



BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Jahresbericht 31.08.2021

Hanseatische Investment-GmbH in Kooperation mit der Sparkasse Bremen

Stark. Fair. Hanseatisch.

HANSAINVEST



Die Sparkasse Bremen
Finanzdienstleistung

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Inhaltsverzeichnis

- 4** Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2020/2021
- 7** Vermögensübersicht zum 31. August 2021
- 8** Vermögensaufstellung zum 31. August 2021
- 31** Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV
- 34** Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers
- 36** Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien



BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Sehr geehrte Anlegerin,
sehr geehrter Anleger,

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

BremenKapital Zertifikate

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

Hamburg, im Dezember 2021

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Tätigkeitsbericht

Anlageziel und Anlagepolitik

Das Anlageziel des Investmentfonds ist es, auch in Seitwärtsmärkten eine Überrendite durch z.B. Discount-, Bonus- und Reversestrukturen zu generieren.

Um dies zu erreichen, beabsichtigt das Fondsmanagement auf Grundlage eines intern festgelegten Investmentprozesses der Sparkasse Bremen Zertifikate mit attraktiven Chancen-Risiko-Profilen zu identifizieren. Diese Marktmeinung bildet in Verbindung mit externem Research sowie unterstützenden Portfoliomodellen die Grundlage für die Einzeltitelauswahl. Der Fonds darf in Aktien, verzinsliche Wertpapiere, Bankguthaben, Geldmarktinstrumente und (in begrenztem Umfang) in andere Investmentfonds investieren.

Das Fondsmanagement darf für den Fonds Derivatgeschäfte zum Zwecke der Absicherung, der effizienten Portfoliosteuerung und der Erzielung von Zusatzerträgen, d.h. auch zu spekulativen Zwecken, einsetzen.

Portfoliostruktur

Zusätzlich zum Kauf von Zertifikaten hat das Fondsmanagement im Laufe des Geschäftsjahres mehrfach davon Gebrauch gemacht, die Derivatestrukturen von Aktienzertifikaten selbst zusammenzustellen. Hierzu wurden die entsprechenden Derivate – in der Regel Optionen – direkt an Terminbörsen erworben. Als Basiswerte wurden Optionen auf Aktienindices gewählt (DAX, EuroStoxx50, S&P500, Nasdaq 100). Es wurden sowohl Kauf- als auch Verkaufsoptionen mit verschiedenen Fälligkeitsterminen und Basispreisen abgeschlossen.

Da beim Abschluss von Derivaten nur Sicherheitsleistungen hinterlegt werden, stand ein Teil des Fondsvermögens für andere Anlagen zur Verfügung. Während ein Teil dieser Gelder in Staats- und Unternehmensanleihen angelegt wurde, investierte das Fondsmanagement weitere Beträge in Rentenzertifikate (Credit Linked Notes/CLN). CLN werden als fest- oder variabel verzinsliche Wertpapiere von Banken emittiert, um das Ausfallrisiko von Unternehmen oder Staaten abzubilden.

Auf Anlagen in anderen Investmentfonds wurde während des Berichtszeitraums verzichtet.

Risikoanalyse

Adressenausfallrisiken:

Adressenausfallrisiken bestanden hinsichtlich der Emittenten der gewählten Zertifikate und Anleihen, wobei das Fondsmanagement auf eine breite Streuung und eine gute Bonität der Emittenten achtete.

Marktpreisrisiken:

Marktpreisrisiken des Investmentvermögens resultierten aus Kursbewegungen der den Zertifikaten zugrundeliegenden Basiswerten, sowie aus der Veränderung der Einflussfaktoren für die Preisbildung der in den Zertifikaten enthaltenen Optionskomponenten (z.B. Volatilität).

Währungsrisiken:

Fremdwährungsrisiken wurden im Fonds nur vereinzelt eingegangen. Diese ergaben sich aus den Optionen auf US-Aktienindices. Alle Zertifikate und Anleihen lauteten hingegen auf Euro.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Operationelle Risiken:

Unter operationellen Risiken wird die Gefahr von Verlusten verstanden, die durch die Unangemessenheit oder das Versagen von internen Verfahren, Menschen und Systemen oder durch externe Ereignisse verursacht werden. Beim operationellen Risiko differenziert die Gesellschaft zwischen technischen Risiken, Personalrisiken, Produktrisiken und Rechtsrisiken sowie Risiken aus Kunden- und Geschäftsbeziehungen und hat hierzu u.a. die folgenden Vorkehrungen getroffen:

- Ex ante und ex post Kontrollen sind Bestandteil des Orderprozesses
- Rechts- und Personalrisiken werden durch Rechtsberatung und Schulungen der Mitarbeiter minimiert
- Darüber hinaus werden Geschäfte in Finanzinstrumenten ausschließlich über kompetente und erfahrene Kontrahenten abgeschlossen
- Die Verwahrung der Finanzinstrumente erfolgt durch eine etablierte Verwahrstelle mit guter Bonität
- Die Ordnungsmäßigkeit der für das Sondervermögen relevanten Aktivitäten und Prozesse wird regelmäßig durch die Interne Revision überwacht

Liquiditätsrisiken:

Aufgrund der Anlagepolitik ist das Sondervermögen den Rentenmärkten inhärenten Liquiditätsrisiken ausgesetzt. Um diese Liquiditätsrisiken zu begrenzen, achtet das Fondsmanagement auf ein ausreichendes Emissionsvolumen der einzelnen Anleihen sowie einen hohen Diversifikationsgrad im Sondervermögen. Des Weiteren befinden sich im Bestand Credit Linked Notes, diese stellen jedoch kein weiteres Liquiditätsrisiko dar.

Zinsänderungsrisiko:

Zinsänderungsrisiken ergeben sich aufgrund der Investitionen des Fonds in festverzinsliche Wertpapiere. Das Portfoliomanagement überwacht und steuert dieses Risiko durch die Auswahl der Anleihen und setzt zusätzlich derivative Instrumente ein (z.B. Optionen auf den Bund-Future).

Sonstige Risiken:

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.

Veräußerungsergebnis

Das Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften für den Berichtszeitraum betrug:
EUR + 14.456.433,38

Die realisierten Gewinne resultierten im Wesentlichen aus Gewinnen aus Zertifikaten. Die realisierten Verluste resultierten im Wesentlichen aus Verlusten aus Optionen.

Sonstige Hinweise

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

Das Portfoliomanagement für den Fonds BremenKapital Zertifikate ist ausgelagert an Die Sparkasse Bremen AG. Das Portfolio des Fonds wurde so angepasst, dass es die Vorgaben des Artikels 8 der EU-Regulierung 2019/2088 erfüllt. Der Fonds gilt somit als nachhaltig.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Abbildung 1: Portfoliostruktur 31.08.2021 *)
Aufteilung nach Asset Gruppe



Abbildung 2: Portfoliostruktur 31.08.2020 *)
Aufteilung nach Asset Gruppe



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

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensübersicht zum 31.08.2021

| | | | |
|---------------------|-----|----------------|------------------|
| Fondsvermögen: | EUR | 134.143.730,12 | (129.868.142,37) |
| Umlaufende Anteile: | | 3.110.138 | (3.141.641) |

| Vermögensaufteilung in TEUR / % | Kurswert in Fondswährung | % des Fondsvermögens | % des Fondsvermögens per 31.08.2020 |
|----------------------------------|-----------------------------|-------------------------|---|
| I. Vermögensgegenstände | | | |
| 1. Anleihen | 120.270 | 89,66 | (0,00) |
| 2. Zertifikate | 9.364 | 6,96 | (93,48) |
| 3. Derivate | -8.068 | -6,00 | (-0,43) |
| 4. Bankguthaben | 12.470 | 9,30 | (7,10) |
| 5. Sonstige Vermögensgegenstände | 278 | 0,21 | (0,00) |
| II. Verbindlichkeiten | | | |
| | -170 | -0,13 | (-0,15) |
| <hr/> | | | |
| III. Fondsvermögen | 134.144 | 100,00 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| 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 |
|---|--------------|-------|--|--------------------|----------------|-------------------|------------|-----------------|----------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| 1,000000000% Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2017(27) | XS1520344745 | | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 % | 107,004000 | 2.675.100,00 | 1,99 |
| 0,010000000% Brandenburg, Land Schatzanw. v.2020(2028) | DE000A289NL9 | | EUR | 995 | 995 | 0 % | 102,240000 | 1.017.288,00 | 0,76 |
| 0,500000000% Finnland, Republik EO-Bonds 17/27 | FI4000278551 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 % | 106,441666 | 3.193.249,98 | 2,38 |
| 0,250000000% Frankreich EO-OAT 2016(26) | FR0013200813 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 % | 104,192500 | 3.125.775,00 | 2,33 |
| 0,200000000% Irland EO-Treasury Bonds 20/27 | IE00BKFVC568 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 % | 103,892500 | 3.116.775,00 | 2,32 |
| 0,375000000% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2016(26) | XS1501554874 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 % | 103,612500 | 3.108.375,00 | 2,32 |
| 0,950000000% Litauen, Republik EO-MTN 17/27 | XS1619567677 | | EUR | 5.000 | 5.000 | 0 % | 106,984750 | 5.349.237,50 | 3,99 |
| 0,950000000% Nordrhein-Westfalen, Land MTN LSA v.18(28) Reihe 1456 | DE000NRW0K03 | | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 % | 108,460275 | 2.711.506,88 | 2,02 |
| 1,000000000% OMV AG EO-Medium-Term Notes 2017(26) | XS1734689620 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 % | 105,781966 | 2.115.639,32 | 1,58 |
| 2,625000000% PepsiCo Inc. EO-Med.-Term Notes 2014(14/26) | XS1061714165 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 % | 112,694000 | 2.253.880,00 | 1,68 |
| 0,000000000% Republic of Iceland EUR Long 7-year | XS2293755125 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 % | 100,050500 | 3.001.515,00 | 2,24 |
| 2,000000000% Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2015(26/26) | XS1301052202 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 % | 110,303000 | 2.206.060,00 | 1,64 |
| 1,750000000% SAP Med.Term Nts. 14/27 | DE000A13SL34 | | EUR | 4.000 | 4.000 | 0 % | 110,034500 | 4.401.380,00 | 3,28 |
| 1,250000000% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27) | SI0002103685 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 % | 109,423000 | 3.282.690,00 | 2,45 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermö- gens | |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|--|----------------------|------------|----------------------|--------------------------------------|------|
| 0,250000000% Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2019(26) | BE6313645127 | | EUR | 1.900 | 1.900 | 0 | % | 102,643000 | 1.950.217,00 | 1,45 |
| 0,500000000% Österreich, Republik EO-Bundesanl. 17/27 | AT0000A1VGK0 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 | % | 106,191000 | 3.185.730,00 | 2,37 |
| 1,375000000% Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2018(18/28) | FR0013346137 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 109,837500 | 2.196.750,00 | 1,64 |
| 0,800000000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81 | BE0000341504 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 | % | 107,859500 | 3.235.785,00 | 2,41 |
| 1,200000000% Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2018(18/28) | XS1900752814 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 109,252000 | 2.185.040,00 | 1,63 |
| Summe der börsengehandelten Wertpapiere | | | | | | | EUR | 54.311.993,68 | 40,48 | |

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

| | | | | | | | | | | |
|---|--------------|--|-----|-------|-------|---|---|------------|--------------|------|
| 0,400000000% BNP CLN DAIMLER 21/26 | XS2248111366 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 | % | 98,280115 | 2.948.403,45 | 2,20 |
| 0,250000000% BNP CRLNFI 21/26 National Grid | XS2237713271 | | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 | % | 98,149759 | 2.453.743,98 | 1,83 |
| 0,750000000% BNP Paribas CLN 21/27 VW AG | XS2266393656 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 99,050639 | 1.981.012,78 | 1,48 |
| 0,250000000% BNP Paribas Issuance B.V. EO-Cred.Lkd M.-T. Cts 21/26 | XS2237713198 | | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 | % | 97,638347 | 2.440.958,68 | 1,82 |
| 0,310000000% DekaBank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(26)ENL | DE000DK0Y756 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 | % | 99,110000 | 2.973.300,00 | 2,22 |
| 0,300000000% Deka-Bank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(27)EON | DE000DK0Y8Q8 | | EUR | 1.700 | 1.700 | 0 | % | 99,300000 | 1.688.100,00 | 1,26 |
| 0,220000000% DekaBank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(27)Heineken | DE000DK0Y8R6 | | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % | 99,480000 | 1.492.200,00 | 1,11 |
| 0,260000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 AVIVA | DE000DD5AVX8 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 100,680000 | 2.013.600,00 | 1,50 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermö- gens |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|--|----------------------|---|------------|--------------------|--------------------------------------|
| 0,180000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 IBM | DE000DD5AV19 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 100,970000 | 2.019.400,00 | 1,51 |
| 0,190000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 Volvo | DE000DD5AVW0 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 100,580000 | 2.011.600,00 | 1,50 |
| 0,640000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO- Credit Linked MTN 21/26 | XS2061859703 | | EUR | 2.400 | 2.400 | 0 | % | 99,515577 | 2.388.373,85 | 1,78 |
| 0,470000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO- Credit Linked MTN 21/26 | XS2061862756 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 99,831631 | 1.996.632,62 | 1,49 |
| 0,500000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO- Credit Linked MTN 21/26 | XS2061862244 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 98,218245 | 1.964.364,90 | 1,46 |
| 0,070000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25) | XS2305763869 | | EUR | 2.100 | 2.100 | 0 | % | 98,445297 | 2.067.351,24 | 1,54 |
| 0,020000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25) | XS2305760923 | | EUR | 2.100 | 2.100 | 0 | % | 98,758023 | 2.073.918,48 | 1,55 |
| 0,150000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25) | XS2305764164 | | EUR | 2.100 | 2.100 | 0 | % | 98,743426 | 2.073.611,95 | 1,55 |
| 0,140000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25) | XS2305763273 | | EUR | 2.100 | 2.100 | 0 | % | 98,432491 | 2.067.082,31 | 1,54 |
| 0,375000000% Ontario, Provinz EO-Medium- Term Notes 2020(27) | XS2153608141 | | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 | % | 103,429930 | 2.585.748,25 | 1,93 |
| 0,350000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26) | XS2277941519 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 99,194876 | 1.983.897,52 | 1,48 |
| 0,460000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26) | XS2277944455 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 99,464824 | 1.989.296,48 | 1,48 |
| 0,280000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26) | XS2277942087 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 98,930847 | 1.978.616,94 | 1,47 |
| 0,220000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 21/26 | XS2277779588 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % | 98,158085 | 1.963.161,70 | 1,46 |
| 0,320000000% UniCredit Bank AG HVB Bonitaet 21(26) SQU | DE000HVB56F5 | | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 | % | 99,380000 | 2.981.400,00 | 2,22 |
| 0,500000000% UNICRE- DIT CLN 21/27 Orange | DE000HVB5AR6 | | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 | % | 99,946976 | 2.498.674,40 | 1,86 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermö- gens |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|--|----------------------|---|--------------|--------------------|--------------------------------------|
| 0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26) | CH0593023788 | | EUR | 2.700 | 2.700 | 0 | % | 99,721009 | 2.692.467,24 | 2,01 |
| 0,150000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26) | CH0593023770 | | EUR | 2.700 | 2.700 | 0 | % | 99,464904 | 2.685.552,41 | 2,00 |
| 0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26) | CH0593023754 | | EUR | 2.700 | 2.700 | 0 | % | 98,780033 | 2.667.060,89 | 1,99 |
| 0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO- Credit Lkd Notes 2021(26) | CH0593023762 | | EUR | 2.700 | 2.700 | 0 | % | 99,057807 | 2.674.560,79 | 2,00 |
| 0,875000000% Quebec, Provinz EO-Medium- Term Notes 2018(28) | XS1851229218 | | EUR | 2.200 | 2.200 | 0 | % | 106,995811 | 2.353.907,84 | 1,75 |
| 2,000000000% Vontobel Financial Products Fix Kupon Exp. v.21(22)DAX | DE000VQ648R6 | | STK | 250 | 250 | 0 | % | 1.000,100000 | 250.025,00 | 0,19 |

Zertifikate

| | | | | | | | | | | |
|---|--------------|--|-----|--------|--------|---|-----|--------------|--------------|------|
| UBS AG (London Branch) BO.C.Z 24.12.21 ESTX50 | DE000UE56KM1 | | STK | 25.000 | 25.000 | 0 | EUR | 40,490000 | 1.012.250,00 | 0,75 |
| BNP Paribas Em.-u.Han- delslg.mbH CA.BO.Z 23.12.21 Nasd100 | DE000PF1JFH8 | | STK | 20.000 | 20.000 | 0 | EUR | 116,350000 | 2.327.000,00 | 1,73 |
| BNP Paribas Em.-u.Han- delslg.mbH FAKTOR EXPR.Z28.10.26 SX5E | DE000PF99B80 | | STK | 127 | 127 | 0 | EUR | 1.002,860000 | 127.363,22 | 0,09 |
| BNP Paribas Em.-u.Han- delslg.mbH MEM. EXPRESS Z22.08.25 SX5E | DE000PF99CG7 | | STK | 266 | 0 | 0 | EUR | 1.000,000000 | 266.000,00 | 0,19 |
| Citigroup Global Mkts Europe CA.BO.Z 22.12.21 DJIA | DE000KE2LFQ9 | | STK | 7.500 | 7.500 | 0 | EUR | 279,740000 | 2.098.050,00 | 1,56 |
| Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.A. Z.02.07.26 DAI | DE000CS8C766 | | STK | 262 | 262 | 0 | EUR | 966,070000 | 253.110,34 | 0,19 |
| Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.Z.11.06.25 1COV | DE000CS8C717 | | STK | 817 | 817 | 0 | EUR | 952,700000 | 778.355,90 | 0,58 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|--------------|-------|--|--------------------|------------------------------------|-------------------|----------------|-----------------------|----------------------|
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG CAP.BO.Z 24.09.21 ESTX50 | DE000TT259P7 | STK | | 15.000 | 15.000 | 0 | EUR 33,950000 | 509.250,00 | 0,38 |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.09.07.25 SX5E | CH1111679150 | STK | | 231 | 231 | 0 | EUR 985,960000 | 227.756,76 | 0,17 |
| Vontobel Financial Products BOC.Z 24.12.21 Nasd100 | DE000VP9DY72 | STK | | 15.000 | 15.000 | 0 | EUR 117,650000 | 1.764.750,00 | 1,32 |
| Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere | | | | | | | EUR | 75.321.909,92 | 56,14 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 129.633.903,60 | 96,62 |

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

Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten

Optionsrechte auf Aktienindices

| | | | | | | |
|---|------|-------------|-----|------------|-------------|-------|
| Call DAX 15800,000000000 17.09.2021 | XEUR | Anzahl -50 | EUR | 221,200000 | -55.300,00 | -0,04 |
| Call DAX 16000,000000000 17.12.2021 | XEUR | Anzahl -50 | EUR | 453,000000 | -113.250,00 | -0,08 |
| Call DAX 15800,000000000 17.09.2021 | XEUR | Anzahl -10 | EUR | 221,200000 | -11.060,00 | -0,01 |
| Call DAX 16000,000000000 17.12.2021 | XEUR | Anzahl -10 | EUR | 453,000000 | -22.650,00 | -0,02 |
| Call DAX 15800,000000000 17.09.2021 | XEUR | Anzahl -60 | EUR | 221,200000 | -66.360,00 | -0,05 |
| Call DAX 16000,000000000 17.12.2021 | XEUR | Anzahl -60 | EUR | 453,000000 | -135.900,00 | -0,10 |
| Call DAX 15800,000000000 17.09.2021 | XEUR | Anzahl -45 | EUR | 221,200000 | -49.770,00 | -0,04 |
| Call DAX 16000,000000000 17.12.2021 | XEUR | Anzahl -45 | EUR | 453,000000 | -101.925,00 | -0,08 |
| Put DAX 14000,000000000 17.09.2021 | XEUR | Anzahl -300 | EUR | 10,400000 | -15.600,00 | -0,01 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|------|-------|--|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| Put DAX 14000,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -150 | | | EUR 10,400000 | -7.800,00 | -0,01 |
| Put DAX 14000,000000000 17.12.2021 | | XEUR | Anzahl | -150 | | | EUR 168,700000 | -126.525,00 | -0,09 |
| Put DAX 14000,000000000 17.12.2021 | | XEUR | Anzahl | -150 | | | EUR 168,700000 | -126.525,00 | -0,09 |
| Call DAX 15200,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -165 | | | EUR 725,600000 | -598.620,00 | -0,45 |
| Call DAX 14600,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -120 | | | EUR 1.304,300000 | -782.580,00 | -0,58 |
| Put DAX 14000,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | 300 | | | EUR 10,400000 | 15.600,00 | 0,01 |
| Put DAX 14500,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -200 | | | EUR 16,200000 | -16.200,00 | -0,01 |
| Put DAX 14500,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -100 | | | EUR 16,200000 | -8.100,00 | -0,01 |
| Call DAX 16000,000000000 17.12.2021 | | XEUR | Anzahl | -50 | | | EUR 453,000000 | -113.250,00 | -0,08 |
| Call DAX 15800,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -50 | | | EUR 221,200000 | -55.300,00 | -0,04 |
| Put DAX 15500,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -50 | | | EUR 70,200000 | -17.550,00 | -0,01 |
| Call ESTX 50 3950,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -100 | | | EUR 256,300000 | -256.300,00 | -0,19 |
| Call ESTX 50 4050,000000000 17.12.2021 | | XEUR | Anzahl | -100 | | | EUR 225,000000 | -225.000,00 | -0,17 |
| Call ESTX 50 3950,000000000 17.09.2021 | | XEUR | Anzahl | -20 | | | EUR 256,300000 | -51.260,00 | -0,04 |
| Call ESTX 50 4050,000000000 17.12.2021 | | XEUR | Anzahl | -20 | | | EUR 225,000000 | -45.000,00 | -0,03 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermö- gens |
|--|------|-------|---|-----------------------|--|----------------------|----------------|--------------------|--------------------------------------|
| Call ESTX 50 3950,000000000 17.09.2021 | | XEUR | | Anzahl -80 | | | EUR 256,300000 | -205.040,00 | -0,15 |
| Call ESTX 50 4050,000000000 17.12.2021 | | XEUR | | Anzahl -80 | | | EUR 225,000000 | -180.000,00 | -0,13 |
| Put ESTX 50 3700,000000000 17.12.2021 | | XEUR | | Anzahl -250 | | | EUR 47,500000 | -118.750,00 | -0,09 |
| Call ESTX 50 4200,000000000 17.12.2021 | | XEUR | | Anzahl -200 | | | EUR 124,300000 | -248.600,00 | -0,19 |
| Call ESTX 50 4200,000000000 17.09.2021 | | XEUR | | Anzahl -100 | | | EUR 43,100000 | -43.100,00 | -0,03 |
| Put ESTX 50 3700,000000000 17.12.2021 | | XEUR | | Anzahl -250 | | | EUR 47,500000 | -118.750,00 | -0,09 |
| Call ESTX 50 3850,000000000 17.09.2021 | | XEUR | | Anzahl -200 | | | EUR 353,600000 | -707.200,00 | -0,53 |
| Call ESTX 50 3800,000000000 17.09.2021 | | XEUR | | Anzahl -120 | | | EUR 402,700000 | -483.240,00 | -0,36 |
| Put ESTX 50 4200,000000000 17.09.2021 | | XEUR | | Anzahl -250 | | | EUR 45,100000 | -112.750,00 | -0,08 |
| Put ESTX 50 4150,000000000 15.10.2021 | | XEUR | | Anzahl -100 | | | EUR 70,600000 | -70.600,00 | -0,05 |
| Put ESTX 50 4150,000000000 17.09.2021 | | XEUR | | Anzahl -250 | | | EUR 29,800000 | -74.500,00 | -0,06 |
| Put Nasdaq-100 11000,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -1 | | | USD 54,100000 | -4.584,75 | 0,00 |
| Put Nasdaq-100 11000,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -1 | | | USD 54,100000 | -4.584,75 | 0,00 |
| Call Nasdaq-100 15500,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -1 | | | USD 692,350000 | -58.673,73 | -0,04 |
| Put Nasdaq-100 11000,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -2 | | | USD 54,100000 | -9.169,49 | -0,01 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|------|-------|--|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| Put Nasdaq-100 12200,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -2 | | | USD 96,250000 | -16.313,56 | -0,01 |
| Put Nasdaq-100 12200,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -2 | | | USD 96,250000 | -16.313,56 | -0,01 |
| Call Nasdaq-100 15000,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -1 | | | USD 1.033,150000 | -87.555,08 | -0,07 |
| Call Nasdaq-100 14600,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -5 | | | USD 1.037,450000 | -439.597,46 | -0,33 |
| Call Nasdaq-100 14600,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -1 | | | USD 1.037,450000 | -87.919,49 | -0,07 |
| Put Nasdaq-100 12900,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -4 | | | USD 6,200000 | -2.101,69 | 0,00 |
| Put Nasdaq-100 13500,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -12 | | | USD 11,150000 | -11.338,98 | -0,01 |
| Call Nasdaq-100 14200,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -6 | | | USD 1.426,850000 | -725.516,95 | -0,54 |
| Call Nasdaq-100 16000,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -5 | | | USD 414,600000 | -175.677,97 | -0,13 |
| Call S&P 500 4250,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -4 | | | USD 284,000000 | -96.271,19 | -0,07 |
| Call S&P 500 4350,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -4 | | | USD 271,350000 | -91.983,05 | -0,07 |
| Call S&P 500 4250,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -6 | | | USD 284,000000 | -144.406,78 | -0,11 |
| Call S&P 500 4350,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -6 | | | USD 271,350000 | -137.974,58 | -0,10 |
| Put S&P 500 3700,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -8 | | | USD 31,150000 | -21.118,64 | -0,02 |
| Put S&P 500 3900,000000000 17.12.2021 | | XCBO | | Anzahl -4 | | | USD 44,350000 | -15.033,90 | -0,01 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|------|-------|--|--------------------|------------------------------------|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|
| Call S&P 500 4150,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -10 | | | USD 381,600000 | -323.389,83 | -0,24 |
| Put S&P 500 3925,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -15 | | | USD 2,400000 | -3.050,85 | 0,00 |
| Put S&P 500 3850,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -10 | | | USD 1,975000 | -1.673,73 | 0,00 |
| Call S&P 500 4250,000000000 17.09.2021 | | XCBO | | Anzahl -10 | | | USD 284,000000 | -240.677,97 | -0,18 |
| Summe der Aktienindex-Derivate | | | | | | | EUR | -8.063.682,98 | -6,00 |
| Zins-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte | | | | | | | | | |
| Call Euro Bund Future 174,000000000 24.09.2021 | | XEUR | EUR | Anzahl -55 | | | | -4.400,00 | 0,00 |
| Summe der Zins-Derivate | | | | | | | EUR | -4.400,00 | 0,00 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2021 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|------|-------|--|--------------------|------------------------------------|-------------------|------|-----------------------|----------------------|
| Bankguthaben | | | | | | | | | |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle: UBS Europe SE | | | EUR | 9.287.651,87 | | | | 9.287.651,87 | 6,92 |
| Bank: National-Bank AG | | | EUR | 3.138,96 | | | | 3.138,96 | 0,00 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle: UBS Europe SE | | | USD | 3.751.081,46 | | | | 3.178.882,59 | 2,37 |
| Summe der Bankguthaben | | | | | | | EUR | 12.469.673,42 | 9,30 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | |
| Zinsansprüche | | | EUR | 277.880,92 | | | | 277.880,92 | 0,21 |
| Summe sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 277.880,92 | 0,21 |
| Sonstige Verbindlichkeiten 1) | | | EUR | -169.644,84 | | | EUR | -169.644,84 | -0,13 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 134.143.730,12 | 100 2) |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 43,13 | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | | STK | 3.110.138 | |

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 26,21%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 131.645.221,76 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 31.08.2021

| | | |
|-----------|-----|-------------------------|
| US-Dollar | USD | 1,180000 = 1 Euro (EUR) |
|-----------|-----|-------------------------|

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

| | |
|------|--------------------------------|
| XEUR | EUREX DEUTSCHLAND |
| XCBO | CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE |



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

| | | | | | |
|--|--------------|-----|-------|-------|--|
| 0,000000000% Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) EO-Anl. 2020(23) DAX | CH0570342979 | STK | 2.275 | 2.275 | |
|--|--------------|-----|-------|-------|--|

Zertifikate

| | | | | | |
|--|--------------|-----|--------|--------|--|
| Cornèr Bank SA Bonus Zert Z24.09.21 SX5E | CH0522695706 | STK | 30.000 | 30.000 | |
|--|--------------|-----|--------|--------|--|

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

| | | | | | |
|--|--------------|-----|---|----|--|
| 36,750000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Anl. 2020(20) Wirecard | DE000CS8CV63 | EUR | - | 38 | |
|--|--------------|-----|---|----|--|

| | | | | | |
|---|--------------|-----|---|-----|--|
| 47,000000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Zert. 2020(21) Tesla Motors | DE000CS8CTW8 | STK | - | 500 | |
|---|--------------|-----|---|-----|--|

| | | | | | |
|---|--------------|-----|---|-----|--|
| 33,150000000% Credit Suisse (London Branch) Protect Öl Aktien v.20/20 | DE000CS8CVZ7 | EUR | - | 500 | |
|---|--------------|-----|---|-----|--|

| | | | | | |
|--|--------------|-----|---|-------|--|
| 3,200000000% Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) EO-Anl. 2020(21) DAX Index | CH0555287736 | STK | - | 5.380 | |
|--|--------------|-----|---|-------|--|

| | | | | | |
|---|--------------|-----|---|-------|--|
| 9,250000000% Standard Chartered Bank EO-Anl. 2020(21) EURO STOXX 50 | XS2142334015 | EUR | - | 1.000 | |
|---|--------------|-----|---|-------|--|

| | | | | | |
|---|--------------|-----|---|-----|--|
| 4,100000000% UBS AG (London Branch) LANXESS Expr.Zt. 20/24.4.23 | DE000UBS1BK6 | STK | - | 725 | |
|---|--------------|-----|---|-----|--|

Zertifikate

| | | | | | |
|---|--------------|-----|---|--------|--|
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 24.12.20 DAX | DE000PH1WAT5 | STK | - | 14.500 | |
|---|--------------|-----|---|--------|--|

| | | | | | |
|---|--------------|-----|---|--------|--|
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 24.12.20 DAX | DE000PH1WAU3 | STK | - | 12.000 | |
|---|--------------|-----|---|--------|--|

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|---|--------------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 25.03.21 DAX | DE000PH1WGU0 | STK | 17.500 | 17.500 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 23.09.21 DAX | DE000PH1XBR5 | STK | 20.000 | 20.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 25.03.21 Nasd100 | DE000PH1XKE4 | STK | 13.000 | 13.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 24.06.21 S&P500 | DE000PH1XM46 | STK | 50.000 | 50.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 24.06.21 S&P500 | DE000PF1YV63 | STK | 30.000 | 30.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH BONUS 24.06.21 ESTX50 | DE000PH1V5A0 | STK | 35.000 | 35.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 24.06.21 DJIA | DE000PF1C0Q4 | STK | 3.000 | 3.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 25.03.21 Nasd100 | DE000PH1TKJ1 | STK | - | 11.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 24.06.21 Nasd100 | DE000PH1TLL5 | STK | 6.500 | 15.500 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 25.03.21 Nasd100 | DE000PF1CX59 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CAP. BZ 28.12.20 STXE 600 | DE000PZ9RCB0 | STK | - | 3.750 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH R.C.BOZ 24.09.20 DAX | DE000PX84EL8 | STK | - | 26.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH R.C.BOZ 24.12.20 DAX | DE000PX84GF5 | STK | - | 38.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH R.C.BOZ 24.12.20 DAX | DE000PX2EC96 | STK | 6.000 | 6.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH R.C.BOZ 24.12.20 DJIA | DE000PX8Q4J1 | STK | - | 15.000 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH REVBONC 25.03.21 Nasd100 | DE000PH1UXD5 | STK | 32.500 | 32.500 | |
| BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH REVBONC 25.03.21 Nasd100 | DE000PF1D3F0 | STK | 25.000 | 25.000 | |
| Citigroup Global Mkts Europe BONUSZ 22.09.21 DAX | DE000KB55K56 | STK | 7.000 | 7.000 | |
| Citigroup Global Mkts Europe BONUSZ 25.03.21 DJIA | DE000KB52336 | STK | - | 19.000 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--------------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| Citigroup Global Mkts Europe BONUSZ 23.06.21 ESTX50 | DE000KB55LS5 | STK | 25.000 | 25.000 | |
| Citigroup Global Mkts Europe CA.BO.Z 23.12.20 DAX | DE000KB55EP6 | STK | - | 4.000 | |
| Citigroup Global Mkts Europe CA.BO.Z 23.06.21 DAX | DE000KB55E70 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| Citigroup Global Mkts Europe CA.BO.Z 24.03.21 DAX | DE000KB55EX0 | STK | 7.500 | 7.500 | |
| Citigroup Global Mkts Europe CA.BO.Z 24.03.21 Twitter | DE000KB5Y757 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| Cornèr Bank SA Bonus Zert Z26.03.21 DHER | CH0522694618 | STK | 10.500 | 10.500 | |
| Cornèr Bank SA Bonus Zert Z25.06.21 DAX | CH0522694659 | STK | 35.000 | 35.000 | |
| Cornèr Bank SA Bonus Zert Stoxx 600 | CH0571432126 | STK | 20.000 | 20.000 | |
| Cornèr Bank SA Bonus Zert Z25.06.21 SAP | CH0571434528 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| Credit Suisse AG (Ldn Br.) C.BON.Z | DE000CS8CU15 | STK | - | 16.000 | |
| CS LONDON BONCAP Z21 STOXX EUROPE 600 Oil&Gas | DE000CS8C0D6 | STK | 750 | 750 | |
| Credit Suisse AG (Ldn Br.) C.BON.Z 28.07.20 STXE 600 | DE000CS8CYW8 | STK | - | 2.700 | |
| DekaBank Dt.Girozentrale Bonus Zert 26.03.21 SX5E | DE000DK0W990 | STK | - | 38.000 | |
| DekaBank Dt.Girozentrale Bonus Zert 25.06.21 SX5E | DE000DK0XHN2 | STK | - | 54.000 | |
| DekaBank Dt.Girozentrale Bonus Zert 29.12.20 DAX | DE000DK0XR4 | STK | - | 21.500 | |
| Deutsche Bank AG CA.BO.Z 22.12.20 DAX | DE000DC4ZZA8 | STK | - | 11.250 | |
| Deutsche Bank AG CA.BO.Z 22.12.20 ESTX50 | DE000DC5F5K2 | STK | - | 46.000 | |
| Deutsche Bank AG DISC.Z 24.03.21 DJIA 24000 | DE000DS3QK63 | STK | - | 100.000 | |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. BONUSZ 24.09.21 ESTX50 | DE000DFK1Q15 | STK | - | 84.500 | |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. BONUSZ 24.09.21 ESTX50 | DE000DFK1QX2 | STK | 7.500 | 7.500 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--------------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 28.12.20 DAX | DE000DFK3MY5 | STK | - | 23.000 | |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 24.12.21 DAX | DE000DFT2Z48 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 24.09.21 DAX | DE000DFS65L0 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 26.03.21 DAX | DE000DFT2TA3 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 26.03.21 DAX | DE000DFT2T87 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| EFG Intl Finance (GG) Ltd. Bonus Z24.09.21 Basket | CH0569864603 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| EFG Intl Finance (GG) Ltd. Bonus Z23.06.21 Basket | CH0569864595 | STK | 7.500 | 7.500 | |
| EFG ITL FIN.BON.Z21 IBEX 35 | CH0575760803 | STK | 22.500 | 22.500 | |
| EFG Bonus on Bayer 25.06.21 | CH0569864652 | STK | 22.500 | 22.500 | |
| EFG Intl Finance (GG) Ltd. Bonus Zert.26.03.21 Nasdaq | CH0575766057 | STK | 10.500 | 10.500 | |
| Erste Group Bank AG C.BO. 19.03.21 ESTX50 | AT0000A2HBK8 | STK | - | 82.500 | |
| Erste Group Bank AG BOZ 24.06.21 ESTX50 | AT0000A2HUV5 | STK | - | 90.000 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH BONUSZ 23.12.20 DAX | DE000GC7DL45 | STK | - | 10.250 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH BONUSZ 24.03.21 DAX | DE000GC543D4 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH BONUSZ 23.06.21 ESTX50 | DE000GC1LLV7 | STK | 53.000 | 53.000 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 23.12.20 DAX | DE000GC2ZNK4 | STK | - | 12.500 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 23.12.20 DAX | DE000GC5XD43 | STK | - | 10.250 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 24.03.21 DAX | DE000GC2AH80 | STK | - | 11.500 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 23.06.21 DAX | DE000GC3RYH2 | STK | 13.000 | 13.000 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 22.09.21 DAX | DE000GC5X168 | STK | 15.000 | 15.000 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--------------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 24.03.21 DAX | DE000GC5X1X5 | STK | 7.500 | 7.500 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH CA.BO.Z 24.03.21 DAX | DE000GC51J17 | STK | 15.000 | 15.000 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH R.C.BO.Z 24.03.21 DAX | DE000GF4EYM5 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| Goldman Sachs Wertpapier GmbH R.C.BO.Z 24.03.21 DAX | DE000CH0BP63 | STK | 15.000 | 15.000 | |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG CAP.BO.Z ESTX50 | DE000TT10PA2 | STK | - | 37.500 | |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG Bo. Z. 25.03.2021 DAX | DE000TT26GV3 | STK | - | 24.000 | |
| HSBC Trinkaus & Burkhardt AG CAP.BO.Z 26.03.21 DAX | DE000TT2L539 | STK | - | 12.000 | |
| Landesbank Baden-Württemberg Ca- Bo-Z 29.12.2020 DAX | DE000LB2JF28 | STK | - | 25.000 | |
| Landesbank Baden-Württemberg Ca- Bo-Z 25.06.2021 ADS | DE000LB15A98 | STK | - | 2.500 | |
| Landesbank Baden-Württemberg Ca- Bo-Z 24.09.2021 BAYN | DE000LB17PR6 | STK | - | 9.000 | |
| Landesbank Baden-Württemberg Ca- Bo-Z 24.09.2021 MOH | DE000LB17RL5 | STK | - | 1.350 | |
| Landesbank Baden-Württemberg Ca-Bo-Z 25.06.2021 SX5E | DE000LB15A49 | STK | 44.000 | 61.000 | |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Bonus Z.25.06.21 DAX | CH0566283898 | STK | 23.500 | 23.500 | |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) BONUSZ 23.06.21 SX5E | CH0559571333 | STK | 15.000 | 190.000 | |
| Raiffeisen Switzerland B.V. Bonus Z STOXX Oil&Gas | CH0534166951 | STK | - | 63.480 | |
| Raiffeisen Switzerland B.V. Bonus Z STOXX Oil&Gas | CH0534166944 | STK | - | 70.000 | |
| Raiffeisen Switzerland B.V. Bonus Z STOXX Basic Re. | CH0546959260 | STK | 17.500 | 82.500 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 28.12.20 DAX | DE000SB1WL11 | STK | - | 8.750 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 28.12.20 DJIA | DE000SB1UUD4 | STK | - | 6.500 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|---|--------------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 28.12.20 DJIA | DE000SB1UT98 | STK | - | 6.500 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 26.03.21 DAX | DE000SB4CW43 | STK | 11.500 | 11.500 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 25.06.21 DAX | DE000SB4C4F9 | STK | 7.500 | 7.500 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 25.06.21 DAX | DE000SB4C5M2 | STK | 15.000 | 15.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 26.03.21 DJIA | DE000SB4C7C9 | STK | - | 4.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 25.06.21 Nasd100 | DE000SB4DGF8 | STK | 5.000 | 5.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 26.03.21 Nasd100 | DE000SB4DEA4 | STK | 8.500 | 8.500 | |
| Société Générale Effekten GmbH BO.C.Z 26.03.21 Nasd100 | DE000SB4DEF3 | STK | 13.500 | 13.500 | |
| Société Générale Effekten GmbH BONUSZ 28.12.20 DJIA | DE000SB1UPW4 | STK | - | 7.750 | |
| Société Générale Effekten GmbH BONUSZ 25.06.21 DJIA | DE000SB4GNN1 | STK | 4.000 | 4.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH BONUSZ 25.06.21 DJIA | DE000SB4GM33 | STK | 6.000 | 6.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH BONUSZ 26.03.21 Nasd100 | DE000SB4GH97 | STK | 8.000 | 8.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH BONUSZ 26.03.21 Nasd100 | DE000SB4GJ61 | STK | 13.000 | 13.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH RC.B.Z 28.12.20 DAX | DE000CU66BJ9 | STK | 15.000 | 45.000 | |
| Société Générale Effekten GmbH RC.B.Z 28.12.20 DAX | DE000CU652T1 | STK | - | 17.500 | |
| UBS AG (London Branch) BO.C.Z 24.06.21 DAX | DE000UD99FZ5 | STK | 12.000 | 12.000 | |
| UBS AG (London Branch) BO.C.Z 26.03.21 DAX | DE000UE1DC64 | STK | 12.000 | 12.000 | |
| UBS AG (London Branch) BO.C.Z 26.03.21 ESTX50 | DE000UD40NK5 | STK | - | 52.500 | |
| UBS AG (London Branch) BONUSZ 25.06.21 ESTX50 | DE000UD8L564 | STK | 25.000 | 50.000 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--------------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| UBS AG (London Branch) BONUSZ 25.06.21 ESTX50 | DE000UD98H56 | STK | - | 40.000 | |
| UBS AG (London Branch) BONUSZ 26.03.21 ESTX50 | DE000UD98H64 | STK | - | 40.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB BONUS 24.06.21 DAX | DE000HR0EHK7 | STK | - | 13.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB BONUS 25.03.21 DAX | DE000HR0EHJ9 | STK | - | 42.500 | |
| UniCredit Bank AG HVB BONUS 24.06.21 ESTX50 | DE000HR0EHL5 | STK | - | 75.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB BONUS 25.06.21 ESTX50 | DE000HZ92FT3 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB CA.BO.Z 28.12.20 ESTX50 | DE000HZ911U9 | STK | - | 60.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB CA.BO.Z 28.12.20 ESTX50 | DE000HZ91149 | STK | 20.000 | 20.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB CA.BO.Z 25.06.21 Alibaba | DE000HR0WVE3 | STK | 2.000 | 2.000 | |
| UniCredit Bank AG HVB CA.BO.Z 26.03.21 DAX | DE000HZ2WBR3 | STK | 7.500 | 7.500 | |
| UniCredit Bank AG HVB CA.BO.Z 24.09.21 Nasd100 | DE000HR1UAU5 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| Vontobel Financial Products BO.Z 25.06.21 DJIA | DE000VP33NP1 | STK | - | 11.500 | |
| Vontobel Financial Products BOC.Z 28.12.20 DAX | DE000VP5S685 | STK | - | 9.000 | |
| Vontobel Financial Products BOC.Z 28.12.20 DAX | DE000VP5S628 | STK | - | 15.000 | |
| Vontobel Financial Products BOC.Z 28.12.20 ESTX50 | DE000VP405Y8 | STK | 55.000 | 55.000 | |
| Vontobel Financial Products BOC.Z 26.03.21 DAX | DE000VP5AGM6 | STK | 12.500 | 12.500 | |
| EFG Intl Finance (GG) Ltd. Bonus Z. DJI | CH0534157661 | STK | - | 26.950 | |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) BONUSZ 24.03.21 DJ Ind.Aver. | CH0572904883 | STK | 7.000 | 7.000 | |
| LEON.SEC(GG) BON.Z21 DJIA | CH0555285607 | STK | - | 9.000 | |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--------------|--|----------------|-------------------|------------------|
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Bonus Z.23.06.21 Dow Jones | CH0572904909 | STK | 7.000 | 7.000 | |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Bonus Z.24.03.21 Nasdaq-100 | CH0572904917 | STK | 10.000 | 10.000 | |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Bonus Z. Kraft Heinz | CH0506331930 | STK | - | 11.000 | |
| Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) BOZ Tesla | CH0555289625 | STK | - | 5.750 | |

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

Terminkontrakte

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:

| | | |
|---------|-----|-----------|
| USD/EUR | EUR | 13.662,88 |
|---------|-----|-----------|

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices:

Gekaufte Kaufoptionen (Call):

| | | |
|---|-----|-------|
| Basiswerte: S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index | USD | 11,68 |
|---|-----|-------|

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

| | | |
|--|-----|----------|
| Basiswert: ESTX 50 Index (Price) (EUR) | EUR | 4.283,58 |
|--|-----|----------|

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

| | | |
|--|-----|----------|
| Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR) | EUR | 2.182,79 |
|--|-----|----------|

| | | |
|---|-----|--------|
| Basiswerte: S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index | USD | 507,58 |
|---|-----|--------|

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

| | | |
|--|-----|----------|
| Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR) | EUR | 3.926,24 |
|--|-----|----------|

| | | |
|---|-----|----------|
| Basiswerte: S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index | USD | 1.144,90 |
|---|-----|----------|

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|---|------|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| Optionsrechte auf Zins-Derivate | | | | | |
| Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte: | | | | | |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call): | | | | | |
| Basiswert: Euro Bund Futures | | EUR | | | 388,59 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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

für den Zeitraum vom 01. September 2020 bis 31. August 2021

I. Erträge

| | | |
|--|------------|-------------------|
| 1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | EUR | 62.435,88 |
| 2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | EUR | 232.975,25 |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | EUR | -88.914,74 |
| davon negative Habenzinsen | EUR | -88.914,74 |
| 4. Sonstige Erträge | EUR | 150,85 |
| Summe der Erträge | EUR | 206.647,24 |

II. Aufwendungen

| | | |
|--|------------|----------------------|
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | EUR | -404,12 |
| 2. Verwaltungsvergütung | EUR | -1.802.657,56 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | EUR | -56.087,45 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | EUR | -10.171,89 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | EUR | -6.690,05 |
| 6. Aufwandsausgleich | EUR | -11.415,05 |
| Summe der Aufwendungen | EUR | -1.887.426,12 |

III. Ordentlicher Nettoertrag

EUR -1.680.778,88

IV. Veräußerungsgeschäfte

| | | |
|---|------------|----------------------|
| 1. Realisierte Gewinne | EUR | 21.219.505,79 |
| 2. Realisierte Verluste | EUR | -6.763.072,41 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | EUR | 14.456.433,38 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 12.775.654,50 |

| | | |
|---|-----|---------------|
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | EUR | -26.276,75 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | EUR | -2.466.935,66 |

VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR -2.493.212,41

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR 10.282.442,09

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Entwicklung des Sondervermögens

| | | 2021 |
|--|------------|-----------------------|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | EUR | 129.868.142,37 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | EUR | -4.678.603,50 |
| 2. Mittelzufluss / -abfluss (netto) | EUR | -1.213.748,87 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen: | EUR | 10.144.266,00 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen: | EUR | -11.358.014,87 |
| 3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | EUR | -114.501,97 |
| 4. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 10.282.442,09 |
| davon nicht realisierte Gewinne: | EUR | -26.276,75 |
| davon nicht realisierte Verluste: | EUR | -2.466.935,66 |
| II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres | EUR | 134.143.730,12 |

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

| Berechnung der Ausschüttung | | insgesamt | je Anteil |
|---|------------|---------------------|------------------|
| I. Für die Ausschüttung verfügbar | | | |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr | EUR | 19.284.882,22 | 6,20 |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 12.775.654,50 | 4,11 |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3) | EUR | 6.763.072,41 | 2,17 |
| II. Nicht für die Ausschüttung verwendet | | | |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt | EUR | -14.036.842,62 | -4,51 |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung | EUR | -20.121.559,52 | -6,47 |
| III. Gesamtausschüttung | EUR | 4.665.207,00 | 1,50 |
| 1. Endausschüttung | | | |
| a) Barausschüttung | EUR | 4.665.207,00 | 1,50 |

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

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

| Geschäftsjahr | Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres | | Anteilwert | |
|---------------|---|----------------|------------|-------|
| 2018 | EUR | 112.172.018,01 | EUR | 58,29 |
| 2019 | EUR | 139.764.529,64 | EUR | 51,78 |
| 2020 | EUR | 129.868.142,37 | EUR | 41,34 |
| 2021 | EUR | 134.143.730,12 | EUR | 43,13 |

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 84.604.972,03

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Baader Bank AG
Donner & Reuschel AG
UBS Europe SE

| | |
|---|-------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | 96,62 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | -6,00 |

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 | 0,72 % |
| größter potentieller Risikobetrag | 7,56 % |
| durchschnittlicher potentieller Risikobetrag | 2,39 % |

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 | 1,74 |
|------------|------|

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

| | |
|----------------------------|----------|
| EURO STOXX 50 Index In EUR | 100,00 % |
|----------------------------|----------|

Sonstige Angaben

| | | |
|--------------------|-----|-----------|
| Anteilwert | EUR | 43,13 |
| Umlaufende Anteile | STK | 3.110.138 |

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.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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

BremenKapital Zertifikate 1,44 %

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

Transaktionskosten EUR 457.667,51

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 gezahlt.

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

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

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 150,85 Erträge aus der Auflösung von Rückstellungen

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 5.060,82 Depotgebühren

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 Fehlansätze 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.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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 Vergütungspolitik 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 (Portfoliomanagement Die Sparkasse Bremen AG)

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 | 108.705.512 |
| davon feste Vergütung: | EUR | 0 |
| davon variable Vergütung: | EUR | 0 |
| Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen: | EUR | 0 |
| Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens: | | 1.205 |

Hamburg, 09. Dezember 2021

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH
Geschäftsführung

(Dr. Jörg W. Stotz) (Ludger Wibbeke)

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens BremenKapital Zertifikate – 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.

BremenKapital Zertifikate (OGAW-Fonds)

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 10. Dezember 2021
KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner Lüning
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüfer

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.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:

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 SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH und der
HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des
Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG)

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

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