

HALBJAHRESBERICHT HMT GLOBAL MULTI STRATEGIE

Ein OGAW deutschen Rechts
zum 30.04.2021

INHALTSVERZEICHNIS

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

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		9.964.630,83	101,03
1. Investmentanteile		9.470.444,26	96,02
- Gemischte Fonds	EUR	3.325.069,63	33,71
- Aktienfonds	EUR	2.664.901,98	27,02
- Rentenfonds	EUR	3.480.472,65	35,29
2. Bankguthaben		494.186,57	5,01
- Bankguthaben in EUR	EUR	494.186,57	5,01
II. Verbindlichkeiten		-101.408,55	-1,03
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-101.408,55	-1,03
III. Fondsvermögen	EUR	9.863.222,28	100,00¹⁾

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.04.2021	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Investmentanteile							EUR	9.470.444,26	96,02
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	9.470.444,26	96,02
LU0108940346	Aberdeen Standard Liquidity [Lux] - Euro Fund	ANT		650	0	0	EUR 1.194,9530	776.719,45	7,87
LU1869435039	Alma Platinum-AP Quantica Managed Futures	ANT		7.941	0	0	EUR 125,7800	998.818,98	10,13
LU1883336213	Amundi Funds - Multi-Strategy Growth	ANT		667	0	0	EUR 1.785,9600	1.191.235,32	12,08
LU0494762056	Bellevue Funds [Lux] SICAV - BB Global Macro	ANT		2.441	0	0	EUR 186,9900	456.442,59	4,63
LU0438336421	BlackRock Strategic Fd SICAV - Fixed Income Str Fd	ANT		3.288	0	0	EUR 130,3600	428.623,68	4,35
LU0627763740	BlueBay Investment Grade Abs. Return Bond Fund I	ANT		5.175	0	0	EUR 125,7000	650.497,50	6,60
LU0616900691	Exane Funds 2 SICAV - Exane Pléiade Fund	ANT		27	27	0	EUR 13.027,0400	351.730,08	3,57
FR0013535762	H2O Allegro FCP	ANT		3	0	0	EUR 48.186,6300	144.559,89	1,47
LU0912261970	Helium Fund - Helium Performance A EUR	ANT		541	0	0	EUR 1.305,5950	706.326,90	7,16
DE000A2PS188	HMT Euro Aktien VolControl	ANT		3.330	3.330	0	EUR 108,0700	359.873,10	3,65
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia IS Eur	ANT		501	0	0	EUR 1.064,0700	533.099,07	5,40
LU0994415189	LUMYNA-MLL LYNCHENHANCED EQU VOLA PREM UCITS FUND	ANT		3.750	0	0	EUR 108,4500	406.687,50	4,12
LU0329425713	Lupus Alpha All Opportunities Fund B EUR	ANT		3.275	0	0	EUR 133,7300	437.965,75	4,44
IE00BLP5S791	Merian Global Inv. Glbl Equity Absolute Return Fd	ANT		367.350	0	0	EUR 1,4912	547.792,32	5,55
LU1829331989	Threadneedle LUX- Credit Opportu. Fund 8E EUR Acc.	ANT		94.684	0	0	EUR 10,2892	974.226,13	9,88
LU0946790952	XAIA Credit Debit Capital IT EUR	ANT		440	0	0	EUR 1.149,6500	505.846,00	5,13
Summe Wertpapiervermögen							EUR	9.470.444,26	96,02

Vermögensaufstellung zum 30.04.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.04.2021	Käufe / Verkäufe / Zugänge Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben						EUR	494.186,57	5,01
EUR - Guthaben bei:						EUR	494.186,57	5,01
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	494.186,57	%	100,0000	494.186,57	5,01
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-101.408,55	-1,03
Kostenabgrenzung						EUR	-101.408,55	-1,03
			EUR	-101.408,55			-101.408,55	-1,03
Fondsvermögen						EUR	9.863.222,28	100,00²⁾
Anteilwert HMT Global Multi Strategie						EUR	98,63	
Umlaufende Anteile HMT Global Multi Strategie						STK	100.000,00	

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

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):**

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU0852336535	BlackRock Strategic Fund SICAV-Em Mark Ab Return F	ANT	0	3.280
IE00B5BBQJ73	GAM STAR Fund PLC - GAM Star Alpha Technology	ANT	0	52.000
LU0228348941	GREIFF special situations Fund	ANT	0	11.089
FR0010881821	JL Equity Market Neutra Fund	ANT	0	760
DE000A111ZE4	Warburg-Defensiv-Fonds I	ANT	0	3.800

Sondervermögen HMT Global Multi Strategie

Mindestanlagesumme	keine
Fondsaufgabe	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	98,63
Umlaufende Anteile HMT Global Multi Strategie	STK	100.000,00

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:

96,02% 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.

Aschheim, Mai 2021

Société Générale Securities Services GmbH

Die Geschäftsführung