

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



HannoverscheBasisInvest

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2022

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



Vermögensübersicht zum 30.06.2022

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	36.431.582,34	102,13
1. Anleihen	36.363.759,00	101,94
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	7.020.819,00	19,68
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	9.446.463,00	26,48
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	19.896.477,00	55,78
2. Derivate	-22.777,20	-0,06
3. Sonstige Vermögensgegenstände	90.600,54	0,25
II. Verbindlichkeiten	-760.661,66	-2,13
III. Fondsvermögen	35.670.920,68	100,00

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	36.363.759,00	101,94
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	33.949.331,00	95,17
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	33.949.331,00	95,17
1,6000 % AT & T Inc. EO-Notes 2020(20/28)	XS2180007549		EUR	1.000	1.000	0 %	93,957	939.570,00	2,63
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2456253082		EUR	1.000	1.000	0 %	96,652	966.520,00	2,71
0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)	XS2436160779		EUR	1.000	1.000	0 %	97,063	970.630,00	2,72
0,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(29)	FR0014008JP6		EUR	1.000	1.000	0 %	92,155	921.550,00	2,58
0,5000 % Commerzbank AG MTH S.P49 v.22(27)	DE000CZ45W16		EUR	1.000	1.000	0 %	94,356	943.560,00	2,65
0,3750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	IT0005481046		EUR	1.000	1.000	0 %	81,066	810.660,00	2,27
0,1250 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF EO-Med.Term Obl.Fonc. 2021(31)	FR0014006WB3		EUR	1.000	0	0 %	82,173	821.730,00	2,30
2,1250 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2022(24)	XS2480543102		EUR	1.500	1.500	0 %	99,307	1.489.605,00	4,18
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)	DE000DL19VD6		EUR	1.000	0	0 %	96,899	968.990,00	2,72
0,2500 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2020(30/30)	XS2242728041		EUR	1.000	1.000	0 %	75,213	752.130,00	2,11
0,1000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Med.-T.Nts 2020(27/28)	AT0000A2KW37		EUR	1.000	0	0 %	85,046	850.460,00	2,38
0,0100 % Erste Group Bank AG EO-M.-T. Hyp.-Pfandb. 2022(28)	AT0000A2UXM1		EUR	1.000	1.000	0 %	89,136	891.360,00	2,50
3,0190 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/27)	XS2486589596		EUR	1.000	1.000	0 %	98,936	989.360,00	2,77
2,5000 % HSBC SFH (France) EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2022(28)	FR001400AEA1		EUR	1.000	1.000	0 %	102,447	1.024.470,00	2,87
0,0100 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2021(29)	XS2396616455		EUR	1.000	0	0 %	85,983	859.830,00	2,41
1,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2015(25)	IT0005090318		EUR	2.000	0	0 %	99,132	1.982.640,00	5,56
2,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28)	IT0005323032		EUR	2.000	1.000	0 %	97,362	1.947.240,00	5,46
1,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	IT0005367492		EUR	1.600	3.300	1.700 %	100,714	1.611.424,00	4,52
1,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30)	IT0005413171		EUR	2.000	400	0 %	89,579	1.791.580,00	5,02
0,2500 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2021(21/28)	XS2381853279		EUR	1.000	0	0 %	82,589	825.890,00	2,32
0,4750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30)	PTOTELOE0028		EUR	1.000	0	0 %	87,508	875.080,00	2,45
0,1250 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Medium-Term Bonds 2022(28)	XS2435783613		EUR	1.000	1.000	0 %	90,072	900.720,00	2,53
0,1250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(27)	XS2436159847		EUR	1.000	1.000	0 %	92,084	920.840,00	2,58
0,1250 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 2022(29)	FR0014008066		EUR	1.000	1.000	0 %	88,514	885.140,00	2,48
0,0000 % Spanien EO-Bonos 2021(27)	ES0000012J15		EUR	2.500	2.500	0 %	92,655	2.316.375,00	6,49
0,7000 % Spanien EO-Bonos 2022(32)	ES0000012K20		EUR	2.300	2.300	0 %	85,157	1.958.611,00	5,49
0,0500 % SpareBank 1 Boligkredit AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(28)	XS2404591161		EUR	1.000	0	0 %	88,453	884.530,00	2,48
0,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/29)	XS2320759538		EUR	1.000	0	0 %	85,159	851.590,00	2,39
0,3750 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(26)	XS2343822842		EUR	1.000	0	0 %	89,291	892.910,00	2,50
1,3750 % Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2022(32)	BE0002849306		EUR	1.200	1.200	0 %	92,028	1.104.336,00	3,10

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	2.414.428,00	6,77
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	2.414.428,00	6,77
2,0000 % Raiffeisenl.Niederöst.-Wien AG EO-Medium-Term Notes 2022(26)	XS2498470116		EUR	1.400	1.400	0	% 100,902	1.412.628,00	3,96
2,2500 % Sky Ltd. EO-Med. Term Notes 2015(15/25)	XS1321424670		EUR	1.000	1.000	0	% 100,180	1.001.800,00	2,81
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	36.363.759,00	101,94
Derivate							EUR	-22.777,20	-0,06
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate							EUR	-22.777,20	-0,06
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	-22.777,20	-0,06
FUTURE EURO-SCHATZ 09.22 EUREX		185	EUR	-6.000.000				-22.777,20	-0,06
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	90.600,54	0,25
Zinsansprüche			EUR	84.919,54				84.919,54	0,24
Quellensteueransprüche			EUR	5.681,00				5.681,00	0,02
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-691.993,53	-1,94
EUR - Kredite			EUR	-691.993,53			% 100,000	-691.993,53	-1,94

Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-68.668,13	-0,19
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-934,18				-934,18	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-54.427,95				-54.427,95	-0,15
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.856,00				-2.856,00	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-10.050,00				-10.050,00	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-400,00				-400,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	35.670.920,68	100,00 1)
Anteilwert			EUR					56,87	
Ausgabepreis			EUR					57,44	
Anteile im Umlauf			STK					627.230	

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 HannoverscheBasisInvest

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

b) 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					
0,0500 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 311 v.21(26)	DE000AAR0298	EUR	0	1.200	
0,2000 % Banco Santander S.A. EO-Pref. Med-T. Nts 2021(28)	XS2298304499	EUR	0	1.000	
0,0500 % Bayer AG EO-Anleihe v.21(21/25)	XS2281342878	EUR	0	1.000	
0,0000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2021(31)	BE0000352618	EUR	0	2.000	
0,2500 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2345982362	EUR	0	1.000	
0,5520 % Credit Suisse Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	CH0591979635	EUR	0	1.000	
0,0000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/26)	XS2390400633	EUR	0	1.000	
0,8370 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(26/27)	XS2389353181	EUR	0	1.000	
4,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2013(23)	IT0004898034	EUR	0	3.500	
0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/28)	XS2238789460	EUR	0	1.000	
0,1250 % Santander Consumer Bank AS EO-Medium-Term Notes 2020(25)	XS2124046918	EUR	0	1.000	
0,0500 % SFIL S.A. EO-Medium-Term Notes 2021(29)	FR0014003S98	EUR	0	1.000	
0,2500 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(27)	FR0014004GE5	EUR	0	1.000	
1,6000 % Spanien EO-Bonos 2015(25)	ES00000126Z1	EUR	0	2.500	
0,3500 % Spanien EO-Bonos 2018(23)	ES0000012B62	EUR	0	1.400	
1,2500 % Spanien EO-Obligaciones 2020(30)	ES0000012G34	EUR	0	2.000	
0,5000 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2118 v.22(27)	DE000HV2AYU9	EUR	1.000	1.000	
0,3750 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/27)	DE000A3E5MG8	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

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

14.698,56

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 %)	101,94
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,06

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	56,87
Ausgabepreis	EUR	57,44
Anteile im Umlauf	STK	627.230

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 1. Juli 2022

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 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