

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

JAHRESBERICHT

ROCKCAP GLOBAL EQUITY

30. September 2022

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Tätigkeitsbericht ROCKCAP GLOBAL EQUITY	4
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	14
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	18
Allgemeine Angaben	20

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

ROCKCAP GLOBAL EQUITY

in der Zeit vom 15.10.2021 bis 30.09.2022.

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Rockcap Global Equity 15.10.2021 bis 30.09.2022

GLIEDERUNG:

- 1) Anlageziel / Anlagepolitik
- 2) Sektorengewichtung / Veräußerungsergebnisse
- 3) Risikoberichterstattung
- 4) Darstellung des mit dem Portfoliomanagement betrauten Unternehmens
- 5) Sonstige Hinweise

1) Anlageziel / Anlagepolitik

Ziel ist es, einen positiven Wertzuwachs zu generieren.

Grundlage des Investmentprozesses ist ein etablierter Research Prozess, bei dem der Fondsmanager Einzeltitel nach Attraktivität, Bewertung, Anlageregion, Dividendenerwartung, Datenbankanalysen, Wirtschaftsprognosen und persönlichen Gesprächen mit den Unternehmen auswählt. Nach Abschluss des Research Prozesses entscheidet der Fondsmanager unter Einhaltung der gesetzlichen Vorgaben über den Kauf oder Verkauf konkreter Vermögensgegenstände. Mindestens 51 % des Wertes des Sondervermögens müssen in Aktien (global) investiert werden.

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

Aktien und Aktien gleichwertige Wertpapiere min. 51 %

Wertpapiere, die keine Aktien und Aktien gleichwertige Papiere sind bis zu 49 %

Geldmarktinstrumente bis zu 49 %

Bankguthaben bis zu 49 %

Investmentvermögen ohne besondere Gewichtung (Mischfonds) bis zu 10 %

Das Sondervermögen kann gem. § 15 der Allgemeinen Anlagebedingungen kurzfristig Kredite zu Investitions-

zwecken von bis zu 10 % seines Wertes aufnehmen. Eine vollständige Investition in eine Anlageklasse bedeutet daher, dass in diese kurzfristig mehr als 100 % des Sondervermögens, nämlich bis maximal 110 % des Sondervermögens investiert werden kann.

Zielfonds werden ohne gesonderten regionalen Schwerpunkt erworben.

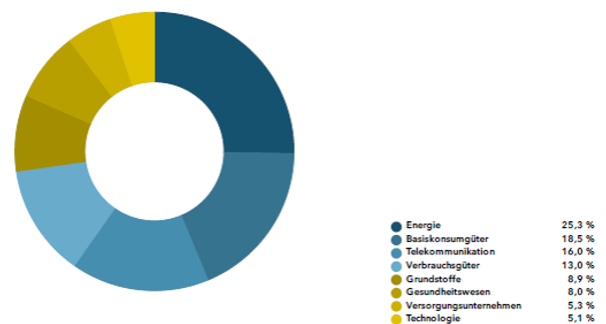
Derivate dürfen zu Absicherungs- und Spekulationszwecken erworben werden.

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

2) Sektorengewichtung:

Per 30.09.2022

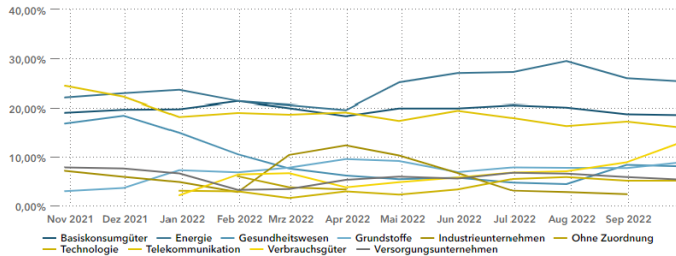
Aufteilung nach Branchen



Tabellarische Branchenallokation

Branche	Anteil in %	Anteil grafisch	Marktwert
Energie	25,26	<div style="width: 25.26%;"></div>	7.275.344,95
Basiskonsumgüter	18,50	<div style="width: 18.50%;"></div>	5.326.967,59
Telekommunikation	15,98	<div style="width: 15.98%;"></div>	4.600.362,68
Verbrauchsgüter	12,98	<div style="width: 12.98%;"></div>	3.738.271,48
Grundstoffe	8,86	<div style="width: 8.86%;"></div>	2.550.898,15
Gesundheitswesen	8,03	<div style="width: 8.03%;"></div>	2.313.567,12
Versorgungsunternehmen	5,30	<div style="width: 5.30%;"></div>	1.525.783,91
Technologie	5,09	<div style="width: 5.09%;"></div>	1.465.940,15

Branchenallokation im Zeitverlauf



Wesentliche Angaben über die Herkunft des Veräußerungsergebnisses

Die realisierten Gewinne resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von Aktien. Die Verluste aus Veräußerungsgeschäften wurden schwerpunktmäßig ebenfalls aus Verkäufen von Aktien erzielt.

3) Risikoberichterstattung

Das Investmentvermögen bestand überwiegend aus handelbaren Wertpapieren. Die **Marktpreisrisiken** lagen im Mittel der normalen Börsenentwicklung.

Es können Finanzinstrumente in anderen **Währungen** als der Fondswährung erworben werden. Der Fonds erhält Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus diesen Anlagen in der jeweiligen Assetwährung. Fällt der Wert dieser Währungen gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert der Anlagen und somit auch das Fondsvermögen. Derivate dürfen zu Absicherungs- und Spekulationszwecken erworben werden.

Durch die konsequente Anlage in liquide Aktientitel konnten überdurchschnittliche **Liquiditätsrisiken** vermieden werden. Zum Stichtag ist das Portfolio innerhalb von 10 Tagen zu 99,08% liquidierbar. Der Cash-Anteil beträgt zum Berichtszeitpunkt (30.09.2022) 0,90%.

Unter **operationalen 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 fol-

gende 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 Aktivität und Prozesse wird regelmäßig durch die Interne Revision überwacht.

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.

4) Darstellung des mit dem Portfoliomanagement

betrachten Unternehmens

TBF Global Asset Management GmbH wurde Anfang 2000 gegründet. Nach drei Jahren Aufbau und Entwicklung der Datenbank wurde im Oktober 2002 das erste Fondsmandat übernommen.

5) Sonstige Hinweise

Das Portfoliomanagement wurde an TBF Global Asset Management GmbH, Singen, ausgelagert.

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

TBF Global Asset Management GmbH ist Fondsmanager aller TBF-Fonds und entwickelt maßgeschneiderte Portfolios für institutionelle Investmentvermögen von Versicherungen, Pensionskassen, Dachfonds und Privatbanken aus dem In- und Ausland.

Der Fonds wurde am 15.10.2021 neu aufgelegt.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensübersicht

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	29.105.572,06	100,12
1. Aktien	28.797.136,03	99,05
2. Bankguthaben	219.939,50	0,76
3. Sonstige Vermögensgegenstände	88.496,53	0,30
II. Verbindlichkeiten	-33.703,73	-0,12
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-33.703,73	-0,12
III. Fondsvermögen	EUR 29.071.868,33	100,00

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

Vermögensaufstellung

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.09.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	28.797.136,03	99,05	
Aktien							EUR	28.797.136,03	99,05	
CA0084741085	Agnico-Eagle Mines		STK	7.400	7.400	0	CAD	58,3600	320.909,53	1,10
CA29250N1050	Enbridge		STK	29.000	29.000	0	CAD	51,2200	1.103.756,27	3,80
CA7397211086	PrairieSky Royalty Ltd. Registered Shares o.N.		STK	48.000	48.000	0	CAD	17,8100	635.244,29	2,19
CA74061A1084	Premium Brands Holdings Corp.		STK	5.000	5.000	0	CAD	85,0000	315.809,03	1,09
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc. Registered Shares o.N.		STK	18.000	18.000	0	CAD	73,4800	982.827,42	3,38
CA87807B1076	TC Energy Corp. Registered Shares o.N.		STK	23.500	23.500	0	CAD	55,6400	971.606,91	3,34
CA89055A2039	Topaz Energy Corp.		STK	57.000	57.000	0	CAD	20,8200	881.842,84	3,03
CA89156V1067	Tourmaline Oil		STK	16.000	16.000	0	CAD	71,7900	853.531,49	2,94
CA96467A2002	Whitecap Resources Inc.		STK	40.000	40.000	0	CAD	8,7400	259.780,79	0,89
DE000BAY0017	Bayer		STK	22.500	25.000	2.500	EUR	47,4150	1.066.837,50	3,67
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke		STK	14.500	14.500	0	EUR	69,9900	1.014.855,00	3,49
DE0005557508	Deutsche Telekom		STK	35.000	48.000	13.000	EUR	17,4920	612.220,00	2,11
IT0003128367	Enel		STK	190.000	190.000	0	EUR	4,2240	802.560,00	2,76
ES0148396007	Industria de Diseño Textil		STK	29.000	29.000	0	EUR	21,2800	617.120,00	2,12
FR0000133308	Orange		STK	76.000	76.000	0	EUR	9,2480	702.848,00	2,42
DE000PAH0038	Porsche Vz.		STK	10.000	10.000	0	EUR	58,1600	581.600,00	2,00
GB00BP6MXD84	Shell PLC Reg. Shares Class EO -, 07		STK	27.100	27.100	0	EUR	25,6350	694.708,50	2,39
GB0002875804	British American Tobacco		STK	26.745	26.745	0	GBP	32,2650	984.178,18	3,39
GB00BN7SWP63	GSK PLC		STK	45.000	45.000	0	GBP	13,0580	670.175,64	2,31
GB0004544929	Imperial Brands		STK	45.003	45.003	0	GBP	18,5500	952.104,98	3,28
GB00BDR05C01	National Grid		STK	68.112	68.112	0	GBP	9,3100	723.223,91	2,49
GB0007188757	Rio Tinto		STK	20.000	20.000	0	GBP	48,9600	1.116.788,32	3,84
GB00BH4HKS39	Vodafone Group		STK	457.000	457.000	0	GBP	1,0112	527.051,09	1,81
JP3726800000	Japan Tobacco		STK	56.000	56.000	0	JPY	2.374,0000	938.008,89	3,23
NO0010063308	Telenor		STK	106.000	117.300	11.300	NOK	99,6600	989.690,84	3,40
NO0010208051	Yara		STK	31.000	31.000	0	NOK	383,3000	1.113.200,30	3,83
US0220951033	Altria		STK	29.200	29.200	0	USD	40,3800	1.204.265,14	4,14
US00206R1023	AT & T		STK	51.000	51.000	0	USD	15,3400	799.039,93	2,75
US11135F1012	Broadcom Inc		STK	200	200	0	USD	444,0100	90.697,58	0,31
US1667641005	Chevron Corp.		STK	6.700	6.700	0	USD	143,6700	983.136,55	3,38
US2371941053	Darden Restaurants		STK	4.200	4.200	0	USD	126,3200	541.869,06	1,86
US24703L2025	Dell Technologies Inc.		STK	3.000	3.000	0	USD	34,1700	104.698,19	0,36
US30231G1022	Exxon Mobil		STK	10.000	10.000	0	USD	87,3100	891.737,31	3,07
US4581401001	Intel Corp.		STK	16.000	16.000	0	USD	25,7700	421.121,44	1,45
US4592001014	Intl Business Machines		STK	7.000	8.300	1.300	USD	118,8100	849.422,94	2,92
US7170811035	Pfizer		STK	12.900	22.900	10.000	USD	43,7600	576.553,98	1,98

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.09.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum		
US7181721090	Philip Morris Internat.		STK	11.000	11.000	0 USD	83,0100	932.601,37	3,21
US92343V1044	Verizon		STK	25.000	25.000	0 USD	37,9700	969.512,82	3,33
Summe Wertpapiervermögen							EUR	28.797.136,03	99,05
Bankguthaben							EUR	219.939,50	0,76
EUR - Guthaben bei:							EUR	215.915,10	0,74
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	215.915,10				215.915,10	0,74
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	4.024,40	0,01
Bank: Donner & Reuschel AG			USD	3.940,29				4.024,40	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	88.496,53	0,30
Dividendenansprüche			EUR	88.492,55				88.492,55	0,30
Sonstige Ansprüche			EUR	0,84				0,84	0,00
Zinsansprüche			EUR	3,14				3,14	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-33.703,73	-0,12
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾			EUR	-33.703,73				-33.703,73	-0,12
Fondsvermögen							EUR	29.071.868,33	100,00
Anteilwert ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I							EUR	113,14	
Umlaufende Anteile ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I							STK	256.961,000	

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

²⁾ 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 30.09.2022				
Britisches Pfund	(GBP)	0,876800	=	1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	(JPY)	141,730000	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,345750	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	(NOK)	10,674000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	0,979100	=	1 Euro (EUR)

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
US88579Y1010	3M Co.	STK	6.400	6.400
US00287Y1091	AbbVie Inc.	STK	1.400	1.400
GB0002634946	BAE Systems	STK	77.448	77.448
GB0007980591	BP PLC	STK	33.085	33.085
CA1363851017	Canadian Natural Resources	STK	2.400	2.400
JP3242800005	Canon	STK	7.500	7.500
US2605571031	Dow Inc.	STK	7.200	7.200
DE000ENAG999	E.ON SE	STK	14.000	14.000
GB00BMX86B70	Haleon PLC Reg.Shares LS 1,25	STK	33.694	33.694
DE0006070006	Hochtief	STK	7.100	7.100
AU000000IPH9	IPH Ltd Registered Shares o.N.	STK	15.000	15.000
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	STK	3.500	3.500
CH0012005267	Novartis	STK	2.350	2.350
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc. Registered Shares o.N.	STK	11.000	11.000
DE0007030009	Rheinmetall	STK	3.200	3.200
GB00B03MLX29	Shell	STK	6.739	6.739
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK	3.900	3.900
SE0000667925	TeliaSonera	STK	46.000	46.000
FR0000120271	TotalEnergies S.E.	STK	6.000	6.000
GB00B10RZP78	Unilever	STK	2.000	2.000
US91913Y1001	Valero Energy	STK	4.000	4.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
CA24477T1003	Definity Financial Corp.. Registered Shares o.N.	STK	1.000	1.000
US9344231041	Discovery Inc. Reg. Shares Series A DL-,01	STK	7.983	7.983
US64110D1046	NetApp Inc.	STK	9.000	9.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Aktien				
GB0009252882	GSK	STK	33.694	33.694
Verzinsliche Wertpapiere				
US704551AB64	Peabody Energy Corp. DL-Notes 2021(21/24) 144A	USD	400	400

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG (INKL. ERTRAGSAUSGLEICH) ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I

FÜR DEN ZEITRAUM VOM 15.10.2021 BIS 30.09.2022

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller		156.926,84
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		1.346.039,24
3. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		5.596,00
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-1.923,33
davon negative Habenzinsen	-2.408,96	
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-109.846,00
6. Sonstige Erträge		5.858,31
Summe der Erträge		1.402.651,06
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-2.215,29
2. Verwaltungsvergütung		-122.547,54
3. Verwahrstellenvergütung		-6.311,42
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-7.664,30
5. Sonstige Aufwendungen		-3.994,74
6. Aufwandsausgleich		-148.986,37
Summe der Aufwendungen		-291.719,66
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.110.931,40
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		1.750.293,27
2. Realisierte Verluste		-330.005,11
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.420.288,16
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		2.531.219,56
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		942.268,85
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-2.969.424,58
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		-2.027.155,73
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		504.063,83

ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres (15.10.2021)		0,00
2. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		29.810.352,23
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	29.889.039,77	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-78.687,54	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-1.242.547,73
4. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres		504.063,83
davon nicht realisierte Gewinne	942.268,85	
davon nicht realisierte Verluste	-2.969.424,58	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres (30.09.2022)		29.071.868,33

VERWENDUNG DER ERTRÄGE DES SONDERVERMÖGENS ROCKCAP GLOBAL EQUITY EURI ¹⁾

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für die Wiederanlage verfügbar	2.861.224,67	11,13
1. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	2.531.219,56	9,85
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	330.005,11	1,28
II. Wiederanlage	2.861.224,67	11,13

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

VERGLEICHENDE ÜBERSICHT ÜBER DIE LETZTEN DREI GESCHÄFTSJAHRE ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert
	EUR	EUR
Auflegung 15.10.2021	100,00	100,00
2022	29.071.868,33	113,14

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

ANGABEN NACH DER DERIVATEVERORDNUNG

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	0,00
Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.		
Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§37 Abs. 5 DerivateV)		
SP 500 Index		50,00%
EURO STOXX Index In EUR		50,00%
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §37 Abs. 4 DerivateV		
kleinster potenzieller Risikobetrag		0,00%
größter potenzieller Risikobetrag		2,56%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag		1,81%
Risikomodell (§10 DerivateV)		Full-Monte-Carlo
Parameter (§11 DerivateV)		
Konfidenzniveau		99,00%
Haltedauer		1 Tage
Länge der historischen Zeitreihe		1 Jahr
Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte		0,97

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 ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I	EUR	113,14
Umlaufende Anteile ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I	STK	256.961,000

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 Tagesschlusskursen des betroffenen 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 ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I

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

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 15.10.2021 BIS 30.09.2022

Transaktionen	Volumen in Fondswährung
Transaktionsvolumen gesamt	46.889.647,56
Transaktionsvolumen mit verbundenen Unternehmen	560.578,23
Relativ in %	1,20 %

Transaktionskosten: 106.446,44 EUR

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

AN DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT ODER DRITTE GEZAHLTE PAUSCHALVERGÜTUNGEN

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

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

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

WESENTLICHE SONSTIGE ERTRÄGE UND AUFWENDUNGEN

ROCKCAP GLOBAL EQUITY EUR I

Sonstige Erträge

QuSt. Erstattung	EUR	4.958,73
------------------	-----	----------

Sonstige Aufwendungen

BaFin Kosten	EUR	3.060,00
--------------	-----	----------

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 Vergütungssysteme 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 2021 und betreffen ausschließlich die in diesem Zeitraum bei der Gesellschaft beschäftigten Mitarbeiter.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung	EUR	19.375.239
davon feste Vergütung	EUR	15.834.735
davon variable Vergütung	EUR	3.540.503
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	EUR	0
Zahl der Mitarbeiter der KVG		263
Höhe des gezahlten Carried Interest	EUR	0
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen	EUR	1.273.467
davon Geschäftsleiter	EUR	1.273.467
davon andere Führungskräfte	EUR	0
davon andere Risikoträger	EUR	0
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	EUR	0
davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe	EUR	0

ANGABEN ZUR MITARBEITERVERGÜTUNG IM AUSLAGERUNGSFALL

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

Die Vergütungsdaten der TBF Global Asset Management GmbH für das Geschäftsjahr 2021 setzen sich wie folgt zusammen:

Portfoliomanager	TBF Global Asset Management GmbH
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung	0,00
davon feste Vergütung	0,00
davon variable Vergütung	0,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens	0

Das Auslagerungsunternehmen TBF Global Asset Management GmbH, Singen, beschäftigte im Geschäftsjahr 2021 keine Mitarbeiter, da die Personalgestellung durch die Muttergesellschaft TBF GmbH, Singen, erfolgt. Daher entfallen die Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall.

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, 23. Januar 2023

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz

Ludger Wibbeke

Verweis

Informationen zu den mittel- bis langfristigen Risiken der 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 ROCKCAP GLOBAL EQUITY – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr vom 15. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Rumpfgeschäftsjahr vom 15. Oktober 2021 bis zum 30. September 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 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 verantwortlich, 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 Überein-

stimmung 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 *HANSAINVEST 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 24.01.2023

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

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 22,659 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2021

- Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach

- Prof. Dr. Stephan Schüller

- Kaufmann

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- Dr. Jörg W. Stotz

- (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG)

- Nicholas Brinckmann

- (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)

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

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
Fuhlentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon (040) 3 00 57-62 96

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST