859	1.429.302,89	1,04
0,320000000% UniCredit Bank AG HVB Bonitaet 21(26) SQU	DE000HVB56F5		EUR	3.000	0	0	%	94,220000	2.826.600,00	2,06
0,500000000% UNICRE- DIT CLN 21/27 Orange	DE000HVB5AR6		EUR	2.500	0	0	%	94,190000	2.354.750,00	1,72
0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26)	CH0593023788		EUR	2.700	0	0	%	96,974223	2.618.304,02	1,91
0,150000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26)	CH0593023770		EUR	2.700	0	0	%	95,351119	2.574.480,21	1,88
0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26)	CH0593023754		EUR	2.700	0	0	%	96,163723	2.596.420,52	1,90
2,000000000% Vontobel Financial Products Fix Kupon Exp. v.21(23)DAX	DE000VQ9LMD1		STK	500	500	0	%	960,410000	480.205,00	0,35
Zertifikate										
BNP Paribas Em.-u. Handelsg.mbH FAKTOR EXPR.Z28.10.26 SX5E	DE000PF99B80		STK	127	0	0	EUR	907,640000	115.270,28	0,08
BNP Paribas Em.-u.Han- delsg.mbH MEM.EXPRESS Z22.08.25 SX5E	DE000PF99CG7		STK	266	0	0	EUR	922,000000	245.252,00	0,18
Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.Z.11.06.25 1COV	DE000CS8C717		STK	817	0	0	EUR	809,160000	661.083,72	0,48

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
LEON.SEC(GG) EXPZ S&P 500	CH1134492656		STK	1.000	1.000	0	EUR 973,880000	973.880,00	0,72
Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.09.07.25 SX5E	CH1111679150		STK	731	500	0	EUR 935,110000	683.565,41	0,51
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	75.040.344,37	54,77

Nicht notierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,900000000% BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH Fix Kupon Express v.21(25)ADS	DE000PF99DT8		STK	393	393	0	% 823,250000	323.537,25	0,24
4,000000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) Siemens Exp.-Zert. 21/7.5.25	DE000CS8DDP4		STK	179	179	0	% 902,550000	161.556,45	0,12
0,710000000% Goldman Sachs CLN 21/26 SEMPRA ENERGY	XS2080946028		EUR	1.500	1.500	0	% 94,243155	1.413.647,33	1,03
0,900000000% Goldman Sachs CLN 21/26 SWIRE PACIFIC Ltd.	XS2080980472		EUR	1.500	1.500	0	% 94,248195	1.413.722,93	1,03
1,050000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 2022(26)	XS1971487134		EUR	2.500	2.500	0	% 94,313782	2.357.844,55	1,72
0,520000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Linked MTN 2022(26)	XS2432159270		EUR	2.500	2.500	0	% 94,554764	2.363.869,10	1,73
0,550000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO-Credit Lkd Notes 2022(28)	CH1145176264		EUR	2.700	2.700	0	% 92,119326	2.487.221,80	1,82

Zertifikate

BNP Paribas Em.-u. Handelsg.mbH MEM. EXPRESS Z16.12.25 DPW	DE000PF99F37		STK	599	599	0	EUR 865,100000	518.194,90	0,38
Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.Z.05.11.25 Covestro	DE000CS8DDQ2		STK	207	207	0	EUR 854,480000	176.877,36	0,13
Goldman Sachs Fin. Corp. Intl Mem.Ph.Autoc. Z17.12.25 ALV	JE00BLS38476		STK	477	477	0	EUR 946,150000	451.313,55	0,33

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.01.06.23 N100	CH1158654785	STK		487	487	0	EUR	987,500000	480.912,50	0,35
Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.02.06.23 DAX	CH1139074475	STK		650	650	0	EUR	961,740000	625.131,00	0,47
Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.11.02.2027 MUV2	CH1150252257	STK		248	248	0	EUR	950,000000	235.600,00	0,18
Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.13.06.23 DAX	CH1139076439	STK		377	377	0	EUR	964,140000	363.480,78	0,28
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR		13.372.909,50	9,81
Summe Wertpapiervermögen							EUR		140.068.233,33	102,29

Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)

Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten

Optionsrechte auf Aktienindices

Put DAX 14800,000000000 18.03.2022	XEUR	Anzahl -25		EUR	519,800000	-64.975,00	-0,05
Put DAX 14800,000000000 18.03.2022	XEUR	Anzahl -100		EUR	519,800000	-259.900,00	-0,19
Put DAX 14800,000000000 18.03.2022	XEUR	Anzahl -200		EUR	519,800000	-519.800,00	-0,38
Call DAX 16300,000000000 17.06.2022	XEUR	Anzahl -350		EUR	93,300000	-163.275,00	-0,12
Call DAX 16300,000000000 17.06.2022	XEUR	Anzahl -50		EUR	93,300000	-23.325,00	-0,02
Put DAX 13650,000000000 17.06.2022	XEUR	Anzahl -125		EUR	490,300000	-306.437,50	-0,22
Put DAX 13650,000000000 17.06.2022	XEUR	Anzahl -50		EUR	490,300000	-122.575,00	-0,09
Put DAX 13650,000000000 17.06.2022	XEUR	Anzahl -125		EUR	490,300000	-306.437,50	-0,22

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Call DAX 16200,000000000 17.06.2022		XEUR		Anzahl -100			EUR 110,000000	-55.000,00	-0,04
Put DAX 14600,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -200			EUR 427,500000	-427.500,00	-0,31
Call DAX 16000,000000000 17.06.2022		XEUR		Anzahl -125			EUR 151,500000	-94.687,50	-0,07
Call DAX 15400,000000000 17.06.2022		XEUR		Anzahl -135			EUR 342,000000	-230.850,00	-0,17
Put ESTX 50 4000,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -250			EUR 124,300000	-310.750,00	-0,23
Put ESTX 50 4050,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -250			EUR 149,200000	-373.000,00	-0,27
Call ESTX 50 4100,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -250			EUR 40,300000	-100.750,00	-0,07
Put ESTX 50 3900,000000000 17.06.2022		XEUR		Anzahl -375			EUR 218,800000	-820.500,00	-0,60
Put ESTX 50 3950,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -100			EUR 103,700000	-103.700,00	-0,08
Put ESTX 50 3950,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -25			EUR 103,700000	-25.925,00	-0,02
Put ESTX 50 3950,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -100			EUR 103,700000	-103.700,00	-0,08
Call ESTX 50 4200,000000000 17.06.2022		XEUR		Anzahl -300			EUR 60,900000	-182.700,00	-0,13
Put ESTX 50 3800,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -150			EUR 60,700000	-91.050,00	-0,07
Call ESTX 50 4100,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -150			EUR 40,300000	-60.450,00	-0,04
Call ESTX 50 4150,000000000 18.03.2022		XEUR		Anzahl -250			EUR 24,900000	-62.250,00	-0,05

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Call ESTX 50 4100,000000000 17.06.2022		XEUR		Anzahl -250			EUR 96,500000	-241.250,00	-0,18
Put Nasdaq-100 14650,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -8			USD 623,250000	-443.436,50	-0,32
Call Nasdaq-100 15800,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -3			USD 174,800000	-46.638,21	-0,03
Call Nasdaq-100 16600,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -3			USD 65,150000	-17.382,60	-0,01
Put Nasdaq-100 13700,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -2			USD 657,550000	-116.960,16	-0,09
Put Nasdaq-100 13700,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -2			USD 657,550000	-116.960,16	-0,09
Put Nasdaq-100 13700,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -2			USD 657,550000	-116.960,16	-0,09
Put Nasdaq-100 15000,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -8			USD 877,950000	-624.653,15	-0,46
Call Nasdaq-100 15500,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -4			USD 249,400000	-88.722,87	-0,06
Call Nasdaq-100 15200,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -4			USD 347,050000	-123.461,40	-0,09
Call Nasdaq-100 15100,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -5			USD 384,850000	-171.135,72	-0,12
Call S&P 500 4350,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -20			USD 117,000000	-208.110,99	-0,15
Call S&P 500 4350,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -10			USD 117,000000	-104.055,50	-0,08
Put S&P 500 4500,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -10			USD 159,350000	-141.720,03	-0,10
Put S&P 500 4600,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -20			USD 232,600000	-413.731,77	-0,30

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Put S&P 500 4275,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -10			USD 64,950000	-57.764,14	-0,04
Put S&P 500 4050,000000000 18.03.2022		XCBO		Anzahl -15			USD 26,150000	-34.885,27	-0,03
Call S&P 500 4400,000000000 17.06.2022		XCBO		Anzahl -25			USD 195,700000	-435.120,95	-0,32
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte									
Call Euro Bund Future 163,500000000 25.03.2022		XEUR	EUR	Anzahl -150				-37.500,00	-0,03
Call Euro Bund Future 163,500000000 25.03.2022		XEUR	EUR	Anzahl -75				-1.140,00	0,00
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-8.351.127,08	-6,11

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 28.02.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: UBS Europe SE			EUR	4.260.046,03				4.260.046,03	3,11
Bank: National-Bank AG			EUR	3.138,96				3.138,96	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: UBS Europe SE			USD	844.437,77				751.011,89	0,55
Summe der Bankguthaben							EUR	5.014.196,88	3,66
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	373.340,12				370.602,62	0,27
Sonstige Ansprüche			EUR	12.792,50				12.792,50	0,01
Kuponforderung			EUR	2.737,50				2.737,50	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	386.132,62	0,28
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-169.915,59			EUR	-169.915,59	-0,12
Fondsvermögen							EUR	136.947.520,16	100 2)
Anteilwert							EUR	42,73	
Umlaufende Anteile							STK	3.205.317	

Fußnoten

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung
 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 1,17 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 1.532.053,03 EUR.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.02.2022

US-Dollar	USD	1,124400 = 1 Euro (EUR)
-----------	-----	-------------------------

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,750000000% SAP Med.Term Nts. 14/27	DE000A13SL34	EUR	-	4.000	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,400000000% BNP CLN DAIMLER 21/26	XS2248111366	EUR	-	3.000	
0,750000000% BNP Paribas CLN 21/27 VW AG	XS2266393656	EUR	-	2.000	
0,310000000% DekaBank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(26)ENL	DE000DK0Y756	EUR	-	3.000	
0,150000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25)	XS2305764164	EUR	-	2.100	
0,140000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25)	XS2305763273	EUR	-	2.100	
0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO-Credit Lkd Notes 2021(26)	CH0593023762	EUR	-	2.700	
6,691702000% Vontobel Financial Products Fix Kupon Exp. v.21(22) DAX	DE000VQ9RDH8	STK	175	175	
2,000000000% Vontobel Financial Products Fix Kupon Exp. v.21(22)DAX	DE000VQ648R6	STK	-	250	
Zertifikate					
BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 23.12.21 Nasd100	DE000PF1JFH8	STK	-	20.000	
Citigroup Global Mkts Europe CA.BO.Z 22.12.21 DJIA	DE000KE2LFG9	STK	-	7.500	
Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.A. Z.02.07.26 DAI	DE000CS8C766	STK	-	262	
DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 24.12.21 ESTX50	DE000DV19UU1	STK	12.500	12.500	

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG CAP.BO.Z 24.09.21 ESTX50	DE000TT259P7	STK	-	15.000	
Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 24.12.21 DAX	DE000SD2HKD8	STK	7.000	7.000	
Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 24.12.21 ESTX50	DE000SD15WH8	STK	25.000	25.000	
UBS AG (London Branch) BO.C.Z 24.12.21 ESTX50	DE000UE56KM1	STK	-	25.000	
UniCredit Bank AG HVB CA.BO.Z 24.12.21 DAX	DE000HR4FQH3	STK	7.000	7.000	
Vontobel Financial Products BOC.Z 24.12.21 Nasd100	DE000VP9DY72	STK	-	15.000	

Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices:

Gekaufte Kaufoptionen (Call):

Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR)	EUR	7.085,37
Basiswerte: S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index	USD	6.004,79

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR)	EUR	7.433,16
Basiswerte: S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index	USD	2.423,47

Optionsrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte:

Gekaufte Kaufoptionen (Call):

Basiswert: Euro Bund Futures	EUR	893,03
------------------------------	-----	--------

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 59.764.254,78

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG
UBS Europe SE

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	102,29
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-6,11

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	42,73
Umlaufende Anteile	STK	3.205.317

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.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

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.

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.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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.de
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:

UBS Europe SE
Gezeichnetes Kapital:
€ 446.001.000,00
Eigenmittel (Art. 72 CRR):
€ 3.982.000.000,00
(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 IDUNA Asset Management GmbH)

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

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

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

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

Prof. Dr. Stephan Schüller,
Kaufmann

Wirtschaftsprüfer:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

Geschäftsführung:

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

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

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

