



HALBJAHRESBERICHT

HMT GLOBAL MULTI STRATEGIE

OGAW-SONDERVERMÖGEN
NACH DEUTSCHEM RECHT



ZUM 30. APRIL 2018

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Investmentanteile			
– Aktienfonds	EUR	2.502.806,62	19,71
– Geldmarktfonds	EUR	452.645,70	3,57
– Gemischte Fonds	EUR	6.724.539,34	52,96
– Rentenfonds	EUR	2.465.113,74	19,41
2. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	588.545,19	4,64
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-36.583,38	-0,29
III. Fondsvermögen		EUR	12.697.067,21
			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	
Investmentanteile						EUR	12.145.105,40	95,65	
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile									
IE00B643RZ01	Lyxor Epsilon Global Trend Fund Reg. Shs I EUR	ANT	3.495	975	1.040	EUR	127,2207	444.636,35	3,50
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile									
LU1597244760	AGIF - Allianz Volatility Strategy Fund P EUR	ANT	999	1.152	153	EUR	980,2400	979.655,29	7,72
LU0271667684	Amundi Funds II - Absolute Return Currencies	ANT	390	0	210	EUR	1.160,6300	452.645,70	3,56
LU0363630020	Amundi Funds II - Multi-Strategy Growth	ANT	667	212	256	EUR	1.506,9200	1.005.115,64	7,92
LU0494762056	Bellevue Funds [Lux] SICAV - BB Global Macro	ANT	4.141	0	1.450	EUR	170,9500	707.903,95	5,58
LU0438336421	BlackRock Strategic Fd SICAV - Fixed Income Str Fd	ANT	3.288	515	1.070	EUR	126,0100	414.320,88	3,26
LU0627763740	BlueBay Investment Grade Abs. Return Bond Fund I	ANT	5.175	5.175	0	EUR	120,2900	622.500,75	4,90
FR0010813105	Candriam Diversified Futures I EUR	ANT	53	0	14	EUR	9.601,1300	508.859,89	4,01
LU0228348941	GREIFF special situations Fund	ANT	11.089	2.620	3.730	EUR	83,5200	926.153,28	7,29
LU0912261970	Helium Fund - Helium Performance A EUR	ANT	541	0	255	EUR	1.202,5060	650.555,75	5,12
FR0010881821	JL Equity Market Neutra Fund	ANT	760	0	196	EUR	1.254,5800	953.480,80	7,51
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia IS Eur	ANT	501	94	337	EUR	1.156,8900	579.601,89	4,56
GB00B5LHW198	M&G Investment Funds [5] - Episode Macro Fund	ANT	74.194	16.000	18.480	EUR	13,2772	985.088,58	7,76
IE00BLP5S791	Old Mutual Global Equity Absolute Return Fund I €	ANT	367.350	0	0	EUR	1,6964	623.172,54	4,91
FR0010473991	Sycomore L/S Opportunities FCP	ANT	2.225	555	0	EUR	387,9200	863.122,00	6,80
GB00B3D8PZ13	Threadneedle Investment Fds. - Credit Opport. IGA	ANT	703.466	0	0	EUR	1,3526	951.508,11	7,49
LU0946790952	XAIA Credit Debit Capital IT EUR	ANT	440	0	120	EUR	1.083,6000	476.784,00	3,76
Summe Wertpapiervermögen						EUR	12.145.105,40	95,65	

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben				EUR	588.545,19	4,64
EUR-Guthaben bei:						
Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)	EUR	588.545,19	%	100,0000	588.545,19	4,64
Sonstige Verbindlichkeiten				EUR	-36.583,38	-0,29
Kostenabgrenzung	EUR	-36.583,38			-36.583,38	-0,29
Fondsvermögen				EUR	12.697.067,21	100,00 ²
Anteilwert				EUR	98,43	
Umlaufende Anteile				ANT	129.000	

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

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
Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
LU0417273223	Allianz Volatility Strategy	ANT	0	956
FR0010098335	Exane Vauban Fund I Cap.	ANT	0	44
LU0462885301	XAIA Credit - Basis II - I	ANT	0	63
LU0707820220	YCAP Credit Fundament. - Corporate Opportun. Fd. B	ANT	0	734

Sondervermögen HMT Global Multi Strategie

Mindestanlagesumme	keine
Fondsauflage	13.01.2017
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,0%; derzeit 2,0%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	derzeit 0,20%; mindestens 15.000,00 EUR
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend
Währung	EUR
ISIN	DE000A2AJJRO

Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV

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

Anteilwert	EUR	98,43
Umlaufende Anteile	ANT	129.000

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:

95,65% 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.
