

# **HALBJAHRESBERICHT HMT GLOBAL MULTI STRATEGIE**

---

**OGAW-Sondervermögen nach deutschem Recht  
zum 30.04.2019**

# VERMÖGENSÜBERSICHT

## Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
1. Investmentanteile			
– Aktienfonds	EUR	3.235.596,13	26,07
– Geldmarktfonds	EUR	784.236,05	6,32
– Gemischte Fonds	EUR	3.854.502,83	31,06
– Rentenfonds	EUR	2.979.074,77	24,01
2. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	1.597.061,33	12,87
<b>II. Verbindlichkeiten</b>			
1. Sonstige Verbindlichkeiten			
	EUR	-40.693,11	-0,33
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>12.409.778,00</b>
			<b>100,00<sup>1</sup></b>

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

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.04.2019

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Investmentanteile</b>						<b>EUR</b>	<b>10.853.409,78</b>	<b>87,46</b>
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								
LU0108940346	Aberdeen Standard Liquidity [Lux] - Euro Fund	ANT	650	1.650	1.000	EUR 1.206,5170	784.236,05	6,32
LU0363630020	Amundi Funds II - Multi-Strategy Growth	ANT	667	0	0	EUR 1.448,9100	966.422,97	7,79
LU0494762056	Bellevue Funds [Lux] SICAV - BB Global Macro	ANT	2.441	0	1.700	EUR 178,6800	436.157,88	3,51
LU0438336421	BlackRock Strategic Fd SICAV - Fixed Income Str Fd	ANT	3.288	0	0	EUR 124,1600	408.238,08	3,29
LU0852336535	BlackRock Strategic Fund SICAV-Em Mark Ab Return F	ANT	3.280	3.280	0	EUR 112,9500	370.476,00	2,99
LU0627763740	BlueBay Investment Grade Abs. Return Bond Fund I	ANT	5.175	0	0	EUR 114,5900	593.003,25	4,78
IE00B5BBQJ73	GAM STAR Fund PLC - GAM Star Alpha Technology	ANT	52.000	52.000	0	EUR 14,5224	755.164,80	6,09
LU0228348941	GREIFF special situations Fund	ANT	11.089	0	0	EUR 79,6400	883.127,96	7,12
FR0011006188	H2O Allegro I 4 Dec.	ANT	3	0	2	EUR 182.511,0300	547.533,09	4,41
LU0912261970	Helium Fund - Helium Performance A EUR	ANT	541	0	0	EUR 1.211,7940	655.580,55	5,28
FR0010881821	JL Equity Market Neutra Fund	ANT	760	0	0	EUR 1.293,3000	982.908,00	7,92
LU1162198839	LFIS Vision UCITS - Premia IS Eur	ANT	501	0	0	EUR 1.173,6300	587.988,63	4,74
IE00BLP5S791	Merian Global Inv. Glbl Equity Absolute Return Fd	ANT	367.350	0	0	EUR 1,4939	548.784,17	4,42
LU0994415189	Merrill Lynch Invest. Solutions Enh. Volat. Prem.	ANT	3.750	3.750	0	EUR 120,0800	450.300,00	3,63
LU1829331989	Threadneedle LUX- Credit Opportu. Fund 8E EUR Acc.	ANT	94.684	0	213	EUR 10,0300	949.683,95	7,65
DE000A111ZE4	Warburg-Defensiv-Fonds I	ANT	3.800	3.800	0	EUR 119,2600	453.188,00	3,65
LU0946790952	XAIA Credit Debit Capital IT EUR	ANT	440	0	0	EUR 1.092,3100	480.616,40	3,87
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>10.853.409,78</b>	<b>87,46</b>

## Vermögensaufstellung zum 30.04.2019

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bankguthaben</b>					EUR	1.597.061,33	12,87
EUR-Guthaben bei:							
Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)	EUR	1.597.061,33			% 100,0000	1.597.061,33	12,87
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>					EUR	-40.693,11	-0,33
Kostenabgrenzung	EUR	-40.693,11				-40.693,11	-0,33
<b>Fondsvermögen</b>					EUR	12.409.778,00	100,00 <sup>2</sup>
<b>Anteilwert</b>					EUR	96,20	
<b>Umlaufende Anteile</b>					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
<b>Investmentanteile</b>				
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
LU1670714499	M&G (Lux) Episode Macro Fund TH EUR Acc	ANT	0	74.194
FR0010473991	Sycomore L/S Opportunities FCP	ANT	0	2.225

## Sondervermögen HMT Global Multi Strategie

Mindestanlagesumme	keine
Fondsaufgabe	13.01.2017
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,00%; derzeit 2,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	bis zu 0,25%, mind. 15.000,00 EUR; derzeit 0,20%, mind. 15.000,00 EUR
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend
Währung	EUR
ISIN	DE000A2AJJR0

## ANHANG GEM. §7 NR. 9 KARBV

---

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

Anteilwert	EUR	96,20
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:

87,46% 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.

---