

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

# JAHRESBERICHT

AW Strategie Global Ausgewogen

30. November 2023

**HANSA**INVEST

## Inhaltsverzeichnis

---

|  |    |
|--|----|
| Tätigkeitsbericht AW Strategie Global Ausgewogen | 4  |
| Vermögensübersicht                               | 8  |
| Vermögensaufstellung                             | 9  |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV                      | 17 |
| Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers        | 21 |
| Allgemeine Angaben                               | 24 |

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

AW Strategie Global Ausgewogen

in der Zeit vom 01.12.2022 bis 30.11.2023.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

# Tätigkeitsbericht AW Strategie Global Ausgewogen für das Geschäftsjahr vom 01.12.2022 bis 30.11.2023

## Anlageziele und -strategie

Der Anlageschwerpunkt des Fonds liegt in festverzinslichen Wertpapieren. Er verfolgt das Ziel, die wechselnden Chancen an den Rentenmärkten durch eine flexible Aufteilung möglichst optimal zu nutzen. Der Fonds ist global orientiert und soll auch die Möglichkeiten verschiedener regionaler Rentenmärkte inklusive potentieller Zinsvorteile aufgreifen. Er investiert dabei schwerpunktmäßig in aktiv aktiv gemanagte Investmentfonds oder auch ETF's aus dem Rentensektor sowie auch in selektive Renteneinzeltitel. Ergänzend sind Investments in konservative derivative Strukturen und Zertifikate sowie Alternative Strategien bzw. Absolute-Return-Ansätze möglich. Hierdurch soll die Wertentwicklung bei Schwankungen im Rentenmarkt verstetigt werden.

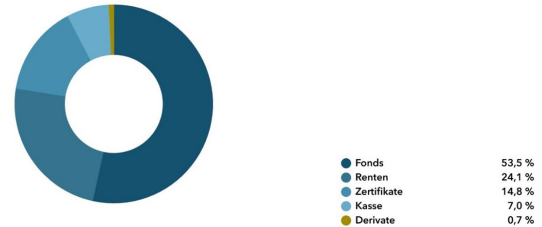
Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Der Fonds ist damit gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 zu qualifizieren.

## Anlagepolitik im Berichtszeitraum

Die Struktur des Fonds sah zu Beginn der Berichtsperiode wie folgt aus: Ca. 24% des Fonds waren in 27 Einzeltiteln aus dem Rentenmarkt investiert, davon ca. 7% in unterschiedliche Währungen. 48% des Fonds waren in Rentenfonds oder ETF's investiert, wovon der europäische Sektor mit ca. 22% den größten Anteil ausmachte. Fonds mit alternativen Strategien nahmen ca. 5% ein. Die Positionen im US-Dollar waren weitestgehend abgesichert. Ca. 15% steckten im Zertifikatebereich, allesamt BonusCap-Strukturen auf den EuroStoxx50. Die Liquiditätsquote lag bei ca. 7%.

## Portfoliostruktur:

per 01.12.2022\*



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

Gegen Ende des Jahres 2022 zogen die Zinsen am Kapitalmarkt nochmals leicht an, die Rendite der 10-jährigen US-Treasuries stieg auf ca. 3,8%. Parallel gaben die Aktien erneut nach, der Dax fiel bis auf ca. 14.000 Punkte. In die gestiegene Volatilität wurde ein Deep Bonuszertifikat auf den EuroStoxx50 erworben mit einer Rendite von ca. 6,4% bei ca. 47% Puffer, Laufzeit 16 Monate. Zudem wurde in dieser Phase die erste Position eines Wandelanleihenfonds gekauft.

Das erste Quartal begann zunächst mit einer leichten Beruhigung bei Bund Future und Treasuries. Im Fonds wurden leichte Gewinnmitnahmen bei einem ETF mit 7-10-jährigen US-Anleihen getätigt. Im März wurde der Markt bestimmt von erheblichen Problemen im Bankensektor. Die Credit Suisse wurde aufgrund von Liquiditätsproblemen von der UBS übernommen, die SVB in USA brach zusammen. Dies sorgte für erhebliche Stresssituationen im Renten- und Geldmarkt sowie im Bankensystem allgemein, die Spreads liefen auseinander. Insbesondere kleinere, seit Trump weniger regulierte US-Banken hatten Liquiditätsprobleme und gerieten unter Druck. Die Fed stellte dem Markt Liquidität zur Verfügung und beruhigte das Geschehen zunächst. In dieser Korrekturphase wurde der Sektor Wandelanleihen aufgestockt, sowie ein gemischter Rentenfonds mit höher verzinslichen Hartwährungen für 2% Gewichtung neu aufgenommen. Trotz der angespannten Lage erhöhte die EZB die Leitzinsen in 3 Schritten auf 3,5% bis Mitte März. Im Fonds waren keine Anleihen oder Zertifikate der Credit Suisse enthalten. Gegen Ende des 1. Quartals wurde mit 11,5% Mutares eine vielversprechende Neuemission für knapp 1% Gewicht gezeichnet.

Der schon seit Beginn 2022 zu beobachtende deutliche Zinsanstieg war ursächlich für die Schieflage einzelner US-Banken. Er könnte zusätzlich den besonders zinsensensitiven Immobilienmarkt stärker in Mitleidenschaft ziehen. Die inverse Zinsstrukturkurve am Anleihenmarkt signalisierte noch immer eine bevorstehende Rezession, sowohl für die USA als auch für Europa. Die jüngst aufgetauchten Probleme im Bankensektor könnten zu einer Verschärfung der finanziellen Konditionen führen, was zumeist schwächere Schuldner eher trifft. Im 2. Quartal wurden daher bessere Bonitäten bevorzugt. Für den Fonds wurde eine Anleihe des Landes NRW sowie eine Anleihe Norwegens in Norwegischen Kronen gekauft, um auch die Währung leicht zu diversifizieren. Die Laufzeiten im Fonds sollten von nun an schrittweise dosiert verlängert werden. Daher wurde die im Januar mit Gewinn verkaufte Position wieder aufgenommen. Zudem wurde eine erste Position in einen ETF mit Bundespapieren mit einer Laufzeit von 7-10 Jahren getätigt. Ein fälliges Bonuszertifikat, erzielte Rendite ca. 4,7%, wurde aufgrund fehlender attraktiver Konditionen in diesem Segment zunächst nicht reinvestiert.

Ende Juli erhöhten FED und EZB ihre Leitzinssätze nochmals von 5,25% auf 5,5% bzw. 4,25%, die EZB erhöhte sie im September erneut auf 4,5 %. Die Inflation war zwar weiter rückläufig, blieb aber größtenteils aufgrund von Basiseffekten erhöht. Die schnellsten und stärksten Zinserhöhungen der Notenbanken seit Jahrzehnten, allein die FED erhöhte zwischen März 2022 und Mai 2023 um fünf Prozentpunkte, führten bislang noch nicht dazu, dass sich die Wirtschaft massiv abkühlte, was aber noch zu erwarten ist. Die Zinsen am Rentenmarkt zogen im 3. Quartal massiv an: 10-jährige US-Treasuries, die im Januar noch bei ca. 3,5% lagen, rentierten Ende September bei ca. 4,7%. Das sorgte für stark rückläufige Kurse in nahezu allen Segmenten am Rentenmarkt. Das nun aber erreichte Zinsniveau und die Aussicht, dass der Zinsgipfel bald erreicht sein dürfte, sprach weiter für ein aussichtsreiches Investmentumfeld für Anleihen mit Investmentgrade: Die Durchschnittsrendite von Euroanleihen mit guter Bonität lag nach dem Zinsanstieg wieder auf einem attraktiven Niveau.

Die Strategie der Verlängerung der Laufzeiten im Fonds bei Beachtung der Bonität wurde weiter fortgesetzt. Es

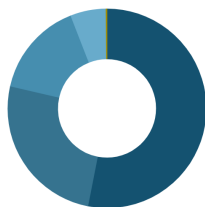
wurde ein ETF mit europäischen Staatsanleihen mit 7-10-jähriger Laufzeit gekauft. Zudem wurde eine 3-jährige Anleihe der Europäischen Investitionsbank in Südafrikanischen Rand (ZAR) gekauft, Kupon 8,75%. Der ZAR war charttechnisch mehrfach gegen langfristige Widerstände gelaufen. Die Ende März erworbene Neuemission wurde trotz des Zinsanstieges mit ca. 4% Gewinn verkauft. Der Sektor der Bonuszertifikate wurde aufgrund anziehender Volatilität und damit günstigeren Konditionen wieder um 1% aufgestockt.

Leitzinserhöhungen waren in den letzten 2 Monaten des Berichtszeitraumes nicht mehr zu sehen. Jedoch zog die Rendite der 10-jährigen US-Treasuries nochmals weiter an und erreichte Ende Oktober mit ca. 5% ein langjähriges Hoch, was zuletzt im Jahr 2007 erreicht wurde. Das wurde seitens des Fondsmanagements als Chance gesehen: Erstmals wurden US-Langläufer mit mehr als 20 Jahren Laufzeit über einen ETF erworben. Es handelte sich um ein währungsgesichertes Investment, da die ersten Zinssenkungen aus den USA kamen und der Dollar dadurch geschwächt wurde. Die Position wurde Anfang November nochmals ausgebaut auf ca. 2%. Auch das Segment der Bonuszertifikate auf den EuroStoxx50 wurde in die Marktschwäche, die auch den Aktienmarkt umfasste, aufgestockt: Laufzeit Dez 2024, Puffer knapp 42%, Rendite 6,2%.

Die Struktur des Fonds sah zum Ende der Berichtsperiode wie folgt aus: Ca. 25% des Fonds waren in 28 Einzeltiteln aus dem Rentenmarkt investiert, davon ca. 6% in unterschiedliche Währungen. 49% des Fonds waren in Rentenfonds oder rentenorientierten ETF's investiert, wovon der europäische Sektor mit ca. 23% den größten Anteil ausmachte. Fonds mit alternativen Strategien nahmen ca. 4% ein. Die Positionen im US-Dollar waren nach z.T. abgesichert. Ca. 15% steckten im Zertifikatebereich, allesamt BonusCap-Strukturen auf den EuroStoxx50. Die Liquiditätsquote lag demzufolge bei ca. 6%.

### Portfoliostruktur:

per 30.11.2023\*



|               |        |
|---------------|--------|
| ● Fonds       | 53,1 % |
| ● Renten      | 25,5 % |
| ● Zertifikate | 15,5 % |
| ● Kasse       | 5,8 %  |
| ● Derivate    | 0,1 %  |

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

Im Berichtszeitraum konnte der Anteilwert des AW Strategie Global Ausgewogen um ca. 2,5% zulegen. Der Rex Gesamt Performanceindex verlor in diesem Zeitraum ca. -0,2%. Der Global Broad Market Corp. Index stieg um ca. 2,7% an.

## Veräußerungsergebnisse

Die realisierten Gewinne resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von Futures und Renten. Für die realisierten Verluste sind im Wesentlichen Veräußerungen von Renten ursächlich. Die entsprechenden Beträge können der Ertrags- und Aufwandsrechnung entnommen werden.

## Wesentliche Risiken im Berichtszeitraum

### Zins- und Spread-Änderungsrisiken

Der AW Strategie Global war im Geschäftsjahr durchschnittlich mit ca. 92% investiert. Der Schwerpunkt waren Investments in nationale und internationale Rentenmärkte. Somit war der Fonds den dort anzutreffenden Marktpreisrisiken ausgesetzt.

Aufgrund der anziehenden Volatilität in 2023 infolge der massiven Zinssteigerungen war eine Spreadausweitung in einigen Rentensegmenten zu sehen. Die Restlaufzeiten des Gesamtportfolios sind aufgrund der unterschiedlichen Strategien der ausgewählten Renten-

fonds schwierig konkret einzustufen, da die Bandbreite von Kurzläuferinvestments und -fonds bis hin zu Fonds mit längeren Laufzeiten reicht. Das Zinsänderungsrisiko wird als überschaubar eingestuft.

### Währungsrisiken

Zum Ende des Berichtszeitraums war der Fonds zu 8,3 % in auf US-Dollar lautende Rentenpapiere investiert. Es waren ca. 7% mittels Devisentermingeschäften abgesichert.

In der Währungsaufteilung entfielen auf die nächsten größeren Fremdwährungspositionen: ca. 1,9% auf das Britische Pfund, ca. 1,1% auf den Kanadischen Dollar und ca. 1,0% auf den Schweizer Franken.

### 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.

### 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

Für das Sondervermögen werden nur Anlagen auf Märkten getätigt, für die aufgrund der Größe und der hohen Zahl von Marktteilnehmern davon auszugehen ist, dass Wertpapiere jederzeit zu einem angemessenen Verkaufserlös veräußert werden können.

Aufgrund der unvorhersehbaren Kriegssituation in der Ukraine bestand, wie unter Sonstig Risiken bereits ausgeführt, vereinzelt eine Einschränkung der Handelbarkeit.

#### Bonitäts- und Adressenausfallrisiken

Aufgrund der ausgewählten Anleihen, Fonds und ETF's bestand ein Ausfallrisiko gem. den klassifizierten Bonitäten, die aufgrund der Fondskonstruktion breit gefächert sind.

Bezüglich der Zertifikate wurde bei der Auswahl und Gewichtung der Emittenten deren aktuelle Bonität sowie deren Credit Spreads berücksichtigt. Weiterhin wurde die 5-10-40 Regelung stets überwacht und eingehalten. Größtes Gewicht im Zertifikatebene hatte die BNP Paribas mit ca. 6% Depotanteil.

### **Wesentliche Ereignisse im Berichtszeitraum**

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

Die Verwahrstellenfunktion wird von der UBS Europe SE ausgefüllt.

Das Portfoliomanagement an die SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH ausgelagert.

Fondsberater ist die Werte Invest Vermögensverwaltung GmbH.

Sonstige wesentliche Ereignisse lagen nicht vor.

## Vermögensübersicht

### VERMÖGENSÜBERSICHT

|                                  | Kurswert<br>in EUR       | % des<br>Fondsver-<br>mögens <sup>1)</sup> |
|----------------------------------|--------------------------|--|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>   | <b>11.954.104,14</b>     | <b>100,20</b>                              |
| 1. Anleihen                      | 3.003.696,85             | 25,18                                      |
| 2. Zertifikate                   | 1.843.776,00             | 15,45                                      |
| 3. Investmentanteile             | 6.337.393,00             | 53,12                                      |
| 4. Derivate                      | 17.037,59                | 0,14                                       |
| 5. Bankguthaben                  | 708.548,90               | 5,94                                       |
| 6. Sonstige Vermögensgegenstände | 43.651,80                | 0,37                                       |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>     | <b>-23.493,75</b>        | <b>-0,20</b>                               |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten    | -23.493,75               | -0,20                                      |
| <b>III. Fondsvermögen</b>        | <b>EUR 11.930.610,39</b> | <b>100,00</b>                              |

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



## Vermögensaufstellung

### VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.11.2023

| ISIN  | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 30.11.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |                     | Kurs       | Kurswert in EUR     | % des Fondsvermögens <sup>1)</sup> |
|---|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|------------|---------------------|------------------------------------|
|   |  |       |                                      |                    |                |                   | im Berichtszeitraum |            |                     |                                    |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   |                     | <b>EUR</b> | <b>2.151.696,65</b> | <b>18,04</b>                       |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   |                     | <b>EUR</b> | <b>2.151.696,65</b> | <b>18,04</b>                       |
| XS2408033210  | 0.0000% Gaz Finance PLC EO-M.-T.LPN 21(28)Gazprom RegS             |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 52,0000    | 52.000,00           | 0,44                               |
| XS2383886947  | 0.0000% LANXESS AG MTN 21/27                                       |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 84,8412    | 84.841,21           | 0,71                               |
| XS2343821794  | 0.0000% VOLKSWAGEN LEASING 21/24                                   |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 97,4790    | 97.479,00           | 0,82                               |
| XS2342706996  | 0.0000% Volvo Treasury AB EO-MTN 21/26                             |       | EUR                                  | 200                | 0              | 0                 | %                   | 91,6627    | 183.325,32          | 1,54                               |
| XS2282094494  | 0.2500% Volkswagen Leasing GmbH MTN 21/26                          |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 92,8219    | 92.821,92           | 0,78                               |
| DE000A3MQNN9  | 0.3750% LEG Immobilien SE MTN 22/26                                |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 92,4417    | 92.441,72           | 0,77                               |
| XS2078696866  | 0.6250% Grenke Finance PLC EO-MTN 19/25                            |       | EUR                                  | 180                | 0              | 0                 | %                   | 94,9800    | 170.964,00          | 1,43                               |
| XS2443921056  | 0.6250% Infineon Technologies AG MTN 22/25                         |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 96,0927    | 96.092,74           | 0,81                               |
| FR0014001YE4  | 0.7500% Iliad S.A. EO-Obl. 2021(21/24)                             |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 99,2280    | 99.228,00           | 0,83                               |
| CH0333827506  | 1.0000% Teva Pharmac.Fin.NL IV B.V. SF-Schuldversch. 2016(25)      |       | CHF                                  | 120                | 0              | 0                 | %                   | 95,4985    | 119.342,05          | 1,00                               |
| XS1946004451  | 1.0690% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24) |       | EUR                                  | 100                | 100            | 0                 | %                   | 99,4745    | 99.474,50           | 0,83                               |
| XS2346125573  | 1.1250% PKN Orlen 21/28  |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 87,8930    | 87.892,97           | 0,74                               |
| NO0010757925  | 1.5000% Norwegen, Königreich NK-Anl. 16/26                         |       | NOK                                  | 1.200              | 1.200          | 0                 | %                   | 94,9710    | 97.362,88           | 0,82                               |
| XS2010039381  | 2.0000% ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019/26                    |       | EUR                                  | 100                | 100            | 0                 | %                   | 93,5860    | 93.586,00           | 0,78                               |
| DE000NRW0N67  | 2.9000% Nordrhein-Westfalen, Land Med.T.LSA v.23(33) Reihe 1561    |       | EUR                                  | 100                | 100            | 0                 | %                   | 99,1901    | 99.190,13           | 0,83                               |
| XS1854830889  | 3.2500% K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.18/24                     |       | EUR                                  | 200                | 0              | 0                 | %                   | 99,0710    | 198.142,00          | 1,66                               |
| XS1271836600  | 4.3820% Deutsche Lufthansa AG FLR-Sub.Anl.v.2015(2021/2075)        |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 95,0355    | 95.035,50           | 0,80                               |
| XS0222524372  | 7.0720% Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)     |       | EUR                                  | 200                | 0              | 0                 | %                   | 96,6465    | 193.293,00          | 1,62                               |
| RU000A0J5MA2  | 7.6000% Russische Föderation RL-Bonds 2012(22) 6209                |       | RUB                                  | 14.000             | 0              | 0                 | %                   | 0,0000     | 0,00                | 0,00                               |
| XS1274823571  | 8.7500% European Investment Bank RC-Medium-Term Notes 2015(25)     |       | ZAR                                  | 2.000              | 2.000          | 0                 | %                   | 101,2450   | 99.183,71           | 0,83                               |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |  |       |                                      |                    |                |                   |                     | <b>EUR</b> | <b>2.695.776,20</b> | <b>22,60</b>                       |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   |                     | <b>EUR</b> | <b>2.695.776,20</b> | <b>22,60</b>                       |
| XS2212959352  | 2.3750% PHOENIX PIB Dutch Finance B.V. EO-Notes 20/25              |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 96,5390    | 96.539,00           | 0,81                               |
| XS2286041517  | 2.4985% Wintershall Dea Finance 2 B.V. EO-FLR Bonds (21/Und.)      |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 91,6020    | 91.602,00           | 0,77                               |
| XS2102507600  | 2.6250% Deutsche Bank AG 20/24                                     |       | GBP                                  | 200                | 0              | 0                 | %                   | 96,1662    | 222.516,87          | 1,87                               |
| DE000A3H2VA6  | 4.0000% VOSSLOH Hybrid 21/und                                      |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 95,3000    | 95.300,00           | 0,80                               |
| CA172967JS17  | 4.0900% Citigroup Inc. CD-Bonds 2015(25)                           |       | CAD                                  | 200                | 0              | 0                 | %                   | 97,7310    | 131.055,01          | 1,10                               |

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.11.2023

| ISIN                                   | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 30.11.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |                     | Kurs       | Kurswert in EUR     | % des Fondsvermögens <sup>1)</sup> |
|--|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|------------|---------------------|------------------------------------|
|  |  |       |                                      |                    |                |                   | im Berichtszeitraum |            |                     |                                    |
| DE000A254N04                           | 5.0000% Groß & Partner Grundst. GmbH IHS v. 2020 (2023/2025)   |       | EUR                                  | 50                 | 0              | 0                 | %                   | 80,3566    | 40.178,32           | 0,34                               |
| DE000A289YC5                           | 5.5000% PANDION AG IHS v. 2021(2023/2026)                      |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 74,5160    | 74.516,00           | 0,62                               |
| XS2352739184                           | 8.5000% Vallourec S.A. EO-Notes 2021(21/26) Reg.S              |       | EUR                                  | 100                | 0              | 0                 | %                   | 100,2930   | 100.293,00          | 0,84                               |
| DE000PD2DA00                           | BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 21.12.23 ESTX50         |       | STK                                  | 13.000             | 0              | 0                 | EUR                 | 37,9500    | 493.350,00          | 4,14                               |
| DE000PD576N1                           | BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 21.12.23 ESTX50         |       | STK                                  | 4.400              | 0              | 0                 | EUR                 | 36,9900    | 162.756,00          | 1,36                               |
| DE000PE9EME6                           | BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH CA.BO.Z 30.12.24 ESTX50         |       | STK                                  | 3.000              | 3.000          | 0                 | EUR                 | 34,2200    | 102.660,00          | 0,86                               |
| DE000DW6N6V4                           | DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 22.03.24 ESTX50           |       | STK                                  | 10.000             | 10.000         | 0                 | EUR                 | 36,5300    | 365.300,00          | 3,06                               |
| DE000DW32TG3                           | DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CA.BO.Z 28.06.24 ESTX50           |       | STK                                  | 6.200              | 0              | 0                 | EUR                 | 37,0100    | 229.462,00          | 1,92                               |
| DE000GK6F8N5                           | Goldman Sachs Bank Europe SE CA.BO.Z 26.06.24 ESTX50           |       | STK                                  | 13.200             | 0              | 0                 | EUR                 | 37,1400    | 490.248,00          | 4,11                               |
| <b>Investmentanteile</b>               |  |       |                                      |                    |                |                   |                     | <b>EUR</b> | <b>6.337.393,00</b> | <b>53,12</b>                       |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b> |  |       |                                      |                    |                |                   |                     | <b>EUR</b> | <b>6.337.393,00</b> | <b>53,12</b>                       |
| DE000A2AGM18                           | Absolute Return Multi Prem.Fo. Inhaber-Anteile AK I            |       | ANT                                  | 2.000              | 0              | 0                 | EUR                 | 79,7700    | 159.540,00          | 1,34                               |
| LU0209095446                           | Amundi Total Return A (ND)                                     |       | ANT                                  | 2.600              | 0              | 0                 | EUR                 | 69,4100    | 180.466,00          | 1,51                               |
| LU1750032077                           | Arbor Invest - Spezialrenten Actions au Porteur I(INE) o.N.    |       | ANT                                  | 2.700              | 0              | 0                 | EUR                 | 95,6000    | 258.120,00          | 2,16                               |
| DE000A1H72N5                           | ASSETS Defensive Opportunit.UI Inhaber-Anteile A               |       | ANT                                  | 4.400              | 0              | 0                 | EUR                 | 88,2900    | 388.476,00          | 3,26                               |
| LU0227125944                           | AXA World Fds-Glob.Em.Mkts Bds Namens-Ant.F-Cap hedged o.N.    |       | ANT                                  | 1.400              | 0              | 0                 | EUR                 | 173,5000   | 242.900,00          | 2,04                               |
| LU0276013322                           | AXA World Funds-US High Yld B. Namens-Ant. F (thes.) EUR o.N.  |       | ANT                                  | 1.800              | 0              | 0                 | EUR                 | 227,3900   | 409.302,00          | 3,43                               |
| LU1220231762                           | Candriam GF-US Hg.Yld Corp.Bds Act.Nom. I EUR Cap. (INE) o.N.  |       | ANT                                  | 230                | 0              | 0                 | EUR                 | 1.458,0600 | 335.353,80          | 2,81                               |
| LU0144746509                           | DEXIA Bonds-Euro High Yield Inhaber-Anteile I o.N.             |       | ANT                                  | 220                | 0              | 0                 | EUR                 | 1.360,6200 | 299.336,40          | 2,51                               |
| IE00B5V94313                           | iShs V-Germany Gov.Bd. UC.ETF Registered Shares o.N.           |       | ANT                                  | 850                | 850            | 0                 | EUR                 | 121,3649   | 103.160,17          | 0,86                               |
| IE00BGPP6697                           | iShsII-\$ Treas.Bd 7-10yr U.ETF Registered Shs EUR Dis. Hgd.oN |       | ANT                                  | 92.000             | 47.000         | 45.000            | EUR                 | 4,0540     | 372.968,00          | 3,13                               |
| IE00B4WXJG34                           | iShsIII-EO Gov.Bd 5-7yr U.ETF Registered Shares o.N.           |       | ANT                                  | 700                | 700            | 0                 | EUR                 | 142,9300   | 100.051,00          | 0,84                               |
| IE00BKPT2S34                           | iShsIII-GI.Infl.L.Gov.Bd U.ETF Reg. Shs HGD EUR Acc. oN        |       | ANT                                  | 30.000             | 0              | 0                 | EUR                 | 4,4029     | 132.087,00          | 1,11                               |
| IE00BD8PGZ49                           | iShsIV-DL Treas.Bd 20+yr U.ETF Reg.Shares EUR Hgd (Dist)oN     |       | ANT                                  | 70.000             | 70.000         | 0                 | EUR                 | 3,2000     | 224.000,00          | 1,88                               |
| AT0000618723                           | KEPLER Short Invest Rentenfds Inhaber-Anteile A o.N.           |       | ANT                                  | 40                 | 0              | 25                | EUR                 | 9.787,7300 | 391.509,20          | 3,28                               |
| LU0476248942                           | LO Fds-Emerg.Loc.Currency Bd Namens-Anteile P Acc. EUR o.N.    |       | ANT                                  | 24.700             | 0              | 0                 | EUR                 | 11,6388    | 287.478,36          | 2,41                               |
| DE000A2DMT51                           | Markus Alt Rentenstrategi.Nr.1 I                               |       | ANT                                  | 3.000              | 0              | 0                 | EUR                 | 85,7800    | 257.340,00          | 2,16                               |
| LU0406716257                           | MFS Mer.-Em.Mkt Debt Loc.Curr. Regist.Shares Cl. A1 EUR o.N.   |       | ANT                                  | 18.000             | 0              | 0                 | EUR                 | 16,2200    | 291.960,00          | 2,45                               |

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.11.2023

| ISIN   | Gattungsbezeichnung  | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000 | Bestand 30.11.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |                     | Kurs     | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens <sup>1)</sup> |
|--|--|-------|--------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|----------|----------------------|------------------------------------|
|  |  |       |                                      |                    |                |                   | im Berichtszeitraum |          |                      |                                    |
| LU0085135894   | Robeco All Strategy Euro Bonds Act. Nom. Class DH EUR o.N. |       | ANT                                  | 5.000              | 0              | 0                 | EUR                 | 82,1300  | 410.650,00           | 3,44                               |
| LU0358408184   | UBS (LUX)BF-Convert Europe(EO) Namens-Anteile Q Acc. o.N.  |       | ANT                                  | 1.100              | 400            | 0                 | EUR                 | 182,1100 | 200.321,00           | 1,68                               |
| IE00BYPHT736   | Xtr.(IE)-iBoxx EUR Cor.Bd Y.P. Registered Shares 1D o.N.   |       | ANT                                  | 25.600             | 0              | 0                 | EUR                 | 14,3565  | 367.526,40           | 3,08                               |
| IE00B4PY7Y77   | iShs II-\$Hgh Yd Corp Bd UC.ETF Registered Shares o.N.     |       | ANT                                  | 3.500              | 0              | 0                 | USD                 | 90,3800  | 288.227,79           | 2,42                               |
| LU0358730231   | Schroder ISF Asian Local Currency Bond C Acc. USD          |       | ANT                                  | 2.200              | 0              | 0                 | USD                 | 147,4646 | 295.601,02           | 2,48                               |
| LU0677077884   | Xtr.II USD Emerging Markets Bd Inhaber-Anteile 2D USD o.N. |       | ANT                                  | 34.600             | 0              | 0                 | USD                 | 10,8170  | 341.018,86           | 2,86                               |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>  |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>11.184.865,85</b> | <b>93,75</b>                       |
| <b>Derivate</b><br>(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>17.037,59</b>     | <b>0,14</b>                        |
| <b>Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>  |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>17.037,59</b>     | <b>0,14</b>                        |
| <b>Währungsterminkontrakte</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>17.037,59</b>     | <b>0,14</b>                        |
| FUTURES EUR/USD 12/23  |  | XCME  | USD                                  | 875.000            |                |                   |                     |          | 17.037,59            | 0,14                               |
| <b>Bankguthaben</b>  |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>708.548,90</b>    | <b>5,94</b>                        |
| <b>EUR - Guthaben bei:</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>669.813,21</b>    | <b>5,61</b>                        |
| Verwahrstelle: UBS Europe SE   |  |       | EUR                                  | 669.813,21         |                |                   |                     |          | 669.813,21           | 5,61                               |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>  |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>38.735,69</b>     | <b>0,32</b>                        |
| Verwahrstelle: UBS Europe SE   |  |       | USD                                  | 42.512,42          |                |                   |                     |          | 38.735,69            | 0,32                               |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>43.651,80</b>     | <b>0,37</b>                        |
| Ansprüche auf Ausschüttung   |  |       | USD                                  | 4.637,50           |                |                   |                     |          | 4.637,50             | 0,04                               |
| Zinsansprüche  |  |       | EUR                                  | 39.014,30          |                |                   |                     |          | 39.014,30            | 0,33                               |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>  |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>-23.493,75</b>    | <b>-0,20</b>                       |
| Sonstige Verbindlichkeiten <sup>2)</sup>   |  |       | EUR                                  | -23.493,75         |                |                   |                     |          | -23.493,75           | -0,20                              |
| <b>Fondsvermögen</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>11.930.610,39</b> | <b>100,00</b>                      |
| <b>Anteilwert AW Strategie Global Ausgewogen</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>EUR</b>          |          | <b>94,09</b>         |                                    |
| <b>Umlaufende Anteile AW Strategie Global Ausgewogen</b>   |  |       |                                      |                    |                |                   | <b>STK</b>          |          | <b>126.806,000</b>   |                                    |

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

<sup>2)</sup> 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 30.11.2023 |   |              |
|-----------------------|-------|----------------|---|--------------|
| Britisches Pfund      | (GBP) | 0,864350       | = | 1 Euro (EUR) |
| Kanadischer Dollar    | (CAD) | 1,491450       | = | 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Krone     | (NOK) | 11,705200      | = | 1 Euro (EUR) |
| Russischer Rubel      | (RUB) | 98,060170      | = | 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken     | (CHF) | 0,960250       | = | 1 Euro (EUR) |
| Südafrikanischer Rand | (ZAR) | 20,415650      | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar             | (USD) | 1,097500       | = | 1 Euro (EUR) |

## MARKTSCHLÜSSEL

### Terminbörse

XCME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE

## 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 |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>  |   |                                       |                 |                    |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>  |   |                                       |                 |                    |
| XS0969741593   | 0.0000% Nordic Investment Bank RB/DL-Zo Med.-T. Nts 2013(23)    | BRL                                   | 0               | 300                |
| CZ0001004600   | 0.4500% Tschechien KC-Bonds 15/23                               | CZK                                   | 0               | 4.000              |
| XS1791714147   | 12.0000% International Bank Rec. Dev. TN-MTN 18/23              | TRY                                   | 0               | 1.600              |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>                                      |   |                                       |                 |                    |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>  |   |                                       |                 |                    |
| NO0012530965   | 12.4720% Mutares SE & Co. KGaA FLR-Bonds v.23(23/27)            | EUR                                   | 100             | 100                |
| DE000A2TST99   | 4.2500% Katjes Intern. GmbH&Co.KG Inh.-Schv. v. 2019(2022/2024) | EUR                                   | 0               | 100                |
| <b>Zertifikate</b>   |   |                                       |                 |                    |
| DE000PF45HU0   | BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mBH CA.BO.Z 22.06.23 ESTX50          | STK                                   | 0               | 11.900             |
| <b>Investmentanteile</b>   |   |                                       |                 |                    |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>   |   |                                       |                 |                    |
| LU1542613465   | Jan.Hend.-J.H.Gbl Eq.Mkt Neut. Actions Nom. R Acc.USD o.N.      | ANT                                   | 0               | 20.000             |
| LU0103636758   | UBAM - Global Bond (CHF) Inh.-Ant. A (Dis.) o.N.                | ANT                                   | 0               | 2.500              |

| 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 |
| <b>Terminkontrakte</b>  |                                       |                 |                    |                  |
| <b>Währungsterminkontrakte</b>  |                                       |                 |                    |                  |
| Gekaufte Kontrakte  |                                       |                 |                    |                  |
| (Basiswerte: Euro/US-Dollar)  | EUR                                   |                 |                    | 8                |

## ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) AW STRATEGIE GLOBAL AUSGEWOGEN

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.12.2022 BIS 30.11.2023

|  | EUR         | EUR                |
|--|-------------|--------------------|
| <b>I. Erträge</b>  |             |                    |
| 1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren                      |             | 39.533,18          |
| 2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) |             | 42.050,81          |
| 3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland                   |             | 16.683,12          |
| 4. Erträge aus Investmentanteilen                            |             | 79.235,24          |
| 5. Abzug ausländischer Quellensteuer                         |             | -251,37            |
| 6. Sonstige Erträge  |             | 6.326,49           |
| <b>Summe der Erträge</b>                                     |             | <b>183.577,47</b>  |
| <b>II. Aufwendungen</b>                                      |             |                    |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen                                |             | -55,73             |
| 2. Verwaltungsvergütung                                      |             | -167.294,72        |
| a) fix   | -167.294,72 |                    |
| b) performanceabhängig                                       | 0,00        |                    |
| 3. Verwahrstellenvergütung                                   |             | -7.110,05          |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten                     |             | -12.018,80         |
| 5. Sonstige Aufwendungen                                     |             | -2.242,26          |
| 6. Aufwandsausgleich   |             | 2.826,35           |
| <b>Summe der Aufwendungen</b>                                |             | <b>-185.895,21</b> |
| <b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>                         |             | <b>-2.317,74</b>   |
| <b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>                             |             |                    |
| 1. Realisierte Gewinne                                       |             | 304.908,70         |
| 2. Realisierte Verluste                                      |             | -250.412,93        |
| <b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>                   |             | <b>54.495,77</b>   |
| <b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>          |             | <b>52.178,03</b>   |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne           |             | 89.371,50          |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste          |             | 155.797,99         |
| <b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>   |             | <b>245.169,49</b>  |
| <b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>                     |             | <b>297.347,52</b>  |

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS AW STRATEGIE GLOBAL AUSGEWOGEN

|   | EUR         | EUR                  |
|---|-------------|----------------------|
| <b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.12.2022)</b> |             | <b>12.061.151,68</b> |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr                |             | 0,00                 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)   |             | -429.031,74          |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen                                  | 0,00        |                      |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen                                 | -429.031,74 |                      |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich   |             | 1.142,93             |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres   |             | 297.347,52           |
| davon nicht realisierte Gewinne   | 89.371,50   |                      |
| davon nicht realisierte Verluste  | 155.797,99  |                      |
| <b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (30.11.2023)</b>  |             | <b>11.930.610,39</b> |

## VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS AW STRATEGIE GLOBAL AUSGEWOGEN <sup>1)</sup>

|   | insgesamt<br>EUR   | je Anteil<br>EUR |
|---|--------------------|------------------|
| <b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>        | <b>315.845,36</b>  | <b>2,49</b>      |
| 1. Vortrag aus dem Vorjahr                      | 13.254,40          | 0,10             |
| 2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres    | 52.178,03          | 0,41             |
| 3. Zuführung aus dem Sondervermögen             | 250.412,93         | 1,97             |
| <b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b> | <b>-106.615,46</b> | <b>-0,84</b>     |
| 1. Der Wiederanlage zugeführt                   | 0,00               | 0,00             |
| 2. Vortrag auf neue Rechnung                    | -106.615,46        | -0,84            |
| <b>III. Gesamtausschüttung</b>                  | <b>209.229,90</b>  | <b>1,65</b>      |
| 1. Endausschüttung                              | 209.229,90         | 1,65             |
| a) Barausschüttung                              | 209.229,90         | 1,65             |

<sup>1)</sup> 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 AW STRATEGIE GLOBAL AUSGEWOGEN

| Geschäftsjahr          | Fondsvermögen am Ende<br>des Geschäftsjahres | Anteilwert |
|------------------------|--|------------|
|                        | EUR  | EUR        |
| 2023                   | 11.930.610,39                                | 94,09      |
| 2022                   | 12.061.151,68                                | 91,77      |
| 2021                   | 13.617.720,35                                | 99,45      |
| (Auflegung 04.01.2021) | 100,00                                       | 100        |



## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

|   |     |                  |
|---|-----|------------------|
| Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure   | EUR | 0,00             |
| <b>Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte</b>   |     |                  |
| UBS Europe SE   |     |                  |
| <b>Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.</b> |     |                  |
| <b>Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)</b>   |     |                  |
| Global Broad Market Index Unhedged Index in EUR   |     | 50,00%           |
| EURO STOXX 50 Net Return Index In EUR   |     | 25,00%           |
| JP Morgan EMBI Global Diversified   |     | 20,00%           |
| MSCI - World Index  |     | 5,00%            |
| <b>Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV</b>  |     |                  |
| kleinster potenzieller Risikobetrag   |     | 0,32%            |
| größter potenzieller Risikobetrag   |     | 1,50%            |
| durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag  |     | 0,48%            |
| <b>Risikomodell (§10 DerivateV)</b>   |     | Full-Monte-Carlo |
| <b>Parameter (§11 DerivateV)</b>  |     |                  |
| Konfidenzniveau   |     | 99,00%           |
| Haltedauer  |     | 1 Tage           |
| Länge der historischen Zeitreihe  |     | 1 Jahr           |
| <b>Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte</b>   |     | <b>1,24</b>      |

### 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 AW Strategie Global Ausgewogen         | EUR | 94,09       |
| Umlaufende Anteile AW Strategie Global Ausgewogen | STK | 126.806,000 |

### 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 AW STRATEGIE GLOBAL AUSGEWOGEN

|   |        |
|---|--------|
| Performanceabhängige Vergütung          | 0,00 % |
| Kostenquote (Total Expense Ratio (TER)) | 1,90 % |

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus, sowie die laufenden Kosten (in Form der veröffentlichten Gesamtkostenquote) der zum Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

## TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.12.2022 BIS 30.11.2023

| Transaktionen                                   | Volumen in Fondswährung |
|---|-------------------------|
| Transaktionsvolumen gesamt                      | 17.939.285,01           |
| Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen | 0,00                    |
| Relativ in %                                    | 0,00 %                  |

Es lagen keine Transaktionen mit verbundenen Unternehmen und Personen vor.

Transaktionskosten: 2.543,79 EUR

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

## AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

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

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

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

## VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

| ISIN         | Fondsname  | Nominale<br>Verwaltungsvergütung<br>der Zielfonds<br>in % |
|--------------|--|---|
| DE000A2AGM18 | Absolute Return Multi Prem.Fo. Inhaber-Anteile AK I <sup>1)</sup>            | 0,73  |
| LU0209095446 | Amundi Total Return A (ND) <sup>1)</sup>                                     | 1,26  |
| LU1750032077 | Arbor Invest - Spezialrenten Actions au Porteur I(INE) o.N. <sup>1)</sup>    | 1,34  |
| DE000A1H72N5 | ASSETS Defensive Opportunit.UI Inhaber-Anteile A <sup>1)</sup>               | 0,50  |
| LU0227125944 | AXA World Fds-Glob.Em.Mkts Bds Namens-Ant.F-Cap hedged o.N. <sup>1)</sup>    | 1,03  |
| LU0276013322 | AXA World Funds-US High Yld B. Namens-Ant. F (thes.) EUR o.N. <sup>1)</sup>  | 0,87  |
| LU1220231762 | Candriam GF-US Hg.Yld Corp.Bds Act.Nom. I EUR Cap.(INE) o.N. <sup>1)</sup>   | 0,55  |
| LU0144746509 | DEXIA Bonds-Euro High Yield Inhaber-Anteile I o.N. <sup>1)</sup>             | 0,60  |
| IE00B4PY7Y77 | iShs II-\$Hgh Yd Corp Bd UC.ETF Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>         | 0,50  |
| IE00B5V94313 | iShs V-Germany Gov.Bd. UC.ETF Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>           | 0,20  |
| IE00BGPP6697 | iShsII-\$ Treas.Bd 7-10yr U.ETF Registered Shs EUR Dis. Hgd.oN <sup>1)</sup> | 0,10  |
| IE00B4WXJG34 | iShsIII-EO Gov.Bd 5-7yr U.ETF Registered Shares o.N. <sup>1)</sup>           | 0,15  |
| IE00BKPT2S34 | iShsIII-Gl.Infl.L.Gov.Bd U.ETF Reg. Shs HGD EUR Acc. oN <sup>1)</sup>        | 0,20  |
| IE00BD8PGZ49 | iShsIV-DL Treas.Bd 20+yr U.ETF Reg.Shares EUR Hdgd (Dist)oN <sup>1)</sup>    | 0,10  |
| LU1542613465 | Jan.Hend.-J.H.Gbl Eq.Mkt Neut. Actions Nom. R Acc.USD o.N. <sup>1)</sup>     | 1,50  |

## VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

| ISIN         | Fondsname  | Nominale<br>Verwaltungsvergütung<br>der Zielfonds<br>in % |
|--------------|--|---|
| AT0000618723 | KEPLER Short Invest Rentenfds Inhaber-Anteile A o.N. <sup>1)</sup>         | 0,10  |
| LU0476248942 | LO Fds-Emerg.Loc.Currency Bd Namens-Anteile P Acc. EUR o.N. <sup>1)</sup>  | 1,46  |
| DE000A2DMT51 | Markus Alt Rentenstrategi.Nr.1 I <sup>1)</sup>                             | 0,74  |
| LU0406716257 | MFS Mer.-Em.Mkt Debt Loc.Curr. Regist.Shares Cl. A1 EUR o.N. <sup>1)</sup> | 1,50  |
| LU0085135894 | Robeco All Strategy Euro Bonds Act. Nom. Class DH EUR o.N. <sup>1)</sup>   | 0,92  |
| LU0358730231 | Schroder ISF Asian Local Currency Bond C Acc. USD <sup>1)</sup>            | 0,81  |
| LU0103636758 | UBAM - Global Bond (CHF) Inh.-Ant. A (Dis.) o.N. <sup>1)</sup>             | 0,50  |
| LU0358408184 | UBS (LUX)BF-Convert Europe(EO) Namens-Anteile Q Acc. o.N. <sup>1)</sup>    | 0,97  |
| IE00BYPH736  | Xtr.(IE)-iBoxx EUR Cor.Bd Y.P. Registered Shares 1D o.N. <sup>1)</sup>     | 0,25  |
| LU0677077884 | Xtr.II USD Emerging Markets Bd Inhaber-Anteile 2D USD o.N. <sup>1)</sup>   | 0,25  |

<sup>1)</sup> Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

## WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

### AW Strategie Global Ausgewogen

#### Sonstige Erträge

|                     |     |          |
|---------------------|-----|----------|
| Kick-Back-Zahlungen | EUR | 6.267,26 |
|---------------------|-----|----------|

#### Sonstige Aufwendungen

|   |     |          |
|---|-----|----------|
| Korrektur Verwaltungsvergütung aus der Vorperiode | EUR | 1.186,52 |
|---|-----|----------|

## BESCHREIBUNG, WIE DIE VERGÜTUNGEN UND GGF. SONSTIGE ZUWENDUNGEN BERECHNET WURDEN

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

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

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

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

## ERGEBNISSE DER JÄHRLICHEN ÜBERPRÜFUNG DER VERGÜTUNGSPOLITIK

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

## ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN DER FESTGELEGTE VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

## ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Januar bis 31. Dezember 2022 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

|   |            |                   |
|---|------------|-------------------|
| <b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer)</b> | <b>EUR</b> | <b>22.647.706</b> |
| davon feste Vergütung   | EUR        | 18.654.035        |
| davon variable Vergütung  | EUR        | 3.993.671         |
| <b>Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen</b>  | <b>EUR</b> | <b>0</b>          |
| <b>Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer (Durchschnitt)</b>  |            | <b>298</b>        |
| <b>Höhe des gezahlten Carried Interest</b>  | <b>EUR</b> | <b>0</b>          |
| <b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risktaker)</b>     | <b>EUR</b> | <b>1.499.795</b>  |
| davon Geschäftsleiter   | EUR        | 1.129.500         |
| davon Führungskräfte  | EUR        | 370.295           |

## ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der Signal Iduna Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2022 setzen sich wie folgt zusammen:

|  |            |   |
|--|------------|---|
| <b>Portfoliomanager</b>  |            | <b>Signal Iduna Asset Management GmbH</b> |
| <b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung</b> | <b>EUR</b> | <b>9.884.467,00</b>                       |
| davon feste Vergütung  | EUR        | 0,00                                      |
| davon variable Vergütung   | EUR        | 0,00                                      |
| <b>Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen</b>   | <b>EUR</b> | <b>0,00</b>                               |
| <b>Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens</b>   |            | <b>115</b>                                |

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

Hamburg, 15. März 2024

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

## Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,  
Hamburg

### Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens AW Strategie Global Ausgewogen – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Dezember 2022 bis zum 30. November 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. November 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Dezember 2022 bis zum 30. November 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 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 eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

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

### Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

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

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* abzugeben
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* bei der Aufstellung des Jahres-

berichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

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

Hamburg, den 18.03.2024

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](mailto:info@hansainvest.de)

Web: [www.hansainvest.de](http://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. 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)
- Ludger Wibbeke
  - (zugleich stellvertretender Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)



## **VERWAHRSTELLE**

---

UBS Europe SE  
Bockenheimer Landstraße 2-4  
60306 Frankfurt am Main  
Deutschland

Haftendes Eigenkapital: 3.041,000 Mio. EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 446,001 Mio. EUR  
Stand: 31.12.2022

## **WIRTSCHAFTSPRÜFER**

---

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Fuhrentwiete 5  
20355 Hamburg  
Deutschland

**HANSAINVEST**

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der  
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8  
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

[info@hansainvest.de](mailto:info@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)

**HANSA**INVEST