

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

## WAVE Total Return ESG

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. APRIL 2024

---

VERWAHRSTELLE:



HAUCK  
AUFHÄUSER  
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## Vermögensübersicht zum 30.04.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>88.872.155,49</b>	<b>100,16</b>
1. Aktien	34.034.413,11	38,36
Belgien	607.538,88	0,68
Bundesrep. Deutschland	9.261.757,52	10,44
Finnland	540.143,18	0,61
Frankreich	14.155.439,87	15,95
Italien	2.117.844,94	2,39
Niederlande	4.790.320,86	5,40
Spanien	2.561.367,86	2,89
2. Anleihen	53.241.632,00	60,00
< 1 Jahr	20.744.320,00	23,38
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	20.441.870,00	23,04
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	7.598.137,00	8,56
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	2.952.940,00	3,33
>= 10 Jahre	1.504.365,00	1,70
3. Derivate	-66.241,54	-0,07
4. Bankguthaben	1.053.851,80	1,19
5. Sonstige Vermögensgegenstände	608.500,12	0,69
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-142.568,00</b>	<b>-0,16</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>88.729.587,49</b>	<b>100,00</b>

# Halbjahresbericht

## WAVE Total Return ESG

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>87.276.045,11</b>	<b>98,36</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>85.336.585,11</b>	<b>96,18</b>
<b>Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>34.034.413,11</b>	<b>38,36</b>
adidas AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1EWWW0		STK	984	0	0	EUR 226,400	222.777,60	0,25
Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	NL0012969182		STK	280	0	0	EUR 1.130,200	316.456,00	0,36
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037		STK	5.498	0	0	EUR 28,440	156.363,12	0,18
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073		STK	5.278	0	0	EUR 183,880	970.518,64	1,09
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	3.800	0	0	EUR 266,600	1.013.080,00	1,14
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	10.818	0	0	EUR 56,160	607.538,88	0,68
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215		STK	3.627	0	0	EUR 832,700	3.020.202,90	3,40
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	21.903	0	0	EUR 32,440	710.533,32	0,80
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835		STK	55.031	0	0	EUR 10,175	559.940,43	0,63
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37		STK	153.267	0	0	EUR 4,573	700.889,99	0,79
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111		STK	8.438	0	0	EUR 49,155	414.769,89	0,47
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	DE000BAY0017		STK	8.611	0	0	EUR 27,350	235.510,85	0,27
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003		STK	3.371	0	0	EUR 102,450	345.358,95	0,39
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104		STK	11.544	0	0	EUR 67,610	780.489,84	0,88
Brenntag SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1DAHH0		STK	1.767	0	0	EUR 74,860	132.277,62	0,15
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007		STK	6.316	0	0	EUR 74,660	471.552,56	0,53
Continental AG	DE0005439004		STK	1.024	0	0	EUR 60,840	62.300,16	0,07
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644		STK	3.796	0	0	EUR 58,660	222.673,36	0,25
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055		STK	1.934	0	0	EUR 181,150	350.344,10	0,39
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004		STK	14.590	0	0	EUR 39,260	572.803,40	0,65
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508		STK	33.233	0	0	EUR 21,490	714.177,17	0,80
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367		STK	80.883	0	0	EUR 6,181	499.937,82	0,56
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667		STK	3.769	0	0	EUR 200,800	756.815,20	0,85
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011585146		STK	975	0	0	EUR 387,200	377.520,00	0,43
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292		STK	568	0	0	EUR 2.251,000	1.278.568,00	1,44
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14		STK	53.579	908	0	EUR 11,510	616.694,29	0,70
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007		STK	15.959	0	0	EUR 42,850	683.843,15	0,77
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004		STK	11.636	0	0	EUR 32,720	380.729,92	0,43
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202		STK	34.480	0	0	EUR 14,862	512.441,76	0,58
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618		STK	173.293	0	0	EUR 3,526	611.031,12	0,69

# Halbjahresbericht

## WAVE Total Return ESG

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485		STK	639	0	0 EUR	330,000	210.870,00	0,24
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	FR0000120321		STK	2.867	0	0 EUR	439,650	1.260.476,55	1,42
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	2.704	0	0 EUR	774,400	2.093.977,60	2,36
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000		STK	5.478	0	0 EUR	70,940	388.609,32	0,44
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	1.345	0	0 EUR	412,200	554.409,00	0,62
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681		STK	51.535	0	0 EUR	3,412	175.811,65	0,20
Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	FI4000297767		STK	33.106	0	0 EUR	11,005	364.331,53	0,41
Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693		STK	1.426	0	0 EUR	142,000	202.492,00	0,23
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783		STK	14.060	0	0 EUR	31,510	443.030,60	0,50
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	10.278	0	0 EUR	93,080	956.676,24	1,08
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	11.625	0	0 EUR	169,700	1.972.762,50	2,22
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	6.615	0	0 EUR	215,100	1.422.886,50	1,60
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	9.721	0	0 EUR	175,900	1.709.923,90	1,93
Siemens Energy AG	DE000ENER6Y0		STK	8.310	0	0 EUR	19,300	160.383,00	0,18
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9		STK	16.371	0	0 EUR	20,880	341.826,48	0,39
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271		STK	30.084	0	0 EUR	68,590	2.063.461,56	2,33
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360		STK	18.200	0	0 EUR	34,580	629.356,00	0,71
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486		STK	6.834	0	0 EUR	110,250	753.448,50	0,85
Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.	DE000ZAL1111		STK	1.279	0	0 EUR	24,660	31.540,14	0,04
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>51.302.172,00</b>	<b>57,82</b>
1,5000 % 3M Co. EO-Med.-Term Nts 2014(14/26) F	XS1136406342		EUR	1.500	0	0 %	94,903	1.423.545,00	1,60
2,8750 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.260 v.2024(2028)	DE000AAR0405		EUR	2.500	2.500	0 %	97,451	2.436.275,00	2,75
0,0500 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 311 v.21(26)	DE000AAR0298		EUR	1.000	0	0 %	89,437	894.370,00	1,01
3,2050 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(24)	XS2555209035		EUR	3.000	0	0 %	99,724	2.991.720,00	3,37
0,5000 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(25)	XS1755086607		EUR	2.000	0	0 %	97,751	1.955.020,00	2,20
0,0500 % Bayer AG EO-Anleihe v.21(21/25)	XS2281342878		EUR	2.000	2.000	0 %	97,334	1.946.680,00	2,19
0,3750 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv. v.21(31)	DE000BHY0SL9		EUR	2.500	2.500	0 %	79,118	1.977.950,00	2,23
1,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(24)	FR0011993518		EUR	2.000	0	0 %	99,689	1.993.780,00	2,25
0,5000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	XS2051494222		EUR	1.500	0	0 %	95,565	1.433.475,00	1,62
4,7370 % Commerzbank AG FLR-MTN-HPF.Em.2299 v.09(24)	DE000EH1A3P2		EUR	6.000	6.000	0 %	100,047	6.002.820,00	6,77
0,1250 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2020(24)	FR0013505575		EUR	2.000	0	0 %	97,838	1.956.760,00	2,21
3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 2024(36)	IT0005585622		EUR	1.500	1.500	0 %	100,291	1.504.365,00	1,70
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)	DE000DL19VD6		EUR	1.500	0	0 %	97,286	1.459.290,00	1,64
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	DE000A30WVF1		EUR	2.000	2.000	0 %	94,116	1.882.320,00	2,12

## Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15317 v.22(26)	DE000A3T0YH5		EUR	1.500	1.500	0 %	94,575	1.418.625,00	1,60
3,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15337 v.24(27)	DE000A31RJ45		EUR	1.500	1.500	0 %	98,636	1.479.540,00	1,67
2,8750 % Erste Group Bank AG EO-M.-T. Hyp.-Pfandb. 2024(31)	AT0000A39GD4		EUR	1.000	1.000	0 %	97,499	974.990,00	1,10
5,5380 % Hamburg Commercial Bank AG FLR-IHS v. 23(25) S.2763	DE000HCB0B02		EUR	3.500	3.500	0 %	100,441	3.515.435,00	3,96
3,0190 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/27)	XS2486589596		EUR	2.000	0	0 %	98,118	1.962.360,00	2,21
3,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 24(29)	XS2781419424		EUR	2.200	2.200	0 %	99,931	2.198.482,00	2,48
4,2790 % Toronto-Dominion Bank, The EO-FLR Med.-T.Cov.Bds 2024(27)	XS2782117118		EUR	3.000	3.000	0 %	100,280	3.008.400,00	3,39
0,2500 % UBS Group AG EO-FLR Notes 2020(25/26)	CH0520042489		EUR	2.500	2.500	0 %	97,214	2.430.350,00	2,74
3,3040 % UBS Switzerland AG EO-Pfbr.-Anl. 2024(29)	CH1331113469		EUR	1.000	1.000	0 %	100,102	1.001.020,00	1,13
3,3750 % UniCredit S.p.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(27)	IT0005549362		EUR	1.500	0	1.500 %	99,768	1.496.520,00	1,69
0,5000 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(25)	XS1748436190		EUR	2.000	0	0 %	97,904	1.958.080,00	2,21
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.939.460,00</b>	<b>2,19</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.939.460,00</b>	<b>2,19</b>
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	XS2308321962		EUR	2.000	0	0 %	96,973	1.939.460,00	2,19
<b>Summe Wertpapiervermögen 2)</b>							<b>EUR</b>	<b>87.276.045,11</b>	<b>98,36</b>

# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-66.241,54</b>	<b>-0,07</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>5.010,71</b>	<b>0,01</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>5.010,71</b>	<b>0,01</b>
FUTURE DAX (PERFORMANCE-INDEX) 21.06.24 EUREX		185	EUR	Anzahl	-36			5.010,71	0,01
<b>Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-71.252,25</b>	<b>-0,08</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>-71.252,25</b>	<b>-0,08</b>
FUTURE EURO-BUND 06.06.24 EUREX		185	EUR		4.000.000			-71.252,25	-0,08

# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>1.053.851,80</b>	<b>1,19</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.053.851,80</b>	<b>1,19</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	856.069,88			% 100,000	856.069,88	0,96
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			GBP	66.198,02			% 100,000	77.551,57	0,09
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	128.538,27			% 100,000	120.230,35	0,14
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>608.500,12</b>	<b>0,69</b>
Zinsansprüche			EUR	411.386,80				411.386,80	0,46
Dividendenansprüche			EUR	181.134,89				181.134,89	0,20
Quellensteueransprüche			EUR	15.978,43				15.978,43	0,02
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-142.568,00</b>	<b>-0,16</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-54.846,68				-54.846,68	-0,06
Performance Fee			EUR	0,01				0,01	0,00
Verwahrstellenvergütung			EUR	-6.574,10				-6.574,10	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-11.250,00				-11.250,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.000,00				-1.000,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-68.897,23				-68.897,23	-0,08
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>88.729.587,49</b>	<b>100,00 1)</b>

# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>WAVE Total Return ESG I</b>									
Anteilwert							EUR	56,08	
Ausgabepreis							EUR	56,08	
Rücknahmepreis							EUR	56,08	
Anzahl Anteile							STK	1.391.523	
<b>WAVE Total Return ESG R</b>									
Anteilwert							EUR	53,85	
Ausgabepreis							EUR	55,47	
Rücknahmepreis							EUR	53,85	
Anzahl Anteile							STK	198.544	

### Fußnoten:

- 1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.
- 2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.





## Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

### 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2456253082	EUR	0	1.500	
4,6250 % Bayer AG MTN v.2023(2033/2033)	XS2630111719	EUR	0	1.500	
3,0000 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(31)	FR001400N6K4	EUR	1.500	1.500	
0,3750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	IT0005481046	EUR	0	3.000	
4,2460 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Pref Med.-T. Nts 23(25)	FR001400GDG7	EUR	0	1.500	
3,6250 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2023(26)	ES0413320153	EUR	2.000	2.000	
3,6250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15332 v.23(27)	DE000A31RJZ2	EUR	0	1.500	
4,9260 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2389353181	EUR	0	1.500	
4,7220 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 2023(25)	XS2719281227	EUR	3.500	3.500	
3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdbr.23(28)	IT0005554578	EUR	0	2.500	
0,6250 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	XS1795392502	EUR	0	2.000	
4,8860 % NatWest Markets PLC EO-FLR Med.-T. Notes 2023(26)	XS2576255751	EUR	0	2.000	
0,1250 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Medium-Term Bonds 2022(28)	XS2435783613	EUR	0	1.500	
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	XS2623820953	EUR	0	2.000	
2,1250 % UBS AG EO-Medium-Term Notes 2022(24)	XS2480543102	EUR	0	3.000	
2,8750 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2024(28)	AT000B049952	EUR	1.000	1.000	
0,0100 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2063 v.19(24)	DE000HV2AST3	EUR	0	1.500	

### 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	2.000	
--	--------------	-----	---	-------	--

**Halbjahresbericht  
WAVE Total Return ESG**

**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
<b>Nichtnotierte Wertpapiere *)</b>					
<b>Aktien</b>					
Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.01/24 EO -,75	ES0144583293	STK	908	908	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)	XS2436160779	EUR	0	3.000	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.179 v.2019(24)	DE0001141794	EUR	3.000	3.000	
<b>Andere Wertpapiere</b>					
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809R9	STK	52.671	52.671	

## Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

### 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

##### Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX)

EUR

79.754,52

##### Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BUND)

EUR

17.997,55

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BUND)

EUR

15.915,99

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.

\*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

**Halbjahresbericht  
WAVE Total Return ESG**

**Anteilklassenmerkmale im Überblick**

<b>Anteilklasse</b>	<b>Mindestanlagesumme in Währung</b>	<b>Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)</b>	<b>Verwaltungsvergütung derzeit (Angabe in % p.a.) *)</b>	<b>Ertragsverwendung</b>	<b>Währung</b>
<b>WAVE Total Return ESG I</b>	100.000	0,00	0,200	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
<b>WAVE Total Return ESG R</b>	keine	3,00	0,600	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

\*) Die maximale Gebühr kann dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,36
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,07

## Sonstige Angaben

### WAVE Total Return ESG I

Anteilwert	EUR	56,08
Ausgabepreis	EUR	56,08
Rücknahmepreis	EUR	56,08
Anzahl Anteile	STK	1.391.523

### WAVE Total Return ESG R

Anteilwert	EUR	53,85
Ausgabepreis	EUR	55,47
Rücknahmepreis	EUR	53,85
Anzahl Anteile	STK	198.544

## 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.

## **Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG**

### **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

**Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A**

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtdite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 2. Mai 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Die Geschäftsführung

# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## Anteilklassen im Überblick

### Erstausgabedatum

Anteilklasse I	28. Dezember 2007
Anteilklasse R	28. Dezember 2007

### Erstausgabepreise

Anteilklasse I	€ 50,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse R	€ 50,00 zzgl. Ausgabeaufschlag

### Ausgabeaufschlag

Anteilklasse I	derzeit 0,00 %
Anteilklasse R	derzeit 3,00 %

### Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	€ 100.000,00
Anteilklasse R	keine

### Verwaltungsvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,20 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,60 % p.a.

### Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,025 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,025 % p.a.

### Anlageberatervergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,30 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,40 % p.a.

### Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse R	Euro

### Ertragsverwendung

Anteilklasse I	ausschüttend
Anteilklasse R	ausschüttend

### Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	A0MU8D / DE000A0MU8D2
Anteilklasse R	A0MU8 / DE000A0MU8A8



# Halbjahresbericht WAVE Total Return ESG

## 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 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

#### Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan  
Frank Eggloff, München  
Mathias Heiß, Langen  
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe  
Axel Vespermann, Dreieich

#### Aufsichtsrat:

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

### 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. € 599 (Stand: 31.12.2022)

### 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  
www.wave-ag.de

### 4. Anlageausschuss

Boris Sonntag  
WAVE Management AG, Hannover