

Optinova Conventional & Clean Energy

Jahresbericht

zum

30. Juni 2021

**Jahresbericht
Optinova Conventional & Clean Energy**

Vermögensübersicht zum 30.06.2021

| Anlageschwerpunkte | Tageswert in EUR | % Anteil am Teilgesellschaftsvermögen |
|---------------------------------------|----------------------|--|
| I. Vermögensgegenstände | 13.131.416,92 | 102,97 |
| 1. Aktien | 8.358.972,74 | 65,55 |
| Australien | 308.173,76 | 2,42 |
| Bermuda | 245.543,11 | 1,93 |
| Bundesrep. Deutschland | 357.226,00 | 2,80 |
| Canada | 1.476.385,81 | 11,58 |
| Finnland | 396.388,00 | 3,11 |
| Großbritannien | 364.772,54 | 2,86 |
| Hongkong | 241.866,12 | 1,90 |
| Italien | 503.428,40 | 3,95 |
| Japan | 1.884.852,14 | 14,78 |
| Kaimaninseln | 592.948,83 | 4,65 |
| Neuseeland | 196.002,71 | 1,54 |
| Österreich | 244.524,00 | 1,92 |
| Schweden | 416.191,54 | 3,26 |
| Schweiz | 158.171,37 | 1,24 |
| Singapur | 161.583,84 | 1,27 |
| Spanien | 395.164,02 | 3,10 |
| USA | 415.750,55 | 3,26 |
| 2. Zertifikate | 1.345.544,72 | 10,55 |
| EUR | 792.470,00 | 6,21 |
| USD | 553.074,72 | 4,34 |
| 3. Investmentanteile | 1.004.681,07 | 7,88 |
| EUR | 657.914,50 | 5,16 |
| USD | 346.766,57 | 2,72 |
| 4. Bankguthaben | 2.386.397,02 | 18,71 |
| 5. Sonstige Vermögensgegenstände | 35.821,37 | 0,28 |
| II. Verbindlichkeiten | -378.710,68 | -2,97 |
| III. Teilgesellschaftsvermögen | 12.752.706,24 | 100,00 |

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2021 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|---------------|----------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen | | | | | | | EUR | 10.709.198,53 | 83,98 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 9.704.517,46 | 76,10 |
| Aktien | | | | | | | EUR | 8.358.972,74 | 65,55 |
| Beach Energy Ltd. Registered Shares o.N. | AU000000BPT9 | | STK | 153.100 | 191.600 | 38.500 | AUD 1,240 | 120.215,30 | 0,94 |
| Washington H.Soul Pat.&Co.Ltd. Registered Shares o.N. | AU000000SOL3 | | STK | 8.800 | 10.600 | 1.800 | AUD 33,730 | 187.958,46 | 1,47 |
| Algonquin Power&Utilities Corp Registered Shares o.N. | CA0158571053 | | STK | 13.900 | 2.100 | 4.000 | CAD 18,470 | 174.874,33 | 1,37 |
| Enerflex Ltd. Registered Shares o.N. | CA29269R1055 | | STK | 41.200 | 45.500 | 4.300 | CAD 8,390 | 235.452,63 | 1,85 |
| Hydro One Ltd. Registered Shares o.N. | CA4488112083 | | STK | 11.800 | 2.600 | 2.600 | CAD 29,960 | 240.806,48 | 1,89 |
| Inter Pipeline Ltd. Registered Shares o.N. | CA45833V1094 | | STK | 20.800 | 20.800 | 0 | CAD 20,150 | 285.484,64 | 2,24 |
| Tourmaline Oil Corp. Registered Shares o.N. | CA89156V1067 | | STK | 12.300 | 16.100 | 3.800 | CAD 35,430 | 296.838,77 | 2,33 |
| Uranium Participation Corp. Registered Shares CD 1 | CA9170171057 | | STK | 65.200 | 75.200 | 10.000 | CAD 5,470 | 242.928,96 | 1,90 |
| BKW AG Namens-Aktien SF 2,50 | CH0130293662 | | STK | 1.800 | 500 | 1.500 | CHF 96,300 | 158.171,37 | 1,24 |
| A2A S.p.A. Azioni nom. EO 0,52 | IT0001233417 | | STK | 144.100 | 66.200 | 29.400 | EUR 1,724 | 248.428,40 | 1,95 |
| CropEnergies AG Inhaber-Aktien o.N. | DE000A0LAUP1 | | STK | 11.300 | 14.200 | 2.900 | EUR 10,820 | 122.266,00 | 0,96 |
| Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50 | ES0130960018 | | STK | 10.700 | 10.700 | 0 | EUR 19,485 | 208.489,50 | 1,63 |
| ERG S.p.A. Azioni nom. EO 0,10 | IT0001157020 | | STK | 10.200 | 4.800 | 5.200 | EUR 25,000 | 255.000,00 | 2,00 |
| EVN AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000741053 | | STK | 12.300 | 2.600 | 1.300 | EUR 19,880 | 244.524,00 | 1,92 |
| Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75 | ES0144580Y14 | | STK | 18.159 | 2.976 | 5.400 | EUR 10,280 | 186.674,52 | 1,46 |
| Lassila & Tikanoja Oyj Registered Shares EO -,50 | FI0009010854 | | STK | 14.500 | 15.800 | 13.500 | EUR 14,160 | 205.320,00 | 1,61 |
| Neste Oyj Registered Shs o.N. | FI0009013296 | | STK | 3.700 | 3.700 | 0 | EUR 51,640 | 191.068,00 | 1,50 |
| VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG Inhaber-Aktien o.N. | DE000A0JL9W6 | | STK | 5.500 | 7.300 | 1.800 | EUR 42,720 | 234.960,00 | 1,84 |
| Diversified Energy Company PLC Registered Shares LS -,01 | GB00BYX7JT74 | | STK | 101.200 | 168.100 | 66.900 | GBP 1,052 | 124.053,13 | 0,97 |
| Drax Group PLC Registered Shares LS -,1155172 | GB00B1VNSX38 | | STK | 48.700 | 55.000 | 6.300 | GBP 4,242 | 240.719,41 | 1,89 |
| AAG Energy Holdings Ltd Registered Shares o.N. | KYG000371040 | | STK | 1.548.000 | 1.936.000 | 388.000 | HKD 1,320 | 221.901,74 | 1,74 |
| China High-Speed Trans.Equip. Registered Shares DL -,01 | KYG2112D1051 | | STK | 230.000 | 302.000 | 72.000 | HKD 4,930 | 123.137,57 | 0,97 |
| China Tian Lun Gas Holdings Registered Shares HD -,01 | KYG843961031 | | STK | 285.000 | 317.000 | 32.000 | HKD 8,010 | 247.909,52 | 1,94 |
| CLP Holdings Ltd. Registered Shares o.N. | HK0002007356 | | STK | 29.000 | 29.000 | 0 | HKD 76,800 | 241.866,12 | 1,90 |
| Chubu Electric Power Co. Inc. Registered Shares o.N. | JP3526600006 | | STK | 16.800 | 10.000 | 4.200 | JPY 1.358,000 | 173.377,25 | 1,36 |
| Ebara Jitsugyo Co. Ltd. Registered Shares o.N. | JP3165950001 | | STK | 10.400 | 17.100 | 6.700 | JPY 3.100,000 | 245.006,77 | 1,92 |
| Iwatani Corp. Registered Shares o.N. | JP3151600008 | | STK | 3.400 | 400 | 3.400 | JPY 6.660,000 | 172.082,30 | 1,35 |
| Japan Petroleum Exploration Co Registered Shares o.N. | JP3421100003 | | STK | 11.100 | 14.000 | 2.900 | JPY 1.997,000 | 168.455,07 | 1,32 |
| Nippon Coke & Engineering Co. Registered Shares o.N. | JP3889610006 | | STK | 257.300 | 302.500 | 45.200 | JPY 102,000 | 199.444,94 | 1,56 |
| Osaka Gas Co. Ltd. Registered Shares o.N. | JP3180400008 | | STK | 10.500 | 10.500 | 0 | JPY 2.069,000 | 165.094,59 | 1,29 |
| Sala Corp. Registered Shares o.N. | JP3310350008 | | STK | 45.300 | 24.000 | 13.000 | JPY 580,000 | 199.668,36 | 1,57 |
| Sinanen Holdings Co. Ltd. Registered Shares o.N. | JP3354000006 | | STK | 6.000 | 0 | 3.100 | JPY 3.045,000 | 138.842,24 | 1,09 |
| Takeei Corporation Registered Shares o.N. | JP3462680004 | | STK | 17.100 | 20.900 | 3.800 | JPY 1.571,000 | 204.152,80 | 1,60 |
| Toyo Kanetsu K.K. Registered Shares o.N. | JP3554400006 | | STK | 11.700 | 11.700 | 0 | JPY 2.460,000 | 218.727,82 | 1,72 |
| Trustpower Ltd. (new) Registered Shares o.N. | NZTPXE0001S5 | | STK | 41.100 | 18.700 | 9.800 | NZD 8,090 | 196.002,71 | 1,54 |
| Eolus Vind AB Namn-Aktier B SK -,50 | SE0007075056 | | STK | 10.800 | 0 | 5.700 | SEK 201,000 | 214.059,62 | 1,68 |
| Tethys Oil AB Namn-Aktier o.N. | SE0015949847 | | STK | 35.100 | 38.700 | 3.600 | SEK 58,400 | 202.131,92 | 1,59 |
| China Aviation Oil (Sg.) Corp. Registered Shares SD -,25 | SG1T06929205 | | STK | 250.000 | 343.000 | 93.000 | SGD 1,030 | 161.583,84 | 1,27 |
| China Everbright Water Ltd. Registered Shares HD 1 | BMG2116Y1057 | | STK | 1.534.500 | 993.100 | 207.000 | SGD 0,255 | 245.543,11 | 1,93 |
| Public Service Ent. Group Inc. Registered Shares o.N. | US7445731067 | | STK | 4.800 | 4.800 | 0 | USD 59,740 | 241.821,56 | 1,90 |
| World Fuel Services Corp. Registered Shares DL -,01 | US9814751064 | | STK | 6.500 | 9.500 | 3.000 | USD 31,730 | 173.928,99 | 1,36 |
| Zertifikate | | | | | | | EUR | 1.345.544,72 | 10,55 |
| WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT06/Und. Energy | DE000A0KRKD4 | | STK | 110.700 | 83.100 | 94.300 | EUR 2,619 | 289.879,02 | 2,27 |
| WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT06/Und. Natural Gas | DE000A0KRJ36 | | STK | 37.424.200 | 20.487.100 | 0 | EUR 0,013 | 501.484,28 | 3,93 |
| WisdomTree Comm. Securit. Ltd. DT.ZT06/Und. WTI Crude Oil | DE000A0KRJX4 | | STK | 200 | 52.400 | 122.000 | EUR 5,534 | 1.106,70 | 0,01 |
| DB ETC Index PLC ETC Z19.05.60 XTR WTI Op Yield | GB00B3SC0P31 | | STK | 12.400 | 12.400 | 0 | USD 52,890 | 553.074,72 | 4,34 |
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 1.004.681,07 | 7,88 |

Jahresbericht
Optinova Conventional & Clean Energy

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2021 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens | |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|----------------------|------------------------------|-------|
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | EUR | 1.004.681,07 | 7,88 | |
| iShs EO Inf.Li.Gov.Bd U.ETF(D) Registered Shares o.N. | IE00B0M62X26 | | ANT | 500 | 500 | 0 | EUR | 228,910 | 114.455,00 | 0,90 |
| Lyxor NEW ENERGY(DR)UCITS ETF Actions au Port.Dist o.N. | FR0010524777 | | ANT | 10.300 | 1.000 | 4.500 | EUR | 41,525 | 427.707,50 | 3,35 |
| MUL-LYX.Co.EO Gov.In.Li.Bd(DR) Nam.-An. Acc o.N. | LU1650491282 | | ANT | 700 | 700 | 0 | EUR | 165,360 | 115.752,00 | 0,91 |
| iShsII-GI.Clean Energy U.ETF Registered Shares o.N. | IE00B1XNHC34 | | ANT | 30.700 | 0 | 35.100 | USD | 13,394 | 346.766,57 | 2,72 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 10.709.198,53 | 83,98 | |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 2.386.397,02 | 18,71 | |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 2.386.397,02 | 18,71 | |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | | | | | |
| State Street Bank International GmbH | | | EUR | 2.379.909,51 | | | % | 100,000 | 2.379.909,51 | 18,66 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | | |
| | | | NOK | 0,07 | | | % | 100,000 | 0,01 | 0,00 |
| | | | SEK | 65.790,00 | | | % | 100,000 | 6.487,46 | 0,05 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | | |
| | | | AUD | 0,07 | | | % | 100,000 | 0,04 | 0,00 |
| | | | HKD | 0,02 | | | % | 100,000 | 0,00 | 0,00 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 35.821,37 | 0,28 | |
| Dividendenansprüche | | | EUR | 29.884,03 | | | | | 29.884,03 | 0,23 |
| Quellensteueransprüche | | | EUR | 5.937,34 | | | | | 5.937,34 | 0,05 |
| Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme | | | | | | | EUR | -275.647,95 | -2,16 | |
| Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | USD | -326.863,34 | | | % | 100,000 | -275.647,95 | -2,16 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -103.062,73 | -0,81 | |
| Zinsverbindlichkeiten | | | EUR | -607,58 | | | | | -607,58 | 0,00 |
| Verwaltungsvergütung | | | EUR | -67.561,51 | | | | | -67.561,51 | -0,53 |
| Verwahrstellenvergütung | | | EUR | -1.190,00 | | | | | -1.190,00 | -0,01 |
| Administrationsvergütung | | | EUR | -26.563,64 | | | | | -26.563,64 | -0,21 |
| Prüfungskosten | | | EUR | -7.140,00 | | | | | -7.140,00 | -0,06 |
| Teilgesellschaftsvermögen | | | | | | | EUR | 12.752.706,24 | 100,00 1) | |
| Anteilwert | | | | | | | EUR | 105,73 | | |
| Ausgabepreis | | | | | | | EUR | 105,73 | | |
| Anteile im Umlauf | | | | | | | STK | 120.614 | | |

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

| | | per 30.06.2021 | |
|-----|-------|----------------|---------------|
| AUD | (AUD) | 1,5792000 | = 1 EUR (EUR) |
| CAD | (CAD) | 1,4681000 | = 1 EUR (EUR) |
| CHF | (CHF) | 1,0959000 | = 1 EUR (EUR) |
| GBP | (GBP) | 0,8582000 | = 1 EUR (EUR) |
| HKD | (HKD) | 9,2084000 | = 1 EUR (EUR) |
| JPY | (JPY) | 131,5882000 | = 1 EUR (EUR) |
| NOK | (NOK) | 10,2034000 | = 1 EUR (EUR) |
| NZD | (NZD) | 1,6964000 | = 1 EUR (EUR) |
| SEK | (SEK) | 10,1411000 | = 1 EUR (EUR) |
| SGD | (SGD) | 1,5936000 | = 1 EUR (EUR) |
| USD | (USD) | 1,1858000 | = 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 | | | | | |
| AES Corp., The Registered Shares DL -,01 | US00130H1059 | STK | 1.600 | 12.800 | |
| Capital Power Corp. Registered Shares o.N. | CA14042M1023 | STK | 1.700 | 9.300 | |
| China Conch Venture Hldgs Ltd. Registered Shares HD -,01 | KYG2116J1085 | STK | 8.000 | 49.000 | |
| CVR Energy Inc. Registered Shares DL -,01 | US12662P1084 | STK | 0 | 7.300 | |
| DNO ASA Navne-Aksjer A NK -,25 | NO0003921009 | STK | 320.600 | 320.600 | |
| Eneos Holdings Inc. Registered Shares o.N. | JP3386450005 | STK | 12.600 | 52.000 | |
| Falck Renewables SpA | IT0003198790 | STK | 0 | 36.500 | |
| Fortum Oyj Registered Shares EO 3,40 | FI0009007132 | STK | 11.700 | 11.700 | |
| Frontera Energy Corp. Registered Shares o.N. | CA35905B1076 | STK | 26.300 | 81.200 | |
| Hilong Holding Ltd Registered Shares HD -,10 | KYG4509G1055 | STK | 0 | 3.603.000 | |
| Hokkaido El.Power Co.Inc., The Registered Shares o.N. | JP3850200001 | STK | 10.900 | 47.800 | |
| HollyFrontier Corp. Registered Shares DL -,01 | US4361061082 | STK | 7.500 | 7.500 | |
| Itochu Enex Co. Ltd. Registered Shares o.N. | JP3144000001 | STK | 3.900 | 27.700 | |
| Marathon Petroleum Corp. Registered Shares DL -,01 | US56585A1025 | STK | 1.500 | 5.600 | |
| National Grid PLC Reg. Shares LS -,12431289 | GB00BDR05C01 | STK | 4.600 | 20.900 | |
| Okinawa Electric Power Co.Inc. Registered Shares o.N. | JP3194700005 | STK | 1.600 | 14.095 | |
| PBF Energy Inc. Registered Shs Class A o.N. | US69318G1067 | STK | 0 | 13.800 | |
| Plains GP Holdings L.P. Reg.Uts Cl.A.Rep.L.Part.Int.oN | US72651A2078 | STK | 7.500 | 22.300 | |
| Royal Dutch Shell Reg. Shares Class A EO -,07 | GB00B03MLX29 | STK | 10.200 | 10.200 | |
| Saras S.p.A. Raffinerie Sarde Azioni nom. o.N. | IT0000433307 | STK | 0 | 166.700 | |
| Shizuoka Gas Co. Ltd. Registered Shares o.N. | JP3351150002 | STK | 12.800 | 37.500 | |
| Stanmore Resources Ltd. Registered Shares o.N. | AU000000SMR4 | STK | 89.431 | 337.931 | |
| Toa Oil Co. Ltd. Registered Shares o.N. | JP3556800005 | STK | 2.900 | 9.600 | |
| TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50 | FR0000120271 | STK | 5.100 | 5.100 | |
| TransAlta Renewables Inc. Registered Shares o.N. | CA8934631091 | STK | 2.200 | 20.000 | |
| Valero Energy Corp. Registered Shares DL -,01 | US91913Y1001 | STK | 1.800 | 4.100 | |
| Whitehaven Coal Ltd. Registered Shares o.N. | AU000000WHC8 | STK | 52.300 | 178.000 | |
| Xinyi Solar Holdings Ltd. Registered Shares o.N. | KYG9829N1025 | STK | 0 | 310.200 | |
| Andere Wertpapiere | | | | | |
| Iberdrola S.A. Anrechte | ES06445809K4 | STK | 20.583 | 20.583 | |
| Iberdrola S.A. Anrechte | ES06445809L2 | STK | 19.383 | 19.383 | |

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 |
|--|--------------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| Nichtnotierte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.01/21 EO -,75 | ES0144583236 | STK | 276 | 276 | |
| Kvaerner ASA Navne-Aksjer NK-,34 | NO0010605371 | STK | 0 | 250.900 | |
| Tethys Oil AB Namn-Aktier o.N. | SE0014399424 | STK | 20.600 | 50.300 | |
| Tethys Oil AB Reg. Redemption Shares o.N. | SE0015949854 | STK | 38.700 | 38.700 | |
| Investmentanteile | | | | | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | |
| ComSt.-ComS.EONIA Ind.UC.ETF Inhaber-Anteile I o.N. | LU0378437684 | ANT | 0 | 4.000 | |
| Deka Dt.B.EUROG.Ger.M.M.U.ETF Inhaber-Anteile | DE000ETFL227 | ANT | 0 | 6.800 | |
| iS.eb.r.Go.G.1.5-2.5y U.ETF DE Inhaber-Anteile EUR (Dist) | DE0006289473 | ANT | 0 | 5.700 | |
| Lyxor Euro Overnight Ret.U.ETF Actions au Porteur Acc o.N. | FR0010510800 | ANT | 0 | 4.700 | |
| Lyxor IF-Lyx.Sma.Overn.Return Act. Nom. EUR Dis. oN | LU2082999306 | ANT | 4.000 | 4.000 | |
| Xtrackers II EUR Over.Rate Sw. Inhaber-Anteile 1C o.N. | LU0290358497 | ANT | 0 | 3.600 | |

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.07.2020 bis 30.06.2021

| | | | insgesamt | je Aktie |
|---|------------|-------------|--------------------|--------------|
| I. Erträge | | | | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer) | EUR | | 0,00 | 0,00 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | EUR | | 301.484,90 | 2,50 |
| 3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren | EUR | | 0,00 | 0,00 |
| 4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | EUR | | 73.595,14 | 0,61 |
| 5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | EUR | | 0,03 | 0,00 |
| 6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer) | EUR | | 0,00 | 0,00 |
| 7. Erträge aus Investmentanteilen | EUR | | 11.100,93 | 0,09 |
| 8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften | EUR | | 0,00 | 0,00 |
| 9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer | EUR | | 0,00 | 0,00 |
| 10. Abzug ausländischer Quellensteuer | EUR | | -31.118,15 | -0,26 |
| 11. Sonstige Erträge | EUR | | 0,00 | 0,00 |
| Summe der Erträge | EUR | | 355.062,84 | 2,94 |
| II. Aufwendungen | | | | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | EUR | | -72,21 | 0,00 |
| 2. Verwaltungsvergütung | EUR | | -158.398,75 | -1,31 |
| - Verwaltungsvergütung | EUR | -158.398,75 | | |
| - Beratungsvergütung | EUR | 0,00 | | |
| - Asset Management Gebühr | EUR | 0,00 | | |
| 3. Verwahrstellenvergütung | EUR | | -14.419,56 | -0,12 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | EUR | | -13.047,11 | -0,11 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | EUR | | -8.309,82 | -0,07 |
| - Depotgebühren | EUR | -3.494,59 | | |
| - Ausgleich ordentlicher Aufwand | EUR | -247,78 | | |
| - Sonstige Kosten | EUR | -4.567,45 | | |
| - davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen | EUR | -3.649,01 | | |
| Summe der Aufwendungen | EUR | | -194.247,45 | -1,61 |
| III. Ordentlicher Nettoertrag | EUR | | 160.815,40 | 1,33 |
| IV. Veräußerungsgeschäfte | | | | |
| 1. Realisierte Gewinne | EUR | | 1.599.699,64 | 13,26 |
| 2. Realisierte Verluste | EUR | | -1.003.417,83 | -8,32 |
| Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften | EUR | | 596.281,81 | 4,94 |
| V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | | | | |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | EUR | | 799.355,46 | 6,63 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | EUR | | 1.105.223,74 | 9,16 |

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

| | | | |
|---|-----|--------------|-------|
| VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 1.904.579,20 | 15,79 |
| VII. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | 2.661.676,41 | 22,06 |

Entwicklung des Teilgesellschaftsvermögens

| | | 2020/2021 | |
|--|-----|------------------|----------------------|
| I. Wert des Teilgesellschaftsvermögens am Beginn des Geschäftsjahres | EUR | | 10.071.764,62 |
| 1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr | EUR | | 0,00 |
| 2. Zwischenausschüttungen | EUR | | 0,00 |
| 3. Mittelzufluss/-abfluss (netto) | EUR | | 19.824,50 |
| a) Mittelzuflüsse aus Aktien-Verkäufen | EUR | 20.025,75 | |
| b) Mittelabflüsse aus Aktien-Rücknahmen | EUR | -201,25 | |
| 4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | EUR | | -559,28 |
| 5. Ergebnis des Geschäftsjahres | EUR | | 2.661.676,41 |
| davon nicht realisierte Gewinne | EUR | 799.355,46 | |
| davon nicht realisierte Verluste | EUR | 1.105.223,74 | |
| II. Wert des Teilgesellschaftsvermögens am Ende des Geschäftsjahres | EUR | | 12.752.706,24 |

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 | 757.097,21 | 6,27 |
| 2. Zuführung aus dem Teilgesellschaftsvermögen | EUR | 0,00 | 0,00 |
| 3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr | EUR | 0,00 | 0,00 |
| II. Wiederanlage | EUR | 757.097,21 | 6,27 |

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 | |
|---------------|---|---------|--|---------------|---|--------|
| 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 |
| 2020/2021 | Stück | 120.614 | EUR | 12.752.706,24 | EUR | 105,73 |

**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 %) | | 83,98 |
| Bestand der Derivate am Teilgesellschaftsvermögen (in %) | | 0,00 |

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikobergrenze für diesen Fonds 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 | 1,20 % |
| größter potenzieller Risikobetrag | 6,54 % |
| durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag | 4,68 % |

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: **0,97**

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

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

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben (§ 37 Abs. 6 DerivateV):

Im Berichtszeitraum wiesen keine Sicherheiten eine erhöhte Emittentenkonzentration nach § 27 Abs. 7 Satz 4 DerivateV auf.

Sonstige Angaben

| | | |
|--------------------------|------------|----------------|
| Wert je Aktie | EUR | 105,73 |
| Ausgabepreis | EUR | 105,73 |
| Umlaufende Aktien | STK | 120.614 |

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

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 1,67 %

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. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Teilgesellschaftsvermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Teilgesellschaftsvermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen 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 |
|---|-----|------|

Verwaltungsvergütungssätze für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

Jahresbericht

Optinova Conventional & Clean Energy

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

| Investmentanteile | Identifikation | Verwaltungsvergütungssatz p.a. in % |
|-------------------|----------------|--|
|-------------------|----------------|--|

Gruppenfremde Investmentanteile

| | | |
|---|--------------|-------|
| iShs EO Inf.Li.Gov.Bd U.ETF(D) Registered Shares o.N. | IE00B0M62X26 | 0,250 |
| iShsII-GI.Clean Energy U.ETF Registered Shares o.N. | IE00B1XNHC34 | 1,300 |
| Lyxor NEW ENERGY(DR)UCITS ETF Actions au Port.Dist o.N. | FR0010524777 | 0,600 |
| MUL-LYX.Co.EO Gov.In.Li.Bd(DR) Nam.-An. Acc o.N. | LU1650491282 | |

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

Gruppenfremde Investmentanteile

| | | |
|--|--------------|-------|
| ComSt.-ComS.EONIA Ind.UC.ETF Inhaber-Anteile I o.N. | LU0378437684 | 0,300 |
| Deka Dt.B.EUROG.Ger.M.M.U.ETF Inhaber-Anteile | DE000ETFL227 | 1,100 |
| iS.eb.r.Go.G.1.5-2.5y U.ETF DE Inhaber-Anteile EUR (Dist) | DE0006289473 | 1,000 |
| Lyxor Euro Overnight Ret.U.ETF Actions au Porteur Acc o.N. | FR0010510800 | 0,100 |
| Lyxor IF-Lyx.Sma.Overn.Return Act. Nom. EUR Dis. oN | LU2082999306 | |
| Xtrackers II EUR Over.Rate Sw. Inhaber-Anteile 1C o.N. | LU0290358497 | 0,020 |

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 32.759,69

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.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2021

Optinova Investmentaktiengesellschaft
Der Vorstand