

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



HannoverscheBasisInvest

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2023

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	34.496.203,20	100,19
1. Anleihen	33.947.806,00	98,60
< 1 Jahr	4.893.550,00	14,21
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	11.344.726,00	32,95
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	8.400.502,00	24,40
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	9.309.028,00	27,04
2. Derivate	-40.331,10	-0,12
3. Bankguthaben	467.283,04	1,36
4. Sonstige Vermögensgegenstände	121.445,26	0,35
II. Verbindlichkeiten	-64.851,24	-0,19
III. Fondsvermögen	34.431.351,96	100,00

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	33.947.806,00	98,60
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	31.022.526,00	90,10
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	31.022.526,00	90,10
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2456253082		EUR	1.000	0	0 %	94,002	940.020,00	2,73
3,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Cédulas Hip. 2023(27)	ES0413211A75		EUR	1.000	1.000	0 %	98,225	982.250,00	2,85
2,3750 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2022(27)	ES0413900848		EUR	1.000	0	0 %	95,233	952.330,00	2,77
0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)	XS2436160779		EUR	1.000	0	0 %	97,573	975.730,00	2,83
0,5000 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(25)	XS1755086607		EUR	1.000	1.000	0 %	94,852	948.520,00	2,75
2,0000 % BAWAG P.S.K. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(32)	XS2523326853		EUR	1.000	0	0 %	89,263	892.630,00	2,59
4,0000 % Bayer AG MTN v.2023(2026/2026)	XS2630111982		EUR	800	800	0 %	100,089	800.712,00	2,33
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)	DE0001104875		EUR	2.000	2.000	0 %	97,616	1.952.320,00	5,67
0,1250 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2020(24)	FR0013505575		EUR	1.000	1.000	0 %	94,771	947.710,00	2,75
0,3750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	IT0005481046		EUR	1.000	0	0 %	75,745	757.450,00	2,20
3,8130 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Pref Med.-T. Nts 23(25)	FR001400GDG7		EUR	800	800	0 %	100,042	800.336,00	2,32
2,1250 % Credit Suisse AG EO-Medium-Term Notes 2022(24)	XS2480543102		EUR	2.000	500	0 %	97,365	1.947.300,00	5,66
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)	DE000DL19VD6		EUR	1.000	0	0 %	94,516	945.160,00	2,75
0,2500 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2020(30/30)	XS2242728041		EUR	1.000	0	0 %	77,095	770.950,00	2,24
0,1000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Med.-T.Nts 2020(27/28)	AT0000A2KW37		EUR	1.000	0	0 %	83,667	836.670,00	2,43
3,0190 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/27)	XS2486589596		EUR	1.000	0	0 %	95,379	953.790,00	2,77
2,5000 % HSBC SFH (France) EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(28)	FR001400AEA1		EUR	1.000	0	0 %	95,547	955.470,00	2,77
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfbr. 2023(28)	AT0000A34CR4		EUR	1.000	1.000	0 %	98,587	985.870,00	2,86
1,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25)	IT0005090318		EUR	1.000	1.600	2.600 %	95,811	958.110,00	2,78
2,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28)	IT0005323032		EUR	1.000	0	0 %	92,944	929.440,00	2,70
1,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30)	IT0005413171		EUR	2.800	800	0 %	86,066	2.409.848,00	7,00
0,6250 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	XS1795392502		EUR	1.000	1.000	0 %	94,439	944.390,00	2,74
0,2500 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28)	XS2381853279		EUR	1.000	0	0 %	82,980	829.800,00	2,41
4,0880 % NatWest Markets PLC EO-FLR Med.-T. Notes 2023(26)	XS2576255751		EUR	1.000	1.000	0 %	100,542	1.005.420,00	2,92
0,1250 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Medium-Term Bonds 2022(28)	XS2435783613		EUR	1.000	0	0 %	85,331	853.310,00	2,48
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	XS2623820953		EUR	1.000	1.000	0 %	98,765	987.650,00	2,87
0,0100 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2063 v.19(24)	DE000HV2AST3		EUR	1.000	1.000	0 %	95,536	955.360,00	2,77
3,3750 % UniCredit S.p.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(27)	IT0005549362		EUR	1.000	1.000	0 %	98,733	987.330,00	2,87
3,2500 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 22(24)	XS2545247863		EUR	1.000	400	0 %	99,393	993.930,00	2,89
0,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/29)	XS2320759538		EUR	1.000	0	0 %	82,272	822.720,00	2,39

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	2.925.280,00	8,50
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	2.925.280,00	8,50
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	XS2308321962		EUR	1.000	1.000	0 %	93,632	936.320,00	2,72
3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdbr.23(28)	IT0005554578		EUR	2.000	2.000	0 %	99,448	1.988.960,00	5,78
Summe Wertpapiervermögen							EUR	33.947.806,00	98,60
Derivate							EUR	-40.331,10	-0,12
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate							EUR	-40.331,10	-0,12
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	-40.331,10	-0,12
FUTURE EURO-BUND 09.23 EUREX		185	EUR	4.000.000				-5.231,10	-0,02
FUTURE EURO-SCHATZ 09.23 EUREX		185	EUR	6.000.000				-35.100,00	-0,10
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	467.283,04	1,36
Bankguthaben							EUR	467.283,04	1,36
EUR - Guthaben bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	467.283,04		%	100,000	467.283,04	1,36

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	121.445,26	0,35
Zinsansprüche			EUR	115.764,26				115.764,26	0,34
Quellensteueransprüche			EUR	5.681,00				5.681,00	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-64.851,24	-0,19
Verwaltungsvergütung			EUR	-51.831,27				-51.831,27	-0,15
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.569,97				-2.569,97	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-10.050,00				-10.050,00	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-400,00				-400,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	34.431.351,96	100,00 1)
Anteilwert							EUR	54,95	
Ausgabepreis							EUR	55,50	
Anteile im Umlauf							STK	626.643	

Fußnoten:

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

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

185

Eurex Deutschland

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

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					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,0000 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.254 v.2023(2027)	DE000AAR0371	EUR	1.000	1.000	
0,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(29)	FR0014008JP6	EUR	0	1.000	
3,1250 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(29)	FR001400F091	EUR	600	600	
3,0000 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.22(28)	DE000A30V2V0	EUR	0	1.000	
0,0100 % Erste Group Bank AG EO-M.-T. Hyp.-Pfandb. 2022(28)	AT0000A2UXM1	EUR	0	1.000	
0,0100 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2021(29)	XS2396616455	EUR	0	1.000	
1,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	IT0005367492	EUR	0	1.600	
1,8750 % Jyske Realkredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2022(29)	DK0009410185	EUR	0	1.400	
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)	AT0000A324S8	EUR	1.000	1.000	
2,3750 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-M.-T.Hyp.Pfandb.2022(32)	XS2526846469	EUR	0	1.000	
0,1250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(27)	XS2436159847	EUR	0	1.000	
0,1250 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 2022(29)	FR0014008066	EUR	0	1.000	
0,7000 % Spanien EO-Bonos 2022(32)	ES0000012K20	EUR	1.700	4.000	
1,7500 % SpareBank 1 Boligkredit AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(27)	XS2525255647	EUR	0	1.000	
0,3750 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(26)	XS2343822842	EUR	0	1.000	
1,3750 % Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2022(32)	BE0002849306	EUR	0	1.000	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

2,2500 % Sky Ltd. EO-Med. Term Notes 2015(15/25)	XS1321424670	EUR	0	1.000	
--	--------------	-----	---	-------	--

**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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-SCHATZ)

EUR

27.814,01

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-SCHATZ)

EUR

14.177,09

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,60
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,12

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	54,95
Ausgabepreis	EUR	55,50
Anteile im Umlauf	STK	626.643

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

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.

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968
Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–
Eigenmittel: EUR 71.352.213,88 (Stand: September 2022)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen

2. Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG

Hausanschrift:

Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 10 10 40
60010 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 21 61-0
Telefax: 069 / 21 61-1340
www.hal-privatbank.com

Rechtsform: Aktiengesellschaft
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 531 (Stand: 31.12.2021)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

WAVE Management AG

Postanschrift:

VHV Platz 1
30177 Hannover

Telefon +49 (0)511 907-2500
Telefax +49 (0)511 907-2524

4. Anlageausschuss

Philipp Magenheimer
WAVE Management AG, Hannover

Boris Sonntag
WAVE Management AG, Hannover

WKN / ISIN: 531731 / DE0005317317