

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

# JAHRESBERICHT

CA Familienstrategie

31. Dezember 2022

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

CA Familienstrategie

in der Zeit vom 01.01.2022 bis 31.12.2022.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

## Tätigkeitsbericht CA Familienstrategie für das Geschäftsjahr 01.01.2022 bis 31.12.2022

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

### Anlageziele und Anlagepolitik

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

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

Aktien 25% - 75%

Kapitalbeteiligungen min. 25%

Verzinsliche Wertpapiere 25% - 75%

Geldmarktinstrumente bis zu 50%

Bankguthaben bis zu 50%

Investmentfonds bis zu 50%

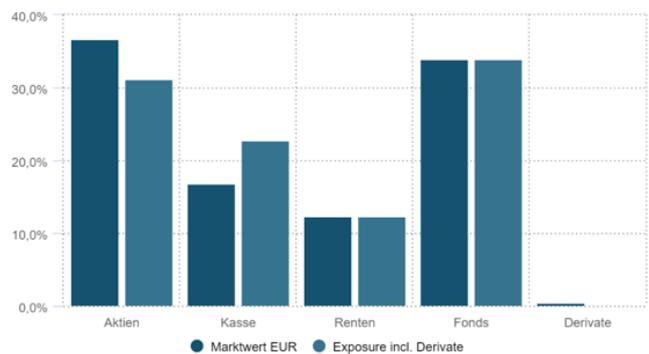
Im Fokus des Auswahlprozesses stehen nordamerikanische und europäische Aktien, mit einer Marktkapitalisierung > 3 Mrd. EUR. Das Anlageuniversum auf der Aktien- bzw. Optionsseite umfasst schwerpunktmäßig den STOXX 600 sowie den S&P 500.

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investi-

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

### Portfoliostruktur

Portfoliostruktur 31.12.2021



Portfoliostruktur 31.12.2022



Zum Stichtag war der CA Familienstrategie zu 46,06% direkt in Aktien investiert.

Des Weiteren wurden Put Stillhaltergeschäfte auf 27 Aktien sowie gedeckte Call Stillhaltergeschäfte auf 13 Aktien gehalten. Das zur Deckung der Put Stillhaltergeschäfte benötigte Kapital wurde in geldmarktnahe Fonds und Bankguthaben angelegt. Insgesamt wurden im Berichtszeitraum 171 Put- und Call Optionen auf Einzelwerte geschrieben.

Zu Absicherungszwecken wurde eine Long Put Position auf den EuroStoxx 50 Index erworben mit einem Stichtagswert von 277.420 EUR.

Der Fonds ist zu 15,5% direkt in EUR-Anleihen investiert. Die Länderallokation der Anleihen entspricht Deutschland (47,3%), Frankreich (22,1%), Kanada (11,4%), Australien (11,3%), Österreich (4%) und Schweiz (3,9%).

Laufzeitenstruktur der investierten Anleihen (Direktinvestments):

0 bis 1 Jahr: 0,00%

1 bis 3 Jahre: 44,1%

3 bis 5 Jahre: 33,1%

5 bis 10 Jahre: 22,7%

10 bis 20 Jahre: 0,00%

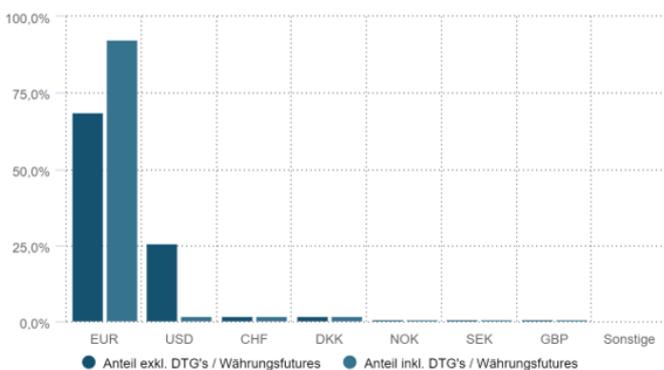
Mehr als 20 Jahre: 0,00%

Die durchschnittliche Restlaufzeit des direkt in Anleihen investierten Kapitals beträgt 3,74 Jahre.

22,8% des Fonds sind in Bankguthaben investiert.

Über das gesamte Fondsvermögen hinweg ist der CA Familienstrategie zu 68,5% in EUR investiert, zu 25,8% in USD, zu 0,8% in NOK, zu 1,9% in CHF, zu 1,7% in DKK, zu 0,6% in GBP, zu 0,7% in SEK.

Währungsrisiko per 31.12.2022:

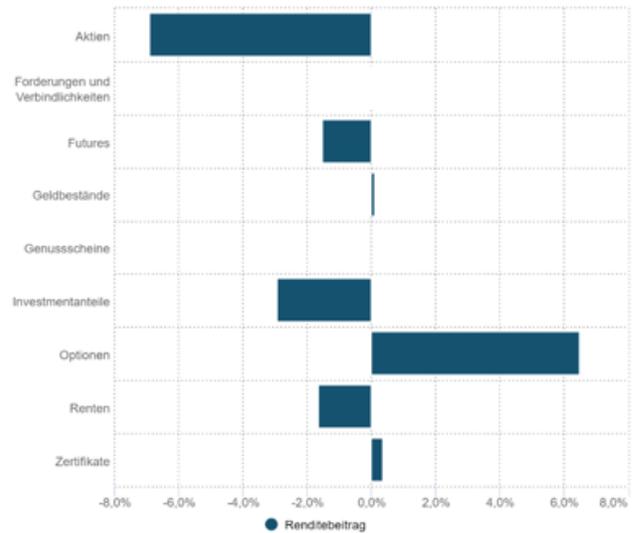


## Wertentwicklung

Die Performance des Fonds im Geschäftsjahr beträgt für

die Anteilklasse A -7,8% sowie für die Anteilklasse B -8,0%.

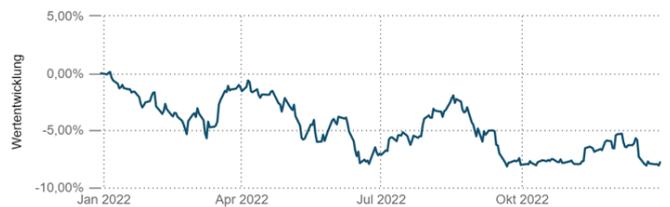
Beiträge nach Assetgruppen:



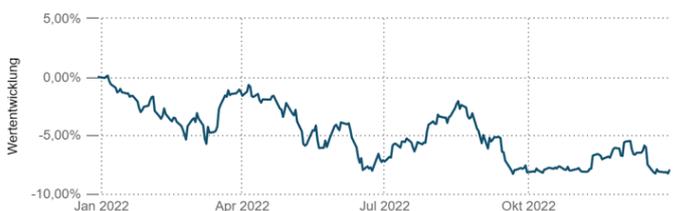
## Veräußerungsergebnis

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

Bei einer Volatilität von 7,85% in der Anteilklasse A lag der max. Drawdown bei -8,25%.



Bei einer Volatilität von 7,86% in der Anteilklasse B lag der max. Drawdown bei -8,39%.



## Risikoberichterstattung

### Marktpreisrisiko

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

### Adressenausfallrisiko

Im Hinblick auf Adressenausfallrisiken stehen Anleihen mit solider Kreditqualität im Fokus. Die drei Anleihepositionen haben ein S&P-Rating von AA, AA- und A+. Auch bei den Rentenfonds wird auf beste Kreditqualität geachtet.

### Zinsänderungsrisiko

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

### Währungsrisiko

Über das gesamte Fondsvermögen hinweg ist der CA Familienstrategie zu 68,5% in EUR investiert, zu 25,8% in USD, zu 0,8% in NOK, zu 1,9% in CHF, zu 1,7% in DKK, zu 0,6% in GBP, zu 0,7% in SEK.

### Liquiditätsrisiko

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

Aufgrund der Anlagepolitik ist das Sondervermögen den Rentenmärkten inhärenten Liquiditätsrisiken ausgesetzt. Um diese Liquiditätsrisiken zu begrenzen, achtet das Fondsmanagement auf ein ausreichendes Emissionsvolumen der einzelnen Anleihen sowie einen hohen Diversifikationsgrad im Sondervermögen.

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

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

### Operationelles Risiko

Die Verwaltung eines Fonds unterliegt grundsätzlich operationellen (betrieblichen) 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 Kon-

trahenten 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.

Die Geschäftsprozesse der Kapitalverwaltungsgesellschaft, der Auslagerungsunternehmen sowie der Corvus Advisory GmbH sind darauf ausgelegt, dass operationelle Risiken soweit wie möglich vermieden werden.

#### Sonstige Risiken

Die Ausbreitung der Atemwegserkrankung COVID-19 hat weltweit zu massiven Einschnitten in das öffentliche Leben mit erheblichen Folgen u.a. für die Wirtschaft und deren Unternehmen geführt. In diesem Zusammenhang kam es zu hohen Kursschwankungen an den Kapitalmärkten. Die weiteren Auswirkungen von COVID-19 auf die Realwirtschaft bzw. die Finanzmärkte sind auch weiterhin mit Unsicherheiten behaftet.

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.

Es sind keine sonstigen wesentlichen Ereignisse eingetreten.

Portfoliomanager des Fonds:

Aramea Asset Management AG

Kleine Johannisstr. 4

20457 Hamburg

## Vermögensübersicht

### VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens <sup>1)</sup>
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>39.059.447,22</b>	<b>100,12</b>
1. Aktien	17.730.558,77	45,45
2. Anleihen	6.046.570,14	15,50
3. Sonstige Beteiligungswertpapiere	238.672,01	0,61
4. Investmentanteile	6.054.488,76	15,52
5. Derivate	80.595,65	0,21
6. Bankguthaben	8.875.508,01	22,75
7. Sonstige Vermögensgegenstände	33.053,88	0,08
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-45.822,84</b>	<b>-0,12</b>
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-45.822,84	-0,12
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>EUR 39.013.624,38</b>	<b>100,00</b>

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

# Vermögensaufstellung

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>	
						im Berichtszeitraum				
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>22.482.078,52</b>	<b>57,63</b>	
<b>Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>17.730.558,77</b>	<b>45,45</b>	
CH0011075394	Zurich Insurance Group		STK	600	0	800	CHF	448,4000	273.150,92	0,70
DK0060534915	Novo-Nordisk AS		STK	2.200	0	2.000	DKK	940,9000	278.361,55	0,71
DE0008404005	Allianz		STK	1.800	0	700	EUR	203,7000	366.660,00	0,94
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	800	800	0	EUR	516,7000	413.360,00	1,06
FR0000125338	Cap Gemini <sup>2)</sup>		STK	3.400	3.400	0	EUR	158,0000	537.200,00	1,38
FR001400AJ45	Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50		STK	14.400	14.400	0	EUR	26,8000	385.920,00	0,99
DE0006062144	Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.		STK	10.900	10.900	0	EUR	36,8800	401.992,00	1,03
DE0005552004	Deutsche Post		STK	19.900	19.900	0	EUR	35,5000	706.450,00	1,81
DE0005557508	Deutsche Telekom		STK	17.000	28.000	11.000	EUR	19,0840	324.428,00	0,83
DE000DWS1007	DWS Group GmbH & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.		STK	7.000	7.000	0	EUR	30,5400	213.780,00	0,55
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18 <sup>2)</sup>		STK	5.800	5.800	0	EUR	171,9500	997.310,00	2,56
ES0144580Y14	Iberdrola		STK	30.083	1.869	18.950	EUR	11,0150	331.364,25	0,85
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	14.000	14.000	0	EUR	28,6900	401.660,00	1,03
FR0000120321	L'Oréal		STK	1.300	1.300	0	EUR	338,7000	440.310,00	1,13
FR0000121014	LVMH		STK	500	1.000	880	EUR	696,5000	348.250,00	0,89
DE0007164600	SAP		STK	2.200	0	2.200	EUR	97,5900	214.698,00	0,55
FR0000121972	Schneider Electric <sup>2)</sup>		STK	6.000	3.300	620	EUR	133,5000	801.000,00	2,05
DE0007236101	Siemens		STK	3.000	4.400	3.200	EUR	130,4400	391.320,00	1,00
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.		STK	10.800	2.800	0	EUR	35,1500	379.620,00	0,97
FR0000125486	VINCI <sup>2)</sup>		STK	4.700	4.700	0	EUR	94,2500	442.975,00	1,14
GB0007908733	SSE PLC Shs LS-,50		STK	10.000	10.000	0	GBP	17,2700	195.185,35	0,50
NO0003054108	Mowi ASA		STK	15.800	0	10.700	NOK	167,0000	250.232,35	0,64
FI4000297767	Nordea Bank Abp		STK	25.000	25.000	0	SEK	112,5200	252.218,00	0,65
US00724F1012	Adobe Systems Inc. <sup>2)</sup>		STK	2.100	3.400	1.300	USD	337,5800	664.589,86	1,70
US02079K3059	Alphabet Inc. Cl. A		STK	4.000	8.000	4.200	USD	88,4500	331.677,14	0,85
US0311621009	Amgen		STK	1.300	0	1.300	USD	263,1600	320.716,23	0,82
US0378331005	Apple Inc. <sup>2)</sup>		STK	2.600	2.600	0	USD	129,6100	315.914,50	0,81
US0584981064	Ball Corp.		STK	7.000	7.000	0	USD	51,6200	338.745,66	0,87
CA1363751027	Canadian National Railway Co.		STK	2.700	1.000	3.700	USD	120,4300	304.828,91	0,78
US17275R1023	Cisco Systems <sup>2)</sup>		STK	14.200	11.500	2.500	USD	47,5000	632.323,99	1,62
US20030N1019	Comcast Corp. Class A		STK	5.100	0	0	USD	35,0500	167.577,58	0,43
US1266501006	CVS Health Corp. <sup>2)</sup>		STK	4.100	4.100	0	USD	93,4500	359.187,21	0,92
IE00B8KQN827	Eaton Corporation <sup>2)</sup>		STK	4.600	5.400	800	USD	157,3500	678.550,67	1,74
CA29250N1050	Enbridge		STK	4.000	6.600	2.600	USD	39,2700	147.257,90	0,38
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co.		STK	1.900	3.700	1.800	USD	133,2200	237.290,71	0,61
IE00BTN1Y115	Medtronic PLC		STK	4.200	5.300	5.900	USD	77,8100	306.367,30	0,79

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
US5949181045	Microsoft Corp. <sup>2)</sup>		STK	3.000	3.400	3.100 USD	241,0100	677.819,44	1,74
US6541061031	Nike		STK	5.900	3.900	1.700 USD	117,3500	649.071,90	1,66
US7010941042	Parker-Hannifin		STK	600	2.600	2.000 USD	292,0000	164.244,87	0,42
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc. <sup>2)</sup>		STK	7.200	5.000	0 USD	70,5600	476.265,12	1,22
US7134481081	PepsiCo Inc		STK	1.900	0	2.100 USD	181,9800	324.141,75	0,83
US7427181091	Procter & Gamble		STK	2.200	300	800 USD	152,5900	314.707,04	0,81
US79466L3024	Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001 <sup>2)</sup>		STK	3.900	6.800	2.900 USD	132,5400	484.584,23	1,24
US92826C8394	VISA <sup>2)</sup>		STK	1.200	0	4.350 USD	208,0600	234.060,19	0,60
US94106L1098	Waste Management		STK	1.700	0	3.150 USD	158,8700	253.191,15	0,65

Verzinsliche Wertpapiere							EUR	4.512.847,74	11,57
DE000A3H2ZX9	0,100000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R. 35384 v.21(26)		EUR	900	900	0 %	85,1570	766.413,18	1,96
XS2397077426	0,125000000% Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2021(29)		EUR	860	860	0 %	79,9225	687.333,50	1,76
XS1752475720	1,000000000% Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2018(27/27)		EUR	850	0	850 %	89,8520	763.742,00	1,96
FR0013403441	1,250000000% Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 19/24		EUR	900	900	0 %	97,6655	878.989,50	2,25
XS2502850865	1,625000000% EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 2022(27)		EUR	250	250	0 %	93,1135	232.783,75	0,60
AT0000A308C5	2,000000000% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(26)		EUR	250	250	0 %	97,4880	243.720,00	0,62
DE0001104909	2,200000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)		EUR	250	250	0 %	99,1465	247.866,25	0,64
XS0936339208	2,250000000% Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2013(25)		EUR	200	200	0 %	97,8945	195.789,07	0,50
FR0011619436	2,250000000% Frankreich EO-OAT 13/24		EUR	250	250	0 %	99,4115	248.528,82	0,64
DE000A30VUG3	2,500000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN-IHS v.22(25)		EUR	250	250	0 %	99,0727	247.681,67	0,63

Sonstige Beteiligungswertpapiere							EUR	238.672,01	0,61
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.		STK	800	0	300 CHF	293,8500	238.672,01	0,61

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	1.533.722,40	3,93
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	1.533.722,40	3,93
XS2262263622	0,010000000% Ontario, Provinz EO-Medium-Term Notes 2020(30)		EUR	900	0	900 %	76,9611	692.649,90	1,78
DE000DL19VR6	1,000000000% Deutsche Bank 20/25		EUR	900	900	0 %	93,4525	841.072,50	2,16

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>6.054.488,76</b>	<b>15,52</b>
<b>KVG - eigene Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>3.990.442,53</b>	<b>10,23</b>
DE000A3CNGA8	Aramea Rendite Global Nachhalt Inhaber-Anteile I	ANT		20.000	20.000	0	EUR 90,0900	1.801.800,00	4,62
DE000A1J67R2	Rücklagenfonds I	ANT		2.425	0	940	EUR 902,5330	2.188.642,53	5,61
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>2.064.046,23</b>	<b>5,29</b>
DE000A0M6W36	CSR Bond Plus OP	ANT		22.073	0	8.400	EUR 93,5100	2.064.046,23	5,29
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>30.070.289,68</b>	<b>77,08</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>80.595,65</b>	<b>0,21</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>-229.120,21</b>	<b>-0,59</b>
<b>Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>							<b>EUR</b>	<b>-229.120,21</b>	<b>-0,59</b>
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>-229.120,21</b>	<b>-0,59</b>
Put Zurich Insurance Group AG 420,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-1.000			CHF 5,4900	-557,39	0,00
Put Zurich Insurance Group AG 420,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-8.000			CHF 5,4900	-4.459,11	-0,01
Put Novo-Nordisk AS 800,000000000 16.06.2023		XCSE	STK	-3.700			DKK 17,0374	-8.477,10	-0,02
Call Capgemini 164,000000000 20.01.2023		XEUR	STK	-2.400			EUR 1,9500	-4.680,00	-0,01
Call EssilorLuxottica S.A. 180,000000000 20.01.2023		XMON	STK	-5.800			EUR 1,3300	-7.714,00	-0,02
Call Schneider Electric 150,000000000 20.01.2023		XEUR	STK	-3.300			EUR 0,0400	-132,00	0,00
Call Vinci 100,000000000 17.02.2023		FMTS	STK	-4.700			EUR 0,8000	-3.760,00	-0,01
Put Allianz Option 184,000000000 17.02.2023		XEUR	STK	-2.200			EUR 1,4300	-3.146,00	-0,01
Put ASML 470,000000000 20.01.2023		XAMS	STK	-100			EUR 4,9300	-493,00	0,00
Put ASML 470,000000000 20.01.2023		XAMS	STK	-600			EUR 4,9300	-2.958,00	-0,01
Put ASML 470,000000000 20.01.2023		XAMS	STK	-100			EUR 4,9300	-493,00	0,00
Put ASML 470,000000000 20.01.2023		XAMS	STK	-100			EUR 4,9300	-493,00	0,00
Put Deutsche Telekom 18,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-22.000			EUR 0,3200	-7.040,00	-0,02
Put Infineon 26,500000000 20.01.2023		XEUR	STK	-15.000			EUR 0,3000	-4.500,00	-0,01
Put LVMH 550,000000000 17.03.2023		XPAR	STK	-700			EUR 5,0800	-3.556,00	-0,01
Put Merck *DE* 160,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-2.500			EUR 2,2400	-5.600,00	-0,01
Put Roche 280,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-1.400			EUR 7,2400	-10.290,88	-0,03
Put UPM-Kymmene Corp. 30,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-13.300			EUR 0,2900	-3.857,00	-0,01
Put Vinci 84,000000000 17.03.2023		XEUR	STK	-4.800			EUR 1,1600	-5.568,00	-0,01
Put MOWI ASA 140,000000000 17.03.2023		XOSL	STK	-30.000			NOK 1,7000	-4.836,60	-0,01
Call Adobe Systems 350,000000000 20.01.2023		XNAS	STK	-1.100			USD 6,8250	-7.038,06	-0,02
Call Apple Inc. 155,000000000 17.02.2023		XNAS	STK	-2.600			USD 0,5900	-1.438,08	0,00
Call Cisco Systems 50,000000000 20.01.2023		XCBO	STK	-14.200			USD 0,1750	-2.329,61	-0,01

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
						im Berichtszeitraum			
	Call CVS Health Corp. Option 100,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-4.100			USD 0,2550	-980,13	0,00
	Call Eaton Corp 160,000000000 20.01.2023	XNYS	STK	-3.500			USD 2,5750	-8.448,95	-0,02
	Call Microsoft 260,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-1.500			USD 1,2550	-1.764,79	0,00
	Call PayPal Holdings Inc. 110,000000000 16.06.2023	XNAS	STK	-5.000			USD 1,0350	-4.851,41	-0,01
	Call SALESFORCE 180,000000000 16.06.2023	XNAS	STK	-3.900			USD 2,4200	-8.847,85	-0,02
	Call VISA Inc. 220,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-1.200			USD 1,0450	-1.175,59	0,00
	Put Alphabet Option 75,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-1.600			USD 2,2150	-3.322,40	-0,01
	Put Alphabet Option 75,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-200			USD 2,2150	-415,30	0,00
	Put Alphabet Option 75,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-1.900			USD 2,2150	-3.945,35	-0,01
	Put Alphabet Option 75,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-100			USD 2,2150	-207,65	0,00
	Put Alphabet Option 75,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-500			USD 2,2150	-1.038,25	0,00
	Put Alphabet Option 75,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-1.400			USD 2,2150	-2.907,10	-0,01
	Put Amgen 260,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-1.600			USD 11,7250	-17.586,95	-0,05
	Put Canadian Natl Railway Co. 100,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-4.000			USD 0,1011	-379,09	0,00
	Put Danaher Corp. Option 240,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-1.700			USD 1,2000	-1.912,44	0,00
	Put Deere & Co. 380,000000000 17.03.2023	XNAS	STK	-1.100			USD 8,1000	-8.352,86	-0,02
	Put Eaton Corp 130,000000000 20.01.2023	XNYS	STK	-3.100			USD 0,1369	-397,87	0,00
	Put Eaton Corp 150,000000000 21.04.2023	XNYS	STK	-2.800			USD 5,9500	-15.618,26	-0,04
	Put Huntsman Corp. 24,000000000 17.02.2023	XNAS	STK	-17.300			USD 0,3500	-5.676,39	-0,01
	Put Linde 250,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-1.600			USD 0,3250	-487,48	0,00
	Put Parker-Hannifin Corp Option 280,000000000 17.02.2023	XNYS	STK	-1.500			USD 7,6000	-10.687,17	-0,03
	Put PepsiCo 165,000000000 21.04.2023	XNAS	STK	-2.400			USD 2,5900	-5.827,32	-0,01
	Put Procter & Gamble 135,000000000 17.02.2023	XCBO	STK	-3.100			USD 0,7200	-2.092,43	-0,01
	Put VISA Inc. 175,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-2.300			USD 0,2000	-431,24	0,00
	Put Walt Disney Co. 90,000000000 17.02.2023	XNAS	STK	-4.500			USD 6,5250	-27.526,48	-0,07
	Put Waste Management Inc. 145,000000000 20.01.2023	XNAS	STK	-2.700			USD 0,3250	-822,63	0,00
<b>Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>							<b>EUR</b>	<b>269.392,90</b>	<b>0,69</b>
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>-8.027,10</b>	<b>-0,02</b>
	E-Mini S&P 500 17.03.2023	XCME	USD Anzahl	-15				19.862,66	0,05
	E-Mini S&P 500 17.03.2023	XCME	USD Anzahl	-20				-20.389,99	-0,05
	E-Mini S&P 500 17.03.2023	XCME	USD Anzahl	-5				-7.499,77	-0,02
<b>Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>277.420,00</b>	<b>0,71</b>
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>							<b>EUR</b>	<b>277.420,00</b>	<b>0,71</b>
	Put ESTX 50 3500,000000000 16.06.2023	XEUR	EUR Anzahl	260			EUR 106,7000	277.420,00	0,71

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens <sup>1)</sup>
					im Berichtszeitraum				
<b>Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)</b>							<b>EUR</b>	<b>40.322,96</b>	<b>0,10</b>
<b>Währungsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>40.322,96</b>	<b>0,10</b>
	FUTURES EUR/USD 03/23	XCME	USD	9.250.000				40.322,96	0,10
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>8.875.508,01</b>	<b>22,75</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>							<b>EUR</b>	<b>6.318.924,33</b>	<b>16,20</b>
	Bank: National-Bank AG		EUR	1.498.680,16				1.498.680,16	3,84
	Bank: UniCredit Bank AG		EUR	2.695.124,11				2.695.124,11	6,91
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		EUR	2.125.120,06				2.125.120,06	5,45
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>472.943,05</b>	<b>1,21</b>
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		DKK	2.927.881,72				393.728,29	1,01
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		NOK	509.254,52				48.295,29	0,12
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		SEK	344.846,41				30.919,47	0,08
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							<b>EUR</b>	<b>2.083.640,63</b>	<b>5,34</b>
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CHF	237.228,91				240.853,76	0,62
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		GBP	44.710,43				50.531,68	0,13
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		USD	1.911.798,62				1.792.255,19	4,59
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>33.053,88</b>	<b>0,08</b>
	Dividendenansprüche		EUR	4.466,77				4.466,77	0,01
	Quellensteueransprüche		EUR	596,22				596,22	0,00
	Zinsansprüche		EUR	27.990,89				27.990,89	0,07
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-45.822,84</b>	<b>-0,12</b>
	Sonstige Verbindlichkeiten <sup>3)</sup>		EUR	-45.822,84				-45.822,84	-0,12
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>39.013.624,38</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert CA Familienstrategie A</b>							<b>EUR</b>	<b>97,45</b>	
<b>Anteilwert CA Familienstrategie B</b>							<b>EUR</b>	<b>95,59</b>	
<b>Umlaufende Anteile CA Familienstrategie A</b>							<b>STK</b>	<b>388.887,000</b>	
<b>Umlaufende Anteile CA Familienstrategie B</b>							<b>STK</b>	<b>11.691,000</b>	

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

<sup>2)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren. Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind: 5.820.161,55 EUR.

<sup>3)</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 30.12.2022		
Britisches Pfund	(GBP)	0,884800	=	1 Euro (EUR)
Dänische Krone	(DKK)	7,436300	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,447350	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	10,544600	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	11,153050	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,984950	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,066700	=	1 Euro (EUR)

## MARKTSCHLÜSSEL

### Terminbörse

FMTS	MTS FRANCE SAS
XAMS	NYSE EURONEXT - EURONEXT AMSTERDAM
XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
XCME	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
XCSE	OMX NORDIC EXCHANGE COPENHAGEN A/S
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND
XMON	EURONEXT PARIS MONEP
XNAS	NASDAQ - ALL MARKETS
XNYS	NEW YORK STOCK EXCHANGE, INC.
XOSL	OSLO BORS ASA
XPAR	NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
FR0000120073	Air Liquide	STK	4	39
FR0000121261	Cie Génle Éts Michelin	STK	0	3.700
US2441991054	Deere	STK	1.400	3.400
DE000EVNK013	Evonik Industries	STK	8.000	16.000
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	0	2.300
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	0	6.000
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.	STK	0	50.000
FR0000120271	TotalEnergies S.E.	STK	6.000	12.000
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK -,20	STK	26.000	34.000
DE0007664039	Volkswagen Vorzugsaktien	STK	0	2.800
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
FR0013313582	1,2500000000% Frankreich EO-OAT 18/34	EUR	0	1.600
<b>Zertifikate</b>				
DE000A0S9GB0	Xetra-Gold	STK	41.500	41.500
<b>Andere Wertpapiere</b>				
ES0644580906	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	39.000	39.000
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
ES0144583269	Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.7/22 EO -,75	STK	1.083	1.083
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
US912828XX34	2,0000000000% United States of America DL-Notes 17/24	USD	280	280
<b>Andere Wertpapiere</b>				
ES06445809N8	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	47.164	47.164
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
ES0144583251	Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.2/22	STK	786	786
<b>Investmentanteile</b>				
<b>KVG - eigene Investmentanteile</b>				
DE000A2DTL03	FRAM Capital Skandinavien Inhaber-Anteile I	ANT	22.900	45.800
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
IE00BJ5JNT46	Lazard GIF-Laz.Scan.Hi.Qual.Bd Reg. Shs C EUR Acc. oN	ANT	0	20.500
LU1378878604	Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.USD o.N.	ANT	21.000	42.000
LU1545248863	SEB Fund 5-Danish Mortg. Bd Fd Namens-Anteile IC (EUR) o.N.	ANT	0	19.500
LU0570871706	Threadneedle(Lux) Eurp Sm Cos Ab Alp IE	ANT	15.000	30.000

## 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>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			4.794
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
S&P 500 Index)				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			88.203
DAX Index				
ESTX 50 Index (Price) (EUR)				
S&P 500 Index)				
<b>Währungsterminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			10.164
Euro/US-Dollar)				
<b>Optionsrechte</b>				
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			520
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001				
Adobe Systems Inc.				
Alphabet Inc. Cl. A				
Apple Inc.				
ASML Holding N.V.				
Cie Génle Éts Michelin				
Cisco Systems				
CVS Health Corp.				
Deere				
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18				
JPMorgan Chase & Co.				
L'Oréal				
LVMH				
Medtronic PLC				
Microsoft Corp.				
Nike				
Novo-Nordisk AS				
Parker-Hannifin				
PayPal Holdings Inc.				
Schneider Electric				
Siemens				
Telefonaktiebolaget L.M.Erics.				
TotalEnergies I S.E.				
Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK -,20				
VINCI				
VISA				
Volkswagen Vorzugsaktien)				

## 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
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			1.272
Adobe Systems Inc.				
Abbott Laboratories				
Allianz				
Alphabet Inc. Cl. A				
Amgen				
Apple Inc.				
ASML Holding N.V.				
Ball Corp.				
BASF				
Canadian National Railway Co.				
Cap Gemini				
Cie Génle Éts Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50				
Cisco Systems				
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.				
CVS Health Corp.				
Danaher				
Deere				
Delta Air Lines				
Deutsche Post				
Eaton Corporation				
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18				
Huntsman				
Infineon Technologies AG				
JPMorgan Chase & Co.				
L'Oréal				
Linde PLC				
LVMH				
Medtronic PLC				
Merck				
Microsoft Corp.				
Münchener Rückversicherung				
Nike				
Novo-Nordisk AS				
Parker-Hannifin				
PayPal Holdings Inc.				
PepsiCo Inc				
Procter & Gamble				
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001				
SAP				
Schneider Electric				
Siemens				
Telefonaktiebolaget L.M.Erics.				
The Walt Disney Co.				
TotalEnergiesl S.E.				
UPM Kymmene Corp.				

## 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
Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier DK -,20				
VINCI				
VISA				
Waste Management)				
<b>Optionsrechte auf Genussscheine</b>				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			7
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.)				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			27
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.)				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			1.470
DAX Index)				

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

### FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2022 BIS 31.12.2022

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden inländischer Aussteller		67.616,81
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		305.752,15
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		19.032,09
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		16.856,18
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-11.647,26
davon negative Habenzinsen	-22.355,28	
6. Erträge aus Investmentanteilen		54.365,35
7. Abzug ausländischer Quellensteuer		-59.377,07
8. Sonstige Erträge		5.553,96
<b>Summe der Erträge</b>		<b>398.152,21</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-1.726,73
2. Verwaltungsvergütung		-315.485,24
3. Verwahrstellenvergütung		-11.838,01
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-9.593,78
5. Sonstige Aufwendungen		-8.940,71
6. Aufwandsausgleich		332,23
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-347.252,24</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>50.899,97</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		5.502.885,89
2. Realisierte Verluste		-3.685.913,05
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>1.816.972,84</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>1.867.872,81</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-1.935.410,38
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-3.149.614,93
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-5.085.025,31</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-3.217.152,50</b>

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

### FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2022 BIS 31.12.2022

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden inländischer Aussteller		1.987,91
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		9.024,19
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		563,63
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		500,01
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-338,79
davon negative Habenzinsen	-658,38	
6. Erträge aus Investmentanteilen		1.611,35
7. Abzug ausländischer Quellensteuer		-1.752,83
8. Sonstige Erträge		163,33
<b>Summe der Erträge</b>		<b>11.758,80</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-48,21
2. Verwaltungsvergütung		-11.177,68
3. Verwahrstellenvergütung		-332,31
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-269,63
5. Sonstige Aufwendungen		-252,62
6. Aufwandsausgleich		-613,81
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-12.694,26</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>-935,46</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		162.229,63
2. Realisierte Verluste		-108.510,60
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>53.719,03</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>52.783,57</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-48.465,54
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-94.725,02
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-143.190,56</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-90.406,99</b>

**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH)****FÜR DEN ZEITRAUM VOM 01.01.2022 BIS 31.12.2022**

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden inländischer Aussteller		69.604,72
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		314.776,34
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		19.595,72
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		17.356,19
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-11.986,05
davon negative Habenzinsen	-23.013,66	
6. Erträge aus Investmentanteilen		55.976,70
7. Abzug ausländischer Quellensteuer		-61.129,90
8. Sonstige Erträge		5.717,29
<b>Summe der Erträge</b>		<b>409.911,01</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-1.774,94
2. Verwaltungsvergütung		-326.662,92
3. Verwahrstellenvergütung		-12.170,32
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-9.863,41
5. Sonstige Aufwendungen		-9.193,33
6. Aufwandsausgleich		-281,58
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-359.946,50</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>49.964,51</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		5.665.115,52
2. Realisierte Verluste		-3.794.423,65
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>1.870.691,87</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>1.920.656,38</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-1.983.875,92
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-3.244.339,95
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-5.228.215,87</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-3.307.559,49</b>

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE A

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.01.2022)</b>		<b>42.207.529,60</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.054.994,87
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-40.975,40
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-40.975,40	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		1.620,59
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-3.217.152,50
davon nicht realisierte Gewinne	-1.935.410,38	
davon nicht realisierte Verluste	-3.149.614,93	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.12.2022)</b>		<b>37.896.027,42</b>

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE B

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres (01.01.2022)</b>		<b>1.178.701,30</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		-29.416,94
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		61.265,01
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	61.265,01	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-2.545,42
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-90.406,99
davon nicht realisierte Gewinne	-48.465,54	
davon nicht realisierte Verluste	-94.725,02	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres (31.12.2022)</b>		<b>1.117.596,96</b>

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>43.386.230,90</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.084.411,81
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		20.289,61
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	61.265,01	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-40.975,40	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-924,83
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-3.307.559,49
davon nicht realisierte Gewinne	-1.983.875,92	
davon nicht realisierte Verluste	-3.244.339,95	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>39.013.624,38</b>

## VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE A <sup>1)</sup>

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>	<b>11.828.515,62</b>	<b>30,42</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr	6.217.452,43	15,99
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	1.961.078,94	5,04
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	3.649.984,25	9,39
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>	<b>-10.883.131,33</b>	<b>-27,99</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	-10.883.131,33	-27,99
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>945.384,30</b>	<b>2,43</b>
1. Endausschüttung	945.384,30	2,43
a) Barausschüttung	945.384,30	2,43

<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)

## VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS CA FAMILIENSTRATEGIE B <sup>1)</sup>

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>	<b>233.464,67</b>	<b>19,97</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr	70.583,46	6,04
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	55.430,19	4,74
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	107.451,02	9,19
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>	<b>-203.994,59</b>	<b>-17,45</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt	-36.355,05	-3,11
2. Vortrag auf neue Rechnung	-167.639,54	-14,34
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>27.883,04</b>	<b>2,39</b>
1. Endausschüttung	27.883,04	2,39
a) Barausschüttung	27.883,04	2,39

<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 CA FAMILIENSTRATEGIE A

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2022	37.896.027,42	97,45
2021	42.207.529,60	108,42
2020	36.449.249,63	103,54
2019	38.871.343,91	110,44

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

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
2022	1.117.596,96	95,59
2021	1.178.701,30	106,58
2020	1.067.652,00	102,07
(Auflegung 01.10.2020)	1.000.000,00	100,00

## VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE FÜR DAS GESAMTFONDSVERMÖGEN

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres
	EUR
2022	39.013.624,38
2021	43.386.230,90
2020	37.516.901,63
2019	38.871.343,91
(Auflegung 01.10.2020)	1.000.000,00

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	11.575.247,78
<b>Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte</b>		
Donner & Reuschel AG		
<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>		
EURO STOXX 50 Index In EUR		75,00%
JP Morgan GBI European Bond Index in EUR		25,00%
<b>Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV</b>		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,53%
größter potenzieller Risikobetrag		1,72%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		0,92%
<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>1,17</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 CA Familienstrategie A	EUR	97,45
Anteilwert CA Familienstrategie B	EUR	95,59
Umlaufende Anteile CA Familienstrategie A	STK	388.887,000
Umlaufende Anteile CA Familienstrategie B	STK	11.691,000

### ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

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

## ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

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

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

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

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

## ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE CA FAMILIENSTRATEGIE A

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	0,88 %
---	--------

## ANGABEN ZUR TRANSPARENZ SOWIE ZUR GESAMTKOSTENQUOTE CA FAMILIENSTRATEGIE B

Kostenquote (Total Expense Ratio (TER))	1,09 %
---	--------

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

## TRANSAKTIONEN IM ZEITRAUM VOM 01.01.2022 BIS 31.12.2022

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	291.878.834,28
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	291.878.834,28
Relativ in %	100,00 %

Transaktionskosten: 114.266,68 EUR

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

## AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

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

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

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

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

## VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
DE000A3CNGA8	Aramea Rendite Global Nachhalt Inhaber-Anteile I <sup>1)</sup>	0,79
DE000A0M6W36	CSR Bond Plus OP <sup>1)</sup>	0,34
DE000A2DTL03	FRAM Capital Skandinavien Inhaber-Anteile I <sup>1)</sup>	1,50
IE00BJ5JNT46	Lazard GIF-Laz.Scan.Hi.Qual.Bd Reg. Shs C EUR Acc. oN <sup>1)</sup>	0,35
LU1378878604	Mo.Stanley Inv.Fds-Asia Opp.Fd Actions Nom.Z Cap.USD o.N. <sup>1)</sup>	0,75
DE000A1J67R2	Rücklagenfonds I <sup>1)</sup>	0,45
LU1545248863	SEB Fund 5-Danish Mortg. Bd Fd Namens-Anteile IC (EUR) o.N. <sup>1)</sup>	0,30
LU0570871706	Threadneedle(Lux) Eurp Sm Cos Ab Alp IE <sup>1)</sup>	0,75

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

## WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

### CA Familienstrategie A

#### Sonstige Erträge

Erträge aus Quellensteuer Erstattung	EUR	4.990,28
--------------------------------------	-----	----------

#### Sonstige Aufwendungen

Depotgebühren	EUR	5.938,84
---------------	-----	----------

### CA Familienstrategie B

#### Sonstige Erträge

Erträge aus Quellensteuer Erstattung	EUR	146,74
--------------------------------------	-----	--------

#### Sonstige Aufwendungen

Depotgebühren	EUR	168,35
---------------	-----	--------

## 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

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 Aramea Asset Management AG für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

<b>Portfoliomanager</b>	<b>Aramea Asset Management AG</b>
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>EUR 8.906.940,09</b>
davon feste Vergütung	EUR 3.492.208,09
davon variable Vergütung	EUR 5.414.732,00
<b>Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen</b>	<b>EUR 0,00</b>
<b>Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens</b>	<b>28</b>

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

### Anforderung

Angaben zu den mittel- bis langfristigen Risiken:

Zusammensetzung des Portfolios,  
Portfolioumsätze und Portfolioumsatzkosten:

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

Einsatz von Stimmrechtsberatern:

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

Hamburg, 06. Juni 2023

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

### Verweis

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

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

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

Informationen zur Stimmrechtsausübung sind auf der Internetseite der HANSAINVEST erhältlich.

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

## Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH,  
Hamburg

### Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens CA Familienstrategie – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 01. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

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

### Grundlage für das Prüfungsurteil

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

teil zum Jahresbericht zu dienen.

### Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht

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

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

### Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts

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

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

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* abzugeben
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der *HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH* bei der Aufstellung des 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 07.06.2023

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: [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**

---

Donner & Reuschel AG  
Ballindamm 27  
20095 Hamburg

Haftendes Eigenkapital: 380,667 Mio. EUR  
Eingezahltes Eigenkapital: 20,500 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)

**HANSA**INVEST