

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

CA Familienstrategie

31. Dezember 2023



ARAMEA
ASSET MANAGEMENT

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht CA Familienstrategie	4
Vermögensübersicht	8
Vermögensaufstellung	9
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	25
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	30
Allgemeine Angaben	33

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

CA Familienstrategie

in der Zeit vom 01.01.2023 bis 31.12.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Tätigkeitsbericht CA Familienstrategie für das Geschäftsjahr 01.01.2023 bis 31.12.2023

Die mit der Verwaltung des Sondervermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH. Das Portfoliomanagement des Sondervermögens ist ausgelagert an die Armaea Asset Management AG. Die Beratung des Portfoliomanagements erfolgt über die Corvus Advisory GmbH.

Anlageziele und Anlagepolitik

Der CA Familienstrategie investiert in nationale und internationale Aktien mit attraktivem Rendite-Risiko-Profil. Die Titelselektion erfolgt anhand eines fundamentalen Investmentprozesses. Ergänzend investiert der Fonds in Anleihen und Investmentvermögen. Derivative Instrumente und Techniken können sowohl zu Absicherungs- als auch zu Investitionszwecken eingesetzt werden. Der Fonds darf zudem in Bankguthaben und Geldmarktinstrumente investieren. Das Ziel der Anlagepolitik des CA Familienstrategie Fonds ist es, im Rahmen einer aktiven Strategie, langfristig einen attraktiven Wertzuwachs (realen Kapitalerhalt) zu erwirtschaften.

Die maximalen Anlagegrenzen für die jeweiligen Vermögensgegenstände sind entsprechend der besonderen Anlagebedingungen wie folgt ausgestaltet:

Aktien 25% - 75%

Kapitalbeteiligungen min. 25%

Verzinsliche Wertpapiere 25% - 75%

Geldmarktinstrumente bis zu 50%

Bankguthaben bis zu 50%

Investmentfonds bis zu 50%

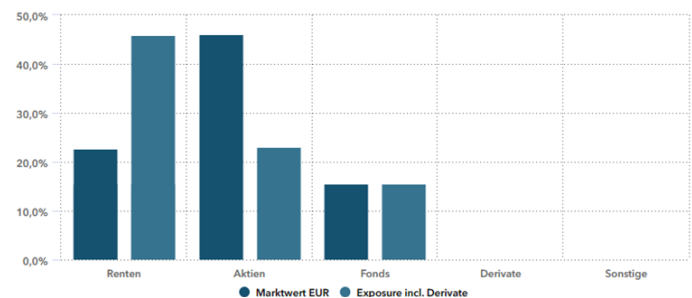
Im Fokus des Auswahlprozesses stehen nordamerikanische und europäische Aktien, mit einer Marktkapitalisierung > 3 Mrd. EUR. Das Anlageuniversum auf der Aktien- bzw. Optionsseite umfasst schwerpunktmäßig den STOXX 600 sowie den S&P 500.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investi-

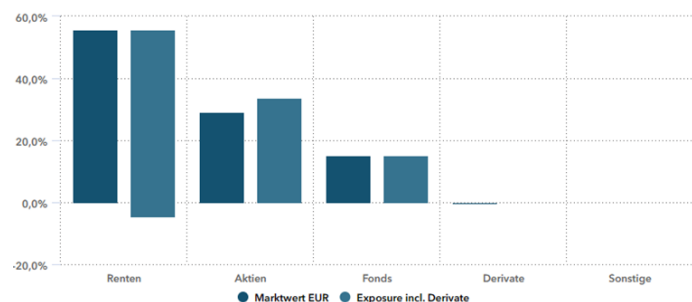
tionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Der Fonds ist damit gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu qualifizieren.

Portfoliostruktur

Portfoliostruktur 31.12.2022



Portfoliostruktur 31.12.2023



Zum Stichtag war der CA Familienstrategie zu 33,80% in Aktien (inkl. Derivate) investiert.

Des Weiteren wurden Put Stillhaltergeschäfte auf 42 Aktien sowie gedeckte Call Stillhaltergeschäfte auf eine Aktie gehalten. Das zur Deckung der Put Stillhaltergeschäfte benötigte Kapital wurde in Anleihen angelegt. Insgesamt wurden im Berichtszeitraum ca. 200 Put- und Call Optionen auf Einzelwerte geschrieben.

Zu Absicherungszwecken wurde unterjährig Long Put sowie Short Future Positionen auf den EuroStoxx 50 und S&P500 Index erworben. Zum Stichtag 31.12.2023 war der Bestand nicht abgesichert.

Der Fonds ist zu 55,76% direkt in Anleihen investiert. Die Länderallokation der Anleihen entspricht USA (27,6%), Deutschland (24,2%), Frankreich (14,7%), Niederlande (8,4%), Litauen (3,7%), Slowakei (3,6%), Spa-

nien (3,6%), Kanada (3,3%), Australien (3,2%), Italien (1,9%), Polen (1,9%), Irland (1,8%), Österreich (1,1%), Sonstige (1%).

Laufzeitenstruktur der investierten Anleihen (Direktinvestments):

0 bis 1 Jahr: 28,5%

1 bis 3 Jahre: 24,3%

3 bis 5 Jahre: 16,0%

5 bis 10 Jahre: 31,2%

10 bis 20 Jahre: 0,00%

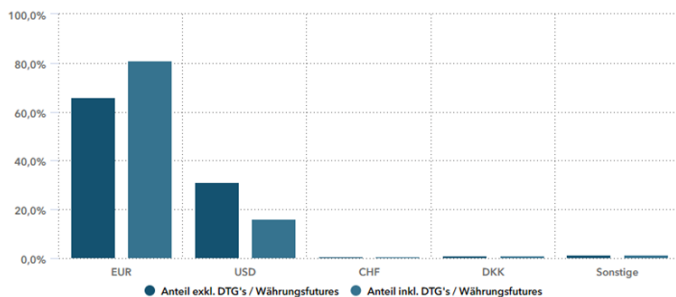
Mehr als 20 Jahre: 0,00%

Die durchschnittliche Restlaufzeit des direkt in Anleihen investierten Kapitals beträgt 3,54 Jahre.

15,06% des Fonds sind in Geldmarktfonds investiert.

Über das gesamte Fondsvermögen hinweg ist der CA Familienstrategie zu 66% in EUR investiert, zu 31% in USD und zu 3% Sonstige.

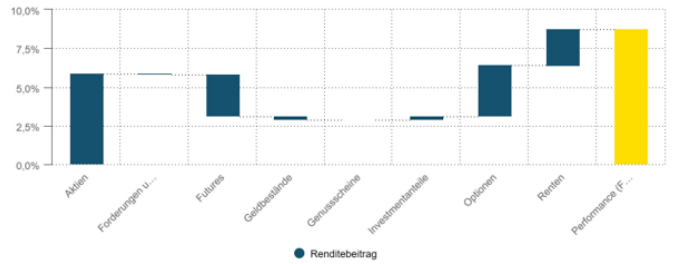
Währungsrisiko per 31.12.2023:



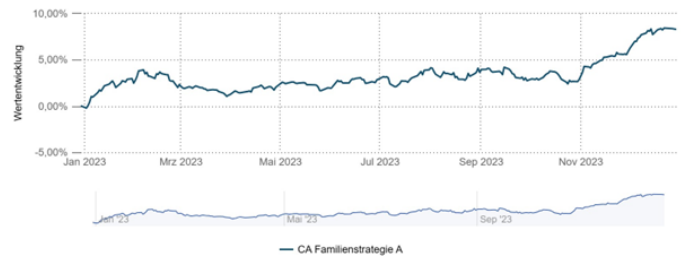
Wertentwicklung

Die Performance des Fonds im Geschäftsjahr beträgt für die Anteilklasse A 8,31% sowie für die Anteilklasse B 8,03%.

Beiträge nach Assetgruppen:



Bei einer Volatilität von 3,8% in der Anteilklasse A lag der max. Drawdown bei -2,76%.



Bei einer Volatilität von 3,79% in der Anteilklasse B lag der max. Drawdown bei -2,8%.



Veräußerungsergebnis

Die realisierten Gewinne resultieren im Wesentlichen aus Aktiengeschäften sowie der Vereinnahmung von Optionsprämien. Für die realisierten Verluste sind im Wesentlichen Veräußerungen von Indexfutures, Investmentanteilen sowie Aktien ursächlich.

Risikoberichterstattung

Marktpreisrisiko:

Der überwiegende Teil der Positionen unterliegt Marktpreisrisiken. Allerdings erfolgt im Fonds eine Diversifizierung nach Assetklassen, Währungen, Laufzeiten, Einzeltiteln und Branchen. Im Fokus stehen qualitative gute Aktien, mit attraktivem Rendite-Risiko-Profil und einem

zukunftsorientierten, nachhaltigen Geschäftsmodell.

Adressenausfallrisiko:

Im Hinblick auf Adressenausfallrisiken stehen Anleihen mit solider Kreditqualität im Fokus. Die Anleihepositionen haben überwiegend ein Investment Grade Rating.

Zinsänderungsrisiko:

Sofern in festverzinsliche Wertpapiere investiert wird, könnte die Möglichkeit bestehen, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Emission einer Anleihe gegeben ist, ändert. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite des festverzinslichen Wertpapiers in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach (Rest-)Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungsrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Zinsänderungsrisiko Zielfonds:

Das Sondervermögen ist Zinsänderungsrisiken über Zielfonds-Investments in Rentenpapiere ausgesetzt. Sofern die Zielfonds in festverzinsliche Wertpapiere investieren könnte die Möglichkeit bestehen, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Emission einer Anleihe gegeben ist, ändert. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite des festverzinslichen Wertpapiers in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach (Rest-)Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungsrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

Währungsrisiko:

Die Finanzinstrumente können in einer anderen Währung als der Währung des Sondervermögens angelegt sein. Der Fonds erhält die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der anderen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert solcher Anlagen und somit auch der Wert des Fondsvermögens. Über das gesamte Fondsvermögen hinweg ist der CA Familienstrategie zu 66% in EUR, zu 31% in USD und 3% in sonstige Währungen investiert.

Liquiditätsrisiko:

Grundsätzlich wird bei der Investition in alle Assetklassen auf eine höchstmögliche Liquidität geachtet. Im Berichtsjahr traten keine Probleme mit der Liquidierbarkeit der gehaltenen Titel auf.

Liquiditätsrisiko Zielfonds:

Der Fonds investiert einen Teil seines Vermögens in Zielfonds. Die Liquidität des Sondervermögens kann eingeschränkt werden, sofern z.B. für die Zielfonds die Rücknahme der Anteilscheine ausgesetzt werden sollte.

Liquiditätsrisiko Renten:

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.

Liquiditätsrisiko Aktien:

Das Sondervermögen ist breit gestreut und mehrheitlich in Aktien mit hoher Marktkapitalisierung investiert, die im Regelfall in großen Volumina an den internationalen Börsen gehandelt werden. Daher ist davon auszugehen, dass jederzeit ausreichend Vermögenswerte zu einem angemessenen Verkaufserlös veräußert werden können.

Adressenausfallrisiko Zielfonds:

Der Fonds legt einen Teil seines Vermögens in Zielfonds an, welche ihrerseits in Anleihen investieren. Dadurch ist der Fonds mittelbar von dem Risiko betroffen, dass es zu einem Ausfall der Zins- und Tilgungszahlungen der im Bestand der Zielfonds befindlichen Anleihen kommen kann. In dessen Folge kann es bei den Anleihen zu Kursverlusten kommen. Das Adressenausfallrisiko soll durch die diversifizierte Anlage in mehrere Zielfonds reduziert werden.

Währungsrisiko Zielfonds:

Die Zielfonds können in Fremdwährung aufgelegt worden sein bzw. in entsprechenden Fremdwährungen investieren. Ferner legen in Euro notierte Zielfonds ganz oder teilweise in Ländern außerhalb des Euroraums an. Das Währungsrisiko soll durch eine Diversifizierung gesteuert und begrenzt werden.

Operationelles Risiko:

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.

Sonstige Risiken:

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

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

Sonstige Ereignisse:

Als Fondsberater fungiert die Corvus Advisory GmbH, Hamburg.

Es sind keine sonstigen wesentlichen Ereignisse eingetreten.

Portfoliomanager des Fonds:

Aramea Asset Management AG

Kleine Johannisstr. 4

20457 Hamburg

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	41.222.779,95	100,12
1. Aktien	11.989.956,50	29,12
2. Anleihen	22.665.692,46	55,05
3. Investmentanteile	6.198.997,96	15,06
4. Derivate	-105.719,34	-0,26
5. Bankguthaben	165.333,78	0,40
6. Sonstige Vermögensgegenstände	308.518,59	0,75
II. Verbindlichkeiten	-47.624,87	-0,12
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-47.624,87	-0,12
III. Fondsvermögen	EUR 41.175.155,08	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	27.030.297,34	65,65
Aktien								EUR	11.989.956,50	29,12
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG		STK	460	900	1.040	CHF	435,8000	215.847,11	0,52
DK0062498333	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1		STK	4.400	4.400	0	DKK	698,2000	412.155,04	1,00
DE0008404005	Allianz SE		STK	1.200	0	600	EUR	240,6500	288.780,00	0,70
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	900	100	0	EUR	685,9000	617.310,00	1,50
FR0000125338	Capgemini SE		STK	1.000	0	2.400	EUR	189,8000	189.800,00	0,46
FR001400AJ45	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50		STK	14.400	0	0	EUR	32,3600	465.984,00	1,13
DE0005552004	Deutsche Post AG ²⁾		STK	19.900	0	0	EUR	44,7000	889.530,00	2,16
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	17.000	0	0	EUR	21,6150	367.455,00	0,89
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.		STK	1.800	0	4.000	EUR	180,9600	325.728,00	0,79
ES0144580Y14	Iberdrola		STK	31.410	1.328	1	EUR	11,8250	371.423,25	0,90
FR0000120321	L'Oréal		STK	500	0	800	EUR	451,3000	225.650,00	0,55
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SA		STK	400	600	700	EUR	731,0000	292.400,00	0,71
DE0008430026	Münchener Rückversicherung AG		STK	550	550	0	EUR	376,8000	207.240,00	0,50
DE0007164600	SAP SE		STK	2.200	0	0	EUR	139,6400	307.208,00	0,75
FR0000121972	Schneider Electric		STK	1.700	0	4.300	EUR	181,3600	308.312,00	0,75
FR0000120271	TotalEnergies SE		STK	5.000	5.000	0	EUR	61,4100	307.050,00	0,75
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.		STK	10.800	0	0	EUR	34,4200	371.736,00	0,90
FR0000125486	VINCI		STK	1.500	1.500	4.700	EUR	113,5600	170.340,00	0,41
GB0007908733	SSE PLC Shs LS-,50		STK	10.000	0	0	GBP	18,5650	213.439,87	0,52
FI4000297767	Nordea Bank Abp		STK	25.000	0	0	SEK	124,2800	281.179,02	0,68
US00724F1012	Adobe Systems Inc.		STK	1.000	0	1.100	USD	595,5200	536.166,38	1,30
US02079K3059	Alphabet Inc. Cl. A		STK	4.000	0	0	USD	140,2300	505.014,86	1,23
US0378331005	Apple Inc.		STK	3.000	400	0	USD	193,5800	522.859,46	1,27
CA1363751027	Canadian National Railway Co.		STK	2.700	0	0	USD	125,1000	304.105,52	0,74
US17275R1023	Cisco Systems Inc.		STK	3.000	3.000	14.200	USD	50,4800	136.346,45	0,33
US2441991054	Deere		STK	600	600	0	USD	399,2600	215.680,20	0,52
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co.		STK	1.900	0	0	USD	170,3000	291.320,79	0,71
US5949181045	Microsoft Corp.		STK	1.500	0	1.500	USD	375,2800	506.815,52	1,23
US6541061031	Nike		STK	4.200	0	1.700	USD	108,8200	411.491,85	1,00
US7010941042	Parker-Hannifin		STK	600	0	0	USD	461,9600	249.550,73	0,61
US7134481081	PepsiCo Inc		STK	4.500	2.600	0	USD	169,3900	686.283,42	1,67
US7427181091	Procter & Gamble		STK	2.200	0	0	USD	145,7300	288.652,20	0,70
US92826C8394	VISA Inc. Class A		STK	1.000	1.000	1.200	USD	260,4000	234.446,75	0,57
US94106L1098	Waste Management		STK	1.700	0	0	USD	178,1400	272.655,08	0,66

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
Verzinsliche Wertpapiere							EUR		15.040.340,84	36,53
DE000A3H2ZX9	0.1000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R. 35384 v.21(26)		EUR	900	0	0	%	89,7984	808.185,49	1,96
XS2397077426	0.1250% Commonwealth Bank of Australia EO-MT Cov. Bds 21/29		EUR	860	0	0	%	85,5795	735.983,51	1,79
FR0013403441	1.2500% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 19/24		EUR	900	0	0	%	99,6595	896.935,50	2,18
XS2502850865	1.6250% EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2022(27)		EUR	250	0	0	%	96,8605	242.151,25	0,59
AT0000A308C5	2.0000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(26)		EUR	250	0	0	%	99,2694	248.173,44	0,60
DE0001104909	2.2000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)		EUR	250	0	0	%	99,2225	248.056,25	0,60
XS0936339208	2.2500% Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2013(25)		EUR	400	200	0	%	98,8503	395.401,21	0,96
FR0011619436	2.2500% Frankreich EO-OAT 13/24		EUR	250	0	0	%	99,4605	248.651,25	0,60
DE000A30VUG3	2.5000% Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN-IHS v.22(25)		EUR	250	0	0	%	99,9085	249.771,25	0,61
US9128285U08	2.6250% United States of America DL-Notes 2018(23)		USD	800	800	0	%	99,9492	719.900,73	1,75
FR001400IJT3	3.2500% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/28)		EUR	500	500	0	%	102,3950	511.975,00	1,24
XS2584685031	3.6250% RWE AG Medium Term Notes v.23(28/29)		EUR	400	400	0	%	103,6475	414.590,19	1,01
FR001400IIR9	3.7500% La Poste EO-Med.-Term Notes 23(23/30)		EUR	400	400	0	%	104,1310	416.524,00	1,01
ES00000124W3	3.8000% Spanien EO-Bonos 14/24		EUR	800	800	0	%	100,0100	800.080,00	1,94
XS2655865546	3.8500% Toyota Motor Credit Corp. EO-Medium-Term Notes 2023(30)		EUR	400	400	0	%	104,6340	418.536,00	1,02
XS2637963146	3.8750% ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26)		EUR	400	400	0	%	102,2173	408.869,02	0,99
XS2586944659	3.8750% Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)		EUR	400	400	0	%	104,2735	417.094,00	1,01
XS2672452237	4.0000% Continental AG MTN v. 23(27/27)		EUR	400	400	0	%	102,4561	409.824,51	1,00
US437076CR18	4.0000% Home Depot Inc., The DL-Notes 2022(22/25)		USD	400	400	0	%	99,1840	357.194,56	0,87
FR001400I4X9	4.1250% BNP Paribas S.A. EO-Preferred MTN 2023(33)		EUR	400	400	0	%	106,3662	425.464,74	1,03
XS2547270756	4.1250% Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(28)		EUR	800	800	0	%	103,7065	829.652,00	2,01
XS2595418596	4.2500% BASF SE MTN v. 2023(2023/2032)		EUR	400	400	0	%	107,3385	429.354,00	1,04
DE000BLB6JZ6	4.2500% Bayerische Landesbank 23/27		EUR	400	400	0	%	102,6222	410.488,77	1,00
FR001400FDB0	4.2500% Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2023(23/32)		EUR	400	400	0	%	105,6020	422.408,00	1,03
XS2623956773	4.2500% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)		EUR	400	400	0	%	105,8695	423.478,00	1,03

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
XS2676863355	4.2500% Koninklijke Philips N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)		EUR	400	400	0	%	103,1040	412.416,00	1,00
SK4120007543	4.3500% Slowakei EO-Anl. 10/25		EUR	800	800	0	%	102,3400	818.720,00	1,99
US64110LAN64	4.3750% Netflix Inc. DL-Notes 2016(16/26)		USD	400	400	0	%	99,6310	358.804,36	0,87
XS2555220941	4.5000% Booking Holdings Inc. EO-Notes 2022(22/31)		EUR	400	400	0	%	109,6315	438.526,00	1,07
XS2630111719	4.6250% Bayer AG MTN v. 2023(2033/2033)		EUR	400	400	0	%	105,3360	421.344,00	1,02
XS2694872594	4.6250% Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.23(29)		EUR	400	400	0	%	105,9179	423.671,56	1,03
XS0513509959	4.7500% TenneT Holding B.V. EO-Medium-Term Notes 2010(30)		EUR	250	250	0	%	111,2465	278.116,25	0,68
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								EUR	7.625.351,62	18,52
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	7.625.351,62	18,52
XS2262263622	0.0100% Ontario, Provinz EO-Medium-Term Notes 2020(30)		EUR	900	0	0	%	83,4412	750.971,06	1,82
XS1752475720	1.0000% Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2018(27/27)		EUR	850	0	0	%	93,9302	798.406,63	1,94
DE000DL19VR6	1.0000% Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(24/25)		EUR	900	0	0	%	97,2815	875.533,50	2,13
US91282CEG24	2.2500% United States of America DL-Notes 2022(24)		USD	1.000	1.000	0	%	99,2441	893.527,87	2,17
US91282CEX56	3.0000% United States of America DL-Notes 2022(24) Ser. BD-2024		USD	1.000	1.000	0	%	98,9375	890.767,08	2,16
XS2631416950	3.5000% ASML Holding N.V. EO-Notes 2023(23/25)		EUR	400	400	0	%	100,8455	403.382,00	0,98
XS2634593854	3.6250% Linde plc EO-Notes 2023(23/25)		EUR	400	400	0	%	100,7158	402.863,38	0,98
XS2623221228	3.8750% Daimler Truck Intl Finance EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)		EUR	400	400	0	%	103,7676	415.070,33	1,01
US91282CFN65	4.2500% United States of America DL-Bonds 22/24		USD	1.000	1.000	0	%	99,5039	895.866,62	2,18
US023135CN43	4.6000% Amazon.com Inc. DL-Notes 2022(22/25)		USD	400	400	0	%	100,3420	361.364,91	0,88
XS2561647368	4.6250% Liberty Mutual Group Inc. EO-Notes 2022(22/30) Reg.S		EUR	200	300	100	%	105,4725	210.945,00	0,51
US91282CGR60	4.6250% United States of America DL-Notes 2023(26)		USD	800	800	0	%	100,8867	726.653,24	1,76
Investmentanteile								EUR	6.198.997,96	15,06
Gruppenfremde Investmentanteile								EUR	6.198.997,96	15,06
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF		ANT	27.860	29.300	1.440	EUR	139,5500	3.887.863,00	9,44
LU0321465469	Xtrackers II USD Cash Swap Inhaber-Anteile 1C o.N.		ANT	13.420	16.620	3.200	USD	191,2800	2.311.134,96	5,61
Summe Wertpapiervermögen								EUR	40.854.646,92	99,22

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
Derivate							EUR	-105.719,34	-0,26
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-184.858,62	-0,45
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	-184.858,62	-0,45
Optionsrechte auf Aktien							EUR	-184.858,62	-0,45
	Put Logitech *Amerikanisch* 64,000000000	XEUR	STK	-6.000			CHF 0,7100	-4.586,81	-0,01
	15.03.2024								
	Put Novo-Nordisk AS 600,000000000	XCSE	STK	-5.000			DKK 10,3200	-6.922,74	-0,02
	15.03.2024								
	Call Deutsche Post 46,000000000	XEUR	STK	-10.900			EUR 0,3900	-4.251,00	-0,01
	19.01.2024								
	Put ASM INTL N.V. *Amsterdam* 400,000000000	XAMS	STK	-1.000			EUR 7,0800	-7.080,00	-0,02
	15.03.2024								
	Put ASML Amsterdam 580,000000000	XAMS	STK	-700			EUR 3,3800	-2.366,00	-0,01
	16.02.2024								
	Put BE Semiconductor Inds N.V. 105,000000000	XAMS	STK	-3.800			EUR 1,5000	-5.700,00	-0,01
	15.03.2024								
	Put Capgemini S.A. *Paris* 160,000000000	XPAR	STK	-2.500			EUR 1,3600	-3.400,00	-0,01
	15.03.2024								
	Put Deutsche Bank 10,000000000	XEUR	STK	-40.000			EUR 0,0800	-3.200,00	-0,01
	15.03.2024								
	Put Ferrari N.V. *Milan* 320,000000000	XMIL	STK	-1.300			EUR 20,0806	-26.104,78	-0,06
	15.03.2024								
	Put Hermes Internat. *Paris* 1800,000000000	XPAR	STK	-200			EUR 40,7200	-8.144,00	-0,02
	15.03.2024								
	Put Infineon 32,000000000	XEUR	STK	-12.500			EUR 0,4200	-5.250,00	-0,01
	15.03.2024								
	Put Merck *DE* 150,000000000	XEUR	STK	-2.700			EUR 10,3600	-27.972,00	-0,07
	15.03.2024								
	Put Siemens 146,000000000	XEUR	STK	-2.800			EUR 0,9500	-2.660,00	-0,01
	16.02.2024								
	Put Accenture 310,000000000	XNAS	STK	-1.400			USD 0,8250	-1.039,88	0,00
	16.02.2024								
	Put Airbnb Inc. 110,000000000	XNAS	STK	-3.800			USD 0,1150	-393,45	0,00
	19.01.2024								
	Put Alphabet Option A-Share 120,000000000	XNAS	STK	-3.600			USD 0,6400	-2.074,37	-0,01
	16.02.2024								
	Put Amazon.Com 110,000000000	XNAS	STK	-3.900			USD 0,1750	-614,48	0,00
	16.02.2024								
	Put Amgen 240,000000000	XNAS	STK	-1.800			USD 0,5550	-899,43	0,00
	16.02.2024								
	Put Amgen 250,000000000	XNAS	STK	-1.700			USD 2,5550	-3.910,60	-0,01
	19.04.2024								
	Put Arista Networks Inc. 195,000000000	XNAS	STK	-2.200			USD 3,1000	-6.140,27	-0,01
	15.03.2024								
	Put Booking Holdings 2850,000000000	XCBO	STK	-100			USD 14,8500	-1.336,99	0,00
	15.03.2024								
	Put Chipotle Mexican Grill 2000,000000000	XNAS	STK	-200			USD 15,2000	-2.737,01	-0,01
	16.02.2024								
	Put Cisco Systems 47,500000000	XCBO	STK	-9.000			USD 0,1050	-850,81	0,00
	19.01.2024								
	Put CME Group 200,000000000	XNAS	STK	-2.200			USD 3,4000	-6.734,49	-0,02
	15.03.2024								
	Put Costco Wholesale *Kapitalmaßnahme* 515,000000000	XCBO	STK	-800			USD 0,5150	-370,94	0,00
	16.02.2024								
	Put Eaton Corp 210,000000000	XNYS	STK	-2.000			USD 0,5750	-1.035,38	0,00
	19.01.2024								
	Put Eli Lilly 550,000000000	XNAS	STK	-800			USD 16,1500	-11.632,30	-0,03
	16.02.2024								
	Put Intuit Inc. 430,000000000	XNAS	STK	-1.000			USD 0,5149	-463,59	0,00
	19.01.2024								
	Put KLA Corp. 490,000000000	XNAS	STK	-900			USD 5,3000	-4.294,59	-0,01
	15.03.2024								
	Put Mastercard 390,000000000	XCBO	STK	-1.100			USD 5,0000	-4.951,83	-0,01
	19.04.2024								

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Put Meta Platforms Inc. 245,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-1.700			USD 0,4850	-742,32	0,00
Put MetLife Inc. 57,500000000 19.01.2024		XNAS	STK	-7.500			USD 0,0504	-340,61	0,00
Put Microsoft 300,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-1.400			USD 0,5600	-705,86	0,00
Put Oracle 105,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-4.200			USD 2,7300	-10.323,22	-0,03
Put Palo Alto Networks Inc. 210,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-1.900			USD 0,3550	-607,27	0,00
Put Parker-Hannifin Corp Option 370,000000000 16.02.2024		XNYS	STK	-1.100			USD 0,6000	-594,22	0,00
Put Qualcomm 120,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-3.700			USD 0,4850	-1.615,65	0,00
Put ServiceNow 610,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-700			USD 5,4500	-3.434,77	-0,01
Put T-Mobile US Inc. 135,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-1.700			USD 0,4500	-688,75	0,00
Put T-Mobile US Inc. 135,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-1.500			USD 0,4500	-607,72	0,00
Put Tesla Motors 150,000000000 16.02.2024		XNAS	STK	-2.800			USD 0,3300	-831,91	0,00
Put Wal-Mart Stores Inc. 150,000000000 19.01.2024		XNAS	STK	-2.800			USD 0,3450	-869,72	0,00
Put Zoetis Inc. 165,000000000 19.04.2024		XNAS	STK	-2.600			USD 2,7250	-6.378,86	-0,02
Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	79.139,28	0,19
Währungsterminkontrakte							EUR	79.139,28	0,19
FUTURES EUR/USD 03/24		XCME	STK	6.000.000				79.139,28	0,19
Bankguthaben							EUR	165.333,78	0,40
EUR - Guthaben bei:							EUR	49.785,52	0,12
Bank: National-Bank AG			EUR	1,35				1,35	0,00
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	0,20				0,20	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	49.783,97				49.783,97	0,12
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							EUR	37.023,97	0,09
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			DKK	111.264,24				14.927,38	0,04
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			NOK	202.712,34				17.999,52	0,04
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			SEK	45.272,24				4.097,07	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	78.524,29	0,19
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	17.000,45				18.304,66	0,04
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			GBP	10.085,19				11.594,84	0,03
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	54.007,55				48.624,79	0,12
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	308.518,59	0,75
Dividendenansprüche			EUR	6.215,24				6.215,24	0,02
Quellensteueransprüche			EUR	596,22				596,22	0,00
Zinsansprüche			EUR	301.707,13				301.707,13	0,73

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							EUR	-47.624,87	-0,12
Sonstige Verbindlichkeiten									
Sonstige Verbindlichkeiten ³⁾			EUR	-47.624,87				-47.624,87	-0,12
Fondsvermögen							EUR	41.175.155,08	100,00
Anteilwert CA Familienstrategie A							EUR	102,95	
Anteilwert CA Familienstrategie B							EUR	100,72	
Umlaufende Anteile CA Familienstrategie A							STK	388.580,000	
Umlaufende Anteile CA Familienstrategie B							STK	11.641,000	

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

²⁾ Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren. Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind: 487.230,00 EUR.

³⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.12.2023		
Britisches Pfund	(GBP)	0,869800	=	1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,453700	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	11,262100	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	11,049900	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,928750	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,110700	=	1 Euro (EUR)

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XAMS	NYSE EURONEXT - EURONEXT AMSTERDAM
XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
XCME	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
XCSE	OMX NORDIC EXCHANGE COPENHAGEN A/S
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND
XMIL	BORSA ITALIANA S.P.A.
XNAS	NASDAQ - ALL MARKETS
XNYS	NEW YORK STOCK EXCHANGE, INC.
XPAR	NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
US0311621009	Amgen Inc.	STK	1.600	2.900
US0584981064	Ball Corp.	STK	0	7.000
US09075V1026	BioNTech SE Nam.-Akt.(sp.ADRs)1/o.N.	STK	1.500	1.500
US1491231015	Caterpillar	STK	1.700	1.700
US20030N1019	Comcast Corp. Class A	STK	0	5.100
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	STK	0	10.900
US1266501006	CVS Health Corp.	STK	0	4.100
US2358511028	Danaher	STK	1.900	1.900
DE000DWS1007	DWS Group GmbH & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	STK	0	7.000
IE00B8KQN827	Eaton Corporation	STK	0	4.600
CA29250N1050	Enbridge	STK	0	4.000
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01	STK	1.000	1.000
US4470111075	Huntsman	STK	15.800	15.800
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK	0	14.000
IE00BTN1Y115	Medtronic PLC	STK	0	4.200
NO0003054108	Mowi ASA	STK	0	15.800
DK0060094928	Orsted A/S	STK	5.200	5.200
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc.	STK	0	7.200
US79466L3024	Salesforce Inc.	STK	0	3.900
DE0007236101	Siemens	STK	4.600	7.600
DE000SYM9999	Symrise	STK	4.200	4.200
US92338C1036	Veralto Corp. Registered Shares o.N.	STK	627	627
US2546871060	Walt Disney Co., The	STK	4.900	4.900
Verzinsliche Wertpapiere				
DE0001104867	0.0000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	EUR	800	800
FI4000219787	0.0000% Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23)	EUR	800	800
BE0000339482	0.2000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(23) Ser. 79	EUR	800	800
XS2648672660	3.8750% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)	EUR	800	800
XS2554488978	4.2500% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(28)	EUR	400	400
Sonstige Beteiligungswertpapiere				
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	STK	1.400	2.200
Andere Wertpapiere				
ES06445809Q1	Iberdrola Anrechte	STK	30.584	30.584
ES06445809P3	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	30.083	30.083

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):				
ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
ES0144583285	Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.07/23 EO -,75	STK	827	827
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	0	2.200
Verzinsliche Wertpapiere				
US9128285D82	2.8671% United States of America DL-Notes 2018(23)	USD	800	800
Nicht notierte Wertpapiere				
Aktien				
ES0144583277	Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.01/23 EO -,75	STK	501	501
Investmentanteile				
KVG - eigene Investmentanteile				
DE000A3CNGA8	Aramea Rendite Global Nachhalt Inhaber-Anteile I	ANT	0	20.000
DE000A1J67R2	Rücklagenfonds I	ANT	0	2.425
Gruppenfremde Investmentanteile				
DE000A0M6W36	CSR Bond Plus OP	ANT	0	22.073

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte: S&P 500 Index)	EUR			1.831
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte: ESTX 50 Index (Price) (EUR) S&P 500 Index)	EUR			88.137
Währungsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte: Euro/US-Dollar)	EUR			13.068
Optionsrechte				
Wertpapier-Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktien				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte: Adobe Systems Inc. Amgen Inc. Apple Inc. ASML Holding N.V. Capgemini SE Cisco Systems Inc.)	EUR			231

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.				
CVS Health Corp.				
Deutsche Post AG				
Eaton Corporation				
EssilorLuxottica S.A.				
Huntsman				
Infineon Technologies AG				
L' Oréal				
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SA				
Microsoft Corp.				
Orsted A/S				
PayPal Holdings Inc.				
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.				
Salesforce Inc.				
Schneider Electric				
Siemens				
The				
VINCI				
VISA Inc. Class A				
Walt Disney Co.				
Zurich Insurance Group AG)				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			1.227
Adobe Systems Inc.				
Airbus Group SE				
Allianz SE				
Alphabet Inc. Cl. A				
Amgen Inc.				
Apple Inc.				
Arista Networks Inc.				
ASM International N.V.				
ASML Holding N.V.				
BNP Paribas S.A.				
Canadian National Railway Co.				
Capgemini SE				
Caterpillar				
Cie Financière Richemont				
Cisco Systems Inc.				
Continental				
Costco Wholesale Corp.				
Danaher				
Deere				
Delta Air Lines				
Deutsche Telekom AG				
Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N				
Eaton Corporation				
EssilorLuxottica S.A.				
Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01				

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Hermes International				
Huntsman				
IDEXX Laboratories Inc.				
Infineon Technologies AG				
ING Groep				
JPMorgan Chase & Co.				
Kering S.A.				
L'Oréal				
Linde PLC				
Linde plc Registered Shares EO -,001				
Logitech International S.A.				
Lululemon Athletica Inc. Registered Shares o.N.				
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SA				
Merck				
MetLife				
Microsoft Corp.				
Mowi ASA				
MSCI Inc. Registered Shares A DL -,01				
Netflix Inc.				
Novo-Nordisk AS				
NVIDIA Corp.				
O'Reilly Automotive Inc.				
Old Dominion Freight Line Inc.				
Orsted A/S				
Palo Alto Networks Inc.				
Parker-Hannifin				
PepsiCo Inc				
Procter & Gamble				
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.				
Salesforce Inc.				
SAP SE				
Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N.				
Schneider Electric				
Siemens				
Siemens Energy AG				
Symrise				
T-Mobile US Inc. Registered Shares DL-,00001				
The				
TotalEnergies SE				
UPM Kymmene Corp.				
Veolia Environnement S.A.				
VINCI				
VISA Inc. Class A				
Walt Disney Co.				
Waste Management				
Wolters Kluwer N.V.				
Zoetis Inc. Registered Shares Cl.A DL -,01				

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Zurich Insurance Group AG)				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			1.203
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
S&P 500 Index)				

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) CA FAMILIENSTRATEGIE A

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2023 BIS 31.12.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller		77.119,83
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		246.767,35
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		66.636,50
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		267.972,21
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		64.121,80
davon negative Habenzinsen	-2,60	
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-47.588,94
7. Sonstige Erträge		3.301,26
Summe der Erträge		678.330,01
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-3.116,64
2. Verwaltungsvergütung		-306.244,09
3. Verwahrstellenvergütung		-11.481,20
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-10.238,58
5. Sonstige Aufwendungen		-5.414,71
6. Aufwandsausgleich		119,99
Summe der Aufwendungen		-336.375,23
III. Ordentlicher Nettoertrag		341.954,78
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		2.440.599,84
2. Realisierte Verluste		-4.344.030,58
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-1.903.430,74
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.561.475,96
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.331.148,80
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		3.313.273,29
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		4.644.422,09
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		3.082.946,13

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) CA FAMILIENSTRATEGIE B

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2023 BIS 31.12.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller		2.264,57
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		7.247,01
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		1.954,22
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		7.863,36
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		1.841,09
davon negative Habenzinsen	-0,08	
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-1.398,20
7. Sonstige Erträge		97,13
Summe der Erträge		19.869,18
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-91,75
2. Verwaltungsvergütung		-11.359,56
3. Verwahrstellenvergütung		-337,29
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-879,11
5. Sonstige Aufwendungen		-159,06
6. Aufwandsausgleich		12,13
Summe der Aufwendungen		-12.814,64
III. Ordentlicher Nettoertrag		7.054,54
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		71.724,17
2. Realisierte Verluste		-127.638,33
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-55.914,16
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-48.859,62
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		38.475,64
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		97.895,38
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		136.371,02
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		87.511,40

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE A

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.01.2023)		37.896.027,42
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		-945.384,30
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-30.033,81
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-30.033,81	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-880,60
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		3.082.946,13
davon nicht realisierte Gewinne	1.331.148,80	
davon nicht realisierte Verluste	3.313.273,29	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.12.2023)		40.002.674,84

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE B

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.01.2023)		1.117.596,96
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		-27.763,79
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-4.860,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-4.860,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-4,33
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		87.511,40
davon nicht realisierte Gewinne	38.475,64	
davon nicht realisierte Verluste	97.895,38	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.12.2023)		1.172.480,24

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE A ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	13.657.094,45	35,15
1. Vortrag aus dem Vorjahr	10.874.539,83	27,99
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.561.475,96	-4,02
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	4.344.030,58	11,18
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-12.656.112,37	-32,57
1. Der Wiederanlage zugeführt	-6.655.711,14	-17,13
2. Vortrag auf neue Rechnung	-6.000.401,23	-15,44
III. Gesamtausschüttung	1.000.982,08	2,58
1. Endausschüttung	1.000.982,08	2,58
a) Barausschüttung	1.000.982,08	2,58

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE B ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar	245.701,29	21,11
1. Vortrag aus dem Vorjahr	166.922,58	14,34
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-48.859,62	-4,20
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	127.638,33	10,96
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	-216.365,97	-18,59
1. Der Wiederanlage zugeführt	-40.493,93	-3,48
2. Vortrag auf neue Rechnung	-175.872,04	-15,11
III. Gesamtausschüttung	29.335,32	2,52
1. Endausschüttung	29.335,32	2,52
a) Barausschüttung	29.335,32	2,52

¹⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung von EUR 0,00)

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE CA FAMILIENSTRATEGIE A

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	40.002.674,84	102,95
2022	37.896.027,42	97,45
2021	42.207.529,60	108,42
2020	36.449.249,63	103,54

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE CA FAMILIEN-STRATEGIE B

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2023	1.172.480,24	100,72
2022	1.117.596,96	95,59
2021	1.178.701,30	106,58
2020	1.067.652,00	102,07

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	2.260.620,77
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Donner & Reuschel AG		
Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.		
Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)		
EURO STOXX 50 Index In EUR		75,00%
JP Morgan GBI European Bond Index in EUR		25,00%
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,32%
größter potenzieller Risikobetrag		1,63%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		0,81%
Risikomodell (§10 DerivateV)		Full-Monte-Carlo
Parameter (§11 DerivateV)		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr
Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte		1,09

ZUSÄTZLICHE ANHANGANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 BETREFFEND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

SONSTIGE ANGABEN

Anteilwert CA Familienstrategie A	EUR	102,95
Anteilwert CA Familienstrategie B	EUR	100,72
Umlaufende Anteile CA Familienstrategie A	STK	388.580,000
Umlaufende Anteile CA Familienstrategie B	STK	11.641,000

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	CA Familienstrategie A	CA Familienstrategie B
ISIN	DE000A2JQJB0	DE000A2QAYB8
Währung	Euro	Euro
Fondsauflage	10.01.2019	01.10.2020
Ertragsverwendung	Ausschüttend	Ausschüttend
Verwaltungsvergütung	0,80 % p.a.	1,01 % p.a.
Ausgabeaufschlag	7,00 %	3,00 %
Mindestanlagevolumen	5.000.000	0

ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

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

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

Die bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

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

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE CA FAMILIENSTRATEGIE A

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,87 %
---	--------

ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE CA FAMILIENSTRATEGIE B

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	1,13 %
---	--------

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

TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.01.2023 BIS 31.12.2023

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	258.492.043,14
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	258.492.043,14
Relativ in %	100,00 %

Transaktionskosten: 96.781,81 EUR

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurden keine Pauschalvergütungen an die Kapitalverwaltungsgesellschaft oder an Dritte gezahlt.

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

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

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

VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
DE000A3CNGA8	Aramea Rendite Global Nachhalt Inhaber-Anteile I ¹⁾	0,65
DE000A0M6W36	CSR Bond Plus OP ¹⁾	0,34
DE000A1J67R2	Rücklagenfonds I ¹⁾	0,45
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF ¹⁾	0,15
LU0321465469	Xtrackers II USD Cash Swap Inhaber-Anteile 1C o.N. ¹⁾	0,05

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

CA Familienstrategie A

Sonstige Erträge

Quellensteuer Erstattung	EUR	3.301,26
--------------------------	-----	----------

Sonstige Aufwendungen

Marktrisiko- und Liquiditätsmessung DerivateV	EUR	4.287,28
---	-----	----------

CA Familienstrategie B

Sonstige Erträge

Quellensteuer Erstattung	EUR	97,13
--------------------------	-----	-------

Sonstige Aufwendungen

Marktrisiko- und Liquiditätsmessung DerivateV	EUR	125,92
---	-----	--------

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 Tarifvertrag für das private Versicherungsgewerbe. 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 und die Generalbevollmächtigten 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 FESTGELEGTE VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2023 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)	EUR	26.098.993
davon feste Vergütung	EUR	21.833.752
davon variable Vergütung	EUR	4.265.241
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)		332
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen	EUR	1.475.752
davon Geschäftsleiter	EUR	1.105.750
davon andere Führungskräfte	EUR	370.002

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der Aramea Asset Management AG für das Geschäftsjahr 2022 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager	Aramea Asset Management AG
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR 5.944.132,00
davon feste Vergütung	EUR 3.420.277,00
davon variable Vergütung	EUR 2.523.855,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR 0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens	27

Die Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung umfasst den Aufwandsposten Personalaufwendungen ohne soziale Abgaben. Die Angaben hat das Auslagerungsunternehmen selbst veröffentlicht.

ANGABEN FÜR INSTITUTIONELLE ANLEGER GEMÄSS § 101 ABS. 2 NR. 5 KAGB I.V.M. § 134C ABS. 4 AKTG

Anforderung

Angaben zu den mittel- bis langfristigen Risiken

Zusammensetzung des Portfolios,
Portfolioumsätze und Portfolioumsatzkosten

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

Einsatz von Stimmrechtsvertretern

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

Hamburg, 18. April 2024

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

Verweis

Informationen zu den mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens werden im Tätigkeitsbericht aufgeführt.

Informationen über die Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten sind im Jahresbericht in den Abschnitten "Vermögensaufstellung", "Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen" und "Angaben zur Transparenz und zur Gesamtkostenquote" verfügbar.

Aktien, die auf einem geregelten Markt gehandelt werden, unterliegen verschiedenen mittel- und langfristigen Risiken.
Die Einschätzung dieser Risiken ist ein grundlegender Bestandteil der Anlagestrategie und -politik.

Informationen zur Stimmrechtsausübung sind auf der Internetseite der HANSAINVEST erhältlich.

Für das Sondervermögen sind im Berichtszeitraum keine Wertpapierleihegeschäfte abgeschlossen worden.
Auf der Internetseite der HANSAINVEST sind Informationen zum Umgang mit Interessenkonflikten verfügbar.

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,
Hamburg

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens CA Familienstrategie – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

teil zum Jahresbericht zu dienen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

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

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

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

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

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* abzugeben
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

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

Hamburg, den 19.04.2024

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner
Wirtschaftsprüfer

Lüning
Wirtschaftsprüfer

Allgemeine Angaben

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96

Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70

E-Mail: info@hansainvest.de

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 28,189 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2022

GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
 - Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth (bis zum 07.11.2023)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Dr. Stefan Lemke (ab dem 15.02.2024)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, Mitglied des Vorstandes der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Markus Barth

- Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg
- Dr. Thomas A. Lange
 - Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen
- Prof. Dr. Harald Stützer
 - Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach
- Prof. Dr. Stephan Schüller
 - Kaufmann

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- Dr. Jörg W. Stotz
 - (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG)
- Nicholas Brinckmann (bis zum 10.02.2024)
 - (zugleich Sprecher der Geschäftsführung HANSAINVEST Real Assets GmbH)
- Claudia Pauls (ab dem 01.04.2024)
- Ludger Wibbeke
 - (zugleich stellvertretender Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

VERWAHRSTELLE

Donner & Reuschel AG
Ballindamm 27
20095 Hamburg

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

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhlentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

info@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST