

# Jahresbericht zum 31. August 2019

3ik-Strategiefonds II

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

3ik-Strategiefonds II

in der Zeit vom 1. September 2018 bis 31. August 2019.

Hamburg, im Dezember 2019

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Nicholas Brinckmann      Dr. Jörg W. Stotz      Ludger Wibbeke

## So behalten Sie den **Überblick:**

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2018/2019 .....	4
Vermögensübersicht per 31. August 2019 .....	6
Vermögensaufstellung per 31. August 2019 .....	7
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	13
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers .....	16
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	18

# Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2018/2019

## Gliederung

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

## Anlageziel / Anlagepolitik

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

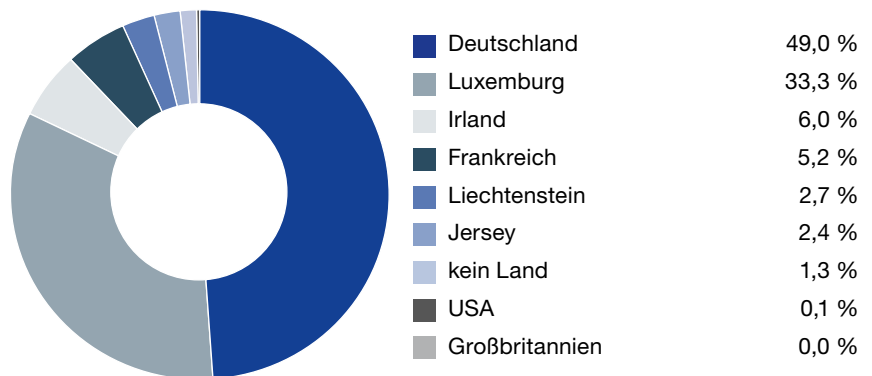
Für den 3ik-Strategiefonds II werden nur Anlagewerte ausgewählt, von denen der Fondsmanager erwartet, dass sie nur mäßigen Wertschwankungen unterliegen. Jede Position wird fortlaufend beobachtet und einer gesonderten Prüfung unterworfen, wenn der Wertrückgang nach dem zuletzt erreichten Höchststand eine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

Im Berichtszeitraum wurde die Allokation breit diversifiziert in folgenden Zielfondskategorien vorgenommen: Anleihenfonds, Wandelanleihenfonds, Mischfonds, Abso-

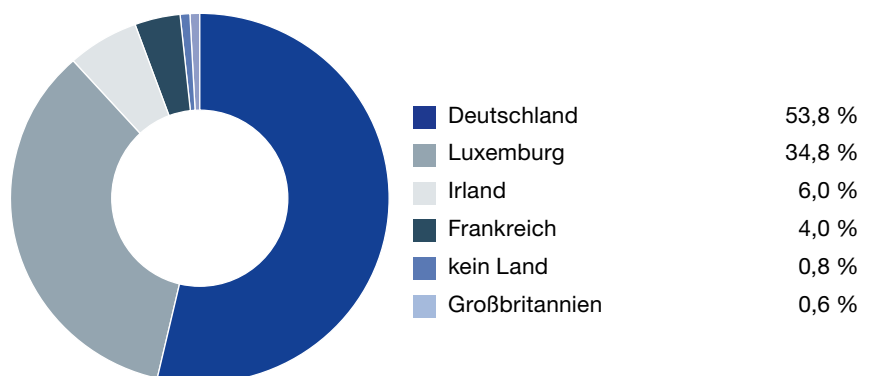
lute Return Fonds, Aktienfonds. Situativ wurde die genannte Portfolioausrichtung durch diverse taktische Investments via Futures (long und short), ETFs und einzelnen Aktien ergänzt.

Die Portfolioübersicht nach Ländern gestaltete sich wie folgt:

### 30.08.2019:



### 30.08.2018:



## Wesentliche Angaben über die Herkunft des Veräußerungsergebnisses

Die Ergebnisse aus Veräußerungsgeschäften wurden im Wesentlichen aus Kursgewinnen/-verlusten bei Indexfutu-

res, Zinsfutures, Devisentermingeschäften, Investmentfonds, Aktien und Rententiteln erzielt.

## Risikoberichterstattung

### Operationelle Risiken

Unter operationellen Risiken wird die Gefahr von Verlusten verstanden, die durch die Unangemessenheit oder das Versagen von internen Verfahren, Menschen

und Systemen oder durch externe Ereignisse verursacht werden. Beim operativen 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.

#### **Marktpreisrisiko**

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

#### **Adressenausfallrisiko**

Die breite Streuung des Fondsvermögens sowohl in Zielfonds als auch bei der Investition in Einzeltitel reduziert die Auswirkung einer möglichen Insolvenz eines Unternehmens in das investiert wurde sehr stark. Die Gewichtung der Einzelpositionen bei Aktien und Zertifikaten (nur hier existiert ein einzelnes Adressenausfallrisiko) lag zwischen 0,3% und 5%.

#### **Zinsänderungsrisiken**

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

#### **Währungsrisiken**

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

#### **Liquiditätsrisiken**

Sowohl bei der Auswahl der Zielfonds als auch der Einzeltitel wird der jederzeitigen Liquidierbarkeit der Positionen unter normalen Marktumständen einen hohen Stellenwert beigemessen.

#### **Sonstige Hinweise**

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

Das Portfoliomanagement ist ausgelagert an Gies & Heimburger GmbH.

# Vermögensübersicht per 31. August 2019

Fondsvermögen: EUR 14.930.724,57 (17.847.558,17)

Umlaufende Anteile: Class I 124.648 (140.718)

Class R 1.249 (1.464)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.08.2018
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
<b>1. Aktien</b>	0	0,00	(0,60)
<b>2. Zertifikate</b>	619	4,14	(0,00)
<b>3. Sonstige Wertpapiere</b>	13.214	88,51	(98,76)
<b>4. Derivate</b>	-37	-0,24	(-0,14)
<b>5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen</b>	941	6,31	(0,00)
<b>6. Bankguthaben</b>	266	1,77	(0,98)
<b>II. Verbindlichkeiten</b>			
	-72	-0,49	(-0,20)
<b>III. Fondsvermögen</b>			
	<b>14.931</b>	<b>100,00</b>	

# Vermögensaufstellung per 31. August 2019

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Zertifikate</b>										
DB ETC PLC ETC Z 15.06.60 Silber	DE000A1EK0J7		STK	3.000	3.000	0	EUR	119,050000	357.150,00	2,39
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0		STK	5.850	8.750	2.900	EUR	44,714000	261.576,90	1,75
<b>Summe der börsengehandelten Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>		<b>618.726,90</b>	<b>4,14</b>
<b>Investmentanteile</b>										
<b>KVG-eigene Investmentanteile</b>										
TBF ATTILA GLOBAL OPPORTUNITY EUR I	DE000A0YJMM9		ANT	831	0	137	EUR	1.162,320000	965.887,92	6,47
TBF GLOBAL EQUITY LS Inhaber-Anteile EUR I	DE000A2JF8R4		ANT	5.400	0	0	EUR	93,820000	506.628,00	3,39
TBF GLOBAL VALUE EUR R	DE0009781633		ANT	10.640	0	0	EUR	60,720000	646.060,80	4,33
TBF SPECIAL INCOME EUR I	DE000A1JRQC3		ANT	4.950	0	610	EUR	126,570000	626.521,50	4,20
4Q-GROWTH FONDS USD (R)	DE000A0D9PG7		ANT	3.750	0	0	USD	137,180000	464.848,87	3,11
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>										
Alpora Innovation Select Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2AJHJ1		ANT	5.405	0	4.200	EUR	140,350000	758.591,75	5,08
Atlantis Intl Umb.-Japan Opp. Registered Shares EUR o.N.	IE00B5TB9J06		ANT	9.140	0	0	EUR	47,208000	431.481,12	2,89
Bellevue Fds (L)-BB Ada.DI He. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1811047916		ANT	1.200	0	0	EUR	175,620000	210.744,00	1,41
Bellevue Fds(Lux)-BB Adm.H.In. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1477743204		ANT	2.520	0	0	EUR	171,320000	431.726,40	2,89
BILKU 1-OPAL Fonds Actions au Port. Cl.AL o.N.	LU1457636733		ANT	5.500	0	0	EUR	87,040000	478.720,00	3,21
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile EUR o.N.	LI0181468138		ANT	192	192	0	EUR	2.089,140000	401.114,88	2,69
Calibrate Total Return Inhaber-Anteile	DE000A0YAEH5		ANT	4.630	0	0	EUR	75,350000	348.870,50	2,34
Commod.Capit.-Global Mining Fd Inhaber-Anteile P o.N.	LU0459291166		ANT	4.450	4.450	0	EUR	75,220000	334.729,00	2,24
GREIFF 'spec.situations' Fd OP Inh.-Anteile	LU0228348941		ANT	5.720	0	4.910	EUR	78,290000	447.818,80	3,00
Greiff Systematic Allocation F Inhaber-Anteile I	DE000A2JN5B4		ANT	5.000	5.000	0	EUR	104,280000	521.400,00	3,49
H2O Allegro Act. au Port. I (4 Déc.) o.N.	FR0011006188		ANT	4	0	1	EUR	194.443,920000	777.775,68	5,21
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	LU1535992389		ANT	4.950	0	0	EUR	104,990000	519.700,50	3,48
MEDICAL - MEDICAL BioHealth	LU0294851513		ANT	920	0	250	EUR	577,460000	531.263,20	3,56
nova Steady HealthCare Inhaber-Anteile I EUR (dist.)	DE000A1145H4		ANT	4.300	0	0	EUR	147,410000	633.863,00	4,25
Palad.A.M.I.AG TGV-Paladin One Inhaber-Anlageaktien	DE000A1W1PH8		ANT	3.690	0	0	EUR	143,150000	528.223,50	3,53
ProfflichSchmidlin Fonds UI Inhaber-Anteile Ant.klasse I	DE000A1W9A36		ANT	263	0	162	EUR	1.218,800000	320.544,40	2,15
QanTRADE Adaptive L/S Strat.UI Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2DMV40		ANT	8.750	580	0	EUR	88,550000	774.812,50	5,19
Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Act. Nom. I1 EUR Dis. oN	LU1858159350		ANT	5.290	5.290	0	EUR	70,230000	371.516,70	2,49
Vates - inprimo Parade Inhaber-Anteile A o.N.	LU1098509851		ANT	37.000	37.000	0	EUR	13,100000	484.700,00	3,25
iShs DL Treas.Bd 1-3yr U.ETF Registered Shares USD (Acc) oN	IE00BYXSP02		ANT	99.800	199.100	99.300	USD	5,232000	471.832,65	3,16
Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.USD o.N.	LU1378878604		ANT	5.230	5.230	0	USD	47,450000	224.247,50	1,50
<b>Summe der Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>		<b>13.213.623,17</b>	<b>88,51</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>		<b>13.832.350,07</b>	<b>92,65</b>

## Vermögensaufstellung zum 31.08.2019

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2019	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum						
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)											
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>											
<b>Wertpapier-Optionsscheine</b>											
<b>Optionsscheine auf Aktien</b>											
Motif Bio PLC WTS 23.11.21	GB00BZ7Q1F72		STK	42.000						593,13	0,00
<b>Summe der Wertpapier-Optionsscheine</b>									<b>EUR</b>	<b>593,13</b>	<b>0,00</b>
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>											
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>											
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures 19.09.2019		XCBT	USD	Anzahl -4						-11.803,64	-0,08
BTP Italien 06.09.2019		XEUR	EUR	Anzahl -8						-26.180,00	-0,18
<b>Summe der Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>									<b>EUR</b>	<b>-37.983,64</b>	<b>-0,25</b>
<b>Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten</b>											
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>											
DAX Future 20.09.2019		XEUR	EUR	Anzahl -8						-17.662,50	-0,12
Tokyo Stock Price (TOPIX) Index 13.09.2019		XJAS	JPY	Anzahl -2						-2.546,47	-0,02
CBOE VIX Future 18.09.2019		XCBO	USD	Anzahl 6						-2.033,16	-0,01
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 20.09.2019		XNAS	USD	Anzahl -6						6.366,05	0,05
E-Mini S&P 500 Index Futures 20.09.2019		XNAS	USD	Anzahl -7						16.762,30	0,11
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>									<b>EUR</b>	<b>886,22</b>	<b>0,01</b>
<b>Bankguthaben und Geldmarktfonds</b>											
<b>Bankguthaben</b>											
<b>EUR - Guthaben bei:</b>											
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	264.852,05						264.852,05	1,77
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	642,27						642,27	0,00
<b>Summe der Bankguthaben</b>									<b>EUR</b>	<b>265.494,32</b>	<b>1,77</b>
<b>Gruppenfremde Geldmarktfonds</b>											
Fidelity Fds-Austr.Dol.Cash Fd Reg. Shares A Acc. AUD o.N.	LU0766124985		ANT	77.200	77.200	0	AUD	10,450300		490.597,56	3,29
Nordea-1 Norwegian Kroner Reserve BP-NOK	LU0078812822		ANT	22.000	22.000	0	NOK	206,030000		450.815,82	3,02
<b>Summe der Geldmarktfonds</b>									<b>EUR</b>	<b>941.413,38</b>	<b>6,31</b>
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahmen</b>											
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen:</b>											
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	-46.930,52						-42.407,73	-0,29
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			JPY	-12.173,00						-103,33	0,00
<b>Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahmen</b>									<b>EUR</b>	<b>-42.511,06</b>	<b>-0,29</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>			<b>EUR</b>	<b>-29.517,85</b>					<b>EUR</b>	<b>-29.517,85</b>	<b>-0,20</b>
<b>Fondsvermögen</b>									<b>EUR</b>	<b>14.930.724,57</b>	<b>100,2)</b>
<b>3ik-Strategiefonds II Class I</b>											
<b>Anteilwert</b>									<b>EUR</b>	<b>118,77</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>									<b>STK</b>	<b>124.648</b>	
<b>3ik-Strategiefonds II Class R</b>											
<b>Anteilwert</b>									<b>EUR</b>	<b>101,26</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>									<b>STK</b>	<b>1.249</b>	

### Fußnoten:

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

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

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 100,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 159.153.335,49 EUR.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 30.08.2019	
Australischer Dollar	AUD	1,644450	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,906600	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	117,810000	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	10,054350	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,106650	= 1 Euro (EUR)

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

CBOT	CHICAGO BOARD OF TRADE
XNAS	NASDAQ - ALL MARKETS
XCBO	CHICAGO BOARD OF EXCHANGE
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND
XJAS	TOKYO STOCK EXCHANGE JASDAQ

## Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Motif Bio PLC Registered Shares LS -,01	GB00BVVT4H71	STK	-	296.500	
<b>Investmentanteile</b>					
<b>KVG-eigene Investmentanteile</b>					
Apus Capital Revalue Fonds	DE000A1H44E3	ANT	-	2.280	
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>					
ACEVO Gl.Healthcare Abs.Ret.Ul Inhaber-Anteile	DE000A1111D5	ANT	-	4.500	
AGIF V-Allianz Japan Small.Cos Inhaber-Anteile A EUR o.N.	IE0002554024	ANT	-	5.100	
BelleVue Fds (Lux)-BB Afr.Opp. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU0433847323	ANT	-	1.650	
ICBCCS WisdomTree S&P China500 Actions Nominatives B USD o.N.	LU1440654330	ANT	-	16.500	
IP Fonds-IP White T	LU1144474043	ANT	-	49.750	
iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE	DE000A0F5UK5	ANT	-	7.600	
iShsII-Core UK Gilts UCITS ETF GBP (Dist)	IE00B1FZSB30	ANT	34.700	34.700	
Jupiter Gl.Fd.-J.Europ.Abs.Ret. Namens-Ant. L EUR A Acc.o.N.	LU0459992037	ANT	-	25.700	
ETFS DAXgbl Gold Min.GO UCITS	DE000A0Q8NC8	ANT	-	16.500	
LOYS Global MH	DE000A0H08T8	ANT	-	2.050	
Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Namens-Anteile o.N.	LU0470205575	ANT	-	6.360	
TAMAC Qilin-China Champions. Actions Nom.D EUR (INE) o.N.	LU1242508387	ANT	-	3.900	
db x-tr.Harv.CSI300 UCITS ETF Inhaber-Anteile 1D o.N.	LU0875160326	ANT	-	41.800	
<b>Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>					
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Italien		EUR			2.182,39
Basiswert: 10Yr. United States of America Treasury Note synth. Anleihe		USD			430,80
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			17.067,62
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			100,36
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Tokyo Stock Price (TOPIX) Index		JPY			509,38
Basiswert: DAX Index		EUR			37.575,76
Basiswerte: Dow Jones Industrial Average Index (Price) (USD), S&P 500 Index, Nasdaq-100 Index		USD			10.194,24
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
JPY/EUR		EUR			467,14
USD/EUR		EUR			889,15
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>					
<b>Optionsrechte auf Aktienindices:</b>					
Gekaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: DAX Index		EUR			5,33

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

für den Zeitraum vom 01. September 2018 bis 31. August 2019	3ik-Strategiefonds II Class I		3ik-Strategiefonds II Class R	
<b>I. Erträge</b>				
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-1.463,81*)		-13,01*)
2. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	23.248,61		196,26
3. Sonstige Erträge	EUR	14.290,60		125,16
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>	<b>36.075,40</b>		<b>308,41</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	-4.540,67		-41,37
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-173.183,57		-1.952,43
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-7.877,30		-72,41
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-7.542,50		-191,26
5. Aufwandsausgleich	EUR	13.170,27		292,10
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>	<b>-179.973,77</b>		<b>-1.965,37</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>	<b>-143.898,37</b>		<b>-1.656,96</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>				
<b>1. Realisierte Gewinne</b>	<b>EUR</b>	<b>1.143.269,27</b>		<b>12.526,33</b>
<b>2. Realisierte Verluste</b>	<b>EUR</b>	<b>-1.420.173,86</b>		<b>-15.839,29</b>
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>	<b>-276.904,59</b>		<b>-3.312,96</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>				
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-424.790,47		-3.901,95
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-57.894,38		-309,87
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-482.684,85</b>		<b>-4.211,82</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>-903.487,81</b>		<b>-9.181,74</b>

\*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen in Höhe von EUR 1.548,51 in der ASK I sowie in Höhe von EUR 13,77 in der ASK R

## Entwicklung des Sondervermögens 2019

	3ik-Strategiefonds II Class I		3ik-Strategiefonds II Class R	
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	EUR	17.689.975,44	EUR	157.582,73
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-113.452,80	EUR	-1.174,40
2. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	-1.893.020,49	EUR	-21.410,79
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	1.152.866,18	EUR	5.029,88
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	-3.045.886,67	EUR	-26.440,67
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	24.238,07	EUR	656,36
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-903.487,81	EUR	-9.181,74
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR	-424.790,47	EUR	-3.901,95
davon nicht realisierte Verluste:	EUR	-57.894,38	EUR	-309,87
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>14.804.252,41</b>	<b>EUR</b>	<b>126.472,16</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt		je Anteil
<b>3ik-Strategiefonds II Class I</b>			
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>			
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR	34.174,69	0,27
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-420.802,96	-3,38
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR	1.420.173,86	11,39
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>			
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	-29.144,38	-0,23
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	-904.682,81	-7,26
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>EUR</b>	<b>99.718,40</b>	<b>0,80</b>
1. Endausschüttung			
a) Barausschüttung	EUR	99.718,40	0,80
<b>3ik-Strategiefonds II Class R</b>			
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>			
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR	-357,87	-0,29
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-4.969,92	-3,98
3. Zuführung aus dem Sondervermögen 3)	EUR	15.839,29	12,68
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>			
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	-310,23	-0,25
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	-9.202,07	-7,37
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>EUR</b>	<b>999,20</b>	<b>0,80</b>
1. Endausschüttung			
a) Barausschüttung	EUR	999,20	0,80

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

## Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert
<b>3ik-Strategiefonds II Class I</b>			
2016	EUR	18.704.220,27	EUR 116,84
2017	EUR	16.483.569,22	EUR 122,24
2018	EUR	17.689.975,44	EUR 125,71
2019	EUR	14.804.252,41	EUR 118,77
<b>3ik-Strategiefonds II Class R</b>			
2016	EUR	146.969,67	EUR 100,66
2017	EUR	163.075,99	EUR 105,01
2018	EUR	157.582,73	EUR 107,64
2019	EUR	126.472,16	EUR 101,26

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 6.123.909,93

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

## Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 92,65  
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -0,24

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

## Angaben nach dem qualifizierten Ansatz

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

kleinster potentieller Risikobetrag 0,55 %  
größter potentieller Risikobetrag 1,27 %  
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag 0,84 %

### Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde

Full-Monte-Carlo

### Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden

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

### Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte

Mittelwert 1,23

### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

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

## Sonstige Angaben

3ik-Strategiefonds II Class I

Anteilwert EUR 118,77  
Umlaufende Anteile STK 124.648

3ik-Strategiefonds II Class R

Anteilwert EUR 101,26  
Umlaufende Anteile STK 1.249

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

## Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

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

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

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

## Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote	
3ik-Strategiefonds II Class I	2,41 %
3ik-Strategiefonds II Class R	2,74 %

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

Transaktionskosten EUR 35.126,60

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

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes	
3ik-Strategiefonds II Class I	0,00 %
3ik-Strategiefonds II Class R	0,00 %

## An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurden keine Pauschalvergütungen gezahlt.

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersatzungen. Die KVG gewährt für die Anteilscheinklasse R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

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

## Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

Die Verwaltungsvergütung für KVG- und Gruppeneigene Investmentanteile beträgt:

TBF ATTILA GLOBAL OPPORTUNITY EUR I	1,6000 %
TBF GLOBAL EQUITY LS Inhaber-Anteile EUR I	0,5200 %
TBF GLOBAL VALUE EUR R	0,6000 %
TBF SPECIAL INCOME EUR I	0,5600 %
4Q-GROWTH FONDS USD (R)	0,6000 %
Apus Capital Revalue Fonds	1,8000 %

Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

Alpora Innovation Select Inhaber-Anteilsklasse I	1,1000 %
Atlantis Intl Umb.-Japan Opp. Registered Shares EUR o.N.	1,5000 %
Bellevue Fds (L)-BB Ada.DI He. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000 %
Bellevue Fds(Lux)-BB Adm.H.In. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000 %
BILKU 1-OPAL Fonds Actions au Port. Cl.AL o.N.	0,2500 %
Bonafide Global Fish Fund Inhaber-Anteile EUR o.N.	1,5000 %
Calibrate Total Return Inhaber-Anteile	0,2000 %
Commod.Capit.-Global Mining Fd Inhaber-Anteile P o.N.	0,1500 %
GREIFF 'spec.situations' Fd OP Inh.-Anteile	0,8000 %
Greiff Systematic Allocation F Inhaber-Anteile I	1,0000 %
H2O Allegro Act. au Port. I (4 Déc.) o.N.	0,7000 %
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	1,0000 %
MEDICAL - MEDICAL BioHealth	1,9000 %
nova Steady HealthCare Inhaber-Anteile I EUR (dist.)	2,5000 %
Palad.A.M.I.AG TGV-Paladin One Inhaber-Anlageaktien	1,5000 %
ProfitlichSchmidlin Fonds UI Inhaber-Anteile Ant.klasse I	1,2500 %
QanTRADE Adaptive L/S Strat.UI Inhaber-Anteilsklasse I	2,5000 %
Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Act. Nom. I1 EUR Dis. oN	0,1500 %
Vates - inprimo Parade Inhaber-Anteile A o.N.	2,1700 %
iShs DL Treas.Bd 1-3yr U.ETF Registered Shares USD (Acc)oN	0,2000 %
Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.USD o.N.	0,7500 %
ACEVO Gl.Healthcare Abs.Ret.UI Inhaber-Anteile	1,8000 %
AGIF V-Allianz Japan Small.Cos Inhaber-Anteile A EUR o.N.	2,0500 %
Bellevue Fds (Lux)-BB Afr.Opp. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000 %
ICBCCS WisdomTree S&P China500 Actions Nominatives B USD o.N.	0,7500 %
IP Fonds-IP White T	1,0000 %
iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE	0,4500 %
iShsII-Core UK Gilts UCITS ETF GBP (Dist)	0,2000 %
Jupiter Gl.Fd.-J.Europ.Abs.Ret. Namens-Ant. L EUR A Acc.o.N.	1,7500 %
ETFS DAXgbl Gold Min.GO UCITS	0,6500 %
LOYS Global MH	0,9000 %
Struct.Sol.-Next Gener.Res.Fd Namens-Anteile o.N.	0,1500 %
TAMAC Qilin-China Champions. Actions Nom.D EUR (INE) o.N.	2,0000 %
db x-tr.Harv.CSI300 UCITS ETF Inhaber-Anteile 1D o.N.	0,8000 %
Fidelity Fds-Austr.Dol.Cash Fd Reg. Shares A Acc. AUD o.N.	0,4000 %
Nordea-1 Norwegian Kroner Reserve BP-NOK	0,1300 %

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

## Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge

3ik-Strategiefonds II Class I: EUR 14.290,60 Kick-Back Zahlungen

3ik-Strategiefonds II Class R: EUR 125,16 Kick Back Zahlungen

Wesentliche sonstige Aufwendungen  
3ik-Strategiefonds II Class I: EUR 0,00  
3ik-Strategiefonds II Class R: EUR 0,00

### Sonstige Informationen

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

### Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2018

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR	11.037.624,19
davon fix:	EUR	9.098.129,21
davon variabel:	EUR	1.939.494,98
Zahl der Mitarbeiter der KVG inkl. Geschäftsführer:		144
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2018 der KVG gezahlten Vergütung an Geschäftsleiter (Risikoträger):	EUR	910.000,16

Die Angabe zur Mitarbeitervergütung beziehen sich auf den Zeitraum 1. Januar bis 31. Dezember 2018 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

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

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

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

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

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

### Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik

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

### Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik

Keine Änderung im Berichtszeitraum.

### Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall für das Geschäftsjahr 2017/2018 (Portfoliomanagement Gies & Heimbürger GmbH)

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens.

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

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung:	EUR	526.887
davon feste Vergütung:	EUR	0
davon variable Vergütung:	EUR	0
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	EUR	0

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens: 11

Hamburg, 5. Dezember 2019

HANSAINVEST  
Hanseatische Investment-GmbH  
Geschäftsführung

(Nicholas Brinckmann) (Dr. Jörg W. Stotz) (Ludger Wibbeke)

# Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg

## Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens 3ik-Strategiefonds II – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. September 2018 bis zum 31. August 2019, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. August 2019, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. September 2018 bis zum 31. August 2019, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

## Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere

Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

## Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

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

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür ver-

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

## Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

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



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

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

- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die HANSA-

INVEST Hanseatische Investment-GmbH nicht fortgeführt wird.

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

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

Hamburg, den 6. Dezember 2019

KPMG AG  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Werner Lüning  
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüfer

# Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

## Kapitalverwaltungsgesellschaft:

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

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

Gezeichnetes Kapital:  
€ 10.500.000,00  
Eigenmittel:  
€ 21.729.099,42  
(Stand: 31.12.2018)

## Gesellschafter:

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

## Verwahrstelle:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:  
€ 20.500.000,00  
Eigenmittel gem.  
Kapitaladäquanzverordnung (CRR):  
€ 222.136.245,61  
(Stand: 31.12.2018)

## Einzahlungen:

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

## Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),  
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA  
Gruppe, Hamburg  
(zugleich Vorsitzender des Aufsichts-  
rates der SIGNAL IDUNA Asset  
Management GmbH)

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

Thomas Gollub,  
Berater der Aramea Asset  
Management AG, Wedel

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

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

Prof. Dr. Stephan Schüller,  
Kaufmann

## Wirtschaftsprüfer:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungs-  
gesellschaft, Hamburg

## Geschäftsführung:

Dr. Jörg W. Stotz  
(Sprecher, zugleich Aufsichtsrats-  
vorsitzender der HANSAINVEST LUX  
S.A., Mitglied der Geschäftsführung  
der SIGNAL IDUNA Asset Management  
GmbH sowie Mitglied der Geschäftsfüh-  
rung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

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

Ludger Wibbeke (ab 01.07.2019)  
(zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-  
vorsitzender der HANSAINVEST LUX  
S.A.)

**HANSAINVEST**  
**Hanseatische Investment-GmbH**

**Ein Unternehmen der**  
**SIGNAL IDUNA Gruppe**

Kapstadtring 8  
22297 Hamburg  
Telefon (040) 3 00 57 - 62 96  
Fax (040) 3 00 57 - 60 70

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