

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

HannoverscheBasisInvest

JAHRESBERICHT

ZUM 31. DEZEMBER 2021

---

VERWAHRSTELLE:



HAUCK  
AUFHÄUSER  
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Tätigkeitsbericht für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2021 bis 31. Dezember 2021

### Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Das Sondervermögen investiert zu mindestens 51 % in auf Euro lautende verzinsliche Wertpapiere. Der Fonds legt in verzinsliche Wertpapiere mit mittleren und längeren Laufzeiten an. Als Anlagen des Fonds kommen vor allem Staatsanleihen, Pfandbriefe und Anleihen von Unternehmen in Frage, die auf Euro lauten. Dabei wird auf eine hohe Kreditwürdigkeit der Schuldner geachtet. Ziel einer Anlage im Fonds ist es, an der Verzinsung und Kursentwicklung von Anleihen aus Euroland teilzuhaben.

### Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

#### Fondsstruktur

	31.12.2021		31.12.2020	
	Kurswert	% Anteil	Kurswert	% Anteil
		Fondsvermögen		Fondsvermögen
Renten	37.895.239,00	96,58	38.858.570,00	97,81
Futures	92.987,90	0,24	-4.700,00	-0,01
Bankguthaben	1.215.429,11	3,10	782.863,62	1,97
Zins- und Dividendenansprüche	102.823,81	0,26	160.530,05	0,40
Sonstige Ford./Verbindlichkeiten	-69.113,25	-0,18	-67.102,85	-0,17
Fondsvermögen	39.237.366,57	100,00	39.730.160,82	100,00

## **Jahresbericht HannoverscheBasisInvest**

Im Rentenportfolio wurde im Laufe des Jahres der Bestand von Unternehmensanleihen abgebaut. Sowohl Industrie- als auch Bankanleihen wurden verkauft, wobei die Liquidität in Staatsanleihen und Pfandbriefe reinvestiert wurde. Die wesentlichen Kreditrisiken verblieben im mittleren Laufzeitenbereich und ausschließlich innerhalb des Investmentgrade-Horizonts. Aufgrund unterschiedlicher wirtschaftlicher und politischer Entwicklungen in Europa wurde der Bestand an Staatsanleihen sehr selektiv gemanagt.

### **Wesentliche Risiken**

#### Allgemeine Marktpreisrisiken

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken. Für die Kurs- oder Marktwertentwicklung stellen die Entwicklungen aufgrund von COVID 19 gegenwärtig einen besonderen Aspekt der Unsicherheit dar.

#### Zinsänderungsrisiken

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Begebung eines Wertpapiers besteht, ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite der festverzinslichen Wertpapiere in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungs-/Kursrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

#### Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken

Durch den Ausfall eines Ausstellers oder Kontrahenten können Verluste für das Sondervermögen entstehen. Das Ausstellerrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Ausstellers, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten. Das Kontrahentenrisiko beinhaltet das Risiko der Partei eines gegenseitigen Vertrages, mit der eigenen Forderung teilweise oder vollständig auszufallen. Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung eines Sondervermögens geschlossen werden.

#### Bonitätsrisiken

Bei Anleihen kann es zu einer Ratingveränderung des Schuldners kommen. Je nachdem, ob die Bonität steigt oder fällt, kann es zu Kursveränderungen des Wertpapiers kommen.

## **Jahresbericht HannoverscheBasisInvest**

### Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften

Die Gesellschaft darf für Rechnung des Sondervermögens sowohl zu Absicherungszwecken als auch zu Investitionszwecken Geschäfte mit Derivaten tätigen. Die Absicherungsgeschäfte dienen dazu, das Gesamtrisiko des Sondervermögens zu verringern, können jedoch ggf. auch die Renditechancen schmälern.

Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:

- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes bis hin zur Wertlosigkeit vermindern. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann das Sondervermögen ebenfalls Verluste erleiden.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Sondervermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Sondervermögen gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass das Sondervermögen zur Abnahme / Lieferung von Vermögenswerten zu einem abweichenden Preis als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet ist.
- Auch bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass das Sondervermögen infolge unerwarteter Entwicklungen der Marktpreise bei Fälligkeit Verluste erleidet.

### **Fondsergebnis**

Die wesentlichen Quellen des positiven Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Gewinne aus ausländischen Renten.

Im Berichtszeitraum vom 1. Januar 2021 bis 31. Dezember 2021 lag die Wertentwicklung des Sondervermögens bei -1,37 %<sup>1</sup>.

### **Wichtiger Hinweis**

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln.

<sup>1</sup> Eigene Berechnung nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese ist nicht prognostizierbar.

**Vermögensübersicht zum 31.12.2021**

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>39.307.198,25</b>	<b>100,18</b>
1. Anleihen	37.895.239,00	96,58
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	5.151.125,00	13,13
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	12.966.888,00	33,05
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	19.777.226,00	50,40
2. Derivate	92.987,90	0,24
3. Bankguthaben	1.215.429,11	3,10
4. Sonstige Vermögensgegenstände	103.542,24	0,26
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-69.831,68</b>	<b>-0,18</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>39.237.366,57</b>	<b>100,00</b>

# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>37.895.239,00</b>	<b>96,58</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>37.895.239,00</b>	<b>96,58</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>37.895.239,00</b>	<b>96,58</b>
0,0500 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 311 v.21(26)	DE000AAR0298		EUR	1.200	1.200	0 %	98,089	1.177.068,00	3,00
0,2000 % Banco Santander S.A. EO-Pref. Med-T. Nts 2021(28)	XS2298304499		EUR	1.000	1.000	0 %	98,292	982.920,00	2,51
0,0500 % Bayer AG EO-Anleihe v.21(21/25)	XS2281342878		EUR	1.000	1.000	0 %	99,803	998.030,00	2,54
0,0000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2021(31)	BE0000352618		EUR	2.000	2.000	0 %	98,241	1.964.820,00	5,01
0,1250 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF EO-Med.Term Obl.Fonc. 2021(31)	FR0014006WB3		EUR	1.000	1.000	0 %	98,193	981.930,00	2,50
0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2345982362		EUR	1.000	1.000	0 %	99,758	997.580,00	2,54
0,4490 % Credit Suisse Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	CH0591979635		EUR	1.000	1.000	0 %	101,354	1.013.540,00	2,58
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)	DE000DL19VD6		EUR	1.000	1.000	0 %	104,058	1.040.580,00	2,65
0,0000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/26)	XS2390400633		EUR	1.000	1.000	0 %	98,746	987.460,00	2,52
0,1000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Med.-T.Nts 2020(27/28)	AT0000A2KW37		EUR	1.000	0	0 %	97,691	976.910,00	2,49
0,4120 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2389353181		EUR	1.000	1.000	0 %	101,810	1.018.100,00	2,59
0,0100 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2021(29)	XS2396616455		EUR	1.000	1.000	0 %	98,556	985.560,00	2,51
4,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2013(23)	IT0004898034		EUR	3.500	0	0 %	106,575	3.730.125,00	9,51
1,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25)	IT0005090318		EUR	2.000	0	0 %	104,552	2.091.040,00	5,33
2,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28)	IT0005323032		EUR	1.000	0	0 %	108,322	1.083.220,00	2,76
1,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30)	IT0005413171		EUR	1.600	0	0 %	105,206	1.683.296,00	4,29
0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/28)	XS2238789460		EUR	1.000	0	0 %	100,044	1.000.440,00	2,55
0,2500 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28)	XS2381853279		EUR	1.000	1.000	0 %	98,300	983.000,00	2,51
0,4750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30)	PTOTELOE0028		EUR	1.000	0	0 %	101,614	1.016.140,00	2,59
0,1250 % Santander Consumer Bank AS EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2124046918		EUR	1.000	0	0 %	99,814	998.140,00	2,54
0,0500 % SFIL S.A. EO-Medium-Term Notes 2021(29)	FR0014003S98		EUR	1.000	1.000	0 %	99,655	996.550,00	2,54
0,2500 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(27)	FR0014004GE5		EUR	1.000	1.000	0 %	99,039	990.390,00	2,52
1,6000 % Spanien EO-Bonos 2015(25)	ES00000126Z1		EUR	2.500	0	0 %	106,588	2.664.700,00	6,79

# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,3500 % Spanien EO-Bonos 2018(23)	ES0000012B62		EUR	1.400	0	0 %	101,500	1.421.000,00	3,62
1,2500 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30)	ES0000012G34		EUR	2.000	0	0 %	107,230	2.144.600,00	5,47
0,0500 % SpareBank 1 Boligkredit AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(28)	XS2404591161		EUR	1.000	1.000	0 %	99,401	994.010,00	2,53
0,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/29)	XS2320759538		EUR	1.000	1.000	0 %	98,474	984.740,00	2,51
0,3750 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(26)	XS2343822842		EUR	1.000	1.000	0 %	99,875	998.750,00	2,55
0,3750 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/27)	DE000A3E5MG8		EUR	1.000	1.000	0 %	99,060	990.600,00	2,52
<b>Summe Wertpapiervermögen 2)</b>							<b>EUR</b>	<b>37.895.239,00</b>	<b>96,58</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>92.987,90</b>	<b>0,24</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>92.987,90</b>	<b>0,24</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>92.987,90</b>	<b>0,24</b>
FUTURE EURO-BOBL 03.22 EUREX		185	EUR	-1.000.000				10.499,00	0,03
FUTURE EURO-BUND 03.22 EUREX		185	EUR	-3.000.000				95.613,90	0,24
FUTURE EURO-SCHATZ 03.22 EUREX		185	EUR	7.500.000				-13.125,00	-0,03
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>1.215.429,11</b>	<b>3,10</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.215.429,11</b>	<b>3,10</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	1.215.429,11		%	100,000	1.215.429,11	3,10
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>103.542,24</b>	<b>0,26</b>
Zinsansprüche			EUR	97.861,24				97.861,24	0,25
Quellensteueransprüche			EUR	5.681,00				5.681,00	0,01

# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-69.831,68</b>	<b>-0,18</b>
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-718,43				-718,43	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-59.083,68				-59.083,68	-0,15
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.929,57				-2.929,57	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-6.700,00				-6.700,00	-0,02
Veröffentlichungskosten			EUR	-400,00				-400,00	0,00
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>39.237.366,57</b>	<b>100,00 1)</b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>62,67</b>	
<b>Ausgabepreis</b>							<b>EUR</b>	<b>63,30</b>	
<b>Anteile im Umlauf</b>							<b>STK</b>	<b>626.078</b>	

### 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.



# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

185

Eurex Deutschland

## Jahresbericht 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,2500 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2019(24)	XS2014287937	EUR	0	400	
0,3750 % Bayer AG EO-Anleihe v.20(20/24)	XS2199265617	EUR	0	1.000	
2,1500 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2015(15/22)	XS1325825211	EUR	0	1.000	
3,2500 % BP Capital Markets PLC EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	XS2193661324	EUR	0	800	
0,6250 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	FR0013429073	EUR	0	1.000	
0,5000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	XS2051494222	EUR	0	1.000	
1,1250 % Caixabank S.A. EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1614722806	EUR	0	1.000	
0,0000 % Daimler AG Medium Term Notes v.19(24)	DE000A2YNZV0	EUR	0	1.000	
0,1250 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35325 v.19(24)	DE000A2NBKK3	EUR	0	400	
0,0020 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2020(22/23)	XS2107332483	EUR	0	1.000	
0,0000 % Honeywell International Inc. EO-Notes 2020(20/24)	XS2126093744	EUR	0	1.000	
1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24)	XS2022425297	EUR	0	1.000	
0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(28)	XS2317069685	EUR	1.500	1.500	
0,3750 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. EO-Notes 2020(20/27)	XS2231330965	EUR	0	1.000	
0,3750 % Lloyds Bank Corporate Markets EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2109394077	EUR	0	600	
0,1000 % OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(27)	XS2258389415	EUR	0	1.000	
0,1250 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2020(26)	FR0013486701	EUR	0	500	
1,0000 % Svenska Handelsbanken AB EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2156510021	EUR	0	500	
1,6250 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.)	XS2290960520	EUR	1.000	1.000	
0,0100 % UniCredit Bank AG HVB MTN-HPF S.2108 v.21(29)	DE000HV2AYJ2	EUR	600	600	
1,8750 % Volkswagen Bank GmbH Med.Term.Nts. v.19(24)	XS1944390241	EUR	0	2.000	

### An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

#### Verzinsliche Wertpapiere

0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	XS2308321962	EUR	1.000	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
<b>Nichtnotierte Wertpapiere *)</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
3,6250 % B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2011(21)	XS0704178556	EUR	0	1.000	
1,2500 % Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2014(2021)	DE000DB7XJB9	EUR	0	1.000	
0,1780 % NatWest Markets PLC EO-FLR Med.-Term Nts 2019(21)	XS2013531228	EUR	0	800	

**Derivate**

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

**Terminkontrakte**

**Zinsterminkontrakte**

Gekaufte Kontrakte:  
(Basiswert(e): EURO-SCHATZ)

EUR 25.239,27

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

EUR 25.535,59

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.

# Jahresbericht

## HannoverscheBasisInvest

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.01.2021 bis 31.12.2021

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	33.569,36	0,05
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	413.795,05	0,66
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	0,00	0,00
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	0,00	0,00
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	0,00	0,00
11. Sonstige Erträge		EUR	0,00	0,00
<b>Summe der Erträge</b>		<b>EUR</b>	<b>447.364,41</b>	<b>0,71</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	-127,50	0,00
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-237.532,89	-0,38
- Verwaltungsvergütung	EUR	-237.532,89		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-11.777,67	-0,02
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-10.262,82	-0,02
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-16.434,76	-0,02
- Depotgebühren	EUR	-7.987,75		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-179,38		
- Sonstige Kosten	EUR	-8.267,63		
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	-6.731,42		
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>EUR</b>	<b>-276.135,64</b>	<b>-0,44</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>EUR</b>	<b>171.228,77</b>	<b>0,27</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>				
1. Realisierte Gewinne		EUR	444.477,48	0,71
2. Realisierte Verluste		EUR	-216.173,05	-0,35
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>EUR</b>	<b>228.304,43</b>	<b>0,36</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>				
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		EUR	-515.539,81	-0,82
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		EUR	-428.636,75	-0,68
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>-944.176,56</b>	<b>-1,50</b>

# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres EUR -544.643,36 -0,87

## Entwicklung des Sondervermögens

			<b>2021</b>
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>			<b>EUR 39.730.160,82</b>
1.	Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr		EUR -243.047,22
2.	Zwischenausschüttungen		EUR 0,00
3.	Mittelzufluss/-abfluss (netto)		EUR 294.987,65
a)	Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR 493.142,91	
b)	Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR -198.155,26	
4.	Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR -91,33
5.	Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR -544.643,36
davon nicht realisierte Gewinne		EUR -515.539,81	
davon nicht realisierte Verluste		EUR -428.636,75	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>			<b>EUR 39.237.366,57</b>

## Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>			<b>EUR 6.403.525,45</b>	<b>10,22</b>
1.	Vortrag aus Vorjahr		EUR 6.003.992,24	9,59
2.	Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR 399.533,20	0,63
3.	Zuführung aus dem Sondervermögen		EUR 0,00	0,00
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>			<b>EUR 6.228.223,61</b>	<b>9,94</b>
1.	Der Wiederanlage zugeführt		EUR 342.618,63	0,55
2.	Vortrag auf neue Rechnung		EUR 5.885.604,98	9,39
<b>III. Gesamtausschüttung</b>			<b>EUR 175.301,84</b>	<b>0,28</b>
1.	Zwischenausschüttung		EUR 0,00	0,00
2.	Endausschüttung		EUR 175.301,84	0,28

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2018	Stück	622.920	EUR	37.708.409,50	EUR	60,53
2019	Stück	621.505	EUR	38.974.393,06	EUR	62,71
2020	Stück	621.441	EUR	39.730.160,82	EUR	63,93
2021	Stück	626.078	EUR	39.237.366,57	EUR	62,67

# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 14.875.750,00

#### die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

UniCredit (Broker) DE

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 96,58

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,24

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 01.07.2018 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	0,15 %
größter potenzieller Risikobetrag	1,33 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	0,41 %

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: 1,34

#### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

BofA Merrill Lynch EMU Direct Governments Index (LC) (USD) (FactSet: MLEG00USD) in EUR 100,00 %

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	62,67
Ausgabepreis	EUR	63,30
Anteile im Umlauf	STK	626.078

## **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

### **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.

### **Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote Gesamtkostenquote**

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt 0,68 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens 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 Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.



# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

<b>Wesentliche sonstige Erträge:</b>	<b>EUR</b>	<b>0,00</b>
<b>Wesentliche sonstige Aufwände:</b>	<b>EUR</b>	<b>8.267,63</b>
- Sonstige Kosten	EUR	8.267,63
- davon Aufwendungen aus negativen Habenzinsen	EUR	6.731,42
<b>Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)</b>		
Transaktionskosten	EUR	4.533,90

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.

### Angaben zur Mitarbeitervergütung

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>67,4</b>
davon feste Vergütung	in Mio. EUR	59,3
davon variable Vergütung	in Mio. EUR	8,1
Zahl der Mitarbeiter der KVG		737
Höhe des gezahlten Carried Interest	in EUR	0
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>7,8</b>
davon Geschäftsleiter	in Mio. EUR	6,6
davon andere Risktaker	in Mio. EUR	1,2

### Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Die Universal-Investment-Gesellschaft mbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die detaillierte Ausgestaltung hat die Gesellschaft in einer Vergütungsrichtlinie geregelt, deren Ziel es ist, eine nachhaltige Vergütungssystematik unter Berücksichtigung von Sustainable Corporate Governance und unter Vermeidung von Fehlanreizen zur Eingehung übermäßiger Risiken (einschließlich einschlägiger Nachhaltigkeitsrisiken) sicherzustellen.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch den Vergütungsausschuss der Universal-Investment auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen sowie interner und externer regulatorischer Vorgaben überprüft. Es umfasst fixe und variable Vergütungselemente. Durch die Festlegung von Bandbreiten für die Gesamtzielvergütung ist gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) gelten besondere Regelungen. Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 50 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt. Wird für risikorelevante Mitarbeiter dieser Schwellenwert überschritten, wird zwingend ein Anteil von 40 % der variablen Vergütung über einen Zeitraum von drei Jahren aufgeschoben.

## **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während dieses Zeitraums risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters oder der Kapitalverwaltungsgesellschaft insgesamt gekürzt werden. Jeweils am Ende jedes Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar und zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt.

Soweit das Portfolio-Management ausgelagert ist, werden keine Mitarbeitervergütungen direkt aus dem Fonds gezahlt.

## **Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB**

### **Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken**

Die Angaben der wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken erfolgt innerhalb des Tätigkeitsberichts.

### **Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten**

Die Angaben zu der Zusammensetzung des Portfolios erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung.

Die Angaben zu den Portfolioumsätzen erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung und innerhalb der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.

Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

### **Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung**

Die Auswahl von Einzeltiteln richtet sich nach der Anlagestrategie. Die vertraglichen Grundlagen für die Anlageentscheidung finden sich in den vereinbarten Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien.

Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

### **Einsatz von Stimmrechtsberatern**

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern verweisen wir auf den neuen Mitwirkungsbericht auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

### **Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten**

Zur grundsätzlichen Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung der Gesellschaft, insbesondere durch die Ausübung von Aktionärsrechten, verweisen wir auf unsere aktuelle Mitwirkungspolitik auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

## **Anhang Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren**

### **Konventionelles Produkt Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungs-Verordnung)**

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

# Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

## VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

### *Prüfungsurteil*

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens HannoverscheBasisInvest - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2021, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes 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 Universal-Investment-Gesellschaft mbH 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 Universal-Investment-Gesellschaft mbH 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 Universal-Investment-Gesellschaft mbH 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 Übereinstimmung 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.

## Jahresbericht HannoverscheBasisInvest

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 Außerkraft setzen 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 Universal-Investment-Gesellschaft mbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Universal-Investment-Gesellschaft mbH 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 Universal-Investment-Gesellschaft mbH 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 Universal-Investment-Gesellschaft mbH 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.

Frankfurt am Main, den 8. April 2022

KPMG AG  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel  
Wirtschaftsprüfer

Rodriguez Gonzalez  
Wirtschaftsprüfer

# Jahresbericht 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 57.243.165,68 (Stand: September 2020)

#### Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München  
Ian Lees, Leverkusen  
Katja Müller, Bad Homburg  
Markus Neubauer, Frankfurt am Main  
Michael Reinhard, Bad Vilbel  
Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)  
Stephan Scholl, Königstein im Taunus  
Axel Vespermann, Dreieich

#### Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin  
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf  
Daniel Fischer, Bad Vilbel  
Daniel F. Just, Pöcking

### 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: EUR 228.000.000 (Stand: 31. Dezember 2020)

### 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