

Optinova Conventional & Clean Energy

Jahresbericht

zum

30. Juni 2020

Jahresbericht Optinova Conventional & Clean Energy

Vermögensübersicht zum 30.06.2020

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilgesellschaftsvermögen
I. Vermögensgegenstände	10.244.793,89	101,72
1. Aktien	6.223.483,29	61,79
Australien	229.106,46	2,27
Bermuda	97.958,12	0,97
Canada	809.229,05	8,03
Finnland	159.576,00	1,58
Großbritannien	177.439,86	1,76
Italien	653.915,65	6,49
Japan	1.609.060,17	15,98
Kaimaninseln	511.686,56	5,08
Neuseeland	128.334,67	1,27
Norwegen	142.895,00	1,42
Österreich	165.220,00	1,64
Schweden	327.656,44	3,25
Schweiz	223.684,21	2,22
Spanien	212.416,56	2,11
USA	775.304,54	7,70
2. Zertifikate	638.541,70	6,34
EUR	638.541,70	6,34
3. Investmentanteile	3.180.083,80	31,57
EUR	2.759.151,30	27,39
USD	420.932,50	4,18
4. Bankguthaben	186.046,43	1,85
5. Sonstige Vermögensgegenstände	16.638,67	0,17
II. Verbindlichkeiten	-173.029,27	-1,72
III. Teilgesellschaftsvermögen	10.071.764,62	100,00

Jahresbericht
Optinova Conventional & Clean Energy

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilgesellschafts- vermögens	
Bestandspositionen							EUR	10.042.108,79	99,71	
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	6.862.024,99	68,13	
Aktien							EUR	6.223.483,29	61,79	
Stanmore Coal Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000SMR4		STK	248.500	248.500	0	AUD	0,780	118.870,35	1,18
Whitehaven Coal Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000WHC8		STK	125.700	125.700	0	AUD	1,430	110.236,11	1,09
Algonquin Power&Utilities Corp Registered Shares o.N.	CA0158571053		STK	15.800	15.800	0	CAD	17,550	181.318,25	1,80
Capital Power Corp. Registered Shares o.N.	CA14042M1023		STK	7.600	9.300	1.700	CAD	27,980	139.049,24	1,38
Frontera Energy Corp. Registered Shares o.N.	CA35905B1076		STK	54.900	54.900	0	CAD	3,400	122.055,84	1,21
Hydro One Ltd. Registered Shares o.N.	CA4488112083		STK	11.800	11.800	0	CAD	25,530	196.988,16	1,96
TransAlta Renewables Inc. Registered Shares o.N.	CA8934631091		STK	17.800	7.300	12.800	CAD	14,590	169.817,56	1,69
BKW AG Namens-Aktien SF 2,50	CH0130293662		STK	2.800	1.300	300	CHF	85,000	223.684,21	2,22
A2A S.p.A. Azioni nom. EO 0,52	IT0001233417		STK	107.300	107.300	0	EUR	1,261	135.251,65	1,34
ERG S.p.A. Azioni nom. EO 0,10	IT0001157020		STK	10.600	1.800	1.200	EUR	19,190	203.414,00	2,02
EVN AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000741053		STK	11.000	6.900	4.000	EUR	15,020	165.220,00	1,64
Falck Renewables S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003198790		STK	36.500	0	20.100	EUR	5,440	198.560,00	1,97
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14		STK	20.583	583	5.100	EUR	10,320	212.416,56	2,11
Lassila & Tikanoja Oyj Registered Shares EO -,50	FI0009010854		STK	12.200	12.200	0	EUR	13,080	159.576,00	1,58
Saras S.p.A. Raffinerie Sarde Azioni nom. o.N.	IT0000433307		STK	166.700	100.800	15.200	EUR	0,700	116.690,00	1,16
National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289	GB00BDR05C01		STK	16.300	10.600	5.900	GBP	9,892	177.439,86	1,76
China Conch Venture Hldgs Ltd. Registered Shares HD -,01	KYG2116J1085		STK	41.000	49.000	8.000	HKD	32,700	154.041,48	1,53
Hilong Holding Ltd Registered Shares HD -,10	KYG4509G1055		STK	3.603.000	3.603.000	0	HKD	0,232	96.041,36	0,95
Xinyi Solar Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	KYG9829N1025		STK	310.200	0	113.800	HKD	7,340	261.603,72	2,60
Chubu Electric Power Co. Inc. Registered Shares o.N.	JP3526600006		STK	11.000	5.400	2.900	JPY	1.352,000	122.769,07	1,22
Eneos Holdings Inc. Registered Shares o.N.	JP3386450005		STK	39.400	39.400	0	JPY	382,000	124.245,08	1,23
Hokkaido El.Power Co.Inc., The Registered Shares o.N.	JP3850200001		STK	36.900	36.900	0	JPY	414,000	126.109,07	1,25
Itochu Enex Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3144000001		STK	23.800	23.800	0	JPY	872,000	171.321,96	1,70
Iwatani Corp. Registered Shares o.N.	JP3151600008		STK	6.400	5.600	2.800	JPY	3.770,000	199.177,80	1,98
Okinawa Electric Power Co.Inc. Registered Shares o.N.	JP3194700005		STK	12.495	24.395	11.900	JPY	1.794,000	185.045,40	1,84
Sala Corp. Registered Shares o.N.	JP3310350008		STK	34.300	26.200	14.600	JPY	567,000	160.545,00	1,59
Shizuoka Gas Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3351150002		STK	24.700	24.700	0	JPY	987,000	201.248,99	2,00
Sinanen Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3354000006		STK	9.100	13.000	3.900	JPY	2.734,000	205.380,64	2,04
Toa Oil Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3556800005		STK	6.700	6.700	0	JPY	2.047,000	113.217,16	1,12
Kvaerner ASA Navne-Aksjer NK-,34	NO0010605371		STK	250.900	169.900	0	NOK	6,170	142.895,00	1,42
Trustpower Ltd. (new) Registered Shares o.N.	NZTPXE0001S5		STK	32.200	0	17.100	NZD	6,950	128.334,67	1,27
Eolus Vind AB Namn-Aktier B SK -,50	SE0007075056		STK	16.500	16.500	0	SEK	125,500	197.924,93	1,97
Tethys Oil AB Namn-Aktier SK 0,02085	SE0014399424		STK	29.700	29.700	0	SEK	45,700	129.731,51	1,29
China Everbright Water Ltd. Registered Shares HD 1	BMG2116Y1057		STK	748.400	229.700	222.300	SGD	0,205	97.958,12	0,97
AES Corp., The Registered Shares DL -,01	US00130H1059		STK	11.200	11.200	0	USD	14,490	144.512,91	1,43
CVR Energy Inc. Registered Shares DL -,01	US12662P1084		STK	7.300	3.400	1.600	USD	20,110	130.723,95	1,30
Marathon Petroleum Corp. Registered Shares DL -,01	US56585A1025		STK	4.100	2.600	1.000	USD	37,380	136.471,95	1,35
PBF Energy Inc. Registered Shs Class A o.N.	US69318G1067		STK	13.800	13.800	0	USD	10,240	125.834,37	1,25
Plains GP Holdings L.P. Reg.Uts Cl.A.Rep.L.Part.Int.oN	US72651A2078		STK	14.800	14.800	0	USD	8,900	117.292,97	1,16
Valero Energy Corp. Registered Shares DL -,01	US91913Y1001		STK	2.300	1.700	1.100	USD	58,820	120.468,39	1,20
Zertifikate							EUR	638.541,70	6,34	
WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT06/Und. Energy	DE000A0KRKD4		STK	121.900	54.000	19.000	EUR	1,750	213.373,76	2,12
WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT06/Und. Natural Gas	DE000A0KRJ36		STK	16.937.100	8.578.500	0	EUR	0,011	193.082,94	1,92
WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT06/Und. WTI Crude Oil	DE000A0KRJX4		STK	69.800	36.900	6.500	EUR	3,325	232.085,00	2,30
Investmentanteile							EUR	3.180.083,80	31,57	
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	3.180.083,80	31,57	

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilgesellschafts- vermögens	
ComSt.-ComS.EONIA Ind.UC.ETF Inhaber-Anteile I o.N.	LU0378437684		ANT	4.000	0	0	EUR	100,327	401.308,00	3,98
Deka Dt.B.EUROG.Ger.M.M.U.ETF Inhaber-Anteile	DE000ETF1227		ANT	6.800	0	0	EUR	70,726	480.933,40	4,78
iS.eb.r.Go.G.1.5-2.5y U.ETF DE Inhaber-Anteile	DE0006289473		ANT	5.700	0	0	EUR	84,170	479.769,00	4,76
Lyxor Euro Overnight Ret.U.ETF Actions au Porteur Acc o.N.	FR0010510800		ANT	4.700	0	0	EUR	104,357	490.477,90	4,87
Lyxor NEW ENERGY UCITS ETF Actions au Port.Dist o.N.	FR0010524777		ANT	13.800	400	4.500	EUR	30,115	415.587,00	4,13
Xtrackers II EUR Over.Rate Sw. Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290358497		ANT	3.600	0	0	EUR	136,410	491.076,00	4,88
iShsII-GI.Clean Energy U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B1XNHC34		ANT	65.800	13.400	28.700	USD	7,184	420.932,50	4,18
Summe Wertpapiervermögen							EUR	10.042.108,79	99,71	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	186.046,43	1,85	
Bankguthaben							EUR	186.046,43	1,85	
Guthaben bei State Street Bank International GmbH (GD) (V)										
Guthaben in Währung des Teilgesellschaftsvermögens			EUR	182.396,96			%	100,000	182.396,96	1,81
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen			NOK	0,07			%	100,000	0,01	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen			AUD	0,07			%	100,000	0,04	0,00
			HKD	0,02			%	100,000	0,00	0,00
			JPY	303.450,00			%	100,000	2.504,99	0,02
			USD	1.285,20			%	100,000	1.144,43	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	16.638,67	0,17	
Dividendenansprüche			EUR	12.651,32				12.651,32	0,13	
Quellensteueransprüche			EUR	3.987,35				3.987,35	0,04	
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-122.617,58	-1,22	
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen			GBP	-12.890,10			%	100,000	-14.185,21	-0,14
			SEK	-1.134.451,97			%	100,000	-108.432,37	-1,08
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-50.411,69	-0,50	
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-75,29				-75,29	0,00	
Verwaltungsvergütung			EUR	-23.751,60				-23.751,60	-0,24	
Verwahrstellenvergütung			EUR	-10.710,00				-10.710,00	-0,11	
Administrationsvergütung			EUR	-7.544,80				-7.544,80	-0,07	
Prüfungskosten			EUR	-8.330,00				-8.330,00	-0,08	
Teilgesellschaftsvermögen							EUR	10.071.764,62	100,00 1)	
Wert je Aktie							EUR	83,64		
Ausgabepreis							EUR	83,64		
Umlaufende Aktien							STK	120.419		

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Jahresbericht Optinova Conventional & Clean Energy

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2020	
AUD	(AUD)	1,6306000	= 1 EUR (EUR)
CAD	(CAD)	1,5293000	= 1 EUR (EUR)
CHF	(CHF)	1,0640000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,9087000	= 1 EUR (EUR)
HKD	(HKD)	8,7035000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	121,1380000	= 1 EUR (EUR)
NOK	(NOK)	10,8335000	= 1 EUR (EUR)
NZD	(NZD)	1,7438000	= 1 EUR (EUR)
SEK	(SEK)	10,4623000	= 1 EUR (EUR)
SGD	(SGD)	1,5662000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,1230000	= 1 EUR (EUR)

Jahresbericht Optinova Conventional & Clean Energy

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
AGL Energy Ltd. Registered Shares o.N.	AU000000AGL7	STK	4.700	15.600	
Ascopiave S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0004093263	STK	0	57.300	
Black Hills Corp. Registered Shares DL 1	US0921131092	STK	0	3.100	
CLP Holdings Ltd. Registered Shares o.N.	HK0002007356	STK	1.500	11.500	
Concord New Energy Group Ltd. Registered Shares HD -,01	BMG2345T1099	STK	0	4.220.000	
Consolidated Edison Inc. Registered Shares DL -,01	US2091151041	STK	0	2.700	
Contact Energy Ltd. Registered Shares o.N.	NZCENE0001S6	STK	0	48.500	
CropEnergies AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A0LAUP1	STK	0	35.900	
DNO ASA Navne-Aksjer A NK -,25	NO0003921009	STK	24.600	113.900	
Electric Power Dev. Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3551200003	STK	3.700	9.000	
Equinor ASA Navne-Aksjer NK 2,50	NO0010096985	STK	600	6.700	
Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas EO 1	PTGAL0AM0009	STK	8.100	15.900	
HollyFrontier Corp. Registered Shares DL -,01	US4361061082	STK	400	3.500	
Idemitsu Kosan Co. Ltd. Registered Shares o.N.	JP3142500002	STK	600	4.700	
Modec Inc. Registered Shares o.N.	JP3888250002	STK	0	6.200	
NorthWestern Corp. Registered Shares New DL -,01	US6680743050	STK	0	3.300	
Phillips 66 Registered Shares DL -,01	US7185461040	STK	900	2.300	
Portland General Electric Co. Registered Shares o.N.	US7365088472	STK	0	4.400	
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	ES0173516115	STK	3.700	10.900	
Royal Dutch Shell Reg. Shares Class A EO -,07	GB00B03MLX29	STK	0	5.000	
Total S.A. Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	300	2.500	
VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A0JL9W6	STK	0	27.900	
Andere Wertpapiere					
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809J6	STK	22.283	22.283	
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809I8	STK	25.100	25.100	
Repsol S.A. Anrechte	ES06735169F2	STK	10.900	10.900	
Nichtnotierte Wertpapiere					

**Jahresbericht
Optinova Conventional & Clean Energy**

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Aktien					
Iberdrola S.A. Acciones Port. E.7/19 EO -,75	ES0144583202	STK	583	583	
Tethys Oil AB Namn-Aktier AK SK -,0417	SE0012455202	STK	18.100	18.100	
Tethys Oil AB Redemption Shares o.N.	SE0014399432	STK	18.100	18.100	
Andere Wertpapiere					
Repsol S.A. Anrechte	ES06735169E5	STK	0	7.200	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
OptoFlex Inhaber-Ant. oN	LU0834815101	ANT	79	79	

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2019 bis 30.06.2020

			insgesamt	je Aktie
I. Erträge				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR		10.254,92	0,08
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR		247.512,05	2,05
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR		0,00	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		-3.886,56	-0,03
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		10,19	0,00
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR		21.859,73	0,18
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR		0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR		-1.538,24	-0,01
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR		-32.734,73	-0,27
11. Sonstige Erträge	EUR		0,00	0,00
Summe der Erträge	EUR		241.477,36	2,00
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		-0,16	0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR		-103.581,18	-0,86
- Verwaltungsvergütung	EUR	-103.581,19		
- Beratungsvergütung	EUR	0,01		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-14.412,89	-0,12
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-7.179,67	-0,06
5. Sonstige Aufwendungen	EUR		-9.885,09	-0,08
- Depotgebühren	EUR	-1.832,25		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-3.451,59		
- Sonstige Kosten	EUR	-4.601,25		
Summe der Aufwendungen	EUR		-135.058,99	-1,12
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR		106.418,37	0,88
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne	EUR		408.869,66	3,40
2. Realisierte Verluste	EUR		-532.077,45	-4,42
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR		-123.207,79	-1,02
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres				
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR		257.535,03	2,14
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR		-1.476.142,71	-12,26

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		-1.218.607,68	-10,12
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		-1.235.397,10	-10,26

Entwicklung des Teilgesellschaftsvermögens

			2019/2020	
I. Wert des Teilgesellschaftsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres			EUR	10.518.041,70
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen			EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)			EUR	793.252,63
a) Mittelzuflüsse aus Aktien-Verkäufen	EUR	1.000.099,47		
b) Mittelabflüsse aus Aktien-Rücknahmen	EUR	-206.846,84		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR	-4.132,61
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR	-1.235.397,10
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	257.535,03		
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-1.476.142,71		
II. Wert des Teilgesellschaftsvermögens am Ende des Geschäftsjahres			EUR	10.071.764,62

Verwendung der Erträge des Teilgesellschaftsvermögens

Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Aktie

			insgesamt	je Aktie
I. Für die Wiederanlage verfügbar				
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		-16.789,42	-0,14
2. Zuführung aus dem Teilgesellschaftsvermögen *)	EUR		16.789,42	0,14
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR		0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR		0,00	-0,00

*) Die Zuführung aus dem Teilgesellschaftsvermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten.

Jahresbericht Optinova Conventional & Clean Energy

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilgesellschaftsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2016/2017	Stück	112.105	EUR	11.128.409,31	EUR	99,27
2017/2018	Stück	112.210	EUR	10.770.970,63	EUR	95,99
2018/2019	Stück	112.225	EUR	10.518.041,70	EUR	93,72
2019/2020	Stück	120.419	EUR	10.071.764,62	EUR	83,64

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	0,00
Bestand der Wertpapiere am Teilgesellschaftsvermögen (in %)		99,71
Bestand der Derivate am Teilgesellschaftsvermögen (in %)		0,00

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für dieses Teilgesellschaftsvermögen wendet die Gesellschaft seit 01.07.2015 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

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

kleinster potenzieller Risikobetrag	1,19 %
größter potenzieller Risikobetrag	6,18 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	2,33 %

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte:	0,96
---	-------------

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

MSCI AC World (EUR) (All Countries) (FactSet: 892400)	100,00 %
---	----------

Sonstige Angaben

Wert je Aktie	EUR	83,64
Ausgabepreis	EUR	83,64
Umlaufende Aktien	STK	120.419

Jahresbericht Optinova Conventional & Clean Energy

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt 1,18 %

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

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen EUR 0,00

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Teilgesellschaftsvermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Aus der Verwaltungsvergütung werden keine Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Teilgesellschaftsvermögens gezahlt. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Teilgesellschaftsvermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Teilgesellschaftsvermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge, die dem Sondervermögen für den Erwerb und die Rücknahme von Investmentanteilen berechnet wurden EUR 0,00

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Verwaltungsvergütungssätze für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

Investmentanteile	Identifikation	Verwaltungsvergütungssatz p.a. in %
ComSt.-ComS.EONIA Ind.UC.ETF Inhaber-Anteile I o.N.	LU0378437684	0,100
Deka Dt.B.EUROG.Ger.M.M.U.ETF Inhaber-Anteile	DE000ETFL227	0,120
iS.eb.r.Go.G.1.5-2.5y U.ETF DE Inhaber-Anteile	DE0006289473	0,150
iShsII-GI.Clean Energy U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B1XNHC34	0,650
Lyxor Euro Overnight Ret.U.ETF Actions au Porteur Acc o.N.	FR0010510800	0,100
Lyxor NEW ENERGY UCITS ETF Actions au Port.Dist o.N.	FR0010524777	0,600
Xtrackers II EUR Over.Rate Sw. Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290358497	0,020

Während des Berichtszeitraumes gehaltene Bestände in Investmentanteilen, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Gruppenfremde Investmentanteile

OptoFlex Inhaber-Ant. oN	LU0834815101	0,700
--------------------------	--------------	-------

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Wesentliche sonstige Erträge:	EUR	0,00
Wesentliche sonstige Aufwendungen:	EUR	0,00

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

Transaktionskosten	EUR	20.683,08
--------------------	-----	-----------

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

**Jahresbericht
Optinova Conventional & Clean Energy**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Oberursel, den 1. Juli 2020

Optinova Investmentaktiengesellschaft
Der Vorstand