

OGAW-Fonds

# BremenKapital Zertifikate.

Halbjahresbericht 28.02.2023

Hanseatische Investment-GmbH in Kooperation mit der Sparkasse Bremen

**HANSA**INVEST



Die Sparkasse  
Bremen

Weil's um mehr als Geld geht.



# Inhaltsverzeichnis

Vermögensübersicht per 28. Februar 2023	4
Vermögensaufstellung per 28. Februar 2023	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	12
Allgemeine Angaben	14

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

BremenKapital Zertifikate

in der Zeit vom 01.09.2022 bis 28.02.2023.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von -0,36%.

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

mit herzlichen Grüßen

Ihre

HANSAINVEST-Geschäftsführung

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

# Vermögensübersicht per 28. Februar 2023

## Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>103.100.004,29</b>	<b>100,13</b>
1. Anleihen	103.750.417,42	100,77
2. Zertifikate	4.655.064,54	4,52
3. Derivate	-11.250.669,64	-10,93
4. Bankguthaben	5.489.110,50	5,33
5. Sonstige Vermögensgegenstände	456.081,47	0,44
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-137.936,93</b>	<b>-0,13</b>
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-137.936,93	-0,13
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>EUR 102.962.067,36</b>	<b>100,00</b>

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

# Vermögensaufstellung per 28. Februar 2023

## Vermögensaufstellung zum 28.02.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>3)</sup>
							im Berichtszeitraum		
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>49.315.182,88</b>	<b>47,90</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>49.315.182,88</b>	<b>47,90</b>
FI4000219787	0,000000000% Finnland, Republik EO-Bonds 2016(23)	EUR	3.000	3.000	0	0 %	98,4455	2.953.365,00	2,87
XS2293755125	0,000000000% Republic of Iceland EUR Long 7-year	EUR	2.500	0	0	0 %	82,0580	2.051.450,00	1,99
DE000PD99JA0	0,000123400% BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH Marktzensanleihe v.23(28)	EUR	574	574	0	0 %	96,0013	551.047,55	0,54
DE000A289K30	0,010000000% Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.250 v.20(28)	EUR	2.000	0	0	0 %	83,9365	1.678.730,00	1,63
XS2181347183	0,125000000% Estland, Republik EO-Bonds 2020(30)	EUR	2.000	0	0	0 %	79,2898	1.585.796,66	1,54
BE0000339482	0,200000000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(23) Ser. 79	EUR	4.000	4.000	0	0 %	98,1325	3.925.300,00	3,81
SK4000017158	0,250000000% Slowakei EO-Anl. 2020(25)	EUR	1.500	1.500	0	0 %	93,2065	1.398.097,50	1,36
XS1501554874	0,375000000% Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2016(26)	EUR	2.500	0	500	0 %	88,8685	2.221.712,50	2,16
XS1716946717	0,625000000% Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2017(24)	EUR	1.000	1.000	0	0 %	95,0105	950.105,00	0,92
XS1917590876	0,750000000% OMV AG EO-MTN 18/23	EUR	2.000	2.000	0	0 %	97,9815	1.959.630,00	1,90
EU000A3K4DJ5	0,800000000% Europäische Union EO-MTN 22/25	EUR	3.000	3.000	0	0 %	94,3870	2.831.610,00	2,75
AT000A2WSC8	0,900000000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(32)	EUR	1.700	1.700	0	0 %	82,6170	1.404.489,00	1,36
XS1619567677	0,950000000% Litauen, Republik EO-MTN 17/27	EUR	3.000	0	0	0 %	89,5200	2.685.600,00	2,61
SI0002103685	1,250000000% Slowenien, Republik EO-Bonds 2017(27)	EUR	2.500	0	500	0 %	92,6776	2.316.939,18	2,25
IT0005367492	1,750000000% Italien, Republik EO-B.T.P. 19/24	EUR	2.000	1.500	2.000	0 %	97,6324	1.952.648,84	1,90
FI4000079041	2,000000000% Finnland, Republik EO-Bonds 2014(2024)	EUR	1.000	1.000	0	0 %	98,7656	987.656,25	0,96
XS1301052202	2,000000000% Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2015(26/26)	EUR	2.000	0	0	0 %	93,4820	1.869.640,00	1,82
IT0005494239	2,500000000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(32)	EUR	1.700	1.700	0	0 %	85,9135	1.460.528,82	1,42
XS1061714165	2,625000000% PepsiCo Inc. EO-Med.-Term Notes 2014(14/26)	EUR	2.000	0	0	0 %	97,1525	1.943.050,00	1,89
IE00B6X95T99	3,400000000% Irland EO-Treasury Bonds 14/24	EUR	1.000	1.000	0	0 %	100,3820	1.003.820,00	0,97
XS2304447142	3,500000000% BNP Paribas Issuance B.V. EO-Cred.Lkd M.-T. Cts 2023(25)	EUR	4.500	5.000	500	0 %	99,0175	4.455.786,96	4,33
ES00000124W3	3,800000000% Spanien EO-Bonos 14/24	EUR	1.000	1.000	0	0 %	100,7032	1.007.032,12	0,98
FR0010466938	4,250000000% Frankreich 07/23	EUR	4.000	4.000	0	0 %	100,7150	4.028.600,00	3,91
IE00B4TV0D44	5,400000000% Irland EO-Treasury Bonds 09/25	EUR	2.000	3.000	1.000	0 %	104,6274	2.092.547,50	2,03

## Vermögensaufstellung zum 28.02.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>3)</sup>
							im Berichtszeitraum			
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>59.090.299,08</b>	<b>57,39</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>54.435.234,54</b>	<b>52,87</b>
AT0000A28KX7	0,000000000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(24)		EUR	2.000	4.000	2.000	%	95,8244	1.916.488,32	1,86
XS2305760923	0,020000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25)		EUR	1.500	0	0	%	89,9121	1.348.681,80	1,31
XS2305763869	0,070000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Lkd MTN 2021(25)		EUR	1.500	0	600	%	89,5652	1.343.478,08	1,30
CH0593023788	0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO-Credit Lkd Notes 2021(26)		EUR	2.700	0	0	%	88,1356	2.379.661,79	2,31
CH0593023754	0,100000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO-Credit Lkd Notes 2021(26)		EUR	2.700	0	0	%	88,7913	2.397.364,64	2,33
CH0593023770	0,150000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO-Credit Lkd Notes 2021(26)		EUR	1.200	0	1.500	%	89,5556	1.074.667,78	1,04
DE000DD5AV19	0,180000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 IBM		EUR	1.600	0	400	%	87,4700	1.399.520,00	1,36
DE000DD5AVW0	0,190000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 Volvo		EUR	1.700	0	300	%	87,6000	1.489.200,00	1,45
DE000DK0Y8R6	0,220000000% DekaBank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(27)Heineken		EUR	2.400	0	600	%	86,2100	2.069.040,00	2,01
XS2430062104	0,230000000% Nordea Bank Abp EO-FLR Cred.Lkd MTN 2022(27)		EUR	2.500	0	0	%	87,1552	2.178.880,88	2,12
XS2237713198	0,250000000% BNP Paribas Issuance B.V. EO-Cred.Lkd M.-T. Cts 21/26		EUR	2.500	0	0	%	85,9684	2.149.210,95	2,09
DE000DD5AVX8	0,260000000% DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. CLN 21/26 AVIVA		EUR	1.700	0	300	%	87,6400	1.489.880,00	1,45
XS2277942087	0,280000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26)		EUR	2.000	0	0	%	88,5861	1.771.721,02	1,72
DE000DK0Y8Q8	0,300000000% DekaBank Dt.Girozentrale Boni Schuldversch. 21(27)EON		EUR	2.800	0	0	%	85,7000	2.399.600,00	2,33
DE000HVB56F5	0,320000000% UniCredit Bank AG HVB Bonitaet 21(26) SQU		EUR	2.500	0	500	%	86,7925	2.169.812,50	2,11
XS2277941519	0,350000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26)		EUR	2.000	0	0	%	88,9541	1.779.082,50	1,73
XS2277944455	0,460000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 2021(26)		EUR	2.000	0	0	%	89,3009	1.786.018,16	1,73
XS2061862756	0,470000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 21/26		EUR	2.000	0	0	%	88,5820	1.771.640,78	1,72
XS2061862244	0,500000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 21/26		EUR	2.000	0	0	%	88,0935	1.761.869,82	1,71
DE000HVB5AR6	0,500000000% UNICREDIT CLN 21/27 Orange		EUR	2.500	0	0	%	85,5065	2.137.662,50	2,08
XS2432159270	0,520000000% HSBC Bank PLC EO-Credit Linked MTN 2022(26)		EUR	2.000	0	0	%	87,4175	1.748.350,66	1,70
CH1145176264	0,550000000% Vontobel Financial Prod. Ltd. EO-Credit Lkd Notes 2022(28)		EUR	2.700	0	0	%	82,6362	2.231.176,81	2,17

## Vermögensaufstellung zum 28.02.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>3)</sup>
							im Berichtszeitraum		
XS2061859703	0,640000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 21/26		EUR	900	0	1.500 %	87,6606	788.945,37	0,77
XS2387492551	0,650000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Credit Linked MTN 2021(27)		EUR	1.500	0	0 %	81,8001	1.227.000,77	1,19
XS2080946028	0,710000000% Goldman Sachs CLN 21/26 SEMPRA ENERGY		EUR	1.500	0	0 %	86,7965	1.301.947,97	1,26
XS2387491827	1,000000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Credit Linked MTN 2021(27)		EUR	1.500	0	0 %	82,0553	1.230.828,86	1,20
XS1971487134	1,050000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-Credit Linked MTN 2022(26)		EUR	2.500	0	0 %	87,1499	2.178.746,33	2,12
XS2436216159	1,050000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Lkd Notes 2022(27)		EUR	1.500	0	0 %	88,4679	1.327.018,19	1,29
XS2114032258	1,200000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl EO-FLR Medium-Term Nts 22(27)		EUR	833	0	0 %	94,5298	787.433,09	0,76
XS1900752814	1,200000000% Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2018(18/28)		EUR	2.000	0	0 %	88,5694	1.771.388,04	1,72
XS2387492122	1,270000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Credit Linked MTN 21/27		EUR	1.500	0	0 %	82,4438	1.236.656,93	1,20
FR0013346137	1,375000000% Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2018(18/28)		EUR	2.000	0	0 %	89,6130	1.792.260,00	1,74
<b>Zertifikate</b>							<b>EUR</b>	<b>4.655.064,54</b>	<b>4,52</b>
DE000A3GZYL3	Opus-Charter. Iss. S.A. C.459 PART.N.30.06.49		EUR	2.000	0	0 %	97,5000	1.950.000,00	1,89
DE000PF99F37	BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH MEM.EXPRESS Z16.12.25 DPW		STK	599	0	0 EUR	782,9000	468.957,10	0,46
DE000CS8DK81	CS AG Express S&P 500 22/24		STK	415	0	0 EUR	949,4100	394.005,15	0,38
CH1158654785	Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.01.06.23 N100		STK	487	0	0 EUR	991,5300	482.875,11	0,47
CH1139074475	Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.02.06.23 DAX		STK	650	0	0 EUR	998,2400	648.856,00	0,63
CH1111679150	Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.09.07.25 SXSE		STK	731	0	0 EUR	971,7800	710.371,18	0,69
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>108.405.481,96</b>	<b>105,29</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-11.250.669,64</b>	<b>-10,93</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>							<b>EUR</b>	<b>-11.250.669,64</b>	<b>-10,93</b>
<b>Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>-11.250.669,64</b>	<b>-10,93</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>							<b>EUR</b>	<b>-11.250.669,64</b>	<b>-10,93</b>
Call DAX 14300,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-150		EUR	1.508,9000	-1.131.675,00	-1,10
Call DAX 14500,000000000 17.03.2023		XEUR	EUR Anzahl	-100		EUR	963,7000	-481.850,00	-0,47
Call DAX 15000,000000000 17.03.2023		XEUR	EUR Anzahl	-150		EUR	525,7000	-394.275,00	-0,38
Call ESTX 50 3800,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-175		EUR	447,8000	-783.650,00	-0,76
Call ESTX 50 3900,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-250		EUR	365,3000	-913.250,00	-0,89

**Vermögensaufstellung zum 28.02.2023**

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
						im Berichtszeitraum			
Call ESTX 50 3900,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-150		EUR	365,3000	-547.950,00	-0,53
Call ESTX 50 3900,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-225		EUR	365,3000	-821.925,00	-0,80
Call ESTX 50 4000,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-200		EUR	287,9000	-575.800,00	-0,56
Call ESTX 50 4100,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-175		EUR	216,9000	-379.575,00	-0,37
Put DAX 15400,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-175		EUR	500,3000	-437.762,50	-0,43
Put DAX 15400,000000000 17.03.2023		XEUR	EUR Anzahl	-150		EUR	218,2000	-163.650,00	-0,16
Put DAX 15400,000000000 17.03.2023		XEUR	EUR Anzahl	-50		EUR	218,2000	-54.550,00	-0,05
Put ESTX 50 3900,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-100		EUR	72,4000	-72.400,00	-0,07
Put ESTX 50 3900,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-225		EUR	72,4000	-162.900,00	-0,16
Put ESTX 50 4000,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-250		EUR	94,2000	-235.500,00	-0,23
Put ESTX 50 4000,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-300		EUR	94,2000	-282.600,00	-0,27
Put ESTX 50 4100,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-200		EUR	122,2000	-244.400,00	-0,24
Put ESTX 50 4200,000000000 16.06.2023		XEUR	EUR Anzahl	-100		EUR	158,5000	-158.500,00	-0,15
Call Nasdaq-100 11500,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-13		USD	676,7500	-829.937,27	-0,81
Call Nasdaq-100 12500,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-10		USD	95,9000	-90.467,43	-0,09
Call S&P 500 3900,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-35		USD	125,4000	-414.037,07	-0,40
Call S&P 500 4000,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-15		USD	61,6500	-87.236,45	-0,08
Call S&P 500 4000,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-15		USD	61,6500	-87.236,45	-0,08
Put Nasdaq-100 12200,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-14		USD	319,1000	-421.432,95	-0,41
Put Nasdaq-100 12800,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-9		USD	741,3000	-629.375,97	-0,61
Put S&P 500 4100,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-30		USD	130,3500	-368.897,69	-0,36
Put S&P 500 4150,000000000 17.03.2023		XCBO	USD Anzahl	-30		USD	169,5500	-479.835,86	-0,47
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>5.489.110,50</b>	<b>5,33</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>							<b>EUR</b>	<b>5.085.422,05</b>	<b>4,94</b>
Verwahrstelle: UBS Europe SE			EUR	5.085.422,05				5.085.422,05	4,94
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>403.688,45</b>	<b>0,39</b>
Verwahrstelle: UBS Europe SE			USD	427.929,94				403.688,45	0,39
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>456.081,47</b>	<b>0,44</b>
Zinsansprüche			EUR	456.081,47				456.081,47	0,44
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-137.936,93</b>	<b>-0,13</b>
Sonstige Verbindlichkeiten <sup>2)</sup>			EUR	-137.936,93				-137.936,93	-0,13
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>102.962.067,36</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert BremenKapital Zertifikate</b>							<b>EUR</b>	<b>39,29</b>	



## Vermögensaufstellung zum 28.02.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 28.02.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
						im Berichtszeitraum			
<b>Umlaufende Anteile BremenKapital Zertifikate</b>						<b>STK</b>		<b>2.620.571,000</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 28.02.2023
US-Dollar	(USD)	1,060050	=	1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

Terminbörse

XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND

## Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
DE000A289NL9	0,010000000% Brandenburg, Land Schatzanw. v.2020(2028)	EUR	0	995
IE00BKFVC568	0,200000000% Irland EO-Treasury Bonds 20/27	EUR	500	3.000
FR0013200813	0,250000000% Frankreich EO-OAT 2016(26)	EUR	500	3.500
FI4000278551	0,500000000% Finnland, Republik EO-Bonds 17/27	EUR	0	2.500
AT0000A1VGK0	0,500000000% Österreich, Republik EO-Bundesanl. 17/27	EUR	0	2.500
XS1851229218	0,875000000% Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2018(28)	EUR	0	2.000
DE000NRW0K03	0,950000000% Nordrhein-Westfalen, Land MTN LSA v.18(28) Reihe 1456	EUR	0	2.500
XS1520344745	1,000000000% Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2017(27)	EUR	0	2.000
XS1734689620	1,000000000% OMV AG EO-Medium-Term Notes 2017(26)	EUR	0	2.500
<b>Zertifikate</b>				
CH1158655527	Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.14.06.23 DAX	STK	0	508
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
XS2277779588	0,220000000% SG Issuer S.A. EO-Credit Linked MTN 21/26	EUR	0	2.000
XS2237713271	0,250000000% BNP CRLNFI 21/26 National Grid	EUR	0	2.500
XS2153608141	0,375000000% Ontario, Provinz EO-Medium-Term Notes 2020(27)	EUR	0	2.000
XS2337873702	0,400000000% BNP PAR.ISS. 21/28	EUR	0	3.000
XS2337874262	0,500000000% BNP PAR.ISS.21/28	EUR	0	3.000
BE0000341504	0,800000000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2017(27) Ser. 81	EUR	0	2.500
DE000PF99DT8	0,900000000% BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH Fix Kupon Express v.21(25)ADS	STK	0	393
<b>Zertifikate</b>				
DE000CS8DDQ2	Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.Z.05.11.25 Covestro	STK	0	207
DE000CS8DM48	Credit Suisse AG (Ldn Br.) Mem.Expr.Z.18.09.23 N100	STK	0	178
CH1134492656	LEON.SEC(GG) EXPZ S&P 500	STK	0	1.000
CH1150252257	Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.11.02.2027 MUV2	STK	0	248
CH1139076439	Leonteq Secs AG (Guernsey Br.) Express Z.13.06.23 DAX	STK	0	377

## 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>Optionsrechte</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			30.556
DAX Index				
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
Nasdaq-100 Index				
S&P 500 Index)				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			44.754
DAX Index				
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
Nasdaq-100 Index				
S&P 500 Index)				
<b>Optionsrechte auf Zins-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			1.927
Euro Bund Futures)				

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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 0,053%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 116.087,00 EUR.

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 105,29

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -10,93

### 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 BremenKapital Zertifikate	EUR	39,29
Umlaufende Anteile BremenKapital Zertifikate	STK	2.620.571,000

### 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.

### 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 Aufwandserstattungen.

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

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

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

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

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

# 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: [service@hansainvest.de](mailto:service@hansainvest.de)

Web: [www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)

Haftendes Eigenkapital: 22,659 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2021

## Gesellschafter

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

## Aufsichtsrat

- Martin Berger
  - Vorsitzender
  - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth
  - stellvertretender Vorsitzender
  - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Markus Barth
  - Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg
- Dr. Thomas A. Lange
  - Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen
- Prof. Dr. Harald Stützer
  - Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach
- Prof. Dr. Stephan Schüller
  - Kaufmann

## Geschäftsführung

- Dr. Jörg W. Stotz
  - (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH, Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Greiff capital management AG (seit 01.03.2023))
- Nicholas Brinckmann
  - (zugleich Sprecher der Geschäftsführung HANSAINVEST Real Assets GmbH)
- Ludger Wibbeke
  - (zugleich stellvertretender Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

## **Verwahrstelle**

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

Haftendes Eigenkapital: 3.043,000 Mio. EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 446,001 Mio. EUR  
Stand: 31.12.2021

## **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

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