

HALBJAHRESBERICHT HMT GLOBAL MULTI STRATEGIE

Ein OGAW deutschen Rechts
zum 30.04.2020



INHALTSVERZEICHNIS

VERMÖGENSÜBERSICHT	3
VERMÖGENSAUFSTELLUNG	4
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	6

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		11.636.851,36	100,44
1. Investmentanteile		11.341.015,76	97,89
- Gemischte Fonds	EUR	4.085.273,79	35,26
- Aktienfonds	EUR	3.722.093,57	32,13
- Rentenfonds	EUR	3.533.648,40	30,50
2. Bankguthaben		295.835,60	2,55
- Bankguthaben in EUR	EUR	295.835,60	2,55
II. Verbindlichkeiten		-50.850,63	-0,44
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-50.850,63	-0,44
III. Fondsvermögen	EUR	11.586.000,73	100,00¹⁾

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.04.2020	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Investmentanteile							EUR	11.341.015,76	97,89
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	11.341.015,76	97,89
LU0108940346	Aberdeen Standard Liquidity [Lux] - Euro Fund	ANT		650	0	0	EUR 1.200,7770	780.505,05	6,74
LU1869435039	Alma Platinum-AP Quantica Managed Futures	ANT		7.941	0	0	EUR 106,4100	845.001,81	7,29
LU1883336213	Amundi Funds - Multi-Strategy Growth	ANT		667	0	0	EUR 1.513,0300	1.009.191,01	8,71
LU0494762056	Bellevue Funds [Lux] SICAV - BB Global Macro	ANT		2.441	0	0	EUR 170,4400	416.044,04	3,59
LU0438336421	BlackRock Strategic Fd SICAV - Fixed Income Str Fd	ANT		3.288	0	0	EUR 122,4600	402.648,48	3,48
LU0852336535	BlackRock Strategic Fund SICAV-Em Mark Ab Return F	ANT		3.280	0	0	EUR 94,5100	309.992,80	2,68
LU0627763740	BlueBay Investment Grade Abs. Return Bond Fund I	ANT		5.175	0	0	EUR 114,8900	594.555,75	5,13
IE00B5BBQJ73	GAM STAR Fund PLC - GAM Star Alpha Technology	ANT		52.000	0	0	EUR 14,8819	773.858,80	6,68
LU0228348941	GREIFF special situations Fund	ANT		11.089	0	0	EUR 71,9000	797.299,10	6,88
FR0011006188	H2O Allegro I 4 Dec.	ANT		3	0	0	EUR 112.819,0000	338.457,00	2,92
LU0912261970	Helium Fund - Helium Performance A EUR	ANT		541	0	0	EUR 1.172,9560	634.569,20	5,48
FR0010881821	JL Equity Market Neutra Fund	ANT		760	0	0	EUR 1.195,5000	908.580,00	7,84
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia IS Eur	ANT		501	0	0	EUR 1.053,7400	527.923,74	4,56
LU0994415189	LUMYNA-MLL LYNCHENHANCED EQU VOLA PREM UCITS FUND	ANT		3.750	0	0	EUR 100,4200	376.575,00	3,25
LU0329425713	Lupus Alpha All Opportunities Fund B EUR	ANT		3.275	0	0	EUR 101,1600	331.299,00	2,86
IE00BLP5S791	Merian Global Inv. Gbl Equity Absolute Return Fd	ANT		367.350	0	0	EUR 1,3193	484.644,86	4,18
LU1829331989	Threadneedle LUX- Credit Opportu. Fund 8E EUR Acc.	ANT		94.684	0	0	EUR 9,7830	926.296,92	7,99
DE000A111ZE4	Warburg-Defensiv-Fonds I	ANT		3.800	0	0	EUR 103,2600	392.388,00	3,39
LU0946790952	XAIA Credit Debit Capital IT EUR	ANT		440	0	0	EUR 1.116,3300	491.185,20	4,24
Summe Wertpapiervermögen							EUR	11.341.015,76	97,89

Vermögensaufstellung zum 30.04.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.04.2020	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben						EUR	295.835,60	2,55
EUR - Guthaben bei:						EUR	295.835,60	2,55
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	295.835,60	%	100,0000	295.835,60	2,55
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-50.850,63	-0,44
Kostenabgrenzung						EUR	-50.850,63	-0,44
			EUR	-50.850,63			-50.850,63	-0,44
Fondsvermögen						EUR	11.586.000,73	100,00²⁾
Anteilwert HMT Global Multi Strategie						EUR	89,810	
Umlaufende Anteile HMT Global Multi Strategie						STK	129.000,000	

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Sondervermögen HMT Global Multi Strategie

Mindestanlagesumme	keine
Fondsauflage	13.01.2017
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,00%, derzeit 0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,07%, derzeit 1,07%
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Währung	Euro
ISIN	DE000A2AJJRO

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

Sonstige Angaben

Anteilwert HMT Global Multi Strategie	EUR	89,810
Umlaufende Anteile HMT Global Multi Strategie	STK	129.000,000

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der Société Générale Securities Services GmbH mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses bei der Société Générale Securities Services GmbH einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand einer weiteren unabhängigen Modellierung verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Für die im Sondervermögen HMT Global Multi Strategie zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

97,89% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse

0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (u.a. anhand der Quelle Interactive Data, indikativer Quotes bzw. Bewertungsmodellen).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder - sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist - auf Basis von Börsenkursen. Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Unterföhring bei München, Mai 2020
Soci t  G n rale Securities Services GmbH
Die Gesch ftsf hrung