

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



HMT Global Wertsicherung 90

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. APRIL 2024

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



HanseMerkurTrust

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Vermögensübersicht zum 30.04.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	21.310.159,21	100,20
1. Anleihen	18.386.504,00	86,46
< 1 Jahr	6.901.090,00	32,45
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	3.809.340,00	17,91
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	620.494,00	2,92
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	7.055.580,00	33,18
2. Derivate	100.432,56	0,47
3. Bankguthaben	2.792.441,58	13,13
4. Sonstige Vermögensgegenstände	30.781,07	0,14
II. Verbindlichkeiten	-43.141,10	-0,20
III. Fondsvermögen	21.267.018,11	100,00

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	18.386.504,00	86,46
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	11.485.414,00	54,01
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	11.485.414,00	54,01
1,2500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86	BE0000346552		EUR	800	0	0 %	86,625	693.000,00	3,26
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030)	DE0001030708		EUR	2.000	0	0 %	85,602	1.712.040,00	8,05
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) Grüne	DE0001030732		EUR	2.000	0	0 %	83,544	1.670.880,00	7,86
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) Grüne	DE000BU3Z005		EUR	1.000	1.000	0 %	98,129	981.290,00	4,61
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.2020(25)	DE0001030716		EUR	2.000	0	0 %	95,698	1.913.960,00	9,00
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2020(25)	EU000A284451		EUR	1.000	0	0 %	95,211	952.110,00	4,48
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(26)	EU000A3KNYF7		EUR	1.000	0	0 %	94,327	943.270,00	4,44
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(28)	EU000A287074		EUR	700	0	0 %	88,642	620.494,00	2,92
0,0100 % Hessen, Land Schatzanw. S.2103 v.2021(2031)	DE000A1RQD43		EUR	300	0	0 %	81,242	243.726,00	1,15
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	IE00BFZRQ242		EUR	800	0	0 %	91,053	728.424,00	3,43
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	IT0005542359		EUR	1.000	0	0 %	102,622	1.026.220,00	4,83
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	6.901.090,00	32,45
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	6.901.090,00	32,45
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/06 f.15.05.24	DE000BU0E055		EUR	1.000	0	0 %	99,874	998.740,00	4,70
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/07 f.19.06.24	DE000BU0E063		EUR	1.000	0	0 %	99,515	995.150,00	4,68
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/09 f.21.08.24	DE000BU0E089		EUR	1.000	1.000	0 %	98,893	988.930,00	4,65
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/10 f.18.09.24	DE000BU0E097		EUR	1.000	1.000	0 %	98,636	986.360,00	4,64
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/12 f.20.11.24	DE000BU0E113		EUR	1.000	1.000	0 %	98,060	980.600,00	4,61
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.24/02 f.11.12.24	DE000BU0E121		EUR	1.000	1.000	0 %	97,878	978.780,00	4,60
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.24/02 f.19.02.25	DE000BU0E147		EUR	1.000	1.000	0 %	97,253	972.530,00	4,57
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	18.386.504,00	86,46

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	100.432,56	0,47
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	32.055,63	0,15
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	32.055,63	0,15
FUTURE DAX (PERFORMANCE-INDEX) 21.06.24 EUREX		185	EUR	Anzahl 2				-1.150,00	-0,01
FUTURE FTSE/MIB INDEX 21.06.24 IDEM		609	EUR	Anzahl 4				12.340,00	0,06
FUTURE FTSE 100 INDEX 21.06.24 ICE		961	GBP	Anzahl 6				33.704,31	0,16
FUTURE TOKYO STK.PR.(TOPIX) IND. 13.06.24 OSE		969	JPY	Anzahl 5				29.603,57	0,14
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 21.06.24 CME		352	USD	Anzahl 6				-42.442,25	-0,20
Zins-Derivate							EUR	68.376,93	0,32
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	68.376,93	0,32
FUTURE 10 Y CANADA BONDS (SYNTH.) 19.06.24 MSE		661	CAD	500.000				-8.715,78	-0,04
FUTURE EURO-BOBL 06.06.24 EUREX		185	EUR	-900.000				12.420,00	0,06
FUTURE EURO-BUND 06.06.24 EUREX		185	EUR	-4.300.000				86.430,00	0,41
FUTURE EURO-SCHATZ 06.06.24 EUREX		185	EUR	-2.700.000				17.550,00	0,08
FUTURE LONG TERM EURO OAT 06.06.24 EUREX		185	EUR	400.000				-6.880,00	-0,03
FUTURE LONG GILT (SYNTH.) 26.06.24 ICE		961	GBP	400.000				-8.575,45	-0,04
FUTURE ULTRA 10Y TREAS.NT 18.06.24 CBOT		362	USD	800.000				-23.851,84	-0,11

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.792.441,58	13,13
Bankguthaben							EUR	2.792.441,58	13,13
EUR - Guthaben bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	1.323.340,12			% 100,000	1.323.340,12	6,22
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			CAD	362.860,13			% 100,000	247.078,94	1,16
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			GBP	162.916,18			% 100,000	190.857,76	0,90
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			JPY	65.805.724,00			% 100,000	391.181,72	1,84
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	684.205,87			% 100,000	639.983,04	3,01
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	30.781,07	0,14
Zinsansprüche			EUR	30.781,07				30.781,07	0,14
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-43.141,10	-0,20
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-24,88				-24,88	0,00
Verwaltungsvergütung			EUR	-30.166,52				-30.166,52	-0,14
Verwahrstellenvergütung			EUR	-3.149,70				-3.149,70	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-9.000,00				-9.000,00	-0,04
Veröffentlichungskosten			EUR	-800,00				-800,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	21.267.018,11	100,00 1)
HMT Global Wertsicherung 90 I									
Anteilwert							EUR	106,38	
Ausgabepreis							EUR	106,38	
Rücknahmepreis							EUR	106,38	
Anzahl Anteile							STK	190.000	

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
HMT Global Wertsicherung 90 R									
Anteilwert							EUR	105,57	
Ausgabepreis							EUR	105,57	
Rücknahmepreis							EUR	105,57	
Anzahl Anteile							STK	10.000	

Fußnoten:

- 1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.
- 2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.04.2024	
CAD	(CAD)	1,4686000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8536000	= 1 EUR (EUR)
JPY	(JPY)	168,2229000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0691000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex
362	Chicago Board of Trade
609	Mailand - IDEM
661	Montreal Exch.-Fut./Opt.
961	London - ICE Fut. Europe
969	Osaka Exchange F.+O.

**Halbjahresbericht
HMT Global Wertsicherung 90**

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Nichtnotierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.22/11 f.22.11.23	DE0001030906	EUR	0	1.000	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/01 f.17.01.24	DE000BU0E014	EUR	0	1.000	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/02 f.13.12.23	DE000BU0E006	EUR	0	1.000	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/03 f.21.02.24	DE000BU0E022	EUR	0	1.000	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/04 f.20.03.24	DE000BU0E030	EUR	0	1.000	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/05 f.17.04.24	DE000BU0E048	EUR	0	1.000	

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Derivate

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

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CAC 40, DAX PERFORMANCE-INDEX, FTSE 100, FTSE MIB, S+P 500, S+P/TSX 60 PR CAD, TOPIX PR JPY)

EUR

8.875,13

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.CANADA GOV.BD.SYN.AN., 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, BRITISCH LO.GILT SYN.AN., ULTRA 10Y.US TR.NT.SYN.AN)

EUR

2.245,73

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-SCHATZ)

EUR

10.120,85

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

**Halbjahresbericht
HMT Global Wertsicherung 90**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)	Verwaltungsvergütung derzeit (Angabe in % p.a.) *)	Ertragsverwendung	Währung
HMT Global Wertsicherung 90 I	100.000	0,00	0,550	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR
HMT Global Wertsicherung 90 R	keine	0,00	0,950	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

*) Die maximale Gebühr kann dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	86,46
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,47

Sonstige Angaben

HMT Global Wertsicherung 90 I

Anteilwert	EUR	106,38
Ausgabepreis	EUR	106,38
Rücknahmepreis	EUR	106,38
Anzahl Anteile	STK	190.000

HMT Global Wertsicherung 90 R

Anteilwert	EUR	105,57
Ausgabepreis	EUR	105,57
Rücknahmepreis	EUR	105,57
Anzahl Anteile	STK	10.000

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

**Halbjahresbericht
HMT Global Wertsicherung 90**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 2. Mai 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse I	1. Juni 2022
Anteilklasse R	1. Juni 2022

Erstausgabepreise

Anteilklasse I	EUR 100
Anteilklasse R	EUR 100

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse I	derzeit keiner
Anteilklasse R	derzeit keiner

Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	EUR 100.000
Anteilklasse R	keine

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,55 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,95 % p.a.

Verwahrstellenvergütung*

Anteilklasse I	derzeit 0,05 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,05 % p.a.

Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse R	Euro

Ertragsverwendung

Anteilklasse I	Ausschüttung
Anteilklasse R	Ausschüttung

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	A3DD99 / DE000A3DD994
Anteilklasse R	A3DEAA / DE000A3DEAA8

*Unterliegt einer Staffelung

Halbjahresbericht HMT Global Wertsicherung 90

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968
Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,-
Eigenmittel: EUR 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan
Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt, Glauburg
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlwagen, Wehrheim

2. Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG

Hausanschrift:

Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 10 10 40
60010 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 21 61-0
Telefax: 069 / 21 61-1340
www.hal-privatbank.com

Rechtsform: Aktiengesellschaft
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 599 (Stand: 31.12.2022)

3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

HanseMercur Trust AG

Postanschrift:

Neue Rabenstraße 3
20354 Hamburg

Telefon +49 40 49 29 39-0
Telefax +49 40 49 29 39-199
www.hmt-ag.de