



HALBJAHRESBERICHT

HMT CORPORATES RISKCONTROL

OGAW-SONDERVERMÖGEN
NACH DEUTSCHEM RECHT



ZUM 30. APRIL 2018

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

Vermögensübersicht

| | | | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|----------------------------------|--|------------|----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | | | |
| 1. Anleihen | | | | |
| – Unternehmensanleihen | | EUR | 28.227.722,50 | 97,74 |
| 2. Derivate | | | | |
| – Futures (Verkauf) | | EUR | -59.340,00 | -0,21 |
| – Futures (Kauf) | | EUR | 6.600,00 | 0,02 |
| 3. Bankguthaben | | | | |
| – Bankguthaben in EUR | | EUR | 368.933,43 | 1,28 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | | EUR | 377.763,08 | 1,31 |
| II. Verbindlichkeiten | | | | |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | | EUR | -39.875,58 | -0,14 |
| | | EUR | 28.881.803,43 | 100,00¹ |

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

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens | |
|-------------------------------------|---|---|-----------------------|--|----------------------|---|------------|----------------------|------------------------------|--|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 26.921.709,50 | 93,22 | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| XS1501367921 | 1,000% Lanxess MTN 07.10.26 | EUR | 350 | 0 | 0 | % | 96,7740 | 338.709,00 | 1,17 | |
| DE000A2BPET2 | 1,375% ThyssenKrupp MTN 03.03.22 | EUR | 200 | 0 | 300 | % | 101,2950 | 202.590,00 | 0,70 | |
| XS1425274484 | 2,250% HeidelbergCement MTN 03.06.24 | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 106,5870 | 106.587,00 | 0,37 | |
| XS1387174375 | 2,250% HeidelbergCement MTN 30.03.23 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 106,9560 | 213.912,00 | 0,74 | |
| XS1591416679 | 2,625% K+S Anl. 06.04.23 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 104,8140 | 314.442,00 | 1,09 | |
| XS1152338072 | 2,625% Merck Nts. 12.12.74V | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 104,9910 | 209.982,00 | 0,73 | |
| XS1219498141 | 2,750% RWE Anl. 21.04.75V | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 103,1900 | 206.380,00 | 0,71 | |
| DE000A11QR65 | 3,000% Bayer MTN 01.07.75V | EUR | 250 | 0 | 0 | % | 104,2250 | 260.562,50 | 0,90 | |
| DE000A1PGZ82 | 3,000% K+S Anl. 20.06.22 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 107,0510 | 214.102,00 | 0,74 | |
| DE000A1R0410 | 3,125% ThyssenKrupp MTN 25.10.19 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 103,7010 | 311.103,00 | 1,08 | |
| XS1490153886 | 3,250% IHO Verwaltungs GmbH Nts. 15.09.23 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 103,3890 | 310.167,00 | 1,07 | |
| XS1222594472 | 3,500% Bertelsmann Anl. 23.04.75V | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 103,2020 | 206.404,00 | 0,71 | |
| XS1044811591 | 3,625% EnBW Energie Baden-Württemberg Anl. 02.04.76V | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 106,7150 | 213.430,00 | 0,74 | |
| XS1586555606 | 0,500% Volkswagen International Finance Nts. 30.03.21 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 100,6590 | 301.977,00 | 1,05 | |
| XS1716243719 | 0,625% Philip Morris International Nts. 08.11.24 | EUR | 400 | 400 | 0 | % | 96,9900 | 387.960,00 | 1,34 | |
| DE000A185QB3 | 0,750% Evonik Finance MTN 07.09.28 | EUR | 500 | 0 | 0 | % | 92,6820 | 463.410,00 | 1,60 | |
| XS1571293171 | 0,875% Ericsson MTN 01.03.21 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 100,1310 | 300.393,00 | 1,04 | |
| FR0013330115 | 0,875% Thales MTN 19.04.24 | EUR | 500 | 800 | 300 | % | 100,0420 | 500.210,00 | 1,73 | |
| FR0013282571 | 0,875% Vivendi MTN 18.09.24 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 99,1540 | 198.308,00 | 0,69 | |
| XS1730873731 | 0,950% ArcelorMittal MTN 17.01.23 | EUR | 200 | 300 | 100 | % | 98,8360 | 197.672,00 | 0,68 | |

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | % | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--------------|---|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---|----------|-----------------|----------------------|
| FR0013327962 | 1,000% Capgemini Nts. 18.10.24 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 99,6020 | 199.204,00 | 0,69 |
| XS1611167856 | 1,000% Hella Finance Nts. 17.05.24 | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 100,6310 | 100.631,00 | 0,35 |
| XS1709433509 | 1,000% PostNL Nts. 21.11.24 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 99,4210 | 198.842,00 | 0,69 |
| XS1664644710 | 1,125% BAT Capital MTN 16.11.23 | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 100,4210 | 100.421,00 | 0,35 |
| XS1505884723 | 1,125% easyJet MTN 18.10.23 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 100,6860 | 302.058,00 | 1,05 |
| XS1471646965 | 1,125% EDP Finance MTN 12.02.24 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 100,8140 | 302.442,00 | 1,05 |
| XS1578294081 | 1,125% Italgas MTN 14.03.24 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 100,9600 | 403.840,00 | 1,40 |
| XS1485533431 | 1,125% Koninklijke KPN MTN 11.09.28 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 94,9600 | 284.880,00 | 0,99 |
| XS1199964575 | 1,125% Ryanair MTN 10.03.23 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 101,7190 | 305.157,00 | 1,06 |
| XS1622624242 | 1,250% Allergan Funding Nts. 01.06.24 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 98,5730 | 295.719,00 | 1,02 |
| XS1788605936 | 1,250% Securitas MTN 06.03.25 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 99,8770 | 199.754,00 | 0,69 |
| ES0211845302 | 1,375% Abertis Infraestructuras OBL 20.05.26 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 97,9970 | 195.994,00 | 0,68 |
| XS1627193359 | 1,375% Compagnie de Saint-Gobain MTN 14.06.27 | EUR | 300 | 0 | 300 | % | 99,4540 | 298.362,00 | 1,03 |
| XS1505896735 | 1,375% CRH Finance MTN 18.10.28 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 96,6270 | 289.881,00 | 1,00 |
| XS1170307414 | 1,375% Gas Natural Fenosa Finance MTN 21.01.25 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 101,6750 | 203.350,00 | 0,70 |
| XS1405766624 | 1,375% Verizon Communications Nts. 02.11.28 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 96,1210 | 192.242,00 | 0,67 |
| XS1651071877 | 1,400% Thermo Fisher Scientific Nts. 23.01.26 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 100,0840 | 300.252,00 | 1,04 |
| FR0013252277 | 1,500% Arkema MTN 20.04.27 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 101,1240 | 303.372,00 | 1,05 |
| XS1382791975 | 1,500% Deutsche Telekom Internat. Finance MTN 03.04.28 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 99,8190 | 299.457,00 | 1,04 |
| XS1180451657 | 1,500% ENI MTN 02.02.26 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 102,1950 | 204.390,00 | 0,71 |
| XS1629387462 | 1,500% HeidelbergCement Finance Luxembourg MTN 14.06.27 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 98,5520 | 197.104,00 | 0,68 |
| XS1704789590 | 1,500% Iren MTN 24.10.27 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 97,3850 | 292.155,00 | 1,01 |
| FR0013248465 | 1,500% Téléperformance Nts. 03.04.24 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 101,3050 | 202.610,00 | 0,70 |
| XS1652855815 | 1,500% Vodafone Group MTN 24.07.27 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 98,1480 | 196.296,00 | 0,68 |
| XS1627947440 | 1,625% Aeroporti di Roma MTN 08.06.27 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 101,2060 | 404.824,00 | 1,40 |
| XS1322048619 | 1,625% Amadeus Capital Markets MTN 17.11.21 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 104,8330 | 419.332,00 | 1,45 |
| XS1558491855 | 1,625% Atlantia MTN 03.02.25 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 101,4520 | 202.904,00 | 0,70 |
| XS1771723167 | 1,625% McKesson Nts. 30.10.26 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 101,0120 | 202.024,00 | 0,70 |
| FR0012384667 | 1,625% Publicis Groupe Nts. 16.12.24 | EUR | 400 | 0 | 200 | % | 104,1630 | 416.652,00 | 1,44 |
| XS1765875718 | 1,625% Societa Iniziative Autostr. e Servizi MTN 08.02.28 | EUR | 300 | 300 | 0 | % | 98,9350 | 296.805,00 | 1,03 |
| BE6282459609 | 1,625% Solvay Nts. 02.12.22 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 104,8320 | 314.496,00 | 1,09 |
| XS1792505866 | 1,694% General Motors Financial MTN 26.03.25 | EUR | 500 | 500 | 0 | % | 101,5680 | 507.840,00 | 1,76 |

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--------------|--|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|---|----------|-----------------|----------------------|
| XS1789699607 | 1,750% A.P.Møller-Mærsk MTN 16.03.26 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 99,3900 | 198.780,00 | 0,69 |
| XS1292988984 | 1,750% ENI MTN 18.01.24 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 105,5800 | 211.160,00 | 0,73 |
| XS1810653540 | 1,750% Heidelberg Cement Finance Luxembourg MTN 24.04.28 | EUR | 400 | 400 | 0 | % | 99,0610 | 396.244,00 | 1,37 |
| XS1291004270 | 1,750% Iberdrola International MTN 17.09.23 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 105,8830 | 211.766,00 | 0,73 |
| XS1811198701 | 1,750% Sydney Airport Finance MTN 26.04.28 | EUR | 100 | 100 | 0 | % | 100,3930 | 100.393,00 | 0,35 |
| XS1645722262 | 1,875% Atlantia MTN 13.07.27 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 100,3250 | 300.975,00 | 1,04 |
| XS1586555945 | 1,875% Volkswagen International Finance MTN 30.03.27 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 101,8640 | 203.728,00 | 0,71 |
| XS1117298247 | 1,900% Discovery Communications Nts. 19.03.27 | EUR | 500 | 0 | 0 | % | 98,7610 | 493.805,00 | 1,71 |
| FR0010154385 | 1,941% Casino, Guichard-Perrachon Nts. 20.04.2167V | EUR | 50 | 0 | 0 | % | 73,4620 | 36.731,00 | 0,13 |
| XS1375957294 | 1,953% BP Capital Markets MTN 03.03.25 | EUR | 350 | 0 | 0 | % | 106,4630 | 372.620,50 | 1,29 |
| XS1117296381 | 2,000% Mohawk Industries Nts. 14.01.22 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 105,3490 | 210.698,00 | 0,73 |
| XS1577731604 | 2,000% Nokia MTN 15.03.24 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 101,0620 | 202.124,00 | 0,70 |
| FR0013323326 | 2,000% Peugeot MTN 20.03.25 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 100,1690 | 200.338,00 | 0,69 |
| AT0000A20F93 | 2,000% Wienerberger SV 02.05.24 | EUR | 100 | 100 | 0 | % | 102,4050 | 102.405,00 | 0,35 |
| XS1520907814 | 2,125% AbbVie Nts. 17.11.28 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 103,1370 | 412.548,00 | 1,43 |
| XS1239586594 | 2,125% ESB Finance MTN 08.06.27 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 106,9320 | 213.864,00 | 0,74 |
| FR0012173862 | 2,125% Pernod-Ricard Bds. 27.09.24 | EUR | 300 | 0 | 300 | % | 107,5060 | 322.518,00 | 1,12 |
| XS1420338102 | 2,250% Holcim Finance Luxembourg MTN 26.05.28 | EUR | 250 | 0 | 0 | % | 103,6250 | 259.062,50 | 0,90 |
| XS1195201931 | 2,250% Total MTN 26.02.99V | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 103,4470 | 310.341,00 | 1,07 |
| XS1468525057 | 2,375% Cellnex Telecom MTN 16.01.24 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 101,7960 | 407.184,00 | 1,41 |
| XS1698218523 | 2,375% Telecom Italia MTN 12.10.27 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 99,5870 | 398.348,00 | 1,38 |
| ES0211845294 | 2,500% Abertis Infraestructuras OBL 27.02.25 | EUR | 200 | 0 | 200 | % | 107,8460 | 215.692,00 | 0,75 |
| ES0205032008 | 2,500% Ferrovial Emisiones Nts. 15.07.24 | EUR | 300 | 0 | 500 | % | 108,5550 | 325.665,00 | 1,13 |
| XS1067329570 | 2,500% Wolters Kluwer Nts. 13.05.24 | EUR | 300 | 0 | 0 | % | 109,2400 | 327.720,00 | 1,13 |
| XS1087831688 | 2,625% ACEA MTN 15.07.24 | EUR | 300 | 0 | 300 | % | 108,8830 | 326.649,00 | 1,13 |
| XS1785467751 | 2,625% Faurecia Nts. 15.06.25 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 101,7860 | 203.572,00 | 0,70 |
| XS1117298759 | 2,750% Smurfit Kappa Acquisitions Nts. 01.02.25 | EUR | 200 | 0 | 300 | % | 105,2450 | 210.490,00 | 0,73 |
| XS0222524372 | 2,771% Südzucker International Fin. Bds. 30.06.99V | EUR | 50 | 0 | 0 | % | 97,6850 | 48.842,50 | 0,17 |
| XS1041934800 | 2,875% Gas Natural Fenosa Finance MTN 11.03.24 | EUR | 200 | 0 | 300 | % | 110,9820 | 221.964,00 | 0,77 |
| XS0811555183 | 2,875% Heineken MTN 04.08.25 | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 112,9340 | 451.736,00 | 1,56 |
| XS0940293763 | 3,000% CEZ MTN 05.06.28 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 111,2390 | 222.478,00 | 0,77 |
| XS1078218218 | 3,000% Sandvik MTN 18.06.26 | EUR | 300 | 0 | 500 | % | 113,2060 | 339.618,00 | 1,18 |
| XS1205618470 | 3,000% Vattenfall Secs. 19.03.77V | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 100,1440 | 100.144,00 | 0,35 |

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|--|---|-----------------------|--|----------------------|---|------------|----------------------|------------------------------|
| XS1814065345 | 3,250% Gestamp Automoción Nts. 30.04.26 | EUR | 200 | 200 | 0 | % | 98,9140 | 197.828,00 | 0,68 |
| XS1019326641 | 3,250% Snam MTN 22.01.24 | EUR | 500 | 0 | 0 | % | 113,6370 | 568.185,00 | 1,97 |
| XS1040508241 | 3,375% Imperial Brands Finance MTN 26.02.26 | EUR | 300 | 0 | 300 | % | 112,5980 | 337.794,00 | 1,17 |
| XS0975256685 | 3,625% Repsol International Finance MTN 07.10.21 | EUR | 200 | 0 | 300 | % | 111,6390 | 223.278,00 | 0,77 |
| XS0907289978 | 3,961% Telefonica Emisiones MTN 26.03.21 | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 111,1690 | 111.169,00 | 0,38 |
| XS1028600473 | 4,250% Orange MTN 07.02.99 | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 106,7960 | 106.796,00 | 0,37 |
| XS0553728709 | 4,500% Deutsche Telekom International Fin. MTN 28.10.30 | EUR | 200 | 0 | 300 | % | 130,1320 | 260.264,00 | 0,90 |
| XS1028959671 | 4,625% Vonovia Finance Nts. 08.04.74V | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 103,7050 | 414.820,00 | 1,44 |
| XS1048568452 | 4,750% Fiat Chrysler Finance Europe MTN 22.03.21 | EUR | 150 | 0 | 0 | % | 111,7510 | 167.626,50 | 0,58 |
| XS0970695572 | 4,875% EDP Finance MTN 14.09.20 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 111,3100 | 222.620,00 | 0,77 |
| XS0943371194 | 4,875% Orsted Sec. 08.07.10V | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 100,9610 | 201.922,00 | 0,70 |
| XS1014997073 | 5,000% ENEL Bds. 15.01.75V | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 107,4840 | 107.484,00 | 0,37 |
| XS1050460739 | 5,000% Telefónica Europe Secs. 31.03.99V | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 107,7870 | 215.574,00 | 0,75 |
| XS0880764435 | 5,200% Hera MTN 29.01.28 | EUR | 200 | 0 | 300 | % | 131,6160 | 263.232,00 | 0,91 |
| FR0011215508 | 5,244% Casino, Guichard-Perrachon MTN 09.03.20 | EUR | 100 | 0 | 0 | % | 107,9830 | 107.983,00 | 0,37 |
| FR0011052661 | 5,976% Casino, Guichard-Perrachon MTN 26.05.21 | EUR | 200 | 0 | 0 | % | 112,7960 | 225.592,00 | 0,78 |
| XS0954675129 | 6,500% ENEL Bds. 10.01.74V | EUR | 200 | 0 | 700 | % | 104,4650 | 208.930,00 | 0,72 |
| XS0953215349 | 6,750% Fiat Chrysler Finance Europe MTN 14.10.19 | EUR | 300 | 0 | 400 | % | 109,6060 | 328.818,00 | 1,14 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | EUR | 1.306.013,00 | 4,52 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | |
| XS1788515788 | 1,125% Metro MTN 06.03.23 | EUR | 400 | 400 | 0 | % | 99,2930 | 397.172,00 | 1,38 |
| XS1778825262 | 1,050% AT&T Nts. 05.09.23 | EUR | 300 | 300 | 0 | % | 100,9400 | 302.820,00 | 1,05 |
| XS1716833352 | 2,125% Rexel Nts. 15.06.25 | EUR | 100 | 100 | 0 | % | 97,1110 | 97.111,00 | 0,34 |
| XS1808984501 | 3,625% Piaggio & C. Nts. 30.04.25 | EUR | 100 | 100 | 0 | % | 102,3300 | 102.330,00 | 0,35 |
| XS0969340768 | 5,125% América Móvil Secs. 06.09.73V | EUR | 400 | 0 | 0 | % | 101,6450 | 406.580,00 | 1,41 |
| Summe Wertpapiervermögen² | | | | | | | EUR | 28.227.722,50 | 97,74 |

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

| Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.04.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|-------------------------------|---------------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------------|-----------------|----------------------|
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | | |
| Zins-Derivate | | | | | | EUR | -52.740,00 | -0,19 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| Zinsterminkontrakte | | | | | | | | |
| 6,000% Euro Bobl Future 06/18 | EDT | EUR | -2.300.000 | | | | -13.110,00 | -0,05 |
| 6,000% Euro Bund Future 06/18 | EDT | EUR | 400.000 | | | | 6.600,00 | 0,02 |
| 6,000% Long Term Euro OAT Future 06/18 | EDT | EUR | -2.300.000 | | | | -46.230,00 | -0,16 |
| Bankguthaben | | | | | | | | |
| | | | | | | EUR | 368.933,43 | 1,28 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | |
| Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle) | | EUR | 368.933,43 | | | % 100,0000 | 368.933,43 | 1,28 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | |
| | | | | | | EUR | 377.763,08 | 1,31 |
| Einschüsse (Initial Margin) | | EUR | 70.005,13 | | | | 70.005,13 | 0,24 |
| Variation Margin | | EUR | 52.740,00 | | | | 52.740,00 | 0,18 |
| Zinsansprüche | | EUR | 255.017,95 | | | | 255.017,95 | 0,89 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | |
| | | | | | | EUR | -39.875,58 | -0,14 |
| Kostenabgrenzung | | EUR | -39.875,58 | | | | -39.875,58 | -0,14 |
| Fondsvermögen | | | | | | | | |
| | | | | | | EUR | 28.881.803,43 | 100,00 ³ |
| Anteilwert HMT Corporates RiskControl | | | | | | EUR | 49,10 | |
| Umlaufende Anteile HMT Corporates RiskControl | | | | | | STK | 588.252 | |
| ² Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert. | | | | | | | | |
| ³ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein. | | | | | | | | |
| Marktschlüssel | | | | | | | | |
| b) Terminbörse | | | | | | | | |
| EDT | EUREX Terminbörse Deutschland | | | | | | | |

Während des Berichtszeitraumes 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 |
|---|---|---|-------------------|----------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| XS1619283218 | 0,250% Bertelsmann MTN 26.05.21 | EUR | 0 | 500 |
| XS1616407869 | 0,000% Amadeus Capital Markets MTN 19.05.19 | EUR | 0 | 300 |
| DE000A19HBM3 | 0,000% Daimler International Finance MTN 11.05.22V | EUR | 0 | 500 |
| XS1057486471 | 0,271% Volkswagen International Finance MTN 15.04.19V | EUR | 0 | 400 |
| XS1363560548 | 0,321% BMW Finance MTN 15.07.19V | EUR | 0 | 400 |
| XS1567173809 | 0,625% McKesson Nts. 27.08.21 | EUR | 0 | 300 |
| FR0013257623 | 0,750% LVMH MTN 26.05.24 | EUR | 0 | 300 |
| FR0013241536 | 0,750% Orange MTN 11.09.23 | EUR | 0 | 400 |
| BE6276039425 | 0,800% Anheuser-Busch InBev MTN 20.04.23 | EUR | 0 | 400 |
| XS1554373164 | 0,875% Fresenius Finance Ireland MTN 31.01.22 | EUR | 0 | 600 |
| XS1629865897 | 1,050% AT&T Nts. 04.09.23 | EUR | 0 | 300 |
| XS1082970853 | 1,375% Tesco MTN 01.07.19 | EUR | 0 | 300 |
| XS1139315581 | 1,375% Total Capital International MTN 19.03.25 | EUR | 0 | 300 |
| FR0012861821 | 1,500% Aéroports de Paris OBL 24.07.23 | EUR | 0 | 200 |
| BE6276040431 | 1,500% Anheuser-Busch InBev MTN 18.04.30 | EUR | 0 | 300 |
| FR0013044278 | 1,500% APRR Nts. 15.01.24 | EUR | 0 | 100 |
| FR0012663169 | 1,590% Veolia Environnement MTN 10.01.28 | EUR | 0 | 400 |
| XS1412711217 | 1,625% ENI MTN 17.05.28 | EUR | 0 | 300 |
| XS1346872580 | 1,625% Mondelez International Nts. 20.01.23 | EUR | 0 | 400 |
| XS1316569638 | 1,875% Autostrade per L'Italia MTN 04.11.25 | EUR | 0 | 150 |
| XS1116408235 | 1,875% Iberdrola International MTN 08.10.24 | EUR | 0 | 500 |
| XS1077584024 | 1,875% Ryanair MTN 17.06.21 | EUR | 0 | 400 |
| FR0013323326 | 2,000% Peugeot MTN 20.03.25 | EUR | 200 | 200 |
| XS1040506112 | 2,177% BP Capital Markets MTN 28.09.21 | EUR | 0 | 300 |
| XS1080163964 | 2,500% Sodexo Nts. 24.06.26 | EUR | 0 | 200 |
| FR0011769090 | 3,125% Renault MTN 05.03.21 | EUR | 0 | 400 |
| XS1409506885 | 3,500% Rexel Nts. 15.06.23 | EUR | 0 | 300 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| XS1611042646 | 0,800% Kellogg Nts. 17.11.22 | EUR | 0 | 500 |

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

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--|-----------------------|---|-------------------------|
| Terminkontrakte | | | | |
| Zinsterminkontrakte | | | | |
| Gekaufte Kontrakte: | | | | |
| (Basiswerte: Euro Bund Future) | EUR | | | 5.125 |
| Verkaufte Kontrakte: | | | | |
| (Basiswerte: Euro Bobl Future, Euro Bund Future, Euro-BTP Future, Long Term Euro OAT Future) | EUR | | | 14.689 |
| Sondervermögen HMT Corporates RiskControl | | | | |
| Mindestanlagesumme | | | | keine |
| Fondsauflage | | | | 03.08.2012 |
| Ausgabeaufschlag | | | bis zu 2,00%; derzeit 2,00% | |
| Rücknahmeabschlag | | | | 0,00% |
| Verwaltungsvergütung p.a. | | | derzeit 0,20%; mindestens 20.000,00 EUR | |
| Stückelung | | | | Globalurkunde |
| Ertragsverwendung | | | | ausschüttend |
| Währung | | | | EUR |
| ISIN | | | | DE000A1JLSJ7 |

Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV

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

| | | |
|--|------------|----------------|
| Anteilwert HMT Corporates RiskControl | EUR | 49,10 |
| Umlaufende Anteile HMT Corporates RiskControl | STK | 588.252 |

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 Corporates RiskControl zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

97,74% 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.
