

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

HannoverscheBasisInvest

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

---

VERWAHRSTELLE:



HAUCK  
AUFHÄUSER  
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



**Vermögensübersicht zum 30.06.2024**

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>35.553.248,63</b>	<b>100,27</b>
1. Anleihen	35.214.242,00	99,32
< 1 Jahr	4.899.980,00	13,82
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	7.887.540,00	22,25
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	6.007.912,00	16,94
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	15.411.590,00	43,47
>= 10 Jahre	1.007.220,00	2,84
2. Derivate	9.792,50	0,03
3. Sonstige Vermögensgegenstände	329.214,13	0,93
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-96.928,87</b>	<b>-0,27</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>35.456.319,76</b>	<b>100,00</b>

# Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>35.214.242,00</b>	<b>99,32</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>34.238.242,00</b>	<b>96,56</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>34.238.242,00</b>	<b>96,56</b>
1,5000 % 3M Co. EO-Med.-Term Nts 2014(14/26) F	XS1136406342		EUR	1.000	0	0	% 95,417	954.170,00	2,69
2,8750 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.260 v.2024(2028)	DE000AAR0405		EUR	1.000	1.000	0	% 98,117	981.170,00	2,77
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	XS2456253082		EUR	1.000	0	0	% 97,757	977.570,00	2,76
3,1250 % Banco Santander S.A. EO-Mortg.Cov.M.-T.Nts 2024(29)	ES0413900947		EUR	600	600	0	% 99,763	598.578,00	1,69
0,0500 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(29)	XS2351089508		EUR	1.000	0	0	% 85,629	856.290,00	2,42
0,5000 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(25)	XS1755086607		EUR	1.000	0	0	% 98,310	983.100,00	2,77
2,0000 % BAWAG P.S.K. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(32)	XS2523326853		EUR	1.000	0	0	% 90,711	907.110,00	2,56
0,3750 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv. v.21(31)	DE000BHY0SL9		EUR	2.000	2.000	0	% 80,100	1.602.000,00	4,52
3,0000 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(31)	FR001400N6K4		EUR	1.000	1.000	0	% 98,620	986.200,00	2,78
1,6250 % Commonwealth Bank of Australia EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 16(31)	XS1357027652		EUR	1.000	0	0	% 89,912	899.120,00	2,54
0,1250 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2020(24)	FR0013505575		EUR	1.000	0	0	% 98,439	984.390,00	2,78
0,3750 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	IT0005481046		EUR	1.000	0	0	% 80,638	806.380,00	2,27
3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2024(36)	IT0005585622		EUR	1.000	1.000	0	% 100,722	1.007.220,00	2,84
3,9520 % Danske Bank AS EO-FLR M.-T.Cov.Bonds 2024(27)	XS2835735163		EUR	1.000	1.000	0	% 100,050	1.000.500,00	2,82
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	DE000A30WV1		EUR	1.000	1.000	0	% 96,850	968.500,00	2,73
3,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15337 v.24(27)	DE000A31RJ45		EUR	1.000	1.000	0	% 99,202	992.020,00	2,80
4,1250 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2024(24/31)	FR001400QR62		EUR	600	600	0	% 100,790	604.740,00	1,71
1,8750 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2018(33/33)	XS1901055472		EUR	1.000	0	0	% 85,530	855.300,00	2,41
0,8750 % Erste Group Bank AG EO-M.-T. Hyp.Pfandb.2019(34)	AT0000A286W1		EUR	1.000	0	0	% 79,702	797.020,00	2,25
3,1250 % Flämische Gemeinschaft EO-Medium-Term Notes 2024(34)	BE0390121847		EUR	1.000	1.000	0	% 98,348	983.480,00	2,77
3,5000 % Frankreich EO-OAT 2023(33)	FR001400L834		EUR	1.800	1.800	0	% 102,130	1.838.340,00	5,18
5,3820 % Hamburg Commercial Bank AG FLR-IHS v. 23(25) S.2763	DE000HCB0B02		EUR	1.000	0	0	% 100,659	1.006.590,00	2,84
3,0190 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/27)	XS2486589596		EUR	1.000	0	0	% 98,548	985.480,00	2,78
3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdr.23(28)	IT0005554578		EUR	2.000	0	0	% 100,800	2.016.000,00	5,69
2,4500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(33)	IT0005240350		EUR	2.000	0	0	% 88,924	1.778.480,00	5,02
2,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2018(28)	IT0005323032		EUR	1.000	0	0	% 95,342	953.420,00	2,69
1,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30)	IT0005413171		EUR	1.000	0	0	% 88,480	884.800,00	2,50
0,6250 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	XS1795392502		EUR	1.000	0	0	% 97,892	978.920,00	2,76
3,1250 % Oldenburgische Landesbank AG MTN-HPF v. 24(32)	DE000A11QJS1		EUR	1.000	1.000	0	% 99,540	995.400,00	2,81
3,1250 % SNCF S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(34)	FR001400OR98		EUR	500	500	0	% 96,668	483.340,00	1,36

## Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

### Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,1500 % Spanien EO-Bonos 2023(33)	ES0000012L52		EUR	1.000	0	0 %	98,988	989.880,00	2,79
0,2500 % UBS Group AG EO-FLR Notes 2020(25/26)	CH0520042489		EUR	1.000	1.000	0 %	97,873	978.730,00	2,76
3,3040 % UBS Switzerland AG EO-Pfbr.-Anl. 2024(29)	CH1331113469		EUR	600	600	0 %	100,409	602.454,00	1,70
3,3750 % UniCredit S.p.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(27)	IT0005549362		EUR	1.000	0	0 %	100,155	1.001.550,00	2,82
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>976.000,00</b>	<b>2,75</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>976.000,00</b>	<b>2,75</b>
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	XS2308321962		EUR	1.000	0	0 %	97,600	976.000,00	2,75
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>35.214.242,00</b>	<b>99,32</b>

**Halbjahresbericht  
HannoverscheBasisInvest**

**Vermögensaufstellung zum 30.06.2024**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>9.792,50</b>	<b>0,03</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>9.792,50</b>	<b>0,03</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>9.792,50</b>	<b>0,03</b>
FUTURE EURO-BUND 06.09.24 EUREX			185	EUR	1.000.000			9.792,50	0,03

# Halbjahresbericht HannoverscheBasisInvest

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>329.214,13</b>	<b>0,93</b>
Zinsansprüche			EUR	323.533,13				323.533,13	0,91
Quellensteueransprüche			EUR	5.681,00				5.681,00	0,02
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-21.121,62</b>	<b>-0,06</b>
EUR - Kredite			EUR	-21.121,62			% 100,000	-21.121,62	-0,06
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-75.807,25</b>	<b>-0,21</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-53.020,57				-53.020,57	-0,15
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.585,84				-2.585,84	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-10.012,78				-10.012,78	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-395,56				-395,56	0,00
Variation Margin			EUR	-9.792,50				-9.792,50	-0,03
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>35.456.319,76</b>	<b>100,00 1)</b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>56,53</b>	
<b>Ausgabepreis</b>							<b>EUR</b>	<b>57,10</b>	
<b>Anteile im Umlauf</b>							<b>STK</b>	<b>627.239</b>	

### 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
2,3750 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2022(27)	ES0413900848	EUR	0	1.000	
2,8750 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(34)	FR001400M4Z8	EUR	1.000	1.000	
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)	DE000DL19VD6	EUR	0	1.000	
3,3750 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.23(29)	DE000A352BT3	EUR	0	1.000	
3,6250 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2023(26)	ES0413320153	EUR	0	1.000	
0,1000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Med.-T.Nts 2020(27/28)	AT0000A2KW37	EUR	0	1.000	
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfbr. 2023(28)	AT0000A34CR4	EUR	0	1.000	
4,6240 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 2023(25)	XS2719281227	EUR	0	1.000	
0,0100 % National Australia Bank Ltd. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Bds 21(29)	XS2360589217	EUR	0	1.000	
0,1250 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Medium-Term Bonds 2022(28)	XS2435783613	EUR	0	1.000	
3,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Pref. Med.-T.Nts 24(29)	XS2781419424	EUR	1.000	1.000	
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	1.000	
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
3,2500 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 22(24)	XS2545247863	EUR	0	1.000	
<b>Nichtnotierte Wertpapiere *)</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)	XS2436160779	EUR	0	1.000	
4,7370 % Commerzbank AG FLR-MTN-HPF.Em.2299 v.09(24)	DE000EH1A3P2	EUR	1.000	1.000	
2,1250 % UBS AG EO-Medium-Term Notes 2022(24)	XS2480543102	EUR	0	2.000	



**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-BUND)

EUR

19.158,22

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

EUR

2.355,26

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 HannoverscheBasisInvest

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	99,32
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,03

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	56,53
Ausgabepreis	EUR	57,10
Anteile im Umlauf	STK	627.239

### 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.

**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 Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

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 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

#### Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan  
Mathias Heiß, Langen  
Dr. André Jäger, Witten  
Corinna Jäger, Nidderau  
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: EUR 621.628.611 (Stand: 31.12.2023)

### 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