

Man Umbrella SICAV

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital
(„Société d’Investissement à Capital Variable“)
Investmentfonds nach luxemburgischem
Recht

Luxemburg
R.C.S. Nr. B 53.150

Halbjahresbericht und
ungeprüfter Abschluss
zum 30. Juni 2023

Auf der Grundlage der Jahres- und Halbjahresberichte dürfen keine Zeichnungen entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigefügt sind.

	Seite
Management und Verwaltung	4
Informationen für Anteilinhaber	5
Nettovermögensaufstellung	6
Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile	7
Statistik	8
Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens	10
Man Convertibles Global	12
Wertpapierbestand	12
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	18
Man AHL Trend Alternative	19
Wertpapierbestand	19
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	20
Man AHL Alpha Core Alternative	21
Wertpapierbestand	21
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	22
Erläuterungen zum Abschluss	23
Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)	56
Ergänzende Informationen	59

Management und Verwaltung

Vorsitzender des Verwaltungsrats:

Yves Wagner
Direktion
19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsratsmitglieder:

Thomas Nummer
Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied
Großherzogtum Luxemburg

John Morton
CEO, Man Asset Management (Ireland) Limited
2 Dublin Landings, North Wall Quay
Dublin 1
Irland

Verwaltungsgesellschaft:

Waystone Management Company (Lux) S.A.
19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Vorsitzender der Verwaltungsgesellschaft:

Géry Daeninck
Independent Management Director
(bis 26. Mai 2023)

Timothy Madigan
Independent Management Director
(seit 5. Juli 2023)

Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft:

John Li How Cheong
Independent Management Director
(bis 26. Mai 2023)

Martin Vogel
Global Head of Strategy
Waystone Management Company (Lux) S.A.

Rachel Wheeler
Chief Executive Officer,
Luxembourg Management Company Solutions

Denis Harty
Chief Executive Officer,
Luxembourg Management Company Solutions
(seit 28. April 2023)

Sitz des Fonds:

19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptverwaltungsstelle:

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung
Luxemburg
31, Zone d'activités Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter:

Anlageverwalter des Man AHL Trend Alternative
und des Man AHL Alpha Core Alternative:

AHL Partners LLP
Riverbank House
2 Swan Lane
London EC4R 3AD
Vereinigtes Königreich

Anlageverwalter des Man Convertibles
Global:

GLG Partners LP
Riverbank House
2 Swan Lane
London EC4R 3AD
Vereinigtes Königreich

Register- und Transferstelle:

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung
Luxemburg
31, Zone d'activités Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Depotbank:

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung
Luxemburg
31, Zone d'activités Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Abschlussprüfer:

Deloitte Audit S.à r.l.
20, Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Ernst & Young (bis zum Ende des
Geschäftsjahrs am 31. Dezember 2022)

Société Anonyme
35E, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Luxemburg:

Arendt & Medernach
Société Anonyme
41A, avenue John F. Kennedy
L-2082 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Informationen für Anteilhaber

Die jährliche Gesellschafterversammlung findet am zweiten Freitag des Monats Mai um 11:00 Uhr am Sitz von Man Umbrella SICAV (der „Fonds“) in Luxemburg oder an einem anderen, im Einberufungsschreiben angegebenen Ort statt.

Die Einberufung zu Gesellschafterversammlungen, jegliche Satzungsänderung, Mitteilungen über die Auflösung und Liquidierung des Fonds oder eines Teilfonds sowie alle sonstigen wesentlichen Informationen an die Anteilhaber werden, soweit gesetzlich erforderlich, im Mémorial sowie in einer Luxemburger Tageszeitung veröffentlicht. Der Verwaltungsrat kann darüber hinaus nach eigenem Ermessen Veröffentlichungen in anderen Zeitungen in Luxemburg und in anderen Ländern, in welchen Anteile vertrieben werden, veranlassen.

Nach jeder Satzungsänderung wird eine koordinierte Fassung der Satzung beim Handels- und Gesellschaftsregister Luxemburg (RCS) hinterlegt und ein Hinweis auf diese Hinterlegung und Satzungsänderung im Mémorial veröffentlicht.

Der Fonds veröffentlicht einen Jahresbericht über seine Aktivitäten und die Verwaltung seiner Vermögenswerte. Dieser Bericht enthält die Aufstellung des Nettovermögens, die Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens, die Aufstellungen der Anlagen und den Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers. Der erste Jahresbericht wurde zum 31. Dezember 1996 veröffentlicht. Des Weiteren veröffentlicht der Fonds Halbjahresberichte, welche insbesondere Auskunft über die dem Portfolio zugrunde liegenden Investitionen und die Anzahl der seit der letzten Veröffentlichung ausgegebenen und zurückgenommenen Anteile geben. Der erste Halbjahresbericht wurde zum 30. Juni 1996 veröffentlicht.

Das Rechnungsjahr des Fonds endet am 31. Dezember jedes Jahres.

Der Verkaufsprospekt, die Dokumente mit den wesentlichen Informationen für die Anleger, die Satzung sowie die Jahres- und die Halbjahresberichte sind bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle kostenlos in Papierform erhältlich. Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie eventuelle Mitteilungen an die Anteilhaber sind außerdem beim eingetragenen Sitz des Fonds erhältlich.

Nettovermögensaufstellung
zum 30. Juni 2023

	Erläuterungen	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
AKTIVA				
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	(10)	157.925.380,74	622.846.627,94	65.070.187,30
Optionskontrakte zum Marktwert (Long-Positionen)	(15)	16.893,27	0,00	0,00
Gezahlter Einschuss	(17)	150.398,72	119.474.689,38	11.802.884,58
Bankguthaben		1.424.649,46	47.188.216,99	3.596.325,26
Brokerguthaben	(17)	3.761.359,43	43.780.579,01	7.899.303,68
Termineinlagen		0,00	306.423.504,80	45.014.200,10
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		126.254,08	0,00	0,00
Forderungen aus Zeichnungen		0,00	3.142.007,17	119.321,94
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		465.662,62	0,00	0,00
Rückerstattung der Quellensteuer		175.869,51	0,00	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten	(12)	2.171.816,01	168.309.482,68	8.997.280,44
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	(13)	0,00	15.785.621,52	1.704.447,55
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten	(14)	162.623,25	12.212,60	431,60
Sonstige Aktiva		36.162,50	0,00	24.339,47
SUMME AKTIVA		166.417.069,59	1.326.962.942,09	144.228.721,92
PASSIVA				
Überziehung		25.040,45	0,00	0,57
Erhaltener Einschuss	(17)	0,00	206.384,16	8.526,87
An Broker zahlbar	(17)	755.039,47	962.369,21	0,01
Zahlbare Beträge aus Rücknahmen		583.739,81	4.617.476,70	154.435,29
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten	(12)	320.833,21	152.921.058,45	7.514.488,20
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(13)	39.812,10	5.525.915,01	600.300,61
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten	(14)	64.940,70	1.333.200,10	145.086,80
Zahlbare Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren	(6)	162.329,29	16.802.476,31	548.818,11
Ausstehende Gebühren und Aufwendungen	(7)	148.473,61	455.109,69	102.052,19
Sonstige Passiva		29.699,88	57.596,76	14.759,78
SUMME PASSIVA		2.129.908,52	182.881.586,39	9.088.468,43
SUMME NETTOVERMÖGEN		164.287.161,07	1.144.081.355,70	135.140.253,49

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

	Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums
Man Convertibles Europe⁽¹⁾				
Man Convertibles Europe D EUR Acc	64.303,90	–	(64.303,90)	–
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	7.260,78	–	(7.260,78)	–
Man Convertibles Europe I EUR Acc	10.258,22	–	(10.258,22)	–
Man Convertibles Global				
Man Convertibles Global D EUR Acc	284.843,56	67.762,22	(16.086,22)	336.519,56
Man Convertibles Global D H CHF Acc	123.484,95	7.824,83	(10.777,73)	120.532,05
Man Convertibles Global D H USD Acc	91.985,70	–	(8.474,00)	83.511,70
Man Convertibles Global DR EUR Acc	29.855,29	700,00	(790,00)	29.765,29
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	35.764,90	–	(8.971,00)	26.793,90
Man Convertibles Global DR H USD Acc	4.869,07	–	(2.100,00)	2.769,07
Man Convertibles Global I EUR Acc	738.111,89	18.640,25	(532.133,53)	224.618,61
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	56.195,00	–	(54.405,00)	1.790,00
Man Convertibles Global I H CHF Acc	421.740,21	16.152,00	(136.076,14)	301.816,07
Man Convertibles Global I H USD Acc	21.195,03	1.168,97	–	22.364,00
Man AHL Trend Alternative				
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	5.401,88	3.123,09	(1.720,80)	6.804,17
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	26.800,71	1.799,74	(12.268,71)	16.331,74
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	399.102,10	17.614,00	(40.195,22)	376.520,88
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	100.957,19	2.792,42	(3.633,09)	100.116,52
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	625.724,09	39.259,87	(48.089,02)	616.894,94
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	22.043,68	39.341,13	(3.966,30)	57.418,51
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	5.210,17	–	–	5.210,17
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	38.977,89	3.035,25	(12.952,30)	29.060,84
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	761.508,82	11.004,42	(27.051,92)	745.461,32
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	1.812.152,78	65.216,65	(95.676,16)	1.781.693,27
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	85.416,53	2.538,08	(10.708,95)	77.245,66
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	930.630,40	141.908,98	(234.068,85)	838.470,53
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	422.516,74	23.175,21	(22.626,86)	423.065,09
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	1.791.209,08	575.660,07	(468.448,82)	1.898.420,33
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	133.186,82	21.381,51	(76.085,68)	78.482,65
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	261.044,90	751.633,03	(263.535,90)	749.142,03
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	10.000,00	–	–	10.000,00
Man AHL Alpha Core Alternative				
Man AHL Alpha Core Alternative DN H EUR Acc ⁽²⁾	–	1.000,00	–	1.000,00
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	2.547,42	–	(347,83)	2.199,59
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	111.126,89	14.866,84	(12.522,84)	113.470,89
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc	32.476,64	54,76	(22.899,97)	9.631,43
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	162.726,57	2.666,22	(39.783,79)	125.609,00
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc	1.329,85	–	(1,00)	1.328,85
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	730.865,99	4.491,86	(1.520,56)	733.837,29
Man AHL Alpha Core Alternative IN H SEK Acc	348.665,89	106.722,01	(33.503,25)	421.884,65
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	221.567,12	5.159,24	(1.276,82)	225.449,54

⁽¹⁾ Am 3. März 2023 aufgrund einer Verschmelzung geschlossen (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 27. März 2023 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Statistik
zum 30. Juni 2023

	Währung	Summe Netto- inventarwert zum 30. Juni 2023	Summe Netto- inventarwert zum 31. Dezember 2022	Summe Netto- inventarwert zum 31. Dezember 2021
Man Convertibles Europe ⁽¹⁾	EUR	12.053.088,18*	12.070.500,37	17.371.570,66
Man Convertibles Global	EUR	164.287.161,07	247.212.936,58	335.107.688,12
Man AHL Trend Alternative	USD	1.144.081.355,70	1.107.627.373,73	811.972.477,79
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	135.140.253,49	142.443.578,90	188.257.298,77
	Währung	NIW je Anteil zum 30. Juni 2023	NIW je Anteil zum 31. Dezember 2022	NIW je Anteil zum 31. Dezember 2021
Man Convertibles Europe⁽¹⁾				
Man Convertibles Europe D EUR Acc	EUR	160,29*	156,30	180,76
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	CHF	106,49*	116,22	134,92
Man Convertibles Europe I EUR Acc	EUR	116,65*	113,60	130,35
Man Convertibles Global				
Man Convertibles Global D EUR Acc	EUR	153,16	148,38	181,77
Man Convertibles Global D H CHF Acc	CHF	123,49	120,71	148,57
Man Convertibles Global D H USD Acc	USD	128,32	122,90	146,88
Man Convertibles Global DR EUR Acc	EUR	105,99	102,30	124,39
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	CHF	100,63	97,97	119,63
Man Convertibles Global DR H USD Acc	USD	122,53	116,87	138,63
Man Convertibles Global I EUR Acc	EUR	139,26	134,38	163,33
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	EUR	127,40	123,42	151,04
Man Convertibles Global I H CHF Acc	CHF	152,65	148,61	181,33
Man Convertibles Global I H USD Acc	USD	133,42	127,24	150,93
Man AHL Trend Alternative				
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	CHF	113,10	112,75	100,99
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	EUR	137,44	135,78	120,85
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	USD	165,22	161,97	143,83
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	CHF	135,40	134,77	120,25
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	EUR	149,98	148,36	132,98
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	GBP	161,08	158,42	140,74
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	SEK	129,27	127,61	113,05
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	SGD	159,82	157,05	138,67
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	EUR	126,40	124,52	110,64
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc ⁽²⁾	GBP	115,43	112,82	99,74
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	EUR	133,17	131,18	116,44
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	USD	182,17	177,84	156,78
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	CHF	128,17	126,99	113,00
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	EUR	161,27	159,02	141,48
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	GBP	139,29	136,38	119,47
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	SEK	143,44	141,17	125,01
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc ⁽³⁾	SGD	107,64	105,46	92,84

* Gesamtnettoinventarwert und NIW je Anteil zum Datum der Verschmelzung/Schließung.

⁽¹⁾ Am 3. März 2023 aufgrund einer Verschmelzung geschlossen (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 22. Dezember 2021 aufgelegt.

⁽³⁾ Die Anteilsklasse wurde am 4. November 2021 aufgelegt

Statistik (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2023

	Währung	NIW je Anteil zum 30. Juni 2023	NIW je Anteil zum 31. Dezember 2022	NIW je Anteil zum 31. Dezember 2021
Man AHL Alpha Core Alternative				
Man AHL Alpha Core Alternative DN H EUR Acc ⁽⁴⁾	EUR	106,10	–	–
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	GBP	155,32	151,40	134,31
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	GBP	169,66	165,11	146,64
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc ⁽⁵⁾	USD	110,64	106,85	–
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	EUR	122,20	119,70	107,56
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc ⁽⁶⁾	GBP	117,21	114,05	–
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	JPY	12.194,83	12.071,49	10.858,78
Man AHL Alpha Core Alternative IN H SEK Acc ⁽⁷⁾	SEK	104,09	101,77	–
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc ⁽⁸⁾	EUR	105,92	103,66	94,41

⁽⁴⁾ Die Anteilsklasse wurde am 27. März 2023 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽⁵⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt.

⁽⁶⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt.

⁽⁷⁾ Die Anteilsklasse wurde am 18. Juli 2022 aufgelegt.

⁽⁸⁾ Die Anteilsklasse wurde am 15. November 2021 aufgelegt.

Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterungen	Man Convertible Europe ⁽¹⁾ EUR	Man Convertible Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS	12.070.500,37	247.212.936,58	1.107.627.373,73
ERTRÄGE			
Zinsen aus Anleihen, netto	152,06	221.778,74	8.529.731,25
Bankzinsen	0,00	113.460,52	9.779.105,67
Sonstige Einnahmen	120,43	1.872,84	20,09
Nachlass auf Anlageverwaltungsgebühr (6)	0,00	0,00	0,00
SUMME ERTRÄGE	272,49	337.112,10	18.308.857,01
AUFWENDUNGEN			
Managementgebühr (6)	29.756,25	1.161.695,50	8.659.269,48
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	360,83	20.431,59	95.256,71
Erfolgsgebühren (6)	0,00	0,00	5.427.808,12
Depotbankgebühren (4)	3.208,22	47.337,10	131.810,70
Domizilstellen-, Administrations- und Transferstellengebühren	6.810,23	106.080,49	502.901,60
Revisionskosten, Druck- und Veröffentlichungskosten	2.620,50	59.169,65	97.391,74
Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) (5)	929,68	25.930,32	163.871,53
Bankzinsen	0,00	10.960,35	0,00
Zinsverbindlichkeiten auf Swap-Kontrakte	0,00	545.054,37	2.605,24
Transaktionskosten (8)	0,85	839,02	342.460,44
Sonstige Aufwendungen (9)	19.299,77	92.080,09	230.699,93
SUMME AUFWENDUNGEN	62.986,33	2.069.578,48	15.654.075,49
NETTOERTRAG/(NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN	(62.713,84)	(1.732.466,38)	2.654.781,52
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen (307.672,11)	(2.916.997,26)	17.853.960,10	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten	10.873,31	79.174.450,12	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten	0,00	(61.388.093,98)	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten	0,00	14.475.156,54	
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten (6.817,35)	953.923,54	(9.738.564,46)	
REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST)	(303.616,15)	(575.080,13)	40.376.908,32
Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus:			
- Wertpapieren	699.628,79	8.248.714,99	(19.099.683,97)
- Devisenkontrakten	(33.864,87)	1.156.001,94	26.150.255,00
- Optionskontrakte	0,00	14.019,92	0,00
- Futures-Kontrakten	0,00	(39.812,10)	(3.580.868,27)
- Swap-Kontrakten	0,00	681.599,96	(1.285.009,20)
ANSTIEG/(RÜCKGANG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT	299.433,93	7.752.978,20	45.216.383,40
KAPITALBEWEGUNGEN			
Ausgabe von Anteilen	0,00	16.499.125,14	167.415.610,54
Rücknahme von Anteilen (12.369.934,30)	(107.177.010,52)	(176.178.011,97)	
Gezahlte Dividende (16)	0,00	(868,33)	0,00
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	0,00	164.287.161,07	1.144.081.355,70

⁽¹⁾ Am 3. März 2023 aufgrund einer Verschmelzung geschlossen (siehe Erläuterung 18).

**Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der
Veränderung des Nettovermögens (Fortsetzung)**
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

	Man AHL Alpha Core Alternative USD
Erläuterungen	
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS	142.443.578,90
ERTRÄGE	
Zinsen aus Anleihen, netto	2.070.943,52
Bankzinsen	1.245.447,64
Sonstige Einnahmen	0,00
Nachlass auf Anlageverwaltungsgebühr (6)	0,00
SUMME ERTRÄGE	3.316.391,16
AUFWENDUNGEN	
Managementgebühr (6)	673.994,11
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	11.872,96
Erfolgsgebühren (6)	405.869,28
Depotbankgebühren (4)	37.653,09
Domizilstellen-, Administrations- und Transferstellengebühren	72.872,27
Revisionskosten, Druck- und Veröffentlichungskosten	25.036,37
Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) (5)	11.496,13
Bankzinsen	12.928,84
Zinsverbindlichkeiten auf Swap-Kontrakte	300,20
Transaktionskosten (8)	37.975,25
Sonstige Aufwendungen (9)	45.469,11
SUMME AUFWENDUNGEN	1.335.467,61
NETTOERTRAG/(NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN	1.980.923,55
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen	(39.426,51)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten	3.880.000,83
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten	(6.668.771,22)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten	1.598.408,38
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten	(1.220.456,21)
REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST)	(2.450.244,73)
Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus:	
- Wertpapieren	(376.810,33)
- Devisenkontrakten	(350.495,98)
- Optionskontrakte	0,00
- Futures-Kontrakten	(520.436,55)
- Swap-Kontrakten	(140.269,60)
ANSTIEG/(RÜCKGANG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT	(1.857.333,64)
KAPITALBEWEGUNGEN	
Ausgabe von Anteilen	5.413.034,45
Rücknahme von Anteilen	(10.859.026,22)
Gezahlte Dividende (16)	0,00
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	135.140.253,49

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2023
 (in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Anleihen – Wandelanleihen					
Australien					
Dexus Finance Pty Limited 2.30% 19/Jun/2026	1.000.000	EUR	633.361,40	588.900,92	0,36
Flight Centre Travel Group Limited 1.63% 1/Nov/2028	800.000	EUR	499.559,64	439.597,46	0,27
Flight Centre Travel Group Limited 2.50% 17/Nov/2027	400.000	EUR	276.409,09	267.236,21	0,16
			1.409.330,13	1.295.734,59	0,79
Belgien					
Groupe Bruxelles Lambert NV 2.13% 29/Nov/2025	400.000	EUR	411.040,00	398.654,00	0,24
Umicore SA 0.00% 23/Jun/2025	300.000	EUR	269.010,79	269.737,50	0,16
			680.050,79	668.391,50	0,40
Kaimaninseln					
Bilibili Inc. 1.38% 1/Apr/2026	597.000	EUR	604.755,89	556.003,45	0,34
Cathay Pacific Finance Ili Limited 2.75% 5/Feb/2026	8.000.000	EUR	920.090,14	981.899,51	0,60
ESR Group Limited 1.50% 30/Sep/2025	912.000	EUR	809.564,06	821.301,56	0,50
Huazhu Group Limited 3.00% 1/May/2026	170.000	EUR	168.823,24	177.231,62	0,11
Li Auto Inc. 0.25% 1/May/2028	931.000	EUR	1.017.148,40	1.181.584,92	0,72
Trip.com Group Limited 1.50% 1/Jul/2027	760.000	EUR	752.280,01	773.235,56	0,47
Wynn Macau Limited 4.50% 7/Mar/2029	712.000	EUR	691.125,91	677.933,64	0,41
Zhen Ding Technology Holding Limited 0.00% 30/Jun/2025	1.300.000	EUR	1.153.856,19	1.187.843,72	0,73
Zhongsheng Group Holdings Limited 0.00% 21/May/2025	2.000.000	EUR	253.788,21	252.268,45	0,15
			6.371.432,05	6.609.302,43	4,03
China					
Zhejiang Expressway Company Limited 0.00% 20/Jan/2026	400.000	EUR	410.600,00	406.732,52	0,25
			410.600,00	406.732,52	0,25
Frankreich					
Atos SE 0.00% 6/Nov/2024	100.000	EUR	88.989,58	87.927,46	0,05
Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.00% 10/Nov/2023	2.200.000	EUR	2.011.769,40	1.976.168,65	1,20
Edenred 0.00% 14/Jun/2028	14.350	EUR	900.754,45	965.719,13	0,59
Selena Sarl 0.00% 25/Jun/2025	100.000	EUR	93.572,50	92.953,71	0,06
SOITEC 0.00% 1/Oct/2025	3.270	EUR	662.640,02	615.573,41	0,37
Ubisoft Entertainment SA 2.38% 15/Nov/2028	600.000	EUR	622.961,63	605.831,28	0,37
Veolia Environnement SA 0.00% 1/Jan/2025	2.800	EUR	90.692,00	89.899,26	0,05
Wendel SE 2.63% 27/Mar/2026	500.000	EUR	493.500,00	490.308,35	0,30
Worldline SA 0.00% 30/Jul/2025	1.400	EUR	148.656,66	151.050,20	0,09
			5.113.536,24	5.075.431,45	3,08
Deutschland					
Adidas AG 0.05% 12/Sep/2023	200.000	EUR	196.097,14	198.500,00	0,12
Delivery Hero SE 0.88% 15/Jul/2025	200.000	EUR	154.320,00	175.575,56	0,11
Delivery Hero SE 1.00% 23/Jan/2027	1.800.000	EUR	1.474.201,37	1.399.199,94	0,85
Delivery Hero SE 3.25% 21/Feb/2030	1.200.000	EUR	1.155.228,57	1.188.000,00	0,72
Deutsche Lufthansa AG 2.00% 17/Nov/2025	500.000	EUR	563.150,00	578.653,55	0,35
Fresenius SE & Company Kgaa 0.00% 31/Jan/2024	200.000	EUR	192.530,40	194.808,00	0,12
MTU Aero Engines AG 0.05% 18/Mar/2027	800.000	EUR	743.180,00	735.462,16	0,45
RAG-Stiftung 0.00% 2/Oct/2024	100.000	EUR	93.977,86	94.510,65	0,06
RAG-Stiftung 1.88% 16/Nov/2029	300.000	EUR	303.000,00	304.160,01	0,19
Rheinmetall AG 1.88% 7/Feb/2028	900.000	EUR	966.240,00	945.450,00	0,57
			5.841.925,34	5.814.319,87	3,54
Hongkong					
Lenovo Group Limited 3.38% 24/Jan/2024	605.000	EUR	755.244,68	716.259,56	0,44
Xiaomi Best Time International Limited 0.00% 17/Dec/2027	300.000	EUR	275.586,76	232.547,54	0,14
			1.030.831,44	948.807,10	0,58
Indien					
Bharti Airtel Limited 1.50% 17/Feb/2025	1.115.000	EUR	1.106.178,87	1.461.968,38	0,89
			1.106.178,87	1.461.968,38	0,89

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
 zum 30. Juni 2023
 (in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Israel					
CyberArk Software Limited 0.00% 15/Nov/2024	514.000	EUR	485.302,70	536.095,88	0,33
			485.302,70	536.095,88	0,33
Italien					
Diasorin SpA 0.00% 5/May/2028	600.000	EUR	586.644,54	467.010,24	0,28
Pirelli & Company SpA 0.00% 22/Dec/2025	700.000	EUR	716.856,96	671.840,54	0,41
Prismian SpA 0.00% 2/Feb/2026	800.000	EUR	802.580,22	859.920,00	0,52
			2.106.081,72	1.998.770,78	1,21
Japan					
	190.000,00				
ANA Holdings Inc. 0.00% 10/Dec/2031	0	EUR	1.454.358,22	1.485.545,41	0,90
DMG Mori Company Limited 0.00% 16/Jul/2024	70.000.000	EUR	568.125,94	490.942,79	0,30
Ezaki Glico Company Limited 0.00% 30/Jan/2024	50.000.000	EUR	388.107,42	316.395,47	0,19
Kyoritsu Maintenance Company Limited 0.00% 29/Jan/2026	50.000.000	EUR	412.604,76	395.500,96	0,24
Mercari Inc. 0.00% 14/Jul/2028	40.000.000	EUR	329.538,49	183.368,81	0,11
Mitsubishi Chemical Holdings Corp. 0.00% 29/Mar/2024	180.000.000	EUR	1.483.965,43	1.143.637,28	0,70
Nagoya Railroad Company Limited 0.00% 11/Dec/2024	60.000.000	EUR	541.596,56	382.877,11	0,23
Nippon Steel Corp. 0.00% 4/Oct/2024	160.000.000	EUR	1.263.417,14	1.270.866,63	0,77
Nippon Steel Corp. 0.00% 5/Oct/2026	200.000.000	EUR	1.581.261,10	1.600.685,31	0,98
Rohm Company Limited 0.00% 5/Dec/2024	110.000.000	EUR	950.583,73	784.604,78	0,48
SBI Holdings Inc. 0.00% 13/Sep/2023	150.000.000	EUR	1.212.195,53	951.158,35	0,58
			10.185.754,32	9.005.582,90	5,48
Luxemburg					
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.00% 25/Jul/2024	6.000.000	EUR	707.405,61	661.524,80	0,40
			707.405,61	661.524,80	0,40
Mexiko					
Fomento Economico Mexicano SAB de CV 2.63% 24/Feb/2026	1.000.000	EUR	1.031.066,66	1.034.325,00	0,63
			1.031.066,66	1.034.325,00	0,63
Niederlande					
America Movil SAB de CV 0.00% 2/Mar/2024	2.000.000	EUR	2.094.326,73	2.110.687,60	1,29
ELM BV for Swiss Reinsurance Company Limited 3.25% 13/Jun/2024	600.000	EUR	563.014,69	611.274,06	0,37
Just Eat Takeaway.com NV 2.25% 25/Jan/2024	100.000	EUR	97.468,75	98.182,14	0,06
Merrill Lynch BV 0.00% 30/Jan/2026	700.000	EUR	714.825,36	674.999,99	0,41
STMicroelectronics NV 0.00% 4/Aug/2025	400.000	EUR	449.017,11	438.496,79	0,27
			3.918.652,64	3.933.640,58	2,40
Neuseeland					
Xero Investments Limited 0.00% 2/Dec/2025	493.000	EUR	403.451,83	400.291,78	0,24
			403.451,83	400.291,78	0,24
Republik Korea (Sud)					
L&F Company Limited 2.50% 26/Apr/2030	400.000	EUR	334.216,28	318.698,44	0,19
Posco Holdings Inc. 0.00% 1/Sep/2026	1.200.000	EUR	1.230.450,00	1.230.712,44	0,75
SK Hynix Inc. 1.75% 11/Apr/2030	1.800.000	EUR	1.730.703,83	2.023.461,17	1,22
			3.295.370,11	3.572.872,05	2,16
Singapur					
SGX Treasury I Pte Limited 0.00% 1/Mar/2024	700.000	EUR	709.000,00	681.614,50	0,41
Singapore Airlines Limited 1.63% 3/Dec/2025	1.000.000	EUR	687.198,40	879.610,88	0,54
			1.396.198,40	1.561.225,38	0,95
Spanien					
Cellnex Telecom SA 0.50% 5/Jul/2028	1.700.000	EUR	1.808.460,00	1.777.622,00	1,09
Cellnex Telecom SA 0.75% 20/Nov/2031	2.100.000	EUR	1.599.024,00	1.664.315,73	1,01
Iberdrola Finanzas SA 0.80% 7/Dec/2027	600.000	EUR	606.848,57	600.141,36	0,37
International Consolidated Airlines Group SA 1.13% 18/May/2028	600.000	EUR	593.872,00	510.393,78	0,31
			4.608.204,57	4.552.472,87	2,78

Die beigefugten Erlauterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2023
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Schweden					
Fastighets AB Balder 3.50% 23/Feb/2028	400.000	EUR	362.840,00	331.916,68	0,20
Geely Sweden Financials Holding AB 0.00% 19/Jun/2024	300.000	EUR	385.950,00	417.975,00	0,25
			748.790,00	749.891,68	0,45
Taiwan					
Globalwafers Company Limited 0.00% 1/Jun/2026	600.000	EUR	526.628,29	477.085,24	0,29
Hon Hai Precision Industry Company Limited 0.00% 5/Aug/2026	1.100.000	EUR	953.411,69	873.395,97	0,53
Taiwan Cement Corp. 0.00% 7/Dec/2026	1.500.000	EUR	1.348.890,15	1.204.275,89	0,73
United Microelectronics Corp. 0.00% 7/Jul/2026	300.000	EUR	256.971,16	240.948,67	0,15
			3.085.901,29	2.795.705,77	1,70
Vereinigte Arabische Emirate					
Abu Dhabi National Oil Company 0.70% 4/Jun/2024	2.200.000	EUR	1.911.490,88	1.914.066,75	1,16
			1.911.490,88	1.914.066,75	1,16
Vereinigtes Konigreich					
Barclays Bank plc 0.00% 24/Jan/2025	300.000	EUR	321.300,00	317.788,50	0,19
Jet2 plc 1.63% 10/Jun/2026	300.000	EUR	367.367,47	326.099,53	0,20
WH Smith plc 1.63% 7/May/2026	300.000	EUR	356.905,37	310.746,59	0,19
			1.045.572,84	954.634,62	0,58
USA					
American Airlines Inc. 6.50% 1/Jul/2025	1.025.000	EUR	1.146.227,54	1.207.527,04	0,74
Asahi Refining USA Inc. 0.00% 16/Mar/2026	500.000	EUR	421.302,36	398.258,48	0,24
Etsy Inc. 0.13% 1/Oct/2026	579.000	EUR	669.717,20	632.708,11	0,39
JPMorgan Chase Bank 0.00% 28/Dec/2023	800.000	EUR	707.365,57	709.440,88	0,44
JPMorgan Chase Bank 0.00% 18/Feb/2024	400.000	EUR	445.618,00	425.200,00	0,26
JPMorgan Chase Bank NA 0.00% 10/Jun/2024	600.000	EUR	659.310,00	692.388,00	0,42
JPMorgan Chase Financial Company LLC 0.00% 29/Apr/2025	700.000	EUR	715.558,31	740.693,31	0,45
Marriott Vacations Worldwide Corp. 0.00% 15/Jan/2026	1.000.000	EUR	978.095,30	851.283,23	0,52
Sasol Financing USA LLC 4.50% 8/Nov/2027	1.600.000	EUR	1.544.448,42	1.388.450,96	0,85
Southwest Airlines Co. 1.25% 1/May/2025	2.147.000	EUR	2.651.187,61	2.269.443,94	1,38
Vishay Intertechnology Inc. 2.25% 15/Jun/2025	596.000	EUR	473.193,86	598.868,01	0,36
Zillow Group Inc. 0.75% 1/Sep/2024	702.000	EUR	713.049,36	795.472,43	0,48
Zillow Group Inc. 1.38% 1/Sep/2026	527.000	EUR	534.751,97	609.080,28	0,37
			11.659.825,50	11.318.814,67	6,90
Vietnam					
Vingroup Jsc 3.00% 20/Apr/2026	1.000.000	EUR	861.251,91	783.306,60	0,48
Vinpearl Jsc 3.25% 21/Sep/2026	600.000	EUR	507.657,16	412.465,63	0,25
			1.368.909,07	1.195.772,23	0,73
Britische Jungferninseln					
ADM AG Holding Limited 0.00% 26/Aug/2023	400.000	EUR	369.366,93	363.342,11	0,22
Anllian Capital Limited 0.00% 5/Feb/2025	1.400.000	EUR	1.690.155,25	1.424.010,00	0,87
China Conch Venture Holdings International Limited 0.00% 5/Sep/2023	2.000.000	EUR	237.445,91	264.295,30	0,16
Universe Trek Limited 2.50% 8/Jul/2025	580.000	EUR	535.492,18	538.932,17	0,33
			2.832.460,27	2.590.579,58	1,58
Summe Anleihen – Wandelanleihen			72.754.323,27	71.056.955,16	43,24
Summe ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Borsennotierung			72.754.323,27	71.056.955,16	43,24

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2023
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen – Wandelanleihen					
Bermuda					
Jazz Investments I Limited 2.00% 15/Jun/2026	1.748.000	EUR	1.817.982,16	1.632.241,06	0,99
NCL Corp. Limited 1.13% 15/Feb/2027	1.735.000	EUR	1.449.727,81	1.469.244,44	0,89
NCL Corp. Limited 5.38% 1/Aug/2025	254.000	EUR	298.355,50	321.418,49	0,20
			<u>3.566.065,47</u>	<u>3.422.903,99</u>	<u>2,08</u>
Kaimaninseln					
Sea Limited 2.38% 1/Dec/2025	1.712.000	EUR	1.986.674,86	1.592.238,46	0,96
ZTO Express Inc. 1.50% 1/Sep/2027	1.116.000	EUR	1.085.590,14	1.019.989,22	0,62
			<u>3.072.265,00</u>	<u>2.612.227,68</u>	<u>1,58</u>
Dänemark					
Ascendis Pharma AS 2.25% 1/Apr/2028	996.000	EUR	826.566,29	836.954,04	0,51
			<u>826.566,29</u>	<u>836.954,04</u>	<u>0,51</u>
Israel					
NICE Limited 0.00% 15/Sep/2025	600.000	EUR	561.780,41	532.630,61	0,33
			<u>561.780,41</u>	<u>532.630,61</u>	<u>0,33</u>
Japan					
CyberAgent Inc. 0.00% 19/Feb/2025	40.000.000	EUR	356.625,32	256.274,95	0,16
CyberAgent Inc. 0.00% 16/Nov/2029	80.000.000	EUR	586.864,28	523.186,11	0,32
Digital Garage Inc. 0.00% 14/Sep/2023	80.000.000	EUR	653.042,07	507.966,15	0,31
Koei Tecmo Holdings Company Limited 0.00% 20/Dec/2024	90.000.000	EUR	731.448,31	605.421,46	0,37
Menicon Company Limited 0.00% 29/Jan/2025	40.000.000	EUR	372.680,55	255.568,49	0,16
Nipro Corp. 0.00% 25/Sep/2026	90.000.000	EUR	704.590,52	574.672,38	0,35
Relo Group Inc. 0.00% 17/Dec/2027	50.000.000	EUR	421.059,62	308.560,90	0,19
Ship Healthcare Holdings Inc. 0.00% 13/Dec/2023	60.000.000	EUR	505.866,36	381.450,24	0,23
			<u>4.332.177,03</u>	<u>3.413.100,68</u>	<u>2,09</u>
Luxemburg					
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.00% 15/Mar/2028	400.000	EUR	422.160,00	430.066,68	0,26
			<u>422.160,00</u>	<u>430.066,68</u>	<u>0,26</u>
Panama					
Carnival Corp. 5.75% 1/Oct/2024	1.409.000	EUR	1.521.764,28	2.579.514,42	1,57
			<u>1.521.764,28</u>	<u>2.579.514,42</u>	<u>1,57</u>
USA					
Airbnb Inc. 0.00% 15/Mar/2026	223.000	EUR	186.089,11	179.912,56	0,11
Akamai Technologies Inc. 0.13% 1/May/2025	555.000	EUR	564.206,24	541.943,15	0,33
Akamai Technologies Inc. 0.38% 1/Sep/2027	2.656.000	EUR	2.542.810,94	2.358.627,81	1,43
Alliant Energy Corp. 3.88% 15/Mar/2026	554.000	EUR	523.492,78	505.252,06	0,31
Alnylam Pharmaceuticals Inc. 1.00% 15/Sep/2027	1.130.000	EUR	1.105.884,24	996.270,05	0,61
Bentley Systems Inc. 0.13% 15/Jan/2026	400.000	EUR	325.771,56	377.125,57	0,23
Bentley Systems Inc. 0.38% 1/Jul/2027	830.000	EUR	656.864,01	690.944,95	0,42
Bill.com Holdings Inc. 0.00% 1/Dec/2025	1.426.000	EUR	1.498.260,63	1.373.704,62	0,84
BioMarin Pharmaceuticals Inc. 0.60% 1/Aug/2024	1.677.000	EUR	1.516.149,68	1.514.839,79	0,92
Block Inc. 0.13% 1/Mar/2025	1.287.000	EUR	1.286.012,59	1.113.002,56	0,68
Bloom Energy Corp. 3.00% 1/Jun/2028	549.000	EUR	595.407,48	571.523,09	0,35
Burlington Stores Inc. 2.25% 15/Apr/2025	453.000	EUR	508.730,55	432.791,47	0,26
Cinemark Holdings Inc. 4.50% 15/Aug/2025	379.000	EUR	464.315,28	477.658,11	0,29
CMS Energy Corp. 3.38% 1/May/2028	783.000	EUR	725.247,96	706.027,73	0,43
Coinbase Global Inc. 0.50% 1/Jun/2026	349.000	EUR	288.255,54	241.691,61	0,15
CONMED Corp. 2.25% 15/Jun/2027	1.037.000	EUR	944.555,40	1.066.940,88	0,66
Cytokinetics Inc. 3.50% 1/Jul/2027	445.000	EUR	542.355,37	382.358,97	0,23
Datadog Inc. 0.13% 15/Jun/2025	810.000	EUR	922.044,57	924.164,71	0,56
Dexcom Inc. 0.25% 15/Nov/2025	1.301.000	EUR	1.132.799,13	1.274.145,26	0,78
Dexcom Inc. 0.38% 15/May/2028	630.000	EUR	596.561,33	589.289,64	0,36
Dropbox Inc. 0.00% 1/Mar/2026	1.352.000	EUR	1.177.678,42	1.170.762,60	0,71
Dropbox Inc. 0.00% 1/Mar/2028	543.000	EUR	485.210,91	476.929,19	0,29
Duke Energy Corp. 4.13% 15/Apr/2026	2.006.000	EUR	1.867.109,85	1.792.253,44	1,08
Enphase Energy Inc. 0.00% 1/Mar/2026	824.000	EUR	773.792,35	711.515,32	0,43
Enphase Energy Inc. 0.00% 1/Mar/2028	720.000	EUR	553.759,28	618.900,39	0,38
Envestnet Inc. 0.75% 15/Aug/2025	763.000	EUR	626.717,54	645.887,54	0,39
Envestnet Inc. 2.63% 1/Dec/2027	622.000	EUR	628.884,59	599.149,62	0,36

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2023
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
USA (Fortsetzung)					
Etsy Inc. 0.13% 1/Sep/2027	1.525.000	EUR	1.425.356,22	1.170.259,29	0,71
Exact Sciences Corp. 0.38% 15/Mar/2027	1.250.000	EUR	1.057.325,29	1.237.396,88	0,75
Exact Sciences Corp. 2.00% 1/Mar/2030	397.000	EUR	397.900,16	505.922,10	0,31
FirstEnergy Corp. 4.00% 1/May/2026	1.132.000	EUR	1.048.499,48	1.029.854,38	0,63
Five9 Inc. 0.50% 1/Jun/2025	790.000	EUR	794.848,46	697.404,90	0,42
Ford Motor Company 0.00% 15/Mar/2026	3.260.000	EUR	3.152.333,86	3.278.077,91	2,00
Halozyme Therapeutics Inc. 0.25% 1/Mar/2027	892.000	EUR	696.967,28	680.912,41	0,41
Halozyme Therapeutics Inc. 1.00% 15/Aug/2028	657.000	EUR	663.824,47	552.270,23	0,34
Insmed Inc. 0.75% 1/Jun/2028	546.000	EUR	500.451,57	420.410,50	0,26
Insmed Inc. 1.75% 15/Jan/2025	641.000	EUR	652.592,81	559.259,29	0,34
Integer Holdings Corp. 2.13% 15/Feb/2028	595.000	EUR	606.400,45	646.946,61	0,39
Integra Lifesciences Holdings Corp. 0.50% 15/Aug/2025	940.000	EUR	826.416,11	788.848,69	0,48
Ionis Pharmaceuticals Inc. 0.00% 1/Apr/2026	880.000	EUR	688.241,48	763.244,73	0,46
Lantheus Holdings Inc. 2.63% 15/Dec/2027	731.000	EUR	695.291,80	871.397,56	0,53
LCI Industries 1.13% 15/May/2026	69.000	EUR	62.487,97	61.216,98	0,04
Liberty Media Corp. 1.38% 15/Oct/2023	115.000	EUR	137.462,71	122.622,04	0,07
Liberty Media Corp. 2.75% 1/Dec/2049	618.000	EUR	558.319,32	527.203,28	0,32
Liberty Media Corp. 3.75% 15/Mar/2028	448.000	EUR	425.533,68	444.181,12	0,27
Live Nation Entertainment Inc. 3.13% 15/Jan/2029	2.509.000	EUR	2.423.280,69	2.548.831,24	1,55
Lumentum Holdings Inc. 0.50% 15/Dec/2026	1.562.000	EUR	1.523.330,86	1.267.031,12	0,77
Lumentum Holdings Inc. 0.50% 15/Jun/2028	343.000	EUR	297.424,51	247.492,90	0,15
Macom Technology Solutions Holdings Inc. 0.25% 15/Mar/2026	650.000	EUR	613.558,02	598.762,60	0,36
Marriott Vacations Worldwide Corp. 3.25% 15/Dec/2027	631.000	EUR	613.616,66	551.618,93	0,34
Match Group Financeco 2 Inc. 0.88% 15/Jun/2026	1.116.000	EUR	994.574,97	919.371,24	0,56
Match Group Financeco 3 Inc. 2.00% 15/Jan/2030	312.000	EUR	338.218,49	257.671,68	0,16
MicroStrategy Inc. 0.75% 15/Dec/2025	714.000	EUR	508.570,35	714.451,57	0,43
Middleby Corp. 1.00% 1/Sep/2025	917.000	EUR	1.029.974,73	1.042.866,87	0,63
Mp Materials Corp. 0.25% 1/Apr/2026	1.157.000	EUR	935.253,41	944.081,25	0,57
NextEra Energy Partners LP 0.00% 15/Jun/2024	1.294.000	EUR	1.122.976,83	1.118.597,53	0,69
NextEra Energy Partners LP 0.00% 15/Nov/2025	790.000	EUR	752.575,77	674.917,06	0,41
Northern Oil and Gas Inc. 3.63% 15/Apr/2029	758.000	EUR	864.660,50	781.602,91	0,48
NRG Energy Inc. 2.75% 1/Jun/2048	1.109.000	EUR	1.030.962,67	1.080.729,14	0,66
Omniceil Inc. 0.25% 15/Sep/2025	482.000	EUR	538.860,90	447.042,85	0,27
On Semiconductor Corp. 0.50% 1/Mar/2029	1.421.000	EUR	1.319.323,20	1.470.546,14	0,90
Pebblebrook Hotel Trust 1.75% 15/Dec/2026	1.134.000	EUR	1.100.860,91	878.948,74	0,54
Post Holdings Inc. 2.50% 15/Aug/2027	850.000	EUR	870.698,17	780.562,56	0,48
Rivian Automotive Inc. 4.63% 15/Mar/2029	1.612.000	EUR	1.477.483,48	1.636.580,12	1,00
Sarepta Therapeutics Inc. 1.25% 15/Sep/2027	1.638.000	EUR	1.759.057,47	1.627.115,03	0,99
Shift4 Payments Inc. 0.00% 15/Dec/2025	654.000	EUR	659.052,71	653.718,26	0,40
Shift4 Payments Inc. 0.50% 1/Aug/2027	1.210.000	EUR	1.044.602,43	981.530,71	0,60
SolarEdge Technologies Inc. 0.00% 15/Sep/2025	908.000	EUR	1.015.603,24	986.965,21	0,60
Southern Copper Corp. 3.88% 15/Dec/2025	1.416.000	EUR	1.329.822,69	1.301.305,30	0,79
Splunk Inc. 0.50% 15/Sep/2023	1.082.000	EUR	1.048.698,71	978.857,93	0,60
Splunk Inc. 1.13% 15/Sep/2025	852.000	EUR	803.748,53	782.643,22	0,48
Splunk Inc. 1.13% 15/Jun/2027	799.000	EUR	691.195,60	635.245,28	0,39
Sunnova Energy International Inc. 0.25% 1/Dec/2026	1.172.000	EUR	937.152,78	841.920,33	0,51
Tyler Technologies Inc. 0.25% 15/Mar/2026	895.000	EUR	839.835,65	854.868,56	0,52
Vail Resorts Inc. 0.00% 1/Jan/2026	900.000	EUR	786.095,55	737.576,81	0,45
Wayfair Inc. 0.63% 1/Oct/2025	200.000	EUR	168.328,60	157.871,31	0,10
Wayfair Inc. 1.13% 1/Nov/2024	523.000	EUR	414.735,81	479.345,92	0,29
Wayfair Inc. 3.25% 15/Sep/2027	549.000	EUR	461.705,30	626.685,26	0,38
Welltower OP LLC 2.75% 15/May/2028	590.000	EUR	558.658,85	544.794,43	0,33
Wolfspeed Inc. 0.25% 15/Feb/2028	1.180.000	EUR	1.036.200,62	837.170,52	0,51
Wolfspeed Inc. 1.88% 1/Dec/2029	2.289.000	EUR	2.020.166,71	1.634.841,15	1,00
Ziff Davis Inc. 1.75% 1/Nov/2026	720.000	EUR	671.624,31	618.285,98	0,38
Zillow Group Inc. 2.75% 15/May/2025	1.104.000	EUR	1.065.258,01	1.068.582,95	0,65
Zscaler Inc. 0.13% 1/Jul/2025	941.000	EUR	1.002.948,69	1.010.233,79	0,61
			74.099.917,83	72.012.305,99	43,85
Summe Anleihen – Wandelanleihen			88.402.696,31	85.839.704,09	52,27
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte ubertragbare Wertpapiere					
			88.402.696,31	85.839.704,09	52,27

Die beigefugten Erlauerungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)**

zum 30. Juni 2023

(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Sonstige ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen					
Bermuda					
Rexlot Holdings Limited 4.50% 17/Apr/2023*	10.447.626	EUR	793.280,23	30.549,49	0,02
			793.280,23	30.549,49	0,02
Summe forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere			793.280,23	30.549,49	0,02
Anleihen – Wandelanleihen					
Kaimaninseln					
China Milk Products Group Limited 0.00% 5/Jan/2024*	1.700.000	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
Taiwan					
Promos Technologies Inc. 0.00% 14/Feb/2024*	1.500.000	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
USA					
Ormat Technologies Inc. 2.50% 15/Jul/2027	592.000	EUR	731.125,18	590.062,84	0,36
Sunedis 0.00% 1/Jun/2024**	8.000.000	EUR	7.183.483,43	73.327,22	0,04
Sunnova Energy International Inc. 2.63% 15/Feb/2028	445.000	EUR	467.591,01	334.781,94	0,20
			8.382.199,62	998.172,00	0,60
Summe Anleihen – Wandelanleihen			8.382.199,62	998.172,00	0,60
Aktien					
Thailand					
Alphatec Electronics*	34.000	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
Summe Aktien			0,00	0,00	0,00
Optionsscheine Aktien					
Indonesien					
Graha Andrasentra Propertindo*	48.700.536	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
Summe Optionsscheine Aktien			0,00	0,00	0,00
Summe sonstige ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			9.175.479,85	1.028.721,49	0,62
SUMME WERTPAPIERBESTAND			170.332.499,43	157.925.380,74	96,13

* Zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Wertpapier

** Illiquides Wertpapier

Man Convertibles Global

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2023

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

Geografische Aufteilung	%	Wirtschaftliche Aufteilung	%
USA	51,35	Software	9,79
Japan	7,57	Internet-Software und -Dienstleistungen	7,42
Kaimaninseln	5,61	Automobilhersteller	5,98
Deutschland	3,54	Halbleiter	5,04
Frankreich	3,08	Fluggesellschaften	5,02
Spanien	2,78	Biotechnologie	4,85
Niederlande	2,40	Finanzdienstleistungen	4,69
Republik Korea (Süd)	2,16	Elektrizitätsversorgung	4,63
Bermuda	2,10	Freizeit und Unterhaltung	3,06
Taiwan	1,70	Pharmazeutika	2,82
Britische Jungferinseln	1,58	Telekommunikationsdienste	2,77
Panama	1,57	Freizeit	2,66
Italien	1,21	Computer und Peripheriegeräte	2,55
Vereinigte Arabische Emirate	1,16	Eisen und Stahl	2,50
Singapur	0,95	Alternative Energiequellen	2,45
Indien	0,89	Gesundheitswesen – Produkte	2,20
Australien	0,79	Gewerbliche Dienstleistungen	2,12
Vietnam	0,73	Ingenieurs- und Bauwesen	2,10
Luxemburg	0,66	Immobilienanlagefonds	2,06
Israel	0,66	Chemie	1,71
Mexiko	0,63	Öl- und Gasproduzenten	1,64
Vereinigtes Königreich	0,58	Elektronikgeräte	1,62
Hongkong	0,58	Einzelhandel	1,47
Dänemark	0,51	Hotelgewerbe	1,35
Schweden	0,45	Banken	1,31
Belgien	0,40	Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	1,02
China	0,25	Investmentgesellschaften	1,01
Neuseeland	0,24	Maschinenbau	0,93
	96,13	Transport	0,87
		Bergbau (Nichtedelmetalle)	0,87
		Gesundheitsprodukte und -ausrüstung	0,75
		Lebensmittel	0,73
		Baumaterialien	0,73
		Getränke	0,63
		Elektrische Ausrüstung	0,54
		Drähte und Seile	0,52
		Medizin	0,48
		Telekommunikationsausrüstung	0,47
		Tourismus	0,43
		Autoteile und -ausrüstung	0,41
		Versicherungen	0,37
		Medien	0,34
		Werbung	0,32
		Landwirtschaft	0,22
		Kohle	0,19
		Industrie	0,16
		Bekleidung	0,12
		Gesundheitswesen – Dienstleistungen	0,12
		Wasserversorgung	0,05
		Wohnungsbauunternehmen	0,04
			96,13

Man AHL Trend Alternative
Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2023
 (in USD)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
USA					
United States Treasury Bill 0.00% 7/Sep/2023	50.000.000	USD	48.957.409,72	49.529.750,00	4,33
United States Treasury Bill 0.00% 2/Nov/2023	50.000.000	USD	48.825.500,00	49.118.465,00	4,29
			<u>97.782.909,72</u>	<u>98.648.215,00</u>	<u>8,62</u>
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			97.782.909,72	98.648.215,00	8,62
Optionsscheine Aktien					
Jersey - Kanalinseln					
Alphabeta Access Products Limited - Wts 17/Mar/2033**	559.543	USD	101.140.523,89	104.070.745,47	9,09
Weser Capital Limited - Wts 17/Mar/2033**	559.543	USD	101.140.523,89	104.070.745,47	9,10
			<u>202.281.047,78</u>	<u>208.141.490,94</u>	<u>18,19</u>
Summe Optionsscheine Aktien			202.281.047,78	208.141.490,94	18,19
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			300.063.957,50	306.789.705,94	26,81
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
USA					
United States Treasury Bill 0.00% 13/Jul/2023	50.000.000	USD	49.015.487,50	49.931.005,00	4,37
United States Treasury Bill 0.00% 20/Jul/2023	50.000.000	USD	48.994.811,95	49.881.885,00	4,36
United States Treasury Bill 0.00% 12/Oct/2023	50.000.000	USD	48.962.500,00	49.273.010,00	4,31
United States Treasury Bill 0.00% 19/Oct/2023	40.000.000	USD	39.122.102,78	39.376.300,00	3,44
United States Treasury Bill 0.00% 26/Oct/2023	30.000.000	USD	29.333.949,90	29.502.147,00	2,58
United States Treasury Bill 0.00% 9/Nov/2023	50.000.000	USD	48.791.729,17	49.071.020,00	4,29
United States Treasury Bill 0.00% 16/Nov/2023	50.000.000	USD	48.732.951,39	49.021.555,00	4,28
			<u>312.953.532,69</u>	<u>316.056.922,00</u>	<u>27,63</u>
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			312.953.532,69	316.056.922,00	27,63
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			312.953.532,69	316.056.922,00	27,63
SUMME WERTPAPIERBESTAND			613.017.490,19	622.846.627,94	54,44

** Illiquide Wertpapiere

Man AHL Trend Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2023

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

Geografische Aufteilung	%	Wirtschaftliche Aufteilung	%
USA	36,25	Regierungen	36,25
Jersey – Kanalinseln	18,19	Finanzdienstleistungen	18,19
	54,44		54,44

Man AHL Alpha Core Alternative

Wertpapierbestand

zum 30. Juni 2023

(in USD)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
USA					
United States Treasury Bill 0.00% 2/Nov/2023	15.000.000	USD	14.647.650,00	14.735.539,50	10,90
			14.647.650,00	14.735.539,50	10,90
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			14.647.650,00	14.735.539,50	10,90
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
USA					
United States Treasury Bill 0.00% 13/Jul/2023	5.000.000	USD	4.922.253,33	4.993.100,50	3,69
United States Treasury Bill 0.00% 20/Jul/2023	3.000.000	USD	2.938.149,17	2.992.913,10	2,21
United States Treasury Bill 0.00% 21/Sep/2023	15.000.000	USD	14.805.866,67	14.828.166,00	10,97
United States Treasury Bill 0.00% 26/Oct/2023	23.000.000	USD	22.484.513,33	22.618.312,70	16,75
United States Treasury Bill 0.00% 16/Nov/2023	5.000.000	USD	4.873.484,05	4.902.155,50	3,63
			50.024.266,55	50.334.647,80	37,25
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			50.024.266,55	50.334.647,80	37,25
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			50.024.266,55	50.334.647,80	37,25
SUMME WERTPAPIERBESTAND			64.671.916,55	65.070.187,30	48,15

Man AHL Alpha Core Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2023

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

Geografische Aufteilung	%	Wirtschaftliche Aufteilung	%
USA	48,15	Regierungen	48,15
	48,15		48,15

Erläuterungen zum Abschluss für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 1 – Allgemeines

Man Umbrella SICAV (der „Fonds“) ist eine Aktiengesellschaft, welche in Luxemburg als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable oder „SICAV“) am 13. Dezember 1995 auf unbestimmte Dauer errichtet wurde.

Der Fonds wurde gemäß Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010, in der jeweils gültigen Fassung, über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz vom 17. Dezember 2010“) aufgelegt. Der Fonds ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß der EU-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 in ihrer jeweils gültigen Fassung. Als selbstverwaltete SICAV entspricht der Fonds den Voraussetzungen des Artikels 27 des Luxemburger Gesetzes vom 20. Dezember 2002 über Organismen für gemeinsame Anlagen, in der jeweils gültigen Fassung („Gesetz vom 20. Dezember 2002“). Das Gesetz vom 20. Dezember 2002 wurde zum 1. Juli 2011 durch das Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung ersetzt. Mit Wirkung zum 31. März 2009 hat der Fonds die Verwaltungsgesellschaft mit der Anlageverwaltungstätigkeit, der administrativen Verwaltung sowie dem Marketing beauftragt. Zum 10. Dezember 2009 wurde der Name des Fonds von RMF Umbrella SICAV in Man Umbrella SICAV geändert. Der Verwaltungsrat des Fonds beabsichtigt, Anteile am Fonds außer in Luxemburg in mehreren Mitgliedstaaten der Europäischen Union sowie in der Schweiz zu vertreiben.

Die Rechtsgrundlagen des Fonds werden durch dessen Satzung festgelegt. Ergänzend finden das Luxemburger Gesetz vom 10. August 1915 über die Handelsgesellschaften (das „Gesetz vom 10. August 1915“) sowie das Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung Anwendung. Die Satzung wurde erstmals am 17. Januar 1996 im Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations (Amtsblatt des Großherzogtums Luxemburg) veröffentlicht. Die Satzung wurde letztmalig am 12. Oktober 2011 geändert. Ein Hinweis auf die Hinterlegung der aktuellen Satzung wurde am 14. Dezember 2011 im Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations, veröffentlicht. Die Änderungen wurden an der Satzung des Fonds am 12. Oktober 2011 vorgenommen, um die Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung und die Auflagen der EU-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 zu erfüllen.

Folgende Teilfonds bestehen zum gegenwärtigen Zeitpunkt:

- Man Convertibles Global
- Man AHL Trend Alternative
- Man AHL Alpha Core Alternative

Die Anteile sind Namensanteile. Sämtliche Anteile werden in einem Globalzertifikat verbrieft. Eine physische Lieferung der Anteile ist ausgeschlossen.

Das Anlageziel des Teilfonds Man Convertibles Global ist die Wertsteigerung der Anlagen in aktienbezogenen Wertpapieren verbunden mit einer angestrebten Sicherheit des Kapitals zugunsten der Anleger. Zu diesem Zweck wird das Fondsvermögen dieses Teilfonds weltweit zu mindestens zwei Dritteln in Wandelanleihen, Umtauschanleihen, Optionsanleihen, wandelbaren Notes, Optionsanleihen, Notes mit Optionsscheinen auf Wertpapiere, Zwangswandelanleihen, wandelbaren Vorzugsaktien angelegt.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 1 – Allgemeines (Fortsetzung)

Der Teilfonds Man AHL Trend Alternative strebt ein mittelfristiges Kapitalwachstum bei gleichzeitiger Beschränkung der verbundenen Risiken an. Hierzu betreibt er ein diversifiziertes Portfolio aus Anlagen unter Verwendung des AHL Diversified Programms (das „AHL Diversified Programm“, siehe Beschreibung weiter unten im Abschnitt „AHL Diversified Programm“). Der Teilfonds beabsichtigt, sich unabhängig von klassischen Aktien- und Anleihenanlagen zu entwickeln, was wertvolle Diversifizierungsvorteile bietet und das Risiko-Ertrags-Profil gegenüber einem herkömmlichen Anlageportfolio verbessert. AHL verwaltet das AHL Diversified Programm, das ausgefeilte, computergestützte Prozesse anwendet, um vor allem Trends und andere Gelegenheiten auf Märkten weltweit zu identifizieren. Anschließend wird eine stabile und fein abgestimmte Handels- und Implementierungsinfrastruktur eingesetzt, um diese Handelsgelegenheiten gewinnbringend zu nutzen. Dieser Prozess ist quantitativer und überwiegend direktonaler Natur und wird durch strenge Risikokontrollen, fortlaufende Analysen, Diversifizierung und das beständige Streben nach Effizienz gestützt.

Der Teilfonds Man AHL Alpha Core Alternative strebt einen mittelfristigen Kapitalzuwachs bei gleichzeitiger Beschränkung der verbundenen Risiken an. Hierzu betreibt er ein diversifiziertes Portfolio aus Anlagen. Der Teilfonds beabsichtigt, sich unabhängig von klassischen Aktien- und Anleihenanlagen zu entwickeln, was wertvolle Diversifizierungsvorteile bietet und das Risiko-Ertrags-Profil gegenüber einem herkömmlichen Anlageportfolio verbessert. Um sein Anlageziel zu erreichen, wendet der Teilfonds einen systematischen, auf Statistiken basierenden Ansatz an, der vornehmlich darauf ausgerichtet ist, Aufwärts- und Abwärts-Preistendenzen auf den Märkten weltweit zu identifizieren und daraus Kapital zu schlagen. Der Teilfonds investiert derzeit in über 100 internationalen Märkten über eine große Bandbreite an Sektoren.

Erläuterung 2 – Zusammenfassung der wichtigsten Grundsätze der Rechnungslegung

Der Abschluss wird gemäß den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds erstellt und vorgelegt. Nachfolgend sind die wichtigsten für die Erstellung dieses Halbjahresabschlusses angewandten Rechnungslegungsmethoden dargestellt:

a) Ermittlung des Nettoinventarwerts der Anteile

Der Nettoinventarwert der Anteile jedes Teilfonds wird berechnet, indem das Nettovermögen des jeweiligen Teilfonds durch die Gesamtzahl der Anteile geteilt wird, die sich auf den betreffenden Teilfonds beziehen.

Nettoinventarwerte werden zum Bewertungstag bestimmt. Die tatsächliche Berechnung und Veröffentlichung der Nettoinventarwerte erfolgt am nächsten Bankarbeitstag nach einem solchen Bewertungstag.

b) Bewertung der Vermögenswerte

An offiziellen Börsen notierte Wertpapiere werden zum letzten verfügbaren Kurs an der Börse bewertet, die normalerweise der Hauptmarkt für das jeweilige Wertpapier ist. Wenn ein übertragbares Wertpapier oder sonstiger Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse bzw. an jenem geregelten Markt maßgebend, welche(r) der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.

Wertpapiere, die nicht an einer offiziellen Wertpapierbörse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden zum letztverfügbaren Kurs auf diesem Markt bewertet.

Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen werden zu ihrem letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet. Falls die Wertpapiere nicht an einer Börse oder einem anderen regulierten Markt notiert sind oder gehandelt werden oder falls es sich bei den Preisen nicht um angemessene Marktpreise handelt, wird der Wert dieser Wertpapiere und sonstigen gesetzlich zulässigen Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 2 – Zusammenfassung der wichtigsten Grundsätze der Rechnungslegung (Fortsetzung)

b) Bewertung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Die flüssigen Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet. Festgelder mit einer ursprünglichen Laufzeit von weniger als 12 Monaten und mehr als 90 Tagen können zum jeweiligen Nennwert zuzüglich der darauf aufgelaufenen Zinsen bewertet werden. Geldmarktinstrumente mit einer Restlaufzeit von höchstens 90 Tagen werden unter Zugrundelegung der fortgeführten Anschaffungskostenmethode, die den annähernden Marktwert ermittelt, bewertet.

c) Bewertung von Future-, Devisentermin-, Options- und Swap-Kontrakten

Futures-Kontrakte

Ausstehende Futures-Kontrakte werden, soweit vorhanden, am Bilanzstichtag zum letzten verfügbaren Marktpreis der Instrumente bewertet. Nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelte Futures-Kontrakte werden vom Verwaltungsrat bewertet.

Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus Futures-Kontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten“ erfasst und Einschusskonten werden in den Posten „Gezahlter Einschuss“ einbezogen.

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Futures-Kontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten“ angegeben.

Devisenkontrakte

Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus ausstehenden Devisenkontrakten wird unter Bezugnahme auf den für die Restlaufzeit des Kontrakts geltenden Devisenterminkurs bewertet und in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten“ erfasst.

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Devisenkontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten“ angegeben.

Optionskontrakte

Ausstehende Optionskontrakte werden, soweit vorhanden, zum Marktpreis bei Geschäftsschluss oder zum letzten verfügbaren Marktpreis der Instrumente bewertet. Die Bewertung von außerbörslich (over the counter, „OTC“) gehandelten Optionskontrakten erfolgt auf Basis von Kursen externer Preisanbieter/Modelle.

Der Marktwert von Optionskontrakten ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter dem Punkt „Optionskontrakte zum Marktwert (Long-Positionen)“ ausgewiesen.

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Optionskontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkäufen von Optionskontrakten“ ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 2 – Zusammenfassung der wichtigsten Grundsätze der Rechnungslegung (Fortsetzung)

c) Bewertung von Future-, Devisentermin-, Options- und Swap-Kontrakten (Fortsetzung)

Swap-Kontrakte

Gegebenenfalls ausstehende Swap-Kontrakte werden unter Verwendung der auf Geschäftsschlussdaten basierenden Gegenparteibewertung bewertet und mit einem unabhängigen Bewertungsanbieter abgeglichen. Die Bewertung stellen Schätzwerte auf der Grundlage eines Berechnungsmodells dar, das Marktdaten zum Geschäftsschluss nutzt. Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus ausstehenden Swap-Kontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten“ erfasst. Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Swap-Kontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten“ angegeben.

d) Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Wertpapierverkäufen

Die aus den Verkäufen von Wertpapieren realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises der verkauften Wertpapiere berechnet.

e) Verbuchung von Erträgen

Zinserträge werden periodengerecht erfasst, abzüglich von nicht erstattungsfähigen Quellensteuern. Abschläge/Aufschläge auf Nullkupon-Anleihen werden als Berichtigung der Zinserträge erfasst. Dividenden werden auf Ex-Dividenden-Basis erfasst, abzüglich von nicht erstattungsfähigen Quellensteuern. Wenn der Fonds einen Anspruch auf Rückerstattung von Quellensteuern hat, wird der Erstattungsanspruch zum Ex-Datum als Forderung erfasst.

f) Währungen der Fonds

Wechselkurse zum 30. Juni 2023:

1 EUR =	1,638999	AUD	1 EUR =	5,092253	MYR
1 EUR =	5,262980	BRL	1 EUR =	11,688451	NOK
1 EUR =	1,443666	CAD	1 EUR =	1,780788	NZD
1 EUR =	0,976063	CHF	1 EUR =	3,954661	PEN
1 EUR =	874,899759	CLP	1 EUR =	60,223007	PHP
1 EUR =	7,936797	CNH	1 EUR =	4,432671	PLN
1 EUR =	4.564,853556	COP	1 EUR =	4,959249	RON
1 EUR =	0,858143	GBP	1 EUR =	97,646111	RUB
1 EUR =	8,549755	HKD	1 EUR =	11,784275	SEK
1 EUR =	373,000379	HUF	1 EUR =	1,476505	SGD
1 EUR =	16.356,821589	IDR	1 EUR =	38,681085	THB
1 EUR =	4,048643	ILS	1 EUR =	28,442567	TRY
1 EUR =	89,499590	INR	1 EUR =	33,979071	TWD
1 EUR =	157,687671	JPY	1 EUR =	1,091000	USD
1 EUR =	1.437,550235	KRW	1 EUR =	20,610182	ZAR
1 EUR =	18,711304	MXN			

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 3 – Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

Die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen erfolgen über die im Verkaufsprospekt aufgeführten Zahl- und Vertriebsstellen des Fonds aufgrund eines schriftlichen, an die Register- und Transferstelle des Fonds zu richtenden Zeichnungs-/Rücknahmeantrages. Zeichnungs-/Rücknahmeanträge, die bis spätestens 12:00 Uhr (Luxemburger Zeit) an einem Bewertungstag bei der Register- und Transferstelle eingehen, werden zum Ausgabe-/Rücknahmepreis dieses Bewertungstages abgerechnet. Zeichnungs-/Rücknahmeanträge, die nach 12:00 Uhr (Luxemburger Zeit) bei der Register- und Transferstelle eingehen, werden zum Ausgabe-/Rücknahmepreis des nächsten Bewertungstages abgerechnet.

Der Ausgabepreis für die Teilfonds ist der ermittelte Anteilswert, zuzüglich einer Verkaufsgebühr von bis zu 5 % des Nettoanteilswertes, welche zugunsten der Vertriebsstellen erhoben wird.

Rücknahmeanträge, die bis spätestens 12:00 Uhr (Luxemburger Ortszeit) („Cut-Off Time“) an dem Bewertungstag bei der Register- und Transferstelle eingehen, werden zum Nettoinventarwert je Anteil (der „Rücknahmepreis“) des Bewertungstages abgerechnet, an dem die Rücknahme erfolgen soll, und am nächsten Bankarbeitstag berechnet und veröffentlicht, sofern der entsprechende Anhang eines Teilfonds keine anderslautenden Vereinbarungen enthält.

Rücknahmeanträge, die nach der Cut-Off Time eingehen, werden zum Rücknahmepreis des nächstfolgenden Bewertungstages abgerechnet, der, vorbehaltlich anderslautender Vereinbarungen im entsprechenden Anhang eines Teilfonds, am nächsten Bankarbeitstag berechnet und veröffentlicht wird. Die Einzelheiten zum Rücknahmepreis werden im entsprechenden Anhang eines Teilfonds erläutert. Die Zahlung erfolgt per Scheck an die vom Anteilinhaber angegebene Anschrift oder per Bankanweisung an ein vom Anteilinhaber angegebenes Konto.

Alle für diese Transaktion anfallenden Kosten trägt der Anteilinhaber, ohne irgendeine diesbezügliche Haftung des Fonds.

Wenn an einem Bewertungstag die Anträge auf eine Rücknahme oder einen Umtausch von Anteilen aus einem Teilfonds oder einer Anteilsklasse heraus insgesamt mehr als zehn Prozent des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse ausmachen, kann der Verwaltungsrat beschließen, dass ein Teil (anteilmäßig) oder die Gesamtheit dieser Rücknahme- oder Umtauschanträge auf den nächsten oder darauffolgende Bewertungstage zurückgestellt werden, bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezogen hatte, zurückgenommen wurden – jeweils unter der Maßgabe, dass der Fonds nicht verpflichtet ist, mehr als zehn Prozent (10 %) des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds oder der betreffenden Anteilsklasse an einem einzelnen Bewertungstag zurückzunehmen. Sollten Anträge auf eine Rücknahme oder einen Umtausch von Anteilen an zehn aufeinanderfolgenden Bewertungstagen zurückgestellt werden, wird der Verwaltungsrat eine Versammlung einberufen, um zu bestimmen, ob eine Aussetzung des Handels (d. h. der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen) mit dem jeweiligen Teilfonds gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „Zeitweilige Aussetzung der Berechnung“ des Prospekts angemessen ist.

Erläuterung 4 – Depotbank

Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg (nachstehend die „Verwahrstelle“) wurde gemäß den Bedingungen einer Vereinbarung mit unbestimmter Dauer, deren aktuelle Version am 20. Februar 2017 in Kraft trat, zur Verwahrstelle für die Vermögenswerte des Fonds ernannt.

Die Verwahrstelle hat in ihrer Eigenschaft als Vermögensverwahrer des Fonds Anspruch auf eine Gebühr durch den Fonds, die in Form eines Prozentsatzes ausgedrückt und auf der Grundlage des mittleren Nettovermögens des jeweiligen Monats berechnet und nachträglich gezahlt wird. Sie beträgt bis zu 0,03 % p. a.

Erläuterung 5 – Abonnementsteuer

Nach Luxemburger Recht und der üblichen Verwaltungspraxis unterliegt der Fonds in Luxemburg keiner Einkommens- oder Vermögenssteuer. Des Weiteren unterliegen eventuelle Ausschüttungen des Fonds vorbehaltlich der Angaben zur EU- Zinsrichtlinie keiner Quellensteuer in Luxemburg. Der Fonds unterliegt jedoch in Luxemburg einer Steuer von 0,05 % pro Jahr („taxe d'abonnement“) auf das Nettovermögen des jeweiligen Teilfonds. Diese Steuer ist vierteljährlich auf der Basis des Teilfondsvermögens am Ende des entsprechenden Quartals zu entrichten. Für Anteilsklassen, die ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten sind, gilt ein vermindertes Steuersatz von 0,01 % p. a. des Nettovermögens der betreffenden Anteilsklasse. Diese Steuer ist vierteljährlich zu entrichten und wird auf der Grundlage des Nettoteilfondsvermögens der jeweiligen Anteilsklasse berechnet.

Auf den Teil des Vermögens jedes Teilfonds, der in andere Luxemburger Organismen für gemeinsame Anlagen investiert ist, die ihrerseits dieser Steuer unterliegen, fällt keine derartige Steuer an.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren

Die Anlageverwalter erhalten die folgenden Anlageverwaltungsgebühren p. a. aus dem Nettovermögen des Teilfonds:

Managementgebührensatz

Man Convertibles Global	
Man Convertibles Global D EUR Acc	1,50 %
Man Convertibles Global D H CHF Acc	1,50 %
Man Convertibles Global D H USD Acc	1,50 %
Man Convertibles Global DR EUR Acc	0,75 %
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	0,75 %
Man Convertibles Global DR H USD Acc	0,75 %
Man Convertibles Global I EUR Acc	0,75 %
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	0,75 %
Man Convertibles Global I H CHF Acc	0,75 %
Man Convertibles Global I H USD Acc	0,75 %
Man AHL Trend Alternative	
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	2,00 %
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	2,00 %
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	1,50 %
Man AHL Alpha Core Alternative	
Man AHL Alpha Core Alternative DN H EUR Acc ⁽¹⁾	1,75 %
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	1,75 %
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H SEK Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	1,00 %

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 27. März 2023 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Die Anlageverwalter können eine erfolgsabhängige Vergütung auf Grundlage des Wertzuwachses im Nettovermögen jedes der unten genannten Teilfonds erhalten. Entsprechend wird diese Erfolgsgebühr sowohl im Hinblick auf nicht realisierte Wertzuwächse als auch realisierte Gewinne angepasst.

Ebenso kann die Erfolgsgebühr auf nicht realisierte Gewinne entrichtet werden, die möglicherweise im Anschluss nie realisiert werden. Die Erfolgsgebühr kann für den Anlageverwalter einen Anreiz darstellen, riskantere Anlagen für den Teilfonds zu tätigen als im Falle einer nicht vorhandenen Erfolgsgebühr.

In der nachstehenden Tabelle ist in der Spalte „Erfolgsgebühren“ der Saldo für Erfolgsgebühren zusammengefasst, die speziell während des aktuellen Berichtszeitraums aufgelaufen sind. Darüber hinaus zeigt der Abschnitt „Verbindlichkeiten aus Erfolgsgebühren“ die Summe der bisher aufgelaufenen, aber noch nicht gezahlten Erfolgsgebühren für jede einzelne Anteilsklasse. Dieser Saldo beinhaltet alle Beträge, die vor dem aktuellen Berichtszeitraum aufgelaufen sind und entsprechend vorgetragen wurden.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 haben die Anlageverwalter die folgenden Erfolgsgebühren erhalten:

	Währung	Erfolgsgebühren		Zu entrichtende Erfolgsgebühren
		Betrag	% des durchschnittlichen NIW der Anteilsklasse	Betrag
Man AHL Trend Alternative				
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	USD	8.766,88	1,26 %	11.948,46
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	USD	2.024,12	0,07 %	21.670,26
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	USD	301.314,46	0,49 %	925.329,05
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	USD	20.217,63	0,14 %	85.418,03
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	USD	292.464,15	0,30 %	1.035.462,00
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	USD	48.334,39	1,11 %	99.807,51
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	USD	184,86	0,30 %	662,01
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	USD	6.004,78	0,18 %	6.004,78
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	USD	400.905,01	0,41 %	1.197.103,28
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	USD	1.590.754,84	0,65 %	3.965.865,16
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	USD	38.603,54	0,34 %	167.019,08
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	USD	893.304,55	0,55 %	2.700.712,46
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	USD	154.883,81	0,27 %	692.800,39
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	USD	1.508.183,18	0,48 %	4.080.926,01
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	USD	104.030,81	0,56 %	283.595,60
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	USD	53.856,52	0,66 %	53.856,52
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	USD	3.974,59	0,51 %	14.949,37
Man AHL Alpha Core Alternative				
Man AHL Alpha Core Alternative DN H EUR Acc ⁽¹⁾	USD	1.664,41	1,49 %	1.664,41
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	USD	1.412,18	0,32 %	1.412,12
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	USD	122.195,07	0,55 %	122.039,48
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc	USD	826,08	0,05 %	826,08
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	USD	77.002,37	0,38 %	72.005,58
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc	USD	1.109,08	0,60 %	4.500,79
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	USD	82.272,55	0,13 %	108.717,24
Man AHL Alpha Core Alternative IN H SEK Acc	USD	17.764,73	0,47 %	25.295,99
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	USD	101.622,81	0,41 %	101.623,09

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 27. März 2023 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative

Eine jährliche Erfolgsgebühr (die „Erfolgsgebühr“) wird bewertungstäglich zu einem Satz von maximal 20 % des neuen, auf die jeweilige Anteilsklasse entfallenden Nettowertzuwachses berechnet. Der Begriff „Performance-Zeitraum“ hat die Bedeutung, die ihm im Folgenden zugeschrieben wird. Die Erfolgsgebühr wird täglich berechnet und abgegrenzt, ist jedoch jährlich innerhalb des vierzigsten (40.) Geschäftstages nach dem letzten Bewertungstag im März zahlbar.

Unter „neuer Nettowertzuwachs“ ist jede überdurchschnittliche Performance (falls zutreffend) des Nettoinventarwerts jeder Anteilsklasse (vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren, jedoch berichtigt um Erfolgsgebühren, die aufgrund von Anteilsrücknahmen fällig sind) nach Abzug aller Gebühren (wie Managementgebühren oder Verwaltungs- und Betriebskosten) gegenüber der High Water Mark (gemäß nachstehender Definition) am Ende des betroffenen Performance-Zeitraums zu verstehen.

Unter der an jedem Bewertungstag berechneten „High Water Mark“ ist der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse am letzten Tag für die Performance zu verstehen, an dem eine Erfolgsgebühr für die jeweilige Anteilsklasse fällig wurde. Die High Water Mark wird für jede Anteilsklasse anteilig um den Betrag der Rücknahmen, Dividenden und Ausschüttungen vermindert und dann um den Betrag der Zeichnungen an jedem Bewertungstag innerhalb des entsprechenden Performance-Zeitraums erhöht. Zum Zwecke der Berechnung der Erfolgsgebühr wird der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren berechnet. Die Hauptverwaltungsstelle kann (in Absprache mit dem Anlageverwalter) entsprechende Anpassungen an der High Water Mark vornehmen, um die High Water Mark in einer Weise festzulegen, die sonstigen Veränderungen infolge von Zeichnungen, Rücknahmen, Dividenden, Ausschüttungen und weiteren vergleichbaren Ereignissen Rechnung trägt. Der Performance-Bezugszeitraum entspricht der gesamten Laufzeit des Teilfonds.

„Performance-Zeitraum“ bezeichnet im Zusammenhang mit jedem Anteil den Zeitraum, der an dem Datum, an dem eine Erfolgsgebühr zuletzt fällig war (oder dem Beginn des ersten Performance-Zeitraums für neu ausgegebene Aktien), beginnt, je nachdem, welcher Zeitpunkt später eintritt, bis zum Börsenschluss des letzten Bewertungstags im März (der „Performance-Tag“) und anschließend jeden 12-Monatszeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der auf den unmittelbar vorausgehenden Performance-Tag (wie oben definiert) folgt, und am Börsenschluss des letzten Bewertungstags im März endet.

Erfolgsgebühren werden an jedem Bewertungstag berechnet und abgegrenzt, sind jedoch jährlich innerhalb des vierzigsten (40.) Geschäftstages nach dem letzten Bewertungstag im März zahlbar. Sie stellen Verbindlichkeiten in den Büchern der entsprechenden Anteilsklassen dar und werden im offiziellen Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse berücksichtigt. Wenn ein Anteilinhaber seine Anteile mitten im betreffenden Performance-Zeitraum zurückgibt, wird die auf dessen Anteile umgelegte Verbindlichkeit durch die am unmittelbar vorangehenden Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühr sofort fällig. Im Falle einer Verschmelzung des Teilfonds mit einem anderen bestehenden Teilfonds innerhalb des Fonds oder einem anderen OGAW wird die anteilig aufgelaufene Verbindlichkeit der Erfolgsgebühr am Bewertungstag, der dem Datum des Inkrafttretens einer solchen Verschmelzung unmittelbar vorausgeht, sofort fällig und zahlbar. Wird dieser Teilfonds mit einem neu aufgelegten übernehmenden OGAW oder einem Teilfonds ohne Performancegeschichte und mit einer Anlagepolitik, die sich nicht wesentlich von derjenigen dieses Teilfonds unterscheidet, verschmolzen, ist jedoch keine Performancegebühr fällig und zahlbar. In diesem Fall gilt der Performance-Bezugszeitraum weiter für den übernehmenden OGAW oder Teilfonds.

Wenn der Anlageverwalter während des Performance-Zeitraums von seinem Amt abberufen wird, werden am letzten Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühren berechnet und ausgezahlt, als wäre der letzte Bewertungstag auf das Ende des entsprechenden Performance-Zeitraums gefallen.

Bitte beachten Sie, dass die von jedem Anteilinhaber der Anteilsklassen des Teilfonds zu entrichtenden Erfolgsgebühren möglicherweise nicht der Wertentwicklung der betreffenden Anteilsklasse entsprechen. Dies liegt daran, dass der Teilfonds die Erfolgsgebühren nicht nach Verfahren abrechnet, die auf Ausgleichskonten oder Fondsserien basieren. Infolgedessen kann die Erfolgsgebühr, die den Anteilinhabern belastet wird, positiv oder negativ durch das Tagesgeschäft beeinflusst werden.

Für die Performance-Zeiträume zu bezahlende Erfolgsgebühren werden jährlich rückwirkend an die Man Investments AG ausbezahlt, die einen wesentlichen Anteil daraus an den Anlageverwalter für dessen Dienstleistungen weiterleiten wird.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative

Eine jährliche Erfolgsgebühr (die „Erfolgsgebühr“) wird bewertungstäglich zu einem Satz von maximal 15 % des neuen, auf die jeweilige Anteilsklasse entfallenden Nettowertzuwachses berechnet. Der Performance-Zeitraum ist der Zeitraum ab dem letzten Zeitpunkt einer gezahlten Erfolgsgebühr (oder ab der Auflegung für den ersten Performance-Zeitraum) bis einschließlich dem letzten Bewertungstag im Geschäftsjahr des Fonds (der „Performance-Tag“). Die Erfolgsgebühr wird täglich berechnet und abgegrenzt, ist jedoch jährlich innerhalb des vierzigsten (40.) Geschäftstages nach dem Ende jedes Geschäftsjahrs zahlbar.

Unter „neuer Nettowertzuwachs“ ist jede überdurchschnittliche Performance (falls zutreffend) des Nettoinventarwerts jeder Anteilsklasse (vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren, jedoch berichtigt um Erfolgsgebühren, die aufgrund von Anteilsrücknahmen fällig sind) nach Abzug aller Gebühren (wie Managementgebühren oder Verwaltungs- und Betriebskosten) gegenüber der High Water Mark (gemäß nachstehender Definition) am Ende des betroffenen Performance-Zeitraums zu verstehen.

Unter der an jedem Bewertungstag berechneten „High Water Mark“ ist der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse am letzten Tag für die Performance zu verstehen, an dem eine Erfolgsgebühr für die jeweilige Anteilsklasse fällig wurde. Die High Water Mark wird für jede Anteilsklasse anteilig um den Betrag der Rücknahmen, Dividenden und Ausschüttungen vermindert und dann um den Betrag der Zeichnungen an jedem Bewertungstag innerhalb des entsprechenden Performance-Zeitraums erhöht. Zum Zwecke der Berechnung der Erfolgsgebühr wird der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren berechnet. Die Hauptverwaltungsstelle kann (in Absprache mit dem Anlageverwalter) entsprechende Anpassungen an der High Water Mark vornehmen, um die High Water Mark in einer Weise festzulegen, die sonstigen Veränderungen infolge von Zeichnungen, Rücknahmen, Dividenden, Ausschüttungen und weiteren vergleichbaren Ereignissen Rechnung trägt. Der Performance-Bezugszeitraum entspricht der gesamten Laufzeit des Teilfonds.

Erfolgsgebühren werden an jedem Bewertungstag berechnet und abgegrenzt, sind jedoch jährlich innerhalb des vierzigsten (40.) Geschäftstages nach dem Ende jedes Geschäftsjahrs zahlbar. Sie stellen Verbindlichkeiten in den Büchern der entsprechenden Anteilsklassen dar und werden im offiziellen Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse berücksichtigt. Wenn ein Anteilinhaber seine Anteile mitten im betreffenden Performance-Zeitraum zurückgibt, wird die auf dessen Anteile umgelegte Verbindlichkeit durch die am unmittelbar vorangehenden Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühr sofort fällig. Im Falle einer Verschmelzung des Teilfonds mit einem anderen bestehenden Teilfonds innerhalb des Fonds oder einem anderen OGAW wird die anteilig aufgelaufene Verbindlichkeit der Erfolgsgebühr am Bewertungstag, der dem Datum des Inkrafttretens einer solchen Verschmelzung unmittelbar vorausgeht, sofort fällig und zahlbar. Wird dieser Teilfonds mit einem neu aufgelegten übernehmenden OGAW oder einem Teilfonds ohne Performancegeschichte und mit einer Anlagepolitik, die sich nicht wesentlich von derjenigen dieses Teilfonds unterscheidet, verschmolzen, ist jedoch keine Performancegebühr fällig und zahlbar. In diesem Fall gilt der Performance-Bezugszeitraum weiter für den übernehmenden OGAW oder Teilfonds.

Wenn der Anlageverwalter während des Performance-Zeitraums von seinem Amt abberufen wird, werden am letzten Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühren berechnet und ausgezahlt, als wäre der letzte Bewertungstag auf das Ende des entsprechenden Performance-Zeitraums gefallen.

Bitte beachten Sie, dass die von jedem Anteilinhaber der Anteilsklassen des Teilfonds zu entrichtenden Erfolgsgebühren möglicherweise nicht der Wertentwicklung der betreffenden Anteilsklasse entsprechen. Dies liegt daran, dass der Teilfonds die Erfolgsgebühren nicht nach Verfahren abrechnet, die auf Ausgleichskonten oder Fondsserien basieren. Infolgedessen kann die Erfolgsgebühr, die den Anteilinhabern belastet wird, positiv oder negativ durch das Tagesgeschäft beeinflusst werden.

Für die Performance-Zeiträume zu bezahlende Erfolgsgebühren werden jährlich rückwirkend an die Man Investments AG ausbezahlt, die einen wesentlichen Anteil daraus an den Anlageverwalter für dessen Dienstleistungen weiterleiten wird.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 7 – Steuern und zahlbare Aufwendungen

	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
Abonnementsteuer (Erläuterung 5)	12.306,76	84.827,08	5.817,13
Administrationsgebühren, Gebühren der Domizilstelle, Verwahrstelle, Zahl- und Transferstelle	85.153,01	232.012,26	55.459,27
Honorare	3.533,04	45.154,04	5.883,96
Veröffentlichung, Druck und behördliche Gebühren	47.480,80	93.116,31	34.891,83
Summe	148.473,61	455.109,69	102.052,19

Erläuterung 8 – Transaktionskosten

Die Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf und Verkauf von Finanzinstrumenten sind unter „Transaktionskosten“ in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

Die Transaktionskosten beziehen sich hauptsächlich auf Maklergebühren.

Erläuterung 9 – Sonstige Aufwendungen

Zu den sonstigen Aufwendungen zählen behördliche Gebühren, Datengebühren, Zahlstellengebühren, Gebühren für die Verwaltungsratsmitglieder, Luxemburgische Mehrwertsteuer, Steuergebühren, CSSF-Gebühren, Versicherungsgebühren und Gebühren für die Veröffentlichung von Daten.

Erläuterung 10 – Verbundene Parteien

Parteien gelten als verbunden, wenn eine Partei die andere Partei bei finanziellen oder operativen Entscheidungen kontrollieren oder maßgeblichen Einfluss auf die andere Partei ausüben kann. Es gab keine Transaktionen mit verbundenen Parteien außer jenen im normalen Geschäftsverlauf. Der Anlageverwalter, die Verwaltungsgesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder werden als mit der Gesellschaft verbunden angesehen. Die an den Anlageverwalter, die Verwaltungsgesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder während des Berichtszeitraums entrichteten Gebühren werden in der Gewinn- und Verlustrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte

Man Convertibles Global

Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten							1.943.045,62
AUD	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	243.377,61	(148.292,02)	148.491,62	159,65
CHF	EUR	Citigroup	4. Jul. 23	20.960,51	(21.357,61)	21.474,55	120,79
CHF	EUR	Citigroup	6. Jul. 23	135.105,52	(138.207,87)	138.418,85	252,32
EUR	AUD	Citigroup	13. Jul. 23	1.547.226,68	(2.469.187,50)	1.547.226,68	41.121,31
EUR	HKD	Citigroup	13. Jul. 23	5.568.310,31	(47.208.200,73)	5.568.310,31	49.211,05
EUR	JPY	Citigroup	13. Jul. 23	15.530.917,70	(2.336.083.918,00)	15.530.917,70	694.591,23
EUR	SGD	Citigroup	13. Jul. 23	1.435.326,84	(2.081.000,00)	1.435.326,84	26.157,57
EUR	USD	Citigroup	13. Jul. 23	133.141.721,27	(144.120.776,27)	133.141.721,27	1.130.738,47
GBP	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	564.874,40	(657.184,89)	658.252,06	689,30
USD	EUR	Citigroup	3. Jul. 23	75.373,40	(69.075,00)	69.086,53	3,93
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten							(317.743,18)
EUR	GBP	Citigroup	13. Jul. 23	436.712,52	(375.296,72)	436.712,52	(372,51)
EUR	USD	Citigroup	13. Jul. 23	1.419.043,06	(1.554.483,30)	1.419.043,06	(4.835,62)
HKD	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	30.629.559,45	(3.623.313,94)	3.582.507,27	(42.405,35)
JPY	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	558.059.500,00	(3.706.731,58)	3.539.017,96	(162.757,98)
SGD	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	841.507,70	(581.071,20)	569.932,17	(11.234,35)
USD	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	23.159.753,87	(21.310.006,66)	21.228.005,38	(96.137,37)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisenkontrakte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten							228.770,39
CHF	EUR	Citigroup	31. Jul. 23	63.745.621,58	(65.231.664,11)	65.308.921,23	194.738,28
EUR	CHF	Citigroup	31. Jul. 23	40.341,47	(39.248,86)	40.341,47	57,63
EUR	USD	Citigroup	31. Jul. 23	68.978,41	(75.373,40)	68.978,41	6,76
USD	EUR	Citigroup	31. Jul. 23	14.106.646,40	(12.874.548,89)	12.930.015,03	33.967,72
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten							(3.090,03)
EUR	CHF	Citigroup	31. Jul. 23	891.136,50	(870.823,29)	891.136,50	(2.643,02)
EUR	USD	Citigroup	31. Jul. 23	125.511,00	(137.648,23)	125.511,00	(447,01)

Man AHL Trend Alternative

Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten							168.298.490,22
AUD	EUR	HSBC London	16. Aug. 23	63.265.056,29	(38.400.000,00)	42.112.384,54	210.421,78
AUD	EUR	HSBC London	03. Jul. 23	24.912.661,79	(15.200.000,00)	16.583.113,25	13.053,15
AUD	GBP	HSBC London	05. Jul. 23	1.241.161,00	(650.000,00)	826.178,82	1.599,77
AUD	GBP	HSBC London	03. Jul. 23	3.342.850,60	(1.750.000,00)	2.225.168,49	5.039,04
AUD	JPY	HSBC London	05. Jul. 23	2.800.000,00	(268.404.340,00)	1.863.819,99	4.930,56
AUD	JPY	HSBC London	25. Aug. 23	72.100.000,00	(6.850.274.435,00)	47.993.364,80	229.920,30
AUD	JPY	HSBC London	03. Jul. 23	5.000.000,00	(477.753.210,00)	3.328.249,99	20.414,61
AUD	NZD	HSBC London	27. Jul. 23	166.700.000,00	(179.146.917,97)	110.963.854,54	1.214.276,98
AUD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	71.757,31	(47.623,56)	47.765,25	206,85
AUD	USD	HSBC London	21. Jul. 23	110.600.000,00	(73.380.493,62)	73.620.889,69	360.176,18
AUD	USD	HSBC London	03. Jul. 23	2.800.000,00	(1.849.479,56)	1.863.819,99	16.278,04
AUD	USD	Citigroup	20. Jul. 23	10.500.000,00	(6.994.211,08)	6.989.324,97	6.254,42
BRL	USD	HSBC London	05. Jul. 23	649.000.000,00	(130.971.826,93)	134.535.766,61	4.508.870,09
BRL	USD	HSBC London	02. Aug. 23	308.626.350,00	(63.102.592,52)	63.977.322,95	974.718,86
BRL	USD	HSBC London	05. Sep. 23	262.229.167,00	(53.668.830,92)	54.359.325,13	451.073,50
CAD	EUR	Citigroup	06. Sep. 23	3.625.348,70	(2.500.000,00)	2.739.730,74	4.549,48
CAD	USD	HSBC London	07. Jul. 23	1.059.000.000,00	(783.959.933,24)	800.302.286,04	16.182.342,75
CAD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	17.492,55	(13.127,17)	13.219,38	90,92

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
CHF	EUR	HSBC London	15. Aug. 23	12.402.986,56	(12.700.000,00)	13.863.507,03	28.976,22
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	07. Aug. 23	108.700.000,00	(121.138.533,38)	121.500.027,94	754.168,23
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	3.300.000,00	(3.669.761,07)	3.688.593,30	16.177,23
CLP	USD	HSBC London	27. Jul. 23	29.850.000.000,00	(36.833.742,19)	37.222.950,00	269.807,81
CLP	USD	HSBC London	22. Aug. 23	9.145.000.000,00	(11.283.259,41)	11.403.815,00	38.250,59
CLP	USD	HSBC London	03. Okt. 23	3.500.000.000,00	(4.308.455,40)	4.364.500,00	7.044,60
COP	USD	HSBC London	23. Aug. 23	132.499.526.065,00	(29.614.315,66)	31.667.386,73	1.523.072,95
EUR	AUD	HSBC London	16. Aug. 23	121.800.000,00	(197.554.963,61)	132.883.841,19	1.406.670,81
EUR	CAD	Citigroup	05. Jul. 23	1.200.000,00	(1.730.940,00)	1.309.200,41	1.874,82
EUR	CAD	Citigroup	06. Sep. 23	900.000,00	(1.299.304,09)	981.900,30	2.756,33
EUR	CHF	HSBC London	15. Aug. 23	40.700.000,00	(39.491.287,28)	44.403.713,77	194.223,12
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	05. Jul. 23	3.300.000,00	(2.833.601,00)	3.600.301,12	2.952,89
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	13.300.000,00	(11.400.855,66)	14.510.304,50	66.167,97
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	700.000,00	(259.550.340,00)	763.700,24	4.660,99
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	08. Aug. 23	595.500.000,00	(89.398.451.827,00)	649.690.701,40	27.589.554,90
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	05. Jul. 23	1.900.000,00	(298.712.400,00)	2.072.900,64	2.559,11
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	900.000,00	(141.617.110,00)	981.900,30	599,66
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	09. Aug. 23	54.600.000,00	(633.520.850,18)	59.568.618,47	620.771,94
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	11. Sep. 23	68.800.000,00	(801.648.285,81)	75.060.823,27	770.680,66
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	200.000,00	(2.353.654,00)	218.200,07	52,87
EUR	USD	HSBC London	05. Jul. 23	335.200.000,00	(358.634.016,02)	365.703.313,37	7.199.576,80
GBP	AUD	HSBC London	05. Jul. 23	300.000,00	(571.224,00)	381.405,22	340,81
GBP	AUD	HSBC London	20. Sep. 23	50.458.836,00	(94.894.466,53)	64.150.878,82	716.682,71
GBP	AUD	HSBC London	03. Jul. 23	100.000,00	(190.231,50)	127.135,07	237,47
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	50.371.564,33	(58.200.000,00)	64.039.925,92	321.984,51
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	5.684.568,49	(6.600.000,00)	7.227.080,39	16.834,21
GBP	JPY	Citigroup	27. Jul. 23	215.000.000,00	(36.800.156.651,00)	273.340.410,52	16.908.404,86
GBP	JPY	Citigroup	05. Jul. 23	1.850.000,00	(337.973.100,00)	2.351.998,88	6.181,59
GBP	JPY	Citigroup	03. Jul. 23	2.500.000,00	(456.339.300,00)	3.178.376,87	12.044,74
GBP	USD	HSBC London	07. Jul. 23	1.050.000,00	(1.326.196,20)	1.334.918,28	7.305,90
GBP	USD	HSBC London	12. Jul. 23	643.600.000,00	(803.258.912,16)	818.241.340,51	14.149.129,44
GBP	USD	HSBC London	13. Jul. 23	2.099,88	(2.638,36)	2.669,68	28,63
GBP	USD	HSBC London	12. Sep. 23	20.950.000,00	(26.478.658,30)	26.634.798,14	132.555,44
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	10.114.371.431,10	(26.600.000,00)	29.583.828,42	135.733,07
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	537.796.780,44	(1.566.287,20)	1.573.017,94	1.971,23
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	08. Aug. 23	7.130.000.000,00	(20.527.716,87)	20.854.750,89	115.843,44
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	28. Jul. 23	16.210.000.000,00	(46.611.132,93)	47.413.115,28	445.686,59
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	31. Aug. 23	5.420.000.000,00	(15.501.478,39)	15.853.120,59	109.964,41
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	26. Okt. 23	4.606.297.298,00	(13.107.916,19)	13.473.097,15	19.294,11
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	6.801.209,00	(1.831.030,51)	1.832.742,15	3.364,38
INR	USD	Citigroup	07. Jul. 23	6.466.954.226,00	(78.392.918,17)	78.832.172,47	355.183,44

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
INR	USD	Citigroup	24. Jul. 23	3.950.000.000,00	(47.633.695,16)	48.150.500,28	437.804,84
INR	USD	Citigroup	11. Aug. 23	3.175.000.000,00	(38.399.118,13)	38.703.250,22	215.231,87
INR	USD	Citigroup	18. Aug. 23	320.000.000,00	(3.889.793,05)	3.900.800,02	1.086,95
JPY	AUD	HSBC London	25. Aug. 23	9.551.507,00	(100.000,00)	66.084,39	30,72
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	08. Aug. 23	1.146.041.042,00	(7.300.000,00)	7.929.159,98	9.235,68
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	47.247.180,00	(300.000,00)	326.890,95	87,37
JPY	USD	HSBC London	13. Jul. 23	945.393,00	(6.536,33)	6.540,93	27,43
JPY	USD	HSBC London	03. Jul. 23	490.000.000,00	(3.384.343,12)	3.390.182,59	11.827,28
KRW	USD	HSBC London	05. Jul. 23	39.500.000.000,00	(29.889.444,23)	29.977.734,99	127.790,77
MXN	USD	Citigroup	13. Jul. 23	5.758.539.088,00	(318.797.950,74)	335.763.146,70	16.533.297,42
MXN	USD	Citigroup	05. Jul. 23	6.500.000,00	(378.937,23)	378.995,51	227,27
MXN	USD	Citigroup	25. Aug. 23	489.500.000,00	(27.277.683,17)	28.541.277,19	988.494,33
MXN	USD	Citigroup	20. Sep. 23	1.342.039.088,00	(76.286.510,43)	78.250.274,99	837.791,90
MXN	USD	Citigroup	03. Jul. 23	18.500.000,00	(1.079.476,97)	1.078.679,53	183,03
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	09. Aug. 23	1.217.679.086,73	(103.000.000,00)	113.658.170,87	930.457,40
NOK	SEK	Citigroup	15. Aug. 23	752.500.000,00	(734.250.447,01)	70.238.353,03	1.968.625,32
NOK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	417.085,50	(38.557,85)	38.930,76	295,75
NOK	USD	Citigroup	03. Jul. 23	9.000.000,00	(835.596,41)	840.060,04	2.447,59
NZD	AUD	HSBC London	27. Jul. 23	6.310.613,83	(5.800.000,00)	3.866.198,33	5.348,87
NZD	USD	HSBC London	12. Jul. 23	4.700.000,00	(2.881.407,71)	2.879.455,57	3.503,99
NZD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	16.349,45	(9.928,20)	10.016,49	107,21
NZD	USD	HSBC London	03. Jul. 23	7.100.000,00	(4.321.048,41)	4.349.815,87	37.236,89
NZD	USD	Citigroup	11. Jul. 23	214.700.000,00	(130.365.658,81)	131.535.981,25	1.420.206,99
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	18. Jul. 23	40.000.000,00	(10.622.571,25)	11.035.079,41	383.828,75
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	64.000.000,00	(17.387.667,80)	17.656.127,06	180.204,21
PHP	USD	HSBC London	10. Jul. 23	1.570.000.000,00	(28.009.693,79)	28.442.120,19	374.336,21
PHP	USD	HSBC London	11. Aug. 23	1.827.500.000,00	(32.602.753,33)	33.106.990,22	412.861,67
PHP	USD	HSBC London	18. Aug. 23	1.405.000.000,00	(25.195.295,11)	25.452.980,17	183.219,89
PLN	EUR	HSBC London	24. Aug. 23	515.972.978,94	(114.704.350,00)	126.994.884,97	1.106.373,19
PLN	EUR	HSBC London	03. Jul. 23	1.334.450,70	(300.000,00)	328.444,36	988,29
PLN	USD	HSBC London	13. Jul. 23	29.107.124,53	(7.150.796,65)	7.164.049,44	7.431,17
PLN	USD	HSBC London	23. Aug. 23	132.600.000,00	(31.764.098,64)	32.636.441,12	777.797,77
PLN	USD	HSBC London	26. Jul. 23	166.100.000,00	(40.067.547,93)	40.881.695,85	749.367,77
PLN	USD	HSBC London	18. Okt. 23	41.500.000,00	(10.025.182,95)	10.214.270,79	131.485,56
RON	EUR	HSBC London	27. Sep. 23	10.494.850,64	(2.100.000,00)	2.308.793,77	2.274,59
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	73.189.742,17	(6.200.000,00)	6.775.979,73	19.353,86
SEK	NOK	Citigroup	15. Aug. 23	119.626.205,78	(119.000.000,00)	11.075.114,09	14.261,29
SEK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	17.509.397,72	(1.611.500,69)	1.621.037,60	12.583,50
SEK	USD	Citigroup	03. Jul. 23	7.000.000,00	(643.856,25)	648.067,02	5.092,75
SGD	USD	Citigroup	14. Aug. 23	9.500.000,00	(7.034.194,42)	7.019.617,99	2.959,08
SGD	USD	Citigroup	03. Jul. 23	3.900.000,00	(2.875.431,87)	2.881.737,91	8.789,73
THB	USD	Citigroup	12. Jul. 23	197.500.000,00	(5.538.014,61)	5.570.487,44	39.187,89
USD	AUD	HSBC London	13. Jul. 23	9.688.652,54	(14.149.105,54)	9.688.652,54	257.353,40
USD	AUD	HSBC London	21. Jul. 23	362.801.507,87	(538.300.000,00)	362.801.507,87	3.896.601,91
USD	AUD	Citigroup	20. Jul. 23	94.188.349,30	(141.099.543,00)	94.188.349,30	115.660,54
USD	BRL	HSBC London	05. Jul. 23	28.907.297,75	(138.144.483,00)	28.907.297,75	69.283,17
USD	BRL	HSBC London	02. Aug. 23	1.796.346,50	(8.600.000,00)	1.796.346,50	10.874,35
USD	CAD	HSBC London	07. Jul. 23	41.670.963,51	(54.400.000,00)	41.670.963,51	568.224,01
USD	CAD	HSBC London	13. Jul. 23	9.327,64	(12.319,30)	9.327,64	18,67
USD	CAD	HSBC London	05. Jul. 23	1.889.865,58	(2.500.000,00)	1.889.865,58	1.020,53
USD	CAD	HSBC London	15. Aug. 23	39.346.317,28	(51.700.000,00)	39.346.317,28	258.495,77
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	05. Jul. 23	335.390,42	(300.000,00)	335.390,42	228,21
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	07. Aug. 23	569.358.129,71	(504.500.000,00)	569.358.129,71	3.612.855,05

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	447.093,72	(400.000,00)	447.093,72	313,24
USD	CLP	HSBC London	27. Jul. 23	21.952.905,29	(17.610.000.000,00)	21.952.905,29	63.880,21
USD	CNH	HSBC London	12. Jul. 23	70.631.120,37	(497.500.000,00)	70.631.120,37	2.113.874,47
USD	CNH	HSBC London	17. Aug. 23	59.574.039,29	(428.500.000,00)	59.574.039,29	382.527,98
USD	CNH	HSBC London	24. Jul. 23	40.994.935,19	(289.000.000,00)	40.994.935,19	1.150.509,24
USD	CNH	HSBC London	04. Aug. 23	128.605.738,16	(917.500.000,00)	128.605.738,16	1.994.987,27
USD	CNH	HSBC London	10. Aug. 23	33.326.840,94	(238.000.000,00)	33.326.840,94	468.155,11
USD	COP	HSBC London	23. Aug. 23	903.309,62	(3.800.000.000,00)	903.309,62	10.528,99
USD	EUR	HSBC London	05. Jul. 23	354.614.053,94	(322.600.000,00)	354.614.053,94	2.531.408,01
USD	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	36.169,34	(33.098,27)	36.169,34	30,18
USD	GBP	HSBC London	07. Jul. 23	1.465.483,12	(1.150.000,00)	1.465.483,12	4.980,62
USD	GBP	HSBC London	12. Jul. 23	101.909.436,32	(79.950.000,00)	101.909.436,32	368.428,38
USD	GBP	HSBC London	13. Jul. 23	25.936,28	(20.366,40)	25.936,28	69,58
USD	GBP	Citigroup	13. Jul. 23	20.222,62	(15.901,30)	20.222,62	26,90
USD	GBP	Citigroup	03. Jul. 23	840.477,41	(660.943,74)	840.477,41	1.100,65
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	3.754,59	(1.277.940,00)	3.754,59	28,12
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	28. Jul. 23	5.332.751,67	(1.835.368.244,00)	5.332.751,67	4.809,10
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	05. Jul. 23	270.080,49	(1.000.000,00)	270.080,49	488,45
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	111.908.965,41	(407.198.791,00)	111.908.965,41	2.079.786,73
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Sep. 23	9.056.007,17	(33.000.000,00)	9.056.007,17	131.830,47
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	23. Okt. 23	33.983.623,15	(123.000.000,00)	33.983.623,15	659.785,98
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	03. Jul. 23	676.218,53	(2.500.000,00)	676.218,53	2.268,43
USD	INR	Citigroup	07. Jul. 23	45.924.868,62	(3.765.000.000,00)	45.924.868,62	78.547,40
USD	JPY	HSBC London	27. Jul. 23	235.455.178,53	(32.520.000.000,00)	235.455.178,53	9.089.294,53
USD	JPY	HSBC London	13. Jul. 23	15.595.672,42	(2.174.589.613,00)	15.595.672,42	496.709,35
USD	JPY	HSBC London	03. Jul. 23	554.637,51	(80.000.000,00)	554.637,51	160,65
USD	KRW	HSBC London	05. Jul. 23	6.365.921,20	(8.300.000.000,00)	6.365.921,20	58.425,21
USD	KRW	HSBC London	07. Aug. 23	37.322.154,27	(48.500.000.000,00)	37.322.154,27	396.884,39
USD	KRW	HSBC London	18. Aug. 23	87.757.937,34	(113.300.000.000,00)	87.757.937,34	1.439.402,09
USD	MXN	Citigroup	13. Jul. 23	19.250.001,63	(329.460.912,00)	19.250.001,63	65.005,25
USD	MXN	Citigroup	03. Jul. 23	12.622.138,91	(216.000.000,00)	12.622.138,91	16.386,20
USD	NOK	Citigroup	13. Jul. 23	18.882,77	(201.758,34)	18.882,77	87,93
USD	NOK	Citigroup	09. Aug. 23	63.610.573,13	(672.000.000,00)	63.610.573,13	941.055,39
USD	NZD	HSBC London	12. Jul. 23	27.804.949,08	(45.043.095,00)	27.804.949,08	157.011,88
USD	NZD	HSBC London	13. Jul. 23	49.532,68	(80.151,29)	49.532,68	335,29
USD	NZD	HSBC London	07. Sep. 23	18.334.445,24	(29.800.000,00)	18.334.445,24	47.840,21
USD	NZD	Citigroup	11. Jul. 23	117.473.261,81	(185.500.000,00)	117.473.261,81	3.610.976,55
USD	NZD	Citigroup	17. Aug. 23	3.431.337,44	(5.500.000,00)	3.431.337,44	56.012,31
USD	PLN	HSBC London	26. Jul. 23	12.387.267,26	(50.000.000,00)	12.387.267,26	100.565,21
USD	SEK	Citigroup	13. Jul. 23	46.474,06	(497.662,56)	46.474,06	313,18
USD	SEK	Citigroup	17. Aug. 23	42.477.832,07	(451.500.000,00)	42.477.832,07	525.023,39
USD	SGD	Citigroup	10. Jul. 23	10.158.762,97	(13.700.000,00)	10.158.762,97	24.083,07
USD	SGD	Citigroup	14. Aug. 23	126.176.270,60	(169.300.000,00)	126.176.270,60	765.470,93
USD	SGD	Citigroup	03. Jul. 23	1.628.076,73	(2.200.000,00)	1.628.076,73	1.079,85
USD	THB	Citigroup	12. Jul. 23	5.423.103,62	(187.500.000,00)	5.423.103,62	128.136,68
USD	THB	Citigroup	26. Jul. 23	5.776.544,57	(200.000.000,00)	5.776.544,57	119.206,48
USD	TWD	Citigroup	07. Jul. 23	26.622.618,39	(815.000.000,00)	26.622.618,39	467.041,60
USD	TWD	Citigroup	21. Jul. 23	10.923.942,05	(335.000.000,00)	10.923.942,05	172.186,78
USD	TWD	Citigroup	22. Aug. 23	17.417.681,06	(537.500.000,00)	17.417.681,06	147.704,85
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	43.995.302,58	(814.000.000,00)	43.995.302,58	927.539,13
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	1.295.500.000,00	(66.949.258,10)	68.577.291,95	1.598.237,92

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten							(150.675.976,80)
AUD	EUR	HSBC London	16. Aug. 23	189.793.857,82	(117.200.000,00)	126.336.280,93	(1.551.907,16)
AUD	GBP	HSBC London	20. Sep. 23	3.725.463,75	(2.000.000,00)	2.479.854,93	(52.370,03)
AUD	JPY	HSBC London	5. Jul. 23	1.900.000,00	(182.836.600,00)	1.264.734,99	(1.539,48)
AUD	JPY	HSBC London	25. Aug. 23	98.300.000,00	(9.441.961.744,00)	65.433.394,73	(396.056,71)
AUD	NZD	HSBC London	27. Jul. 23	71.500.000,00	(78.671.673,49)	47.593.974,80	(604.374,61)
AUD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	320.248,40	(217.926,57)	213.173,35	(4.462,43)
AUD	USD	HSBC London	21. Jul. 23	545.900.000,00	(368.050.179,55)	363.378.333,49	(4.080.634,83)
AUD	USD	Citigroup	20. Jul. 23	297.800.000,00	(199.587.482,86)	198.230.569,18	(1.040.947,06)
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 23	222.873.650,00	(46.399.985,31)	46.201.043,70	(126.735,27)
BRL	USD	HSBC London	5. Sep. 23	44.270.833,00	(9.156.494,74)	9.177.211,80	(19.703,14)
CAD	EUR	Citigroup	6. Sep. 23	82.053.545,55	(57.000.000,00)	62.009.103,00	(351.811,55)
CAD	USD	HSBC London	7. Jul. 23	40.700.000,00	(31.466.220,75)	30.757.604,38	(714.765,95)
CAD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	31.759,36	(24.066,48)	24.001,03	(67,82)
CAD	USD	HSBC London	15. Aug. 23	18.500.000,00	(14.066.846,11)	13.980.729,27	(79.976,61)
CHF	EUR	HSBC London	15. Aug. 23	45.384.690,18	(46.900.000,00)	50.728.989,19	(361.513,30)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	7. Aug. 23	322.900.000,00	(365.263.657,80)	360.923.266,08	(3.173.930,60)
CLP	USD	HSBC London	27. Jul. 23	29.950.000.000,00	(37.419.688,39)	37.347.650,00	(191.838,39)
CLP	USD	HSBC London	22. Aug. 23	13.005.000.000,00	(16.152.350,93)	16.217.235,00	(52.160,93)
CLP	USD	HSBC London	3. Okt. 23	10.200.000.000,00	(12.604.671,93)	12.719.400,00	(28.071,93)
CNH	USD	HSBC London	12. Jul. 23	497.500.000,00	(69.072.681,00)	68.386.844,38	(557.478,50)
CNH	USD	HSBC London	24. Jul. 23	12.000.000,00	(1.667.294,00)	1.649.531,92	(12.950,00)
COP	USD	HSBC London	23. Aug. 23	99.500.473.935,00	(23.493.471,23)	23.780.613,27	(110.859,87)
EUR	AUD	HSBC London	5. Jul. 23	1.700.000,00	(2.789.539,90)	1.854.700,57	(3.544,05)
EUR	AUD	HSBC London	16. Aug. 23	87.700.000,00	(144.410.349,74)	95.680.729,66	(429.215,99)
EUR	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	15.200.000,00	(25.060.328,00)	16.583.205,14	(111.443,74)
EUR	CAD	Citigroup	5. Jul. 23	1.600.000,00	(2.317.164,30)	1.745.600,54	(4.484,19)
EUR	CAD	Citigroup	6. Sep. 23	24.600.000,00	(35.683.473,84)	26.838.608,32	(52.460,13)
EUR	CHF	HSBC London	15. Aug. 23	17.600.000,00	(17.205.193,55)	19.201.605,95	(58.814,59)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	2.600.000,00	(2.237.035,00)	2.836.600,88	(3.389,36)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	18.300.000,00	(15.816.236,67)	19.965.306,19	(73.218,54)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	6.600.000,00	(5.694.852,00)	7.200.602,23	(29.895,42)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	1.600.000,00	(251.460.098,00)	1.745.600,54	(3.906,62)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	900.000,00	(141.807.000,00)	981.900,30	(947,11)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	1.300.000,00	(204.836.800,00)	1.418.300,44	(1.065,18)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	9. Aug. 23	100.300.000,00	(1.185.967.436,60)	109.427.333,92	(925.914,99)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	1.000.000,00	(11.773.440,10)	1.091.000,34	(5.029,84)
EUR	PLN	HSBC London	24. Aug. 23	5.200.000,00	(23.346.591,77)	5.673.201,76	(39.489,67)
EUR	PLN	HSBC London	3. Jul. 23	300.000,00	(1.333.452,00)	327.300,10	(742,73)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	1.900.000,00	(22.426.294,00)	2.072.900,64	(5.651,65)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	11. Sep. 23	10.900.000,00	(128.624.457,66)	11.891.903,69	(27.991,30)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	6.000.000,00	(70.936.286,20)	6.546.002,03	(28.695,05)
EUR	USD	HSBC London	5. Jul. 23	322.000.000,00	(354.010.321,65)	351.302.108,90	(2.583.063,65)
GBP	AUD	HSBC London	5. Jul. 23	250.000,00	(476.872,50)	317.837,69	(284,00)
GBP	AUD	HSBC London	20. Sep. 23	20.891.164,00	(39.790.433,30)	26.559.996,95	(37.663,09)
GBP	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	1.650.000,00	(3.150.560,00)	2.097.728,73	(3.904,29)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	66.398.701,92	(77.400.000,00)	84.416.039,26	(319.757,81)
GBP	JPY	Citigroup	27. Jul. 23	1.700.000,00	(310.533.047,00)	2.161.296,27	(1.794,25)
GBP	USD	HSBC London	7. Jul. 23	21.050.000,00	(26.829.803,99)	26.761.933,22	(96.261,89)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
GBP	USD	HSBC London	12. Jul. 23	7.000.000,00	(8.966.481,92)	8.899.455,23	(76.089,92)
GBP	USD	HSBC London	13. Jul. 23	11.840,76	(15.120,47)	15.053,76	(81,91)
GBP	USD	HSBC London	12. Sep. 23	71.600.000,00	(91.226.544,72)	91.028.713,46	(278.434,69)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	334.339.560,00	(900.000,00)	977.919,81	(4.890,00)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	7.686.100.944,00	(20.400.000,00)	22.481.307,22	(99.982,47)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	259.711.300,00	(700.000,00)	759.637,37	(4.185,73)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	2.013.919,00	(5.906,50)	5.890,57	(33,75)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	26. Okt. 23	863.702.702,00	(2.463.048,55)	2.526.269,94	(1.634,04)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	361.698.791,00	(99.630.157,30)	97.468.056,27	(2.074.206,15)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	2.500.000,00	(676.374,90)	673.682,49	(2.424,90)
INR	USD	Citigroup	7. Jul. 23	195.545.774,00	(2.382.016,53)	2.383.703,00	(855,64)
INR	USD	Citigroup	24. Aug. 23	890.000.000,00	(10.831.816,42)	10.849.100,06	(12.976,42)
INR	USD	Citigroup	11. Aug. 23	1.812.500.000,00	(22.088.164,40)	22.094.375,13	(44.539,40)
INR	USD	Citigroup	18. Aug. 23	8.687.500.000,00	(105.803.769,65)	105.900.625,61	(172.457,16)
JPY	AUD	HSBC London	25. Aug. 23	1.386.265.628,00	(14.600.000,00)	9.591.211,42	(53.122,18)
JPY	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	478.302.943,00	(5.000.000,00)	3.309.253,69	(16.608,96)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	78.378.046.655,00	(522.600.000,00)	542.277.324,95	(24.847.911,39)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	298.962.910,00	(1.900.000,00)	2.068.446,64	(1.312,49)
JPY	GBP	Citigroup	27. Jul. 23	25.273.381.847,00	(146.550.000,00)	174.859.957,42	(10.256.602,11)
JPY	GBP	Citigroup	3. Jul. 23	456.734.960,00	(2.500.000,00)	3.160.030,43	(9.306,01)
JPY	USD	HSBC London	27. Jul. 23	19.710.000.000,00	(142.287.251,40)	136.368.365,01	(5.114.126,68)
JPY	USD	HSBC London	13. Jul. 23	575.441.517,00	(4.034.124,04)	3.981.330,23	(38.896,87)
KRW	USD	HSBC London	5. Jul. 23	76.500.000.000,00	(59.377.823,65)	58.058.144,98	(1.243.178,68)
KRW	USD	HSBC London	7. Aug. 23	44.300.000.000,00	(34.442.101,74)	33.620.598,99	(715.625,74)
KRW	USD	HSBC London	24. Jul. 23	41.400.000.000,00	(32.579.619,43)	31.419.701,99	(1.081.257,43)
KRW	USD	HSBC London	18. Aug. 23	700.000.000,00	(548.602,45)	531.251,00	(15.335,45)
MXN	USD	Citigroup	13. Jul. 23	562.960.912,00	(32.837.738,58)	32.824.562,69	(55.398,76)
MXN	USD	Citigroup	5. Jul. 23	73.500.000,00	(4.297.726,06)	4.285.564,60	(10.250,56)
MXN	USD	Citigroup	20. Sep. 23	294.460.912,00	(16.980.603,96)	17.169.132,81	(58.524,26)
MXN	USD	Citigroup	3. Jul. 23	197.500.000,00	(11.544.469,60)	11.515.632,78	(18.369,60)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	9. Aug. 23	514.079.475,44	(44.500.000,00)	47.984.180,31	(715.224,81)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	11.700.685,10	(1.000.000,00)	1.092.141,99	(1.744,24)
NOK	SEK	Citigroup	15. Aug. 23	106.000.000,00	(107.007.723,75)	9.894.040,43	(54.404,81)
NOK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	92.473,31	(8.635,44)	8.631,46	(21,08)
NOK	USD	Citigroup	9. Aug. 23	5.000.000,00	(466.953,44)	466.700,02	(673,44)
NZD	AUD	HSBC London	27. Jul. 23	186.322.270,45	(173.900.000,00)	114.150.361,77	(1.610.243,47)
NZD	USD	HSBC London	12. Jul. 23	107.200.000,00	(66.107.419,33)	65.676.093,11	(306.880,13)
NZD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	22.310,30	(13.745,11)	13.668,41	(50,89)
NZD	USD	HSBC London	7. Sep. 23	6.200.000,00	(3.822.385,00)	3.798.430,76	(17.786,00)
NZD	USD	Citigroup	11. Jul. 23	186.200.000,00	(119.692.166,64)	114.075.452,76	(5.399.999,83)
NZD	USD	Citigroup	17. Aug. 23	16.700.000,00	(10.393.522,68)	10.231.257,04	(144.766,09)
PHP	USD	HSBC London	11. Aug. 23	7.500.000,00	(135.550,91)	135.870,00	(55,91)
PHP	USD	HSBC London	18. Aug. 23	7.500.000,00	(135.526,17)	135.870,00	(53,67)
PLN	EUR	HSBC London	24. Aug. 23	68.595.839,99	(15.395.650,00)	16.883.288,79	(12.572,77)
PLN	USD	HSBC London	13. Jul. 23	18.869,80	(4.660,06)	4.644,37	(19,46)
PLN	USD	HSBC London	18. Okt. 23	47.700.000,00	(11.772.338,58)	11.740.258,23	(98.288,29)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	11. Sep. 23	85.359.589,03	(7.300.000,00)	7.902.676,35	(53.865,10)
SEK	NOK	Citigroup	15. Aug. 23	768.858.402,44	(792.500.000,00)	71.181.681,93	(2.484.324,56)
SEK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	151.859,03	(14.141,34)	14.059,26	(55,66)
SEK	USD	Citigroup	17. Aug. 23	105.000.000,00	(9.825.865,35)	9.721.005,30	(69.685,35)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
SGD	USD	Citigroup	10. Jul. 23	800.000,00	(598.820,32)	591.125,73	(7.014,72)
SGD	USD	Citigroup	14. Aug. 23	116.500.000,00	(86.982.930,99)	86.082.683,71	(685.206,49)
THB	USD	Citigroup	12. Jul. 23	37.500.000,00	(1.083.232,85)	1.057.687,49	(24.270,35)
THB	USD	Citigroup	26. Jul. 23	265.000.000,00	(7.690.445,29)	7.474.324,92	(194.920,29)
TWD	USD	Citigroup	7. Jul. 23	815.000.000,00	(26.392.450,54)	26.168.020,01	(236.655,54)
TWD	USD	Citigroup	21. Jul. 23	605.000.000,00	(19.804.611,51)	19.425.340,01	(387.136,51)
TWD	USD	Citigroup	22. Aug. 23	75.000.000,00	(2.423.889,86)	2.408.100,00	(14.139,86)
USD	AUD	HSBC London	13. Jul. 23	113.968,58	(172.135,17)	113.968,58	(769,19)
USD	AUD	HSBC London	5. Jul. 23	3.511.322,50	(5.300.000,00)	3.511.322,50	(20.510,11)
USD	AUD	HSBC London	21. Jul. 23	141.502.663,64	(216.100.000,00)	141.502.663,64	(2.576.663,16)
USD	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	1.850.176,00	(2.800.000,00)	1.850.176,00	(15.580,64)
USD	AUD	Citigroup	20. Jul. 23	110.778.933,76	(167.200.457,00)	110.778.933,76	(695.021,44)
USD	BRL	HSBC London	5. Jul. 23	104.215.008,44	(510.855.517,00)	104.215.008,44	(2.429.741,43)
USD	BRL	HSBC London	2. Aug. 23	47.652.398,09	(232.500.000,00)	47.652.398,09	(623.408,17)
USD	CAD	HSBC London	7. Jul. 23	836.933.267,61	(1.134.300.000,00)	836.933.267,61	(20.100.928,71)
USD	CAD	HSBC London	13. Jul. 23	28.923,49	(38.573,08)	28.923,49	(223,87)
USD	CAD	HSBC London	5. Jul. 23	5.282.144,94	(7.000.000,00)	5.282.144,94	(6.620,62)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	1.780.160,68	(1.600.000,00)	1.780.160,68	(7.367,16)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	7. Aug. 23	127.169.899,33	(114.100.000,00)	127.169.899,33	(774.946,50)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	3.230.706,99	(2.900.000,00)	3.230.706,99	(8.448,97)
USD	CHF	Citigroup	13. Jul. 23	11.427,67	(10.246,05)	11.427,67	(29,85)
USD	CLP	HSBC London	27. Jul. 23	20.161.997,10	(16.340.000.000,00)	20.161.997,10	(149.101,16)
USD	CNH	HSBC London	17. Aug. 23	413.825,55	(3.000.000,00)	413.825,55	(571,18)
USD	COP	HSBC London	23. Aug. 23	3.442.139,08	(16.200.000.000,00)	3.442.139,08	(372.623,87)
USD	EUR	HSBC London	13. Jul. 23	19.520.360,94	(18.040.513,83)	19.520.360,94	(177.489,29)
USD	EUR	HSBC London	5. Jul. 23	415.282.751,66	(392.300.000,00)	415.282.751,66	(12.866.334,85)
USD	GBP	HSBC London	7. Jul. 23	26.471.976,24	(20.950.000,00)	26.471.976,24	(134.560,14)
USD	GBP	HSBC London	12. Jul. 23	629.210.424,30	(504.700.000,00)	629.210.424,30	(11.785.855,09)
USD	GBP	HSBC London	13. Jul. 23	8.985.998,18	(7.106.355,57)	8.985.998,18	(39.545,87)
USD	GBP	Citigroup	5. Jul. 23	947.250,77	(749.225,34)	947.250,77	(4.254,05)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	5.150,43	(1.778.964,00)	5.150,43	(37,30)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	28. Jul. 23	14.933.554,61	(5.164.631.756,00)	14.933.554,61	(59.604,92)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	672.074,48	(2.500.000,00)	672.074,48	(1.905,35)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	1.831.030,51	(6.801.209,00)	1.831.030,51	(3.362,51)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Sep. 23	28.835.994,29	(107.000.000,00)	28.835.994,29	(98.314,72)
USD	INR	Citigroup	7. Jul. 23	34.922.159,96	(2.897.500.000,00)	34.922.159,96	(361.082,62)
USD	JPY	HSBC London	27. Jul. 23	16.048.920,03	(2.310.000.000,00)	16.048.920,03	(27.563,33)
USD	JPY	HSBC London	13. Jul. 23	19.770,75	(2.849.920,00)	19.770,75	(15,89)
USD	JPY	HSBC London	5. Jul. 23	3.109.835,37	(450.000.000,00)	3.109.835,37	(10.165,13)
USD	JPY	HSBC London	3. Jul. 23	2.839.076,26	(410.000.000,00)	2.839.076,26	(2.616,45)
USD	KRW	HSBC London	5. Jul. 23	80.829.023,97	(107.700.000.000,00)	80.829.023,97	(1.014.100,81)
USD	KRW	HSBC London	24. Jul. 23	31.364.892,56	(41.400.000.000,00)	31.364.892,56	(133.136,13)
USD	KRW	HSBC London	18. Aug. 23	22.253.768,45	(29.300.000.000,00)	22.253.768,45	(67.010,33)
USD	MXN	Citigroup	13. Jul. 23	287.964.504,51	(5.148.039.088,00)	287.964.504,51	(11.847.356,45)
USD	NOK	Citigroup	13. Jul. 23	114.390,73	(1.238.757,81)	114.390,73	(1.005,26)
USD	NOK	Citigroup	5. Jul. 23	278.318,41	(3.000.000,00)	278.318,41	(1.053,43)
USD	NOK	Citigroup	9. Aug. 23	3.476.666,99	(37.500.000,00)	3.476.666,99	(20.400,81)
USD	NOK	Citigroup	3. Jul. 23	833.529,04	(9.000.000,00)	833.529,04	(4.514,62)
USD	NZD	HSBC London	12. Jul. 23	59.000.737,56	(96.956.905,00)	59.000.737,56	(512.509,82)
USD	NZD	HSBC London	5. Jul. 23	3.466.458,50	(5.700.000,00)	3.466.458,50	(32.407,43)
USD	NZD	HSBC London	11. Jul. 23	425.460,00	(700.000,00)	425.460,00	(4.210,05)
USD	NZD	HSBC London	3. Jul. 23	4.313.536,10	(7.100.000,00)	4.313.536,10	(44.749,73)
USD	NZD	Citigroup	11. Jul. 23	130.365.658,81	(214.700.000,00)	130.365.658,81	(1.420.290,31)
USD	NZD	Citigroup	17. Aug. 23	6.760.480,05	(11.200.000,00)	6.760.480,05	(112.965,53)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	18. Jul. 23	10.974.372,36	(40.000.000,00)	10.974.372,36	(32.085,01)
USD	PHP	HSBC London	10. Jul. 23	28.149.288,32	(1.570.000.000,00)	28.149.288,32	(235.222,10)
USD	PHP	HSBC London	11. Aug. 23	940.012,03	(52.500.000,00)	940.012,03	(8.476,37)
USD	PLN	HSBC London	13. Jul. 23	10.378,56	(42.294,95)	10.378,56	(22,93)
USD	PLN	HSBC London	26. Jul. 23	9.379.665,53	(38.700.000,00)	9.379.665,53	(130.548,42)
USD	RON	HSBC London	13. Jul. 23	1.498,96	(6.838,77)	1.498,96	(5,62)
USD	SEK	Citigroup	13. Jul. 23	11.415,34	(124.134,53)	11.415,34	(98,70)
USD	SEK	Citigroup	5. Jul. 23	2.435.391,67	(26.500.000,00)	2.435.391,67	(21.604,41)
USD	SEK	Citigroup	17. Aug. 23	28.739.310,75	(311.500.000,00)	28.739.310,75	(203.544,57)
USD	SEK	Citigroup	3. Jul. 23	644.613,49	(7.000.000,00)	644.613,49	(4.335,08)
USD	SGD	Citigroup	5. Jul. 23	7.153.123,87	(9.700.000,00)	7.153.123,87	(21.060,45)
USD	SGD	Citigroup	10. Jul. 23	3.763.609,01	(5.100.000,00)	3.763.609,01	(9.148,27)
USD	SGD	Citigroup	14. Aug. 23	17.010.589,92	(23.000.000,00)	17.010.589,92	(26.683,18)
USD	SGD	Citigroup	3. Jul. 23	1.256.001,45	(1.700.000,00)	1.256.001,45	(1.223,25)
USD	THB	Citigroup	12. Jul. 23	1.333.937,12	(47.500.000,00)	1.333.937,12	(7.406,45)
USD	THB	Citigroup	26. Jul. 23	140.839,52	(5.000.000,00)	140.839,52	(583,82)
USD	THB	Citigroup	21. Aug. 23	5.557.494,03	(197.500.000,00)	5.557.494,03	(42.587,97)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	23. Aug. 23	932.372,85	(18.000.000,00)	932.372,85	(17.494,75)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	69.529.597,43	(1.344.500.000,00)	69.529.597,43	(1.615.121,98)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	2. Okt. 23	2.365.205,36	(46.000.000,00)	2.365.205,36	(52.601,21)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	23. Aug. 23	18.000.000,00	(974.672,20)	952.829,99	(24.902,20)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	1.493.500.000,00	(80.696.299,40)	79.058.421,87	(1.672.227,39)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	2. Okt. 23	408.000.000,00	(22.226.954,45)	21.597.479,83	(786.554,45)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisenkontrakte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten							10.992,46
CHF	USD	Citigroup	31. Jul. 23	1.137,00	(1.265,21)	1.270,89	8,87
EUR	USD	Citigroup	31. Jul. 23	125.117,72	(135.846,11)	136.503,47	903,05
GBP	USD	Citigroup	31. Jul. 23	762.843,07	(964.664,07)	969.841,11	4.339,63
USD	CHF	Citigroup	31. Jul. 23	3.644,06	(3.251,41)	3.644,06	0,64
USD	EUR	Citigroup	31. Jul. 23	1.906.238,20	(1.740.267,91)	1.906.238,20	4.181,06
USD	GBP	Citigroup	31. Jul. 23	680.527,56	(534.513,97)	680.527,56	1.559,21
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten							(2.245.081,65)
CHF	USD	Citigroup	31. Jul. 23	66.772.155,41	(74.866.790,19)	74.634.947,09	(44.183,10)
EUR	USD	Citigroup	31. Jul. 23	501.443.889,83	(549.409.907,21)	547.075.453,40	(1.349.787,60)
GBP	USD	Citigroup	31. Jul. 23	223.149.016,81	(284.216.094,27)	283.700.669,12	(760.386,22)
SEK	USD	Citigroup	31. Jul. 23	106.850.102,79	(10.002.521,25)	9.892.289,67	(82.557,71)
SGD	USD	Citigroup	31. Jul. 23	5.648.068,65	(4.188.861,86)	4.173.398,34	(7.212,57)
USD	CHF	Citigroup	31. Jul. 23	4.987,07	(4.463,00)	4.987,07	(13,97)
USD	EUR	Citigroup	31. Jul. 23	78.362,05	(72.173,44)	78.362,05	(520,06)
USD	GBP	Citigroup	31. Jul. 23	68.749,18	(54.453,48)	68.749,18	(420,42)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten							8.996.788,80
AUD	EUR	HSBC London	16. Aug. 23	4.285.641,87	(2.600.000,00)	2.852.737,50	15.625,40
AUD	EUR	HSBC London	3. Jul. 23	2.622.384,96	(1.600.000,00)	1.745.590,54	1.373,69
AUD	GBP	HSBC London	5. Jul. 23	286.377,50	(150.000,00)	190.627,18	339,69
AUD	GBP	HSBC London	3. Jul. 23	382.040,07	(200.000,00)	254.304,97	575,89
AUD	JPY	HSBC London	5. Jul. 23	300.000,00	(28.740.230,00)	199.695,00	648,69
AUD	JPY	HSBC London	25. Aug. 23	7.300.000,00	(693.562.767,00)	4.859.244,98	23.387,40
AUD	JPY	HSBC London	3. Jul. 23	500.000,00	(47.768.600,00)	332.825,00	2.088,02
AUD	NZD	HSBC London	27. Jul. 23	10.300.000,00	(11.114.673,54)	6.856.194,97	47.030,94
AUD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	7.849,71	(5.209,66)	5.225,16	22,63
AUD	USD	HSBC London	3. Jul. 23	300.000,00	(198.144,18)	199.695,00	1.758,42
AUD	USD	Citigroup	20. Jul. 23	600.000,00	(399.822,90)	399.390,00	203,70
BRL	USD	HSBC London	5. Jul. 23	72.100.000,00	(14.549.814,02)	14.946.115,21	501.277,28
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 23	31.840.700,00	(6.501.713,01)	6.600.482,26	109.084,96
BRL	USD	HSBC London	5. Sep. 23	29.083.334,00	(5.952.354,82)	6.028.888,50	49.979,97
CAD	EUR	Citigroup	6. Sep. 23	435.028,80	(300.000,00)	328.757,83	536,10
CAD	USD	HSBC London	7. Jul. 23	47.100.000,00	(35.172.331,97)	35.594.180,99	414.732,44
CAD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	1.313,90	(986,04)	992,93	6,79
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	7. Aug. 23	400.000,00	(448.066,76)	447.102,22	480,44
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	400.000,00	(444.819,53)	447.102,22	1.960,87
CLP	USD	HSBC London	27. Jul. 23	3.050.000.000,00	(3.760.816,39)	3.803.350,00	30.333,62
CLP	USD	HSBC London	22. Aug. 23	1.025.000.000,00	(1.264.664,25)	1.278.175,00	4.285,75
CLP	USD	HSBC London	3. Okt. 23	350.000.000,00	(430.903,44)	436.450,00	646,56
COP	USD	HSBC London	23. Aug. 23	14.905.213.270,00	(3.329.633,27)	3.562.345,97	173.091,87
EUR	AUD	HSBC London	16. Aug. 23	7.700.000,00	(12.505.131,34)	8.400.702,60	78.250,39
EUR	CAD	Citigroup	5. Jul. 23	100.000,00	(144.199,00)	109.100,03	190,99
EUR	CAD	Citigroup	6. Sep. 23	100.000,00	(144.623,32)	109.100,03	112,70
EUR	CHF	HSBC London	15. Aug. 23	1.200.000,00	(1.166.980,52)	1.309.200,41	2.802,73
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	400.000,00	(343.617,00)	436.400,14	167,17
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	1.600.000,00	(1.371.550,43)	1.745.600,54	7.936,03
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	100.000,00	(37.433.998,00)	109.100,03	1.208,83
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	100.000,00	(37.078.620,00)	109.100,03	665,86
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	26.200.000,00	(3.931.766.818,00)	28.584.208,86	1.223.996,88
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	100.000,00	(15.700.500,00)	109.100,03	281,61
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	100.000,00	(15.731.000,00)	109.100,03	95,97
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	9. Aug. 23	2.600.000,00	(30.097.231,68)	2.836.600,88	36.118,04
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	11. Sep. 23	7.600.000,00	(88.548.361,80)	8.291.602,57	85.671,85
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	100.000,00	(1.176.827,00)	109.100,03	26,44
EUR	USD	HSBC London	5. Jul. 23	2.300.000,00	(2.495.625,22)	2.509.300,78	14.569,48
GBP	AUD	HSBC London	20. Sep. 23	5.373.796,00	(10.104.083,59)	6.831.979,56	77.688,56
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	5.280.332,93	(6.100.000,00)	6.713.155,21	34.810,72
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	602.908,78	(700.000,00)	766.508,53	1.785,45
GBP	JPY	Citigroup	27. Jul. 23	11.950.000,00	(2.046.039.893,00)	15.192.641,42	935.387,27
GBP	JPY	Citigroup	5. Jul. 23	200.000,00	(36.528.250,00)	254.270,15	733,28
GBP	JPY	Citigroup	3. Jul. 23	250.000,00	(45.641.950,00)	317.837,69	1.148,89
GBP	USD	HSBC London	7. Jul. 23	100.000,00	(126.304,40)	127.135,07	695,80
GBP	USD	HSBC London	12. Jul. 23	31.450.000,00	(39.282.009,39)	39.983.980,98	661.251,82
GBP	USD	HSBC London	13. Jul. 23	223,90	(280,80)	284,66	3,57
GBP	USD	HSBC London	12. Sep. 23	1.750.000,00	(2.211.917,23)	2.224.863,81	10.976,53
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	1.026.890.123,19	(2.700.000,00)	3.003.581,73	14.479,16

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	61.039.232,03	(177.771,38)	178.535,48	223,91
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	800.000.000,00	(2.303.244,72)	2.339.944,00	13.003,30
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	28. Jul. 23	1.790.000.000,00	(5.147.323,29)	5.235.624,70	48.957,22
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	31. Aug. 23	610.000.000,00	(1.744.671,50)	1.784.207,30	12.335,89
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	26. Okt. 23	513.378.378,00	(1.460.895,91)	1.501.595,82	2.150,32
INR	USD	Citigroup	7. Jul. 23	707.717.136,00	(8.579.436,17)	8.627.071,94	38.435,39
INR	USD	Citigroup	24. Jul. 23	430.000.000,00	(5.185.445,15)	5.241.700,03	47.654,85
INR	USD	Citigroup	11. Aug. 23	380.000.000,00	(4.595.806,39)	4.632.200,03	25.753,61
INR	USD	Citigroup	18. Aug. 23	32.500.000,00	(395.057,68)	396.175,00	109,82
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	125.593.539,00	(800.000,00)	868.949,04	1.012,13
JPY	USD	HSBC London	13. Jul. 23	93.240,00	(644,67)	645,10	2,68
JPY	USD	HSBC London	3. Jul. 23	50.000.000,00	(345.294,36)	345.937,00	1.253,64
KRW	USD	HSBC London	5. Jul. 23	4.400.000.000,00	(3.329.967,74)	3.339.292,00	13.724,26
MXN	USD	Citigroup	13. Jul. 23	245.500.000,00	(13.636.060,67)	14.314.368,85	659.895,34
MXN	USD	Citigroup	25. Aug. 23	54.500.000,00	(3.037.045,73)	3.177.731,58	110.056,79
MXN	USD	Citigroup	20. Sep. 23	144.927.805,00	(8.234.079,26)	8.450.305,73	94.631,84
MXN	USD	Citigroup	3. Jul. 23	1.000.000,00	(58.350,76)	58.307,00	9,24
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	9. Aug. 23	52.188.605,50	(4.400.000,00)	4.871.284,65	55.684,11
NOK	SEK	Citigroup	15. Aug. 23	41.000.000,00	(40.299.269,49)	3.826.940,17	80.044,75
NOK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	46.190,90	(4.264,61)	4.311,46	38,30
NOK	USD	Citigroup	3. Jul. 23	1.000.000,00	(92.844,05)	93.340,00	271,95
NZD	AUD	HSBC London	27. Jul. 23	761.617,55	(700.000,00)	466.605,09	640,50
NZD	USD	HSBC London	12. Jul. 23	400.000,00	(245.261,11)	245.060,05	263,29
NZD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	1.770,79	(1.075,31)	1.084,87	11,61
NZD	USD	HSBC London	3. Jul. 23	800.000,00	(486.878,55)	490.120,10	4.195,85
NZD	USD	Citigroup	11. Jul. 23	7.500.000,00	(4.559.301,94)	4.594.875,92	44.303,06
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	18. Jul. 23	4.500.000,00	(1.195.073,34)	1.241.446,43	43.146,66
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	7.250.000,00	(1.969.530,49)	2.000.108,14	20.580,01
PHP	USD	HSBC London	10. Jul. 23	167.500.000,00	(2.988.416,80)	3.034.430,02	39.815,70
PHP	USD	HSBC London	11. Aug. 23	197.500.000,00	(3.521.584,58)	3.577.910,02	46.450,42
PHP	USD	HSBC London	18. Aug. 23	150.000.000,00	(2.689.888,48)	2.717.400,02	19.561,52
PLN	EUR	HSBC London	24. Aug. 23	55.762.037,92	(12.393.718,00)	13.724.543,49	122.368,96
PLN	USD	HSBC London	13. Jul. 23	3.259.802,25	(800.821,92)	802.325,37	851,47
PLN	USD	HSBC London	23. Aug. 23	14.900.000,00	(3.569.256,82)	3.667.292,40	87.411,77
PLN	USD	HSBC London	26. Jul. 23	17.700.000,00	(4.266.631,08)	4.356.448,02	82.913,85
PLN	USD	HSBC London	18. Okt. 23	4.600.000,00	(1.111.697,06)	1.132.184,23	14.102,34
RON	EUR	HSBC London	27. Sep. 23	999.509,58	(200.000,00)	219.885,12	216,62
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	8.263.357,98	(700.000,00)	765.029,97	2.185,12
SEK	NOK	Citigroup	15. Aug. 23	11.056.943,92	(11.000.000,00)	1.023.662,96	1.231,03
SEK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	1.936.596,52	(178.232,93)	179.292,05	1.396,08
SEK	USD	Citigroup	3. Jul. 23	1.000.000,00	(91.979,46)	92.581,00	727,54
SGD	USD	Citigroup	3. Jul. 23	400.000,00	(294.916,09)	295.562,86	901,51
THB	USD	Citigroup	12. Jul. 23	22.500.000,00	(630.913,06)	634.612,49	4.464,44
USD	AUD	HSBC London	13. Jul. 23	1.083.983,71	(1.583.009,66)	1.083.983,71	28.804,80
USD	AUD	HSBC London	21. Jul. 23	22.054.374,67	(32.900.000,00)	22.054.374,67	118.781,76
USD	AUD	Citigroup	20. Jul. 23	10.352.086,05	(15.508.009,00)	10.352.086,05	12.718,03
USD	BRL	HSBC London	5. Jul. 23	3.238.313,90	(15.475.966,00)	3.238.313,90	7.666,32
USD	BRL	HSBC London	2. Aug. 23	271.509,71	(1.300.000,00)	271.509,71	1.612,56
USD	CAD	HSBC London	7. Jul. 23	4.311.741,09	(5.700.000,00)	4.311.741,09	5.025,77
USD	CAD	HSBC London	13. Jul. 23	1.399,34	(1.847,90)	1.399,34	2,98
USD	CAD	HSBC London	5. Jul. 23	226.766,55	(300.000,00)	226.766,55	105,14
USD	CAD	HSBC London	15. Aug. 23	4.185.720,08	(5.500.000,00)	4.185.720,08	27.441,25
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	7. Aug. 23	16.441.524,77	(14.500.000,00)	16.441.524,77	180.931,67

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	CLP	HSBC London	27. Jul. 23	2.430.704,91	(1.950.000.000,00)	2.430.704,91	6.876,97
USD	CNH	HSBC London	12. Jul. 23	7.736.929,18	(54.500.000,00)	7.736.929,18	231.020,41
USD	CNH	HSBC London	17. Aug. 23	6.118.620,47	(44.000.000,00)	6.118.620,47	40.607,04
USD	CNH	HSBC London	24. Jul. 23	4.397.506,55	(31.000.000,00)	4.397.506,55	123.536,73
USD	CNH	HSBC London	4. Aug. 23	13.671.046,17	(97.500.000,00)	13.671.046,17	216.484,61
USD	CNH	HSBC London	10. Aug. 23	3.780.908,68	(27.000.000,00)	3.780.908,68	53.242,19
USD	COP	HSBC London	23. Aug. 23	190.101,04	(800.000.000,00)	190.101,04	2.145,75
USD	EUR	HSBC London	5. Jul. 23	8.107.237,06	(7.400.000,00)	8.107.237,06	30.951,64
USD	EUR	Citigroup	13. Jul. 23	11.022,09	(10.086,22)	11.022,09	9,20
USD	GBP	HSBC London	7. Jul. 23	63.688,34	(50.000,00)	63.688,34	188,23
USD	GBP	HSBC London	12. Jul. 23	11.599.640,55	(9.100.000,00)	11.599.640,55	42.127,44
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	406,35	(137.890,00)	406,35	4,27
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	28. Jul. 23	596.570,00	(205.320.946,00)	596.570,00	537,99
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	5.846.825,74	(21.273.846,00)	5.846.825,74	108.868,92
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Sep. 23	1.097.690,36	(4.000.000,00)	1.097.690,36	15.972,00
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	23. Okt. 23	3.590.888,52	(13.000.000,00)	3.590.888,52	68.861,27
USD	INR	Citigroup	7. Jul. 23	4.970.306,73	(407.500.000,00)	4.970.306,73	8.187,97
USD	INR	Citigroup	24. Jul. 23	30.443,25	(2.500.000,00)	30.443,25	18,28
USD	JPY	HSBC London	27. Jul. 23	13.523.779,56	(1.870.000.000,00)	13.523.779,56	507.114,69
USD	JPY	HSBC London	13. Jul. 23	1.747.429,70	(243.651.898,00)	1.747.429,70	55.666,33
USD	JPY	HSBC London	3. Jul. 23	138.652,79	(20.000.000,00)	138.652,79	33,59
USD	KRW	HSBC London	5. Jul. 23	690.852,02	(900.000.000,00)	690.852,02	6.905,92
USD	KRW	HSBC London	7. Aug. 23	4.308.742,91	(5.600.000.000,00)	4.308.742,91	45.208,55
USD	KRW	HSBC London	18. Aug. 23	9.374.652,26	(12.100.000.000,00)	9.374.652,26	156.158,72
USD	MXN	Citigroup	13. Jul. 23	2.019.938,21	(34.572.194,00)	2.019.938,21	6.748,01
USD	MXN	Citigroup	3. Jul. 23	1.344.024,18	(23.000.000,00)	1.344.024,18	1.744,95
USD	NOK	Citigroup	13. Jul. 23	1.631,21	(17.437,40)	1.631,21	6,83
USD	NOK	Citigroup	9. Aug. 23	6.771.238,74	(71.500.000,00)	6.771.238,74	103.271,69
USD	NZD	HSBC London	12. Jul. 23	2.822.205,84	(4.571.455,00)	2.822.205,84	16.197,51
USD	NZD	HSBC London	13. Jul. 23	5.038,63	(8.155,36)	5.038,63	32,81
USD	NZD	HSBC London	7. Sep. 23	1.968.799,49	(3.200.000,00)	1.968.799,49	5.137,20
USD	NZD	Citigroup	11. Jul. 23	3.062.942,30	(4.900.000,00)	3.062.942,30	55.256,95
USD	NZD	Citigroup	17. Aug. 23	436.465,31	(700.000,00)	436.465,31	6.878,41
USD	PLN	HSBC London	26. Jul. 23	1.387.354,99	(5.600.000,00)	1.387.354,99	11.244,34
USD	SEK	Citigroup	13. Jul. 23	4.930,19	(52.781,57)	4.930,19	34,42
USD	SEK	Citigroup	17. Aug. 23	4.610.374,68	(49.000.000,00)	4.610.374,68	57.355,80
USD	SGD	Citigroup	10. Jul. 23	890.167,42	(1.200.000,00)	890.167,42	2.458,10
USD	SGD	Citigroup	14. Aug. 23	7.006.830,22	(9.400.000,00)	7.006.830,22	43.676,89
USD	SGD	Citigroup	3. Jul. 23	147.973,88	(200.000,00)	147.973,88	65,08
USD	THB	Citigroup	12. Jul. 23	795.508,23	(27.500.000,00)	795.508,23	18.912,95
USD	THB	Citigroup	26. Jul. 23	577.178,91	(20.000.000,00)	577.178,91	11.446,45
USD	TWD	Citigroup	7. Jul. 23	2.937.575,05	(90.000.000,00)	2.937.575,05	49.228,05
USD	TWD	Citigroup	21. Jul. 23	1.303.653,05	(40.000.000,00)	1.303.653,05	19.861,10
USD	TWD	Citigroup	22. Aug. 23	1.863.313,78	(57.500.000,00)	1.863.313,78	15.827,94
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	2.800.018,98	(51.500.000,00)	2.800.018,98	75.262,35
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	74.500.000,00	(3.863.137,84)	3.943.657,47	78.806,15

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten							(7.052.809,75)
AUD	EUR	HSBC London	16. Aug. 23	10.342.118,33	(6.400.000,00)	6.884.231,04	(99.423,65)
AUD	GBP	HSBC London	20. Sep. 23	372.556,80	(200.000,00)	247.992,43	(5.230,04)
AUD	JPY	HSBC London	5. Jul. 23	300.000,00	(28.858.800,00)	199.695,00	(172,83)
AUD	JPY	HSBC London	25. Aug. 23	10.800.000,00	(1.037.408.811,00)	7.189.019,97	(43.802,81)
AUD	NZD	HSBC London	27. Jul. 23	7.600.000,00	(8.362.947,94)	5.058.939,98	(64.636,64)
AUD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	37.275,54	(25.388,74)	24.812,46	(542,43)
AUD	USD	HSBC London	21. Jul. 23	31.900.000,00	(21.614.847,29)	21.234.234,91	(346.064,58)
AUD	USD	Citigroup	20. Jul. 23	33.300.000,00	(22.318.101,53)	22.166.144,91	(116.625,23)
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 23	23.759.300,00	(4.946.356,78)	4.925.232,11	(13.427,17)
BRL	USD	HSBC London	5. Sep. 23	4.916.666,00	(1.016.915,13)	1.019.210,21	(2.193,93)
CAD	EUR	Citigroup	6. Sep. 23	8.924.969,16	(6.200.000,00)	6.744.733,92	(38.382,78)
CAD	USD	HSBC London	7. Jul. 23	4.400.000,00	(3.346.861,95)	3.325.146,42	(22.380,35)
CAD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	2.265,96	(1.717,47)	1.712,42	(5,22)
CAD	USD	HSBC London	15. Aug. 23	1.900.000,00	(1.444.847,68)	1.435.858,68	(8.358,88)
CHF	EUR	HSBC London	15. Aug. 23	3.199.580,20	(3.300.000,00)	3.576.348,52	(18.494,07)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	7. Aug. 23	5.800.000,00	(6.553.446,68)	6.482.982,17	(49.512,28)
CLP	USD	HSBC London	27. Jul. 23	3.300.000.000,00	(4.123.256,38)	4.115.100,00	(21.356,38)
CLP	USD	HSBC London	22. Aug. 23	1.375.000.000,00	(1.707.764,77)	1.714.625,00	(5.514,77)
CLP	USD	HSBC London	3. Okt. 23	1.100.000.000,00	(1.359.209,38)	1.371.700,00	(2.909,38)
CNH	USD	HSBC London	12. Jul. 23	54.500.000,00	(7.568.941,32)	7.491.624,16	(63.255,82)
CNH	USD	HSBC London	24. Jul. 23	1.500.000,00	(208.466,70)	206.191,49	(1.673,70)
COP	USD	HSBC London	23. Aug. 23	10.494.786.730,00	(2.476.866,44)	2.508.254,03	(10.591,55)
EUR	AUD	HSBC London	5. Jul. 23	200.000,00	(328.591,00)	218.200,07	(690,02)
EUR	AUD	HSBC London	16. Aug. 23	7.000.000,00	(11.523.178,16)	7.637.002,37	(32.057,79)
EUR	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	1.600.000,00	(2.638.475,00)	1.745.600,54	(12.094,54)
EUR	CAD	Citigroup	5. Jul. 23	200.000,00	(289.315,00)	218.200,07	(310,81)
EUR	CAD	Citigroup	6. Sep. 23	2.800.000,00	(4.061.265,22)	3.054.800,95	(5.768,30)
EUR	CHF	HSBC London	15. Aug. 23	2.000.000,00	(1.955.063,05)	2.182.000,68	(6.602,43)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	300.000,00	(258.126,00)	327.300,10	(399,43)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	2.100.000,00	(1.814.709,88)	2.291.100,71	(8.061,65)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	700.000,00	(604.039,00)	763.700,24	(3.220,94)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	200.000,00	(31.432.938,00)	218.200,07	(491,27)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	200.000,00	(31.520.800,00)	218.200,07	(266,82)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	200.000,00	(31.531.300,00)	218.200,07	(288,22)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	9. Aug. 23	7.000.000,00	(82.564.617,70)	7.637.002,37	(45.551,97)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	100.000,00	(1.176.599,90)	109.100,03	(433,70)
EUR	PLN	HSBC London	24. Aug. 23	600.000,00	(2.693.742,49)	654.600,20	(4.533,12)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	200.000,00	(2.361.106,00)	218.200,07	(636,02)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	11. Sep. 23	1.000.000,00	(11.801.679,42)	1.091.000,34	(2.685,78)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	600.000,00	(7.095.276,20)	654.600,20	(3.022,24)
EUR	USD	HSBC London	5. Jul. 23	30.300.000,00	(33.331.717,18)	33.057.310,25	(262.630,49)
GBP	AUD	HSBC London	5. Jul. 23	100.000,00	(190.868,00)	127.135,07	(192,90)
GBP	AUD	HSBC London	20. Sep. 23	2.226.204,00	(4.240.196,30)	2.830.286,12	(4.045,81)
GBP	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	200.000,00	(381.843,00)	254.270,15	(444,55)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	17. Aug. 23	7.463.225,17	(8.700.000,00)	9.488.376,89	(36.188,59)
GBP	JPY	Citigroup	27. Jul. 23	200.000,00	(36.536.303,00)	254.270,15	(231,91)
GBP	USD	HSBC London	7. Jul. 23	1.700.000,00	(2.166.770,87)	2.161.296,27	(7.767,47)
GBP	USD	HSBC London	12. Jul. 23	750.000,00	(960.694,49)	953.513,06	(8.152,49)
GBP	USD	HSBC London	12. Sep. 23	7.950.000,00	(10.129.204,34)	10.107.238,44	(30.915,57)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	37.147.700,00	(100.000,00)	108.654,42	(546,67)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	16. Aug. 23	904.150.554,00	(2.400.000,00)	2.644.577,08	(12.041,20)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	37.083.500,00	(100.000,00)	108.466,64	(650,95)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	82.453,00	(242,06)	241,17	(1,62)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	26. Okt. 23	96.621.622,00	(275.538,96)	282.611,48	(182,79)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	17.500.000,00	(4.828.599,68)	4.715.777,40	(108.569,68)
INR	USD	Citigroup	7. Jul. 23	19.782.864,00	(240.990,95)	241.153,11	(95,01)
INR	USD	Citigroup	24. Aug. 23	100.000.000,00	(1.217.058,03)	1.219.000,01	(1.458,03)
INR	USD	Citigroup	11. Aug. 23	175.000.000,00	(2.132.650,36)	2.133.250,01	(4.300,35)
INR	USD	Citigroup	18. Aug. 23	890.000.000,00	(10.840.102,08)	10.849.100,06	(18.592,11)
JPY	AUD	HSBC London	25. Aug. 23	151.916.590,00	(1.600.000,00)	1.051.071,38	(5.842,05)
JPY	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	47.830.294,00	(500.000,00)	330.925,37	(1.660,90)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	8. Aug. 23	2.753.113.637,00	(18.400.000,00)	19.048.077,39	(919.849,13)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	47.204.670,00	(300.000,00)	326.596,84	(207,23)
JPY	GBP	Citigroup	27. Jul. 23	829.681.638,00	(4.700.000,00)	5.740.351,52	(195.762,03)
JPY	GBP	Citigroup	3. Jul. 23	45.673.496,00	(250.000,00)	316.003,04	(930,60)
JPY	USD	HSBC London	27. Jul. 23	510.000.000,00	(3.617.214,12)	3.528.557,39	(67.833,42)
JPY	USD	HSBC London	13. Jul. 23	63.381.861,00	(444.314,40)	438.522,62	(4.261,10)
KRW	USD	HSBC London	5. Jul. 23	8.700.000.000,00	(6.754.231,17)	6.602.691,00	(142.840,22)
KRW	USD	HSBC London	7. Aug. 23	5.200.000.000,00	(4.045.531,77)	3.946.436,00	(86.667,77)
KRW	USD	HSBC London	24. Jul. 23	4.300.000.000,00	(3.384.222,62)	3.263.399,00	(112.653,62)
KRW	USD	HSBC London	18. Aug. 23	100.000.000,00	(78.737,06)	75.893,00	(2.556,06)
MXN	USD	Citigroup	13. Jul. 23	53.000.000,00	(3.091.736,61)	3.090.271,07	(5.440,61)
MXN	USD	Citigroup	5. Jul. 23	8.500.000,00	(496.846,13)	495.609,51	(1.015,63)
MXN	USD	Citigroup	20. Sep. 23	29.572.195,00	(1.705.321,05)	1.724.266,02	(5.866,13)
MXN	USD	Citigroup	3. Jul. 23	22.000.000,00	(1.285.901,58)	1.282.754,03	(1.981,58)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	9. Aug. 23	52.178.825,62	(4.500.000,00)	4.870.371,79	(54.341,02)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	1.170.068,51	(100.000,00)	109.214,20	(174,42)
NOK	SEK	Citigroup	15. Aug. 23	11.500.000,00	(11.610.077,90)	1.073.410,05	(5.971,88)
NOK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	13.016,95	(1.215,92)	1.215,00	(3,32)
NOK	USD	Citigroup	9. Aug. 23	500.000,00	(46.680,08)	46.670,00	(52,08)
NZD	AUD	HSBC London	27. Jul. 23	11.802.930,36	(11.000.000,00)	7.231.066,73	(91.330,71)
NZD	USD	HSBC London	12. Jul. 23	11.800.000,00	(7.276.324,69)	7.229.271,44	(33.354,90)
NZD	USD	HSBC London	13. Jul. 23	3.028,73	(1.867,53)	1.855,55	(8,48)
NZD	USD	HSBC London	7. Sep. 23	700.000,00	(431.423,67)	428.855,09	(1.872,17)
NZD	USD	Citigroup	11. Jul. 23	14.000.000,00	(8.779.620,98)	8.577.101,71	(186.224,97)
NZD	USD	Citigroup	17. Aug. 23	1.900.000,00	(1.182.508,83)	1.164.035,23	(16.482,63)
PHP	USD	HSBC London	18. Aug. 23	2.500.000,00	(45.157,98)	45.290,00	(0,48)
PLN	EUR	HSBC London	24. Aug. 23	6.711.270,12	(1.506.282,00)	1.651.824,83	(1.235,09)
PLN	USD	HSBC London	13. Jul. 23	1.305,00	(322,11)	321,20	(1,18)
PLN	USD	HSBC London	18. Okt. 23	5.300.000,00	(1.308.037,62)	1.304.473,14	(10.920,92)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	11. Sep. 23	10.528.761,24	(900.000,00)	974.763,27	(6.179,67)
SEK	NOK	Citigroup	15. Aug. 23	45.702.494,48	(47.000.000,00)	4.231.182,77	(137.636,23)
SEK	USD	Citigroup	13. Jul. 23	16.742,59	(1.559,10)	1.550,05	(6,14)
SEK	USD	Citigroup	17. Aug. 23	11.000.000,00	(1.029.195,88)	1.018.391,03	(7.119,88)
SGD	USD	Citigroup	10. Jul. 23	100.000,00	(74.852,54)	73.890,72	(876,84)
SGD	USD	Citigroup	14. Aug. 23	4.700.000,00	(3.516.528,00)	3.472.863,63	(34.988,90)
THB	USD	Citigroup	12. Jul. 23	7.500.000,00	(215.140,44)	211.537,50	(3.347,94)
THB	USD	Citigroup	26. Jul. 23	32.500.000,00	(943.914,08)	916.662,49	(24.651,58)
TWD	USD	Citigroup	7. Jul. 23	90.000.000,00	(2.915.097,77)	2.889.720,00	(26.727,77)
TWD	USD	Citigroup	21. Jul. 23	65.000.000,00	(2.126.130,38)	2.087.020,00	(39.955,38)
TWD	USD	Citigroup	22. Aug. 23	12.500.000,00	(403.981,64)	401.350,00	(2.356,64)
USD	AUD	HSBC London	13. Jul. 23	12.779,12	(19.301,09)	12.779,12	(86,15)
USD	AUD	HSBC London	5. Jul. 23	397.807,10	(600.000,00)	397.807,10	(2.023,03)
USD	AUD	HSBC London	21. Jul. 23	6.228.784,11	(9.400.000,00)	6.228.784,11	(38.481,03)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	AUD	HSBC London	3. Jul. 23	198.178,00	(300.000,00)	198.178,00	(1.724,49)
USD	AUD	Citigroup	20. Jul. 23	12.185.482,95	(18.391.991,00)	12.185.482,95	(76.612,47)
USD	BRL	HSBC London	5. Jul. 23	11.552.696,88	(56.624.034,00)	11.552.696,88	(267.974,76)
USD	BRL	HSBC London	2. Aug. 23	5.083.150,66	(24.800.000,00)	5.083.150,66	(66.267,15)
USD	CAD	HSBC London	7. Jul. 23	40.931.657,65	(55.300.000,00)	40.931.657,65	(850.944,91)
USD	CAD	HSBC London	13. Jul. 23	3.343,22	(4.458,42)	3.343,22	(25,74)
USD	CAD	HSBC London	5. Jul. 23	528.269,23	(700.000,00)	528.269,23	(607,33)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	222.701,28	(200.000,00)	222.701,28	(739,78)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	7. Aug. 23	12.924.808,35	(11.600.000,00)	12.924.808,35	(82.714,35)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	3. Jul. 23	445.702,38	(400.000,00)	445.702,38	(1.077,77)
USD	CLP	HSBC London	27. Jul. 23	2.097.848,53	(1.700.000.000,00)	2.097.848,53	(15.300,56)
USD	CNH	HSBC London	17. Aug. 23	68.982,38	(500.000,00)	68.982,38	(83,79)
USD	COP	HSBC London	23. Aug. 23	425.157,84	(2.000.000.000,00)	425.157,84	(45.796,23)
USD	EUR	HSBC London	13. Jul. 23	2.297.147,78	(2.123.000,00)	2.297.147,78	(20.886,86)
USD	EUR	HSBC London	5. Jul. 23	33.737.025,66	(31.300.000,00)	33.737.025,66	(423.357,28)
USD	GBP	HSBC London	7. Jul. 23	2.211.358,95	(1.750.000,00)	2.211.358,95	(11.144,09)
USD	GBP	HSBC London	12. Jul. 23	19.799.912,90	(15.900.000,00)	19.799.912,90	(393.944,62)
USD	GBP	HSBC London	13. Jul. 23	1.113.985,24	(880.967,74)	1.113.985,24	(4.902,35)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 23	1.012,93	(349.592,00)	1.012,93	(6,53)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	28. Jul. 23	1.661.693,65	(574.679.054,00)	1.661.693,65	(6.625,59)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	5. Jul. 23	134.310,04	(500.000,00)	134.310,04	(485,92)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 23	195.496,15	(726.154,00)	195.496,15	(359,01)
USD	ILS	Scotland	20. Sep. 23	3.099.195,64	(11.500.000,00)	3.099.195,64	(10.566,56)
USD	INR	Citigroup	7. Jul. 23	3.856.835,09	(320.000.000,00)	3.856.835,09	(39.847,37)
USD	JPY	HSBC London	27. Jul. 23	1.736.874,38	(250.000.000,00)	1.736.874,38	(3.004,65)
USD	JPY	HSBC London	13. Jul. 23	2.274,28	(327.950,00)	2.274,28	(2,63)
USD	JPY	HSBC London	5. Jul. 23	345.497,31	(50.000.000,00)	345.497,31	(1.169,38)
USD	JPY	HSBC London	3. Jul. 23	207.772,08	(30.000.000,00)	207.772,08	(156,66)
USD	KRW	HSBC London	5. Jul. 23	9.156.085,51	(12.200.000.000,00)	9.156.085,51	(114.909,08)
USD	KRW	HSBC London	24. Jul. 23	3.257.633,43	(4.300.000.000,00)	3.257.633,43	(13.900,77)
USD	KRW	HSBC London	18. Aug. 23	2.354.463,49	(3.100.000.000,00)	2.354.463,49	(7.120,47)
USD	MXN	Citigroup	13. Jul. 23	10.160.834,65	(176.927.806,00)	10.160.834,65	(142.401,00)
USD	NOK	Citigroup	13. Jul. 23	12.753,98	(138.103,73)	12.753,98	(111,01)
USD	NOK	Citigroup	9. Aug. 23	370.852,32	(4.000.000,00)	370.852,32	(2.168,26)
USD	NOK	Citigroup	3. Jul. 23	92.566,50	(1.000.000,00)	92.566,50	(549,46)
USD	NZD	HSBC London	12. Jul. 23	6.589.645,15	(10.828.545,00)	6.589.645,15	(57.038,51)
USD	NZD	HSBC London	5. Jul. 23	364.828,50	(600.000,00)	364.828,50	(3.473,17)
USD	NZD	HSBC London	11. Jul. 23	60.780,00	(100.000,00)	60.780,00	(601,44)
USD	NZD	HSBC London	3. Jul. 23	485.897,00	(800.000,00)	485.897,00	(5.177,47)
USD	NZD	Citigroup	11. Jul. 23	10.015.725,59	(16.500.000,00)	10.015.725,59	(112.212,00)
USD	NZD	Citigroup	17. Aug. 23	724.326,70	(1.200.000,00)	724.326,70	(12.113,87)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	18. Jul. 23	1.234.628,65	(4.500.000,00)	1.234.628,65	(3.597,78)
USD	PHP	HSBC London	10. Jul. 23	3.003.917,49	(167.500.000,00)	3.003.917,49	(24.364,77)
USD	PHP	HSBC London	11. Aug. 23	179.216,26	(10.000.000,00)	179.216,26	(1.447,74)
USD	PLN	HSBC London	13. Jul. 23	1.196,38	(4.879,35)	1.196,38	(3,58)
USD	PLN	HSBC London	26. Jul. 23	1.237.357,89	(5.100.000,00)	1.237.357,89	(15.924,21)
USD	RON	HSBC London	13. Jul. 23	413,19	(1.885,09)	413,19	(1,54)
USD	SEK	Citigroup	13. Jul. 23	907,48	(9.874,82)	907,48	(8,45)
USD	SEK	Citigroup	5. Jul. 23	229.708,03	(2.500.000,00)	229.708,03	(2.084,04)
USD	SEK	Citigroup	17. Aug. 23	2.997.094,71	(32.500.000,00)	2.997.094,71	(22.622,10)
USD	SEK	Citigroup	3. Jul. 23	91.998,71	(1.000.000,00)	91.998,71	(708,22)
USD	SGD	Citigroup	5. Jul. 23	737.313,02	(1.000.000,00)	737.313,02	(2.293,60)
USD	SGD	Citigroup	10. Jul. 23	294.983,95	(400.000,00)	294.983,95	(918,51)
USD	SGD	Citigroup	14. Aug. 23	2.071.040,09	(2.800.000,00)	2.071.040,09	(3.063,04)
USD	SGD	Citigroup	3. Jul. 23	147.738,86	(200.000,00)	147.738,86	(169,92)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisenkontrakte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	THB	Citigroup	12. Jul. 23	70.356,14	(2.500.000,00)	70.356,14	(241,07)
USD	THB	Citigroup	26. Jul. 23	140.645,66	(5.000.000,00)	140.645,66	(777,13)
USD	THB	Citigroup	21. Aug. 23	633.132,23	(22.500.000,00)	633.132,23	(4.851,80)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	23. Aug. 23	103.596,99	(2.000.000,00)	103.596,99	(1.943,86)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	3.790.744,16	(73.500.000,00)	3.790.744,16	(98.564,62)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	2. Okt. 23	257.087,54	(5.000.000,00)	257.087,54	(5.717,52)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	23. Aug. 23	2.000.000,00	(108.283,89)	105.870,00	(2.753,89)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 23	115.000.000,00	(6.218.338,66)	6.087.524,95	(133.458,65)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	2. Okt. 23	46.000.000,00	(2.506.031,63)	2.435.009,98	(88.731,63)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisenkontrakte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Kontrahent	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenkontrakten							491,64
GBP	USD	Citigroup	31. Jul. 23	1.503,30	(1.897,96)	1.911,22	11,61
JPY	USD	Citigroup	31. Jul. 23	5.000.000,00	(34.642,51)	34.593,70	178,49
SEK	USD	Citigroup	31. Jul. 23	2.367,04	(217,29)	219,14	2,47
USD	EUR	Citigroup	31. Jul. 23	128.419,58	(117.438,37)	128.419,58	63,57
USD	GBP	Citigroup	31. Jul. 23	97.681,32	(76.713,67)	97.681,32	235,50
Nicht realisierter Verlust aus Devisenkontrakten							(461.678,45)
EUR	USD	Citigroup	31. Jul. 23	39.284.386,43	(43.042.150,67)	42.859.278,88	(105.730,54)
GBP	USD	Citigroup	31. Jul. 23	19.692.635,01	(25.081.833,75)	25.036.246,22	(67.205,05)
JPY	USD	Citigroup	31. Jul. 23	8.915.199.919,00	(62.342.189,47)	61.681.950,11	(254.954,19)
SEK	USD	Citigroup	31. Jul. 23	43.704.127,82	(4.091.259,21)	4.046.171,98	(33.767,98)
USD	GBP	Citigroup	31. Jul. 23	4.488,24	(3.549,63)	4.488,24	(20,69)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 12 – Ausstehende Finanzterminkontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
Sale E-mini Nasdaq 100 Index Future	Merrill Lynch	(10)	USD	15. Sep. 23	2.811.549,04	(39.812,10)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(39.812,10)

Man AHL Trend Alternative

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Purchase Nifty Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	502	USD	27. Jul. 23	19.356.116,00	0,00
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	14. Sep. 26	530.662,56	27,28
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	15. Jun. 27	483.575,00	175,00
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	14. Sep. 27	483.600,00	287,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	USD	16. Mär. 27	725.250,00	637,50
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	AUD	12. Jun. 25	1.977.253,30	967,53
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	USD	15. Dez. 26	966.700,00	1.150,00
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(17)	EUR	16. Mär. 26	4.504.604,02	2.086,82
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(110)	EUR	18. Sep. 23	28.829.411,19	2.414,17
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(7)	AUD	13. Mär. 25	4.612.127,22	2.836,11
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(7)	USD	15. Sep. 26	1.691.025,00	3.212,50
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(22)	EUR	15. Dez. 25	5.824.087,11	5.796,73
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	AUD	12. Dez. 24	7.903.610,31	6.055,73
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(11)	USD	16. Jun. 26	2.656.087,50	6.512,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(14)	USD	17. Mär. 26	3.378.725,00	8.987,50
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(21)	AUD	07. Sep. 23	13.822.549,80	10.645,41
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(30)	EUR	15. Sep. 25	7.934.163,58	12.275,44
Sale Hang Seng Index Future (HKG)	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	HKD	28. Jul. 23	1.079.948,73	14.477,35
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(19)	USD	16. Dez. 25	4.581.850,00	15.137,50
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(17)	AUD	12. Sep. 24	11.191.866,26	15.490,04
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(23)	AUD	13. Jun. 24	15.136.768,68	16.344,55
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(27)	AUD	07. Dez. 23	17.765.785,44	16.732,71
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(27)	AUD	07. Mär. 24	17.766.218,40	19.085,24
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(112)	EUR	18. Dez. 23	29.329.143,89	23.050,55
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(43)	EUR	16. Jun. 25	11.359.400,06	23.364,25
Sale 30 Year US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch JP Morgan Chase	(312)	USD	20. Sep. 23	33.574.125,00	31.968,75
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(46)	USD	16. Sep. 25	11.081.400,00	32.787,50

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 12 – Ausstehende Futures-Kontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(72)	EUR	17. Mär. 25	18.993.879,49	41.600,15
Sale 10 Year Korean Treasury Bond Future (KRX)	JP Morgan Chase Bank NA	(580)	KRW	19. Sep. 23	48.842.306,21	44.761,69
Purchase Amsterdam Index Future (AEX)	JP Morgan Chase Bank NA	120	EUR	21. Jul. 23	20.298.104,93	56.988,58
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(73)	USD	17. Jun. 25	17.558.325,00	69.937,50
Sale FTSE Bursa Malaysia index Future (KLCI)	JP Morgan Chase Bank NA	(642)	MYR	31. Jul. 23	9.459.765,49	72.817,20
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(93)	EUR	16. Dez. 24	24.493.175,79	76.994,27
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(168)	USD	19. Dez. 23	39.732.000,00	83.550,00
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(126)	EUR	18. März 24	33.005.596,83	87.087,40
Purchase Euro Stoxx 50 Future (EUX)	JP Morgan Chase Bank NA	435	EUR	15. Sep. 23	21.009.884,46	97.777,76
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(117)	EUR	16. Sep. 24	30.750.171,83	113.043,14
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(128)	EUR	17. Jun. 24	33.576.626,41	115.293,64
Sale VSTOXX Future	Goldman Sachs JP Morgan Chase	(355)	EUR	19. Jul. 23	577.084,63	118.597,08
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(98)	USD	18. Mär. 25	23.513.875,00	124.125,00
Purchase CAC40 Index Future (FSE)s	JP Morgan Chase Bank NA	233	EUR	21. Jul. 23	18.837.719,15	124.830,83
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(128)	USD	17. Dez. 24	30.601.600,00	194.387,50
Purchase 10 Year Japanese Bond Future (TSE)	JP Morgan Chase Bank NA	181	JPY	12. Sep. 23	124.284.965,52	212.549,13
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(195)	USD	19. März 24	46.137.000,00	228.862,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(153)	USD	17. Sep. 24	36.429.300,00	251.662,50
Sale 10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	JP Morgan Chase Bank NA	(1.434)	CAD	20. Sep. 23	93.931.470,24	284.909,26
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(188)	USD	18. Jun. 24	44.595.950,00	286.787,50
Purchase FTSE MIB Future	JP Morgan Chase Bank NA	175	EUR	15. Sep. 23	27.076.037,27	689.647,72
Sale Long Gilt Future	JP Morgan Chase Bank NA	(906)	GBP	27. Sep. 23	74.189.105,80	941.452,03
Sale Australian Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2.567)	AUD	15. Sep. 23	198.506.361,13	1.061.400,02
Purchase Nikkei 225 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	376	JPY	07. Sep. 23	43.151.489,38	1.203.332,37
Purchase E-mini S&P 500 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	219	USD	15. Sep. 23	49.146.337,50	1.218.390,00
Purchase E-Mini Nasdaq 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	117	USD	15. Sep. 23	35.888.580,00	1.287.656,00
Purchase Topix Index Future (TSE)	JP Morgan Chase Bank NA	324	JPY	07. Sep. 23	51.289.449,72	1.314.812,13
Sale 10 Year US Treasury Note Future (CBT)	Merrill Lynch JP Morgan Chase	(1.058)	USD	20. Sep. 23	104.179.937,50	1.593.859,46
Sale CBOE Volatility Index Future (VIX)	JP Morgan Chase Bank NA	(877)	USD	19. Jul. 23	13.164.647,00	3.516.003,00
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						15.785.621,52

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 12 – Ausstehende Futures-Kontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Purchase MSCI Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	1.155	TWD	19. Jul. 23	124.508.306,11	(1.747.278,83)
Purchase KOSPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	915	KRW	14. Sep. 23	59.112.583,35	(739.159,87)
Purchase SPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	331	AUD	21. Sep. 23	39.444.604,94	(623.673,47)
Purchase MSCI Emerging Markets Index Future	Merrill Lynch	565	USD	15. Sep. 23	28.190.675,00	(609.475,00)
Sale Ultra US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(313)	USD	20. Sep. 23	28.258.031,25	(427.312,54)
Purchase Euro-OAT Future	JP Morgan Chase Bank NA	216	EUR	07. Sep. 23	23.626.642,23	(224.411,35)
Purchase Euro-BTP Future	JP Morgan Chase Bank NA	2.430	EUR	07. Sep. 23	273.328.936,60	(213.538,03)
Purchase FTSE Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	1.598	USD	28. Jul. 23	92.332.440,00	(189.817,83)
Sale SET50 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2.050)	THB	28. Sep. 23	10.576.480,01	(175.477,00)
Purchase DAX Index Future (EUX)	JP Morgan Chase Bank NA	46	EUR	15. Sep. 23	20.415.671,13	(100.740,43)
Purchase Hang Seng China Enterprises Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	267	HKD	28. Jul. 23	10.822.590,40	(71.227,19)
Sale S&P 60 Future (TSX)	JP Morgan Chase Bank NA	(16)	CAD	14. Sep. 23	2.946.926,13	(66.936,14)
Purchase Stockholm 30 Index Future (OMX)	JP Morgan Chase Bank NA	1.207	SEK	21. Jul. 23	25.882.998,26	(61.287,19)
Purchase MSCI EAFE Future	Merrill Lynch	283	USD	15. Sep. 23	30.500.325,00	(60.090,73)
Purchase Swiss Market Index Future (EUZ)	JP Morgan Chase Bank NA	223	CHF	15. Sep. 23	28.233.622,09	(53.653,11)
Sale Euro-Bund Future	JP Morgan Chase Bank NA	(66)	EUR	07. Sep. 23	6.789.159,82	(52.440,66)
Sale MSCI Singapore Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(902)	SGD	28. Jul. 23	19.255.019,03	(45.136,34)
Purchase Euro-BUXL 30 Year Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	27	EUR	07. Sep. 23	2.335.410,60	(24.507,23)
Purchase Mexican Bolsa Index Future	Goldman Sachs	30	MXN	15. Sep. 23	957.430,12	(23.828,06)
Sale FTSE China A50 Index Future (SGX)	JP Morgan Chase Bank NA	(288)	USD	28. Jul. 23	3.554.784,00	(4.757,07)
Sale U.S. Dollar Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(11)	USD	18. Sep. 23	1.128.457,00	(4.187,00)
Purchase FTSE 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	3	GBP	15. Sep. 23	287.636,75	(2.533,54)
Purchase E-mini Russell 2000 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	45	USD	15. Sep. 23	4.283.325,00	(2.350,00)
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	15. Mär. 27	796.525,71	(900,20)
Sale FTSE/JSE Top40 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	ZAR	21. Sep. 23	112.794,43	(800,69)
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	EUR	15. Jun. 26	3.182.175,24	(245,51)
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	14. Dez. 27	241.787,50	(150,00)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(5.525.915,01)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 12 – Ausstehende Futures-Kontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	13. Mär. 25	658.875,32	96,59
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	16. Jun. 26	241.462,50	287,50
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	16. Mär. 26	529.953,41	340,98
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	12. Dez. 24	658.634,19	354,05
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	15. Sep. 26	241.575,00	412,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	17. Mär. 26	241.337,50	437,50
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	EUR	18. Sep. 23	3.145.026,67	463,74
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	15. Dez. 25	529.462,46	545,58
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	15. Sep. 25	793.416,36	1.254,82
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	AUD	07. Sep. 23	1.316.433,31	1.350,80
Sale Hang Seng Index Future (HKG)	Goldman Sachs	(1)	HKD	28. Jul. 23	119.994,30	1.575,98
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	AUD	12. Sep. 24	1.316.690,15	1.593,75
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	AUD	13. Jun. 24	1.316.240,75	1.704,96
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	AUD	07. Dez. 23	1.973.976,16	1.736,08
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	AUD	07. Mär. 24	1.974.024,27	1.880,80
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	16. Dez. 25	482.300,00	1.925,00
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	EUR	16. Jun. 25	1.320.860,47	2.127,74
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	EUR	18. Dez. 23	3.142.408,27	2.836,99
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	USD	16. Sep. 25	1.204.500,00	3.387,50
Sale 30 Year US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(33)	USD	20. Sep. 23	3.551.109,38	3.468,75
Sale 10 Year Korean Treasury Bond Future (KRX)	JP Morgan Chase Bank NA	(62)	KRW	19. Sep. 23	5.221.074,11	3.749,11
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	EUR	17. Mär. 25	2.110.431,05	4.923,81
Purchase Amsterdam Index Future (AEX)	Goldman Sachs	13	EUR	21. Jul. 23	2.198.961,37	5.333,54
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	USD	17. Jun. 25	1.924.200,00	7.150,00
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(10)	EUR	16. Dez. 24	2.633.674,82	7.392,54
Sale FTSE Bursa Malaysia index Future (KLCI)	JP Morgan Chase Bank NA	(68)	MYR	31. Jul. 23	1.001.968,93	7.702,18
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	EUR	18. März 24	3.405.339,36	8.088,15
Purchase Euro Stoxx 50 Future (EUX)	Goldman Sachs	46	EUR	15. Sep. 23	2.221.734,91	10.169,52
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(18)	USD	19. Dez. 23	4.257.000,00	10.362,50
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	EUR	16. Sep. 24	3.153.863,78	11.961,73
Purchase CAC40 Index Future (FSE)s	Goldman Sachs	25	EUR	21. Jul. 23	2.021.214,50	12.406,92
Sale VSTOXX Future	Goldman Sachs	(38)	EUR	19. Jul. 23	61.772,44	12.897,39
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(10)	USD	18. Mär. 25	2.399.375,00	13.575,00
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(14)	EUR	17. Jun. 24	3.672.443,51	14.362,26

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 12 – Ausstehende Futures-Kontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(14)	USD	17. Dez. 24	3.347.050,00	21.050,00
Purchase 10 Year Japanese Bond Future (TSE)	Goldman Sachs	19	JPY	12. Sep. 23	13.046.488,09	24.186,25
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(21)	USD	19. März 24	4.968.600,00	26.387,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(16)	USD	17. Sep. 24	3.809.600,00	27.050,00
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(20)	USD	18. Jun. 24	4.744.250,00	31.650,00
Sale 10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	Merrill Lynch	(153)	CAD	20. Sep. 23	10.021.976,95	33.460,52
Purchase FTSE MIB Future	Goldman Sachs	19	EUR	15. Sep. 23	2.939.684,05	72.814,01
Sale Long Gilt Future	JP Morgan Chase Bank NA	(96)	GBP	27. Sep. 23	7.861.097,30	105.583,64
Sale Australian Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(273)	AUD	15. Sep. 23	21.111.116,71	114.179,31
Purchase E-mini S&P 500 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	23	USD	15. Sep. 23	5.161.487,50	130.745,00
Purchase Nikkei 225 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	40	JPY	07. Sep. 23	4.590.583,98	135.539,42
Purchase E-Mini Nasdaq 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	12	USD	15. Sep. 23	3.680.880,00	138.550,00
Purchase Topix Index Future (TSE)	Goldman Sachs	34	JPY	07. Sep. 23	5.382.226,21	138.717,31
Sale 10 Year US Treasury Note Future (CBT)	Merrill Lynch	(113)	USD	20. Sep. 23	11.126.968,75	174.031,33
Sale CBOE Volatility Index Future (VIX)	Goldman Sachs	(93)	USD	19. Jul. 23	1.396.023,00	372.647,00
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						1.704.447,55

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Purchase MSCI Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	123	TWD	19. Jul. 23	13.259.326,11	(187.992,34)
Purchase KOSPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	97	KRW	14. Sep. 23	6.266.579,87	(80.262,54)
Purchase SPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	35	AUD	21. Sep. 23	4.170.879,68	(64.039,76)
Purchase MSCI Emerging Markets Index Future	Merrill Lynch	60	USD	15. Sep. 23	2.993.700,00	(63.515,00)
Sale Ultra US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(33)	USD	20. Sep. 23	2.979.281,25	(49.187,50)
Purchase Euro-OAT Future	Goldman Sachs	23	EUR	07. Sep. 23	2.515.799,87	(24.736,37)
Purchase Euro-BTP Future	Goldman Sachs	258	EUR	07. Sep. 23	29.020.109,32	(20.568,18)
Purchase FTSE Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	170	USD	28. Jul. 23	9.822.600,00	(20.018,48)
Sale SET50 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(218)	THB	28. Sep. 23	1.124.718,36	(18.367,94)
Purchase DAX Index Future (EUX)	Goldman Sachs	5	EUR	15. Sep. 23	2.219.094,69	(11.661,67)
Sale S&P 60 Future (TSX)	Merrill Lynch	(2)	CAD	14. Sep. 23	368.365,77	(9.413,37)
Purchase Hang Seng China Enterprises Index Future	Goldman Sachs	28	HKD	28. Jul. 23	1.134.953,30	(8.517,97)
Purchase Stockholm 30 Index Future (OMX)	Goldman Sachs	128	SEK	21. Jul. 23	2.744.841,57	(8.423,65)
Purchase MSCI EAFE Future	Merrill Lynch	30	USD	15. Sep. 23	3.233.250,00	(7.788,58)
Sale Euro-Bund Future	Goldman Sachs	(7)	EUR	07. Sep. 23	720.062,41	(7.147,03)
Purchase Swiss Market Index Future (EUZ)	Goldman Sachs	24	CHF	15. Sep. 23	3.038.596,10	(6.040,04)
Sale MSCI Singapore Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(96)	SGD	28. Jul. 23	2.049.314,66	(4.879,32)
Purchase Euro-BUXL 30 Year Bond Future	Goldman Sachs	3	EUR	07. Sep. 23	259.490,07	(3.622,62)
Purchase Mexican Bolsa Index Future	Goldman Sachs	3	MXN	15. Sep. 23	95.743,01	(2.507,68)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 12 – Ausstehende Futures-Kontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Kontrahent	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Sale 3 Month Euribor Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	EUR	15. Jun. 26	265.181,27	(654,69)
Sale FTSE China A50 Index Future (SGX)	JP Morgan Chase Bank NA	(31)	USD	28. Jul. 23	382.633,00	(518,88)
Sale U.S. Dollar Index Future	Merrill Lynch	(1)	USD	18. Sep. 23	102.587,00	(367,00)
Purchase E-mini Russell 2000 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	5	USD	15. Sep. 23	475.925,00	(70,00)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(600.300,61)

Erläuterung 13 – Ausstehende Swap-Kontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Kontrahent	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Gewinn (in EUR)
TRS	01. Apr. 26	Sagerpar	Citigroup	EUR	1.166.750,00	1.612,78
TRS	15. Jun. 26	Schneider Electric SE	Citigroup	EUR	935.410,17	1.685,43
TRS	04. Aug. 23	Citigroup Global Markets Funding	Citigroup	EUR	399.600,01	1.724,99
TRS	27. Mär. 24	Carrefour SA	Citigroup	USD	778.799,99	2.566,46
TRS	01. Sep. 25	LEG Immobilien SE	Citigroup	EUR	709.000,00	7.560,00
TRS	23. Jun. 25	Umicore SA	Citigroup	EUR	1.071.000,00	7.950,00
TRS	07. Dez. 27	Accor SA	Citigroup	EUR	369.200,02	8.615,98
TRS	01. Jan. 25	Veolia Environnement SA	Citigroup	EUR	1.041.398,75	11.706,91
TRS	30. Jun. 25	Deutsche Post AG	Citigroup	EUR	1.249.625,00	11.923,60
TRS	09. Apr. 25	Amadeus IT Group SA	Citigroup	EUR	1.024.000,00	13.500,00
TRS	25. Jun. 25	Selena Sarl	Citigroup	EUR	1.194.375,00	14.023,23
TRS	13. Mai 25	BNP Paribas SA	Citigroup	EUR	447.500,00	19.341,40
TRS	04. Aug. 27	STMicroelectronics NV	Citigroup	USD	1.389.000,00	60.412,47
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten						162.623,25

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Kontrahent	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
TRS	13. Sep. 23	Qiagen NV	Citigroup	USD	1.315.500,00	(22.482,13)
TRS	29. Dez. 23	Oliver Capital Sarl	Citigroup	EUR	625.500,00	(16.440,00)
TRS	06. Nov. 24	Atos SE	Citigroup	EUR	801.000,00	(9.652,86)
TRS	16. Jan. 26	Cellnex Telecom SA	Citigroup	EUR	395.250,00	(7.017,51)
TRS	07. Jun. 26	RAG-Stiftung	Citigroup	EUR	1.281.000,00	(6.466,46)
TRS	30. Jul. 25	Worldline SA	Citigroup	EUR	939.392,98	(2.881,74)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten						(64.940,70)

Man AHL Trend Alternative

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Kontrahent	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
TRS	05. Jul. 23	Bloomberg Commodity ex-Agriculture and Livestock Capped Index	Goldman Sachs	USD	4.672.414,40	12.212,60
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten						12.212,60

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Kontrahent	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in USD)
TRS	05. Jul. 23	Bloomberg Commodity ex-Agriculture and Livestock Capped Index	Goldman Sachs	USD	156.861.758,30	(1.333.200,10)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten						(1.333.200,10)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 13 – Ausstehende Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative

Beschreibung	Fälligkeitstermin	Basiswert	Kontrahent	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
TRS	05. Jul. 23	Bloomberg Commodity ex-Agriculture and Livestock Capped Index	Goldman Sachs	USD	252.334,40	431,60
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten						431,60

Beschreibung	Fälligkeitstermin	Basiswert	Kontrahent	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in USD)
TRS	05. Jul. 23	Bloomberg Commodity ex-Agriculture and Livestock Capped Index	Goldman Sachs	USD	16.984.303,60	(145.086,80)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten						(145.086,80)

Erläuterung 14 – Ausstehende Optionskontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung	Kontrahent	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeits-termin	Marktwert (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn (in EUR)
Call on Seino Holdings Conv 0% 31/Mar/2026 Strike Price JPY 55	Nomura	JPY	20.000.000	31. Mär. 26	16.893,27	6.096,95
Marktwert und nicht realisierter Gewinn aus Optionen					16.893,27	6.096,95

Erläuterung 15 – Gezahlte Dividende

Anteilsklasse	Stichtag	Datum des Dividenden- abschlags	Zahlungsdatum	Gezahlter Betrag (in EUR)	Betrag je Anteil	Währung
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	5. Mai 23	10. Mai 23	15. Mai 23	868,33	0,4851	EUR
				868,33		

Erläuterung 16 – Angaben zu Barsicherheiten

Die nachfolgende Tabelle enthält die Barsicherheitssalden der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2023. Diese Sicherheiten beziehen sich auf Devisentermin-, Future- und Swap-Kontrakte.

Teilfonds	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung	Barsicherheiten	
				Gezahlt	Erhalten
Man Convertibles Global	Barmittel	Nomura	EUR	82.719,32	–
Man Convertibles Global	Barmittel	Merrill Lynch	EUR	150.398,72	–
Man Convertibles Global	Barmittel	Citigroup	EUR	3.678.640,11	755.039,47
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Citigroup	USD	–	962.369,21
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Merrill Lynch	USD	5.966.733,77	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Royal Bank of Scotland	USD	19.775.994,60	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Goldman Sachs	USD	24.322.409,82	127.743,35
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	HSBC	USD	34.440.387,08	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	JP Morgan	USD	78.749.743,12	78.640,81
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Merrill Lynch	USD	959.411,27	–
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Royal Bank of Scotland	USD	2.167.293,16	0,01
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	HSBC	USD	2.862.567,97	–
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Citigroup	USD	3.092.010,52	–
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	JP Morgan	USD	4.587.158,61	8.526,05
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Goldman Sachs	USD	6.033.746,73	0,82

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Erläuterung 17 – Wesentliche Ereignisse im Verlauf des Berichtszeitraums

Am 3. März 2023, dem Datum des Inkrafttretens, wurde der Man Convertibles Europe (der eingebrachte Teilfonds) mit dem Teilfonds Man Convertibles Global (der aufnehmende Teilfonds) verschmolzen, einem Teilfonds von Man Funds plc, ein Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds, der in Irland als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital konstituiert und von der Central Bank of Ireland zugelassen ist.

Das Umtauschverhältnis in Bezug auf die Anteilsklassen des eingebrachten Teilfonds und die entsprechenden Anteilsklassen des aufnehmenden Teilfonds wurde ermittelt, indem der Nettoinventarwert je Anteil der betreffenden Anteilsklassen des eingebrachten Teilfonds, berechnet zum 2. März 2023, dem Datum des letzten NIW, durch den Nettoinventarwert je Anteil der entsprechenden Anteilsklassen des aufnehmenden Teilfonds zum selben Datum dividiert wurde.

Die folgende Anteilsklasse wurde im Berichtszeitraum aufgelegt:

Man AHL Alpha Core Alternative DN EUR Acc am 27. März 2023 aufgelegt

Darüber hinaus sind sich der Verwaltungsrat und die Anlageverwalter der aktuellen Krise in der Ukraine und der damit verbundenen Sanktionen gegen Russland bewusst. Der Anlageverwalter hat die im Fonds gehaltenen Positionen auf ein etwaiges russisches und ukrainisches Engagement überprüft und kein Engagement festgestellt. Nichtsdestotrotz bleibt die Situation unter ständiger Beobachtung.

Seit Ende des Berichtszeitraums sind keine weiteren Ereignisse eingetreten, die sich wesentlich auf den Abschluss auswirken würden.

Erläuterung 18 – Käufe und Verkäufe

Eine detaillierte Auflistung aller während des von diesem Bericht abgedeckten Zeitraums erworbenen und veräußerten Kapitalanlagen ist auf Anfrage kostenlos am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, beim Facilities Agent sowie bei den Zahl- und Informationsstellen erhältlich und für schweizerische Anleger beim Vertreter für die Schweiz.

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023**

Vertreter

Der Repräsentant in der Schweiz ist Man Investments AG, Huobstrasse 3, 8808 Pfäffikon/SZ, Schweiz.

Zahlstelle

Die Zahlstelle in der Schweiz ist RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich.

Stelle, von der die entsprechenden Dokumente bezogen werden können

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung, Jahres- und Halbjahresberichte, eine Aufstellung aller Käufe bzw. Verkäufe während des von diesem Bericht abgedeckten Zeitraums und weitere Informationen sind kostenfrei bei der Vertretung in der Schweiz erhältlich.

Total Expense Ratio (TER)

Die bei der Verwaltung des Fonds angefallenen Provisionen und Kosten sind in der international unter dem Begriff „Total Expense Ratio (TER)“ bekannten Kennziffer offenzulegen. Diese Kennziffer drückt die Gesamtheit der Provisionen und Kosten aus, die laufend dem entsprechenden Teilfondsvermögen belastet werden (Aufwendungen), und als Prozentsatz des jeweiligen Teilfondsvermögens errechnet und ausgewiesen werden. Für im Laufe des Jahres aufgelegte Anteilsklassen werden die TER annualisiert.

Die Nebenkosten, die dem Organismus für gemeinsame Anlagen beim Kauf und Verkauf der Anlagen entstehen, sind nicht in den Betriebskosten enthalten (außer bei „Pauschalgebühren“). Diese sind Bestandteil der Anlagen und fallen auf die realisierten Kapitalgewinne/-verluste beim Verkauf der Anlagen an.

Die nachstehenden Zahlen beinhalten eine Kostenobergrenze und erlassene Honorare der Verwaltungsratsmitglieder.

Anteilsklassen, für die keine Erfolgsgebühr erhoben wird

	TER
Man Convertibles Global	
Man Convertibles Global D EUR Acc	1,84 %
Man Convertibles Global D H CHF Acc	1,84 %
Man Convertibles Global D H USD Acc	1,83 %
Man Convertibles Global DR EUR Acc	1,09 %
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	1,09 %
Man Convertibles Global DR H USD Acc	1,09 %
Man Convertibles Global I EUR Acc	1,04 %
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	1,02 %
Man Convertibles Global I H CHF Acc	1,04 %
Man Convertibles Global I H USD Acc	1,04 %

Anteilsklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird

	TER mit Erfolgsgebühr*	TER ohne Erfolgsgebühr
Man AHL Trend Alternative		
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	4,74 %	2,22 %
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	2,29 %	2,16 %
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	3,65 %	2,67 %
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	2,95 %	2,67 %
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	3,27 %	2,67 %
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	4,88 %	2,65 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	3,26 %	2,66 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	3,03 %	2,67 %
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	2,51 %	1,70 %
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	2,60 %	1,31 %
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	2,37 %	1,70 %
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	2,76 %	1,65 %
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	2,20 %	1,65 %
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	2,62 %	1,66 %
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	2,78 %	1,66 %
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	2,98 %	1,65 %
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	2,58 %	1,55 %

* % der Erfolgsgebühren werden in Erläuterung 6 angegeben.

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten) (Fortsetzung)**
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Total Expense Ratio (TER) (Fortsetzung)

Anteilklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird (Fortsetzung)

	TER mit Erfolgsgebühr*	TER ohne Erfolgsgebühr
Man AHL Alpha Core Alternative		
Man AHL Alpha Core Alternative DN H EUR Acc ⁽¹⁾	7,80 %	2,08 %
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	2,74 %	2,10 %
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	2,46 %	1,35 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc	1,41 %	1,31 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	2,08 %	1,31 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc	2,51 %	1,31 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	1,57 %	1,31 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H SEK Acc	2,25 %	1,31 %
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	2,03 %	1,21 %

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 27. März 2023 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

* % der Erfolgsgebühren werden in Erläuterung 6 angegeben.

Performance

	2023	2022	2021
Man Convertibles Global			
Man Convertibles Global D EUR Acc	3,22 %	-18,37 %	-1,62 %
Man Convertibles Global D H CHF Acc	2,30 %	-18,75 %	-1,88 %
Man Convertibles Global D H USD Acc	4,41 %	-16,33 %	-0,70 %
Man Convertibles Global DR EUR Acc	3,61 %	-17,76 %	-0,88 %
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	2,72 %	-18,11 %	-1,15 %
Man Convertibles Global DR H USD Acc	4,84 %	-15,70 %	0,03 %
Man Convertibles Global I EUR Acc	3,63 %	-17,72 %	-0,84 %
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	3,63 %	-17,73 %	-0,84 %
Man Convertibles Global I H CHF Acc	2,72 %	-18,04 %	-1,10 %
Man Convertibles Global I H USD Acc	4,86 %	-15,70 %	0,07 %
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index (BM MCG) (Hedged to EUR)	4,83 %	-17,84 %	-1,81 %
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index (BM MCG CHF-D) (Hedged to CHF)	4,00 %	-18,10 %	-1,96 %
Refinitiv Global Focus Hedged Convertible Bond Index (USD)	6,03 %	-16,00 %	-1,11 %
Man AHL Trend Alternative			
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	0,31 %	11,64 %	-3,96 %
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	1,22 %	12,35 %	-3,90 %
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	2,01 %	12,61 %	-3,68 %
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	0,47 %	12,07 %	-4,40 %
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	1,09 %	11,57 %	-4,39 %
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	1,68 %	12,56 %	-3,76 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	1,30 %	12,88 %	-4,13 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	1,76 %	13,25 %	-3,37 %
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	1,51 %	12,55 %	-3,78 %
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	2,31 %	13,11 %	-0,26 %
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	1,52 %	12,66 %	-3,26 %
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	2,43 %	13,43 %	-2,84 %
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	0,93 %	12,38 %	-3,42 %
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	1,41 %	12,40 %	-3,69 %
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	2,13 %	14,15 %	-3,54 %
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	1,61 %	12,93 %	-2,81 %
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	2,07 %	13,59 %	-7,16 %
HFRX Investable Global Hedge Fund Index	0,63 %	-4,41 %	3,65 %

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten) (Fortsetzung)**
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023

Performance (Fortsetzung)

	2023	2022	2021
Man AHL Alpha Core Alternative			
Man AHL Alpha Core Alternative DN H EUR Acc	6,10 %	n. v.	n. v.
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	2,59 %	12,72 %	-7,36 %
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	2,76 %	12,60 %	-6,67 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc	3,55 %	4,66 %	n. v.
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	2,09 %	11,29 %	-7,16 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc	2,77 %	14,05 %	n. v.
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	1,02 %	11,17 %	-6,45 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H SEK Acc	2,28 %	1,77 %	n. v.
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	2,18 %	9,80 %	-5,59 %
HFRX Investable Global Hedge Fund Index	0,63 %	-4,41 %	3,65 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.

Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Provisionen und Kosten unberücksichtigt.

Ergänzende Informationen

Informationen zur Vergütung

Waystone Management Company (Lux) S.A. hat eine Vergütungspolitik nach Maßgabe des Circular CSSF 22/797 über die Anwendung der Leitlinien der Europäischen Bankaufsichtsbehörde für solide Vergütungsgrundsätze unter der Verordnung 2013/36/EU (EBA/GL/2021/04) eingeführt.

Wie von der vom Europäischen Parlament am 27. November 2019 verabschiedeten Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (EU) 2019/2088 vorgesehen, stellt die Gesellschaft bei der Ausübung ihrer Tätigkeiten als AIFM/Verwaltungsgesellschaft sicher, dass ihre Vergütungsstruktur keine übermäßige Risikobereitschaft im Hinblick auf Nachhaltigkeitsrisiken fördert.

Einzelheiten zur Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft, darunter die Identität der für die Zuteilung der festen und variablen Vergütungen zuständigen Personen, eine Beschreibung der wichtigsten Vergütungselemente und ein Überblick darüber, wie die Vergütung festgelegt wird, sind auf der Website <https://www.waystone.com/waystone-policies> verfügbar.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (Waystone Management Company (Lux) S.A. beschäftigte zu diesem Zeitpunkt 92 Mitarbeiter) belief sich die gesamte von Waystone Management Company (Lux) S.A. an ihre Mitarbeiter gezahlte feste bzw. variable Vergütung auf 6.680.489,44 EUR bzw. 865.637,79 EUR. Die Gesamtvergütung, die von der Verwaltungsgesellschaft an die Geschäftsleitung und Mitglieder des Personals, deren Tätigkeiten wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der Organismen für gemeinsame Anlagen haben, gezahlt wurde, belief sich auf 3.736.654,76 EUR. Der Vergütungsausschuss der Verwaltungsgesellschaft hat die Umsetzung der Vergütungspolitik überprüft und diesbezüglich keine Mängel festgestellt. Darüber hinaus wurde die aktuelle Fassung der Vergütungspolitik im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 aktualisiert und vom Verwaltungsrat genehmigt, wobei die aktuelle Fassung aus dem Februar 2021 stammt. Die Vergütungspolitik wird vom Verwaltungsrat im 2. Quartal 2023 überprüft und genehmigt.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte führt Berichtsanforderungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß Artikel 3(11) der Verordnung über Wertpapiergeschäfte definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufsgeschäft oder ein Verkaufs-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum Juni 30, 2023 hielten die Teilfonds Man Convertibles Global, Man AHL Trend Alternative und Man Alpha Core Alternative Total Return Swaps als Anlageform, die der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unterliegt.

Globale Daten

Betrag der Vermögenswerte/Verbindlichkeiten über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg zum Juni 30, 2023:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Art des Vermögenswerts/ der Verbindlichkeit	Betrag in Währung des Teilfonds	% des NIW
Man Convertibles Global	EUR	Total Return Swaps	97.682,55	0,06 %
Man AHL Trend Alternative	USD	Total Return Swaps	(1.320.987,50)	(0,12) %
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	Total Return Swaps	(144.655,20)	(0,11) %

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2023 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2023 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

Konzentrationsdaten

Alle zum 30. Juni 2023 für TRS erhaltenen Sicherheiten sind Barsicherheiten. Daher werden keine Angaben zu den zehn größten Emittenten gemacht.

Die Einzelheiten zu den zehn größten Kontrahenten (basierend auf dem Bruttovolumen ausstehender Transaktionen) für Total Return Swaps zum 30. Juni 2023 sind wie folgt:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Art des Vermögenswerts/ der Verbindlichkeit	Kontrahent	Betrag in Währung des Teilfonds
Man Convertibles Global	EUR	Total Return Swaps	Citigroup	97.682,55
Man AHL Trend Alternative	USD	Total Return Swaps	Goldman Sachs	(1.320.987,50)
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	Total Return Swaps	Goldman Sachs	(144.655,20)

Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Zum 30. Juni 2023 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Barsicherheiten werden auf dem Kassenkonto jedes Fonds bei der Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg erhalten.

Zum 30. Juni 2023 wurden Sicherheiten für Total Return Swaps in folgender Höhe erhalten:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheiten	Wert der Sicherheiten in Währung des Teilfonds*	% des NIW
Man Convertibles Global	EUR	Barmittel	Citigroup	EUR	755.039,47	0,46 %

Verwahrung gestellter Sicherheiten

Zum 30. Juni 2023 wurden Sicherheiten für Total Return Swaps in folgender Höhe gestellt:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheiten	Wert der Sicherheiten in Währung des Teilfonds*	% des NIW
Man Convertibles Global	EUR	Barmittel	Citigroup	EUR	3.678.640,11	2,24 %
Man AHL Trend Alternative	USD	Barmittel	Goldman Sachs	USD	24.004.584,41	2,10 %
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	Barmittel	Goldman Sachs	USD	2.640.000,00	1,95 %

* Dieser Sicherheitenbetrag kann sich auf andere Transaktionen als TRS beziehen, die nicht unter die Offenlegung gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte fallen.

Rendite/Kosten

Für den Berichtszeitraum zum Juni 30, 2023 gestalten sich die Daten zu den Renditen und Kosten in Bezug auf Total Return Swaps wie folgt:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Renditen	Betrag in Währung des Teilfonds*	% der Gesamtrenditen
Man Convertibles Global	EUR	An den Fonds	5.229.547,39	100 %
Man AHL Trend Alternative	USD	An den Fonds	20.378.511,06	100 %
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	An den Fonds	2.265.628,82	100 %

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebenen Renditen aus Total Return Swaps sind in der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps“ und „Veränderung des nicht realisierten Nettowertzuwachs/(-wertverlusts) aus Swaps“ enthalten.

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Kosten	Betrag in Währung des Teilfonds*	% der Gesamtkosten
Man Convertibles Global	EUR	An den Fonds	545.054,37	100 %
Man AHL Trend Alternative	USD	An den Fonds	2.605,24	100 %
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	An den Fonds	300,20	100 %

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebenen Kosten aus Total Return Swaps sind in „Zinserträge aus Swap-Kontrakten“ und „Gezahlte Zinsen auf Swap-Kontrakte“ enthalten.

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

Aggregierte Transaktionsdaten

Die Laufzeit-, Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Total Return Swaps sind zum 30. Juni 2023 wie folgt:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Land	Fälligkeit	Betrag in Währung des Teilfonds
Man Convertibles Global	EUR	Bilateral	USA	Ein bis drei Monate	(20.757,14)
				Drei Monate bis ein Jahr	(13.873,54)
				Mehr als ein Jahr	132.313,23
Man AHL Trend Alternative	USD	Bilateral	USA	Ein Tag bis eine Woche	(1.320.987,50)
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	Bilateral	USA	Ein Tag bis eine Woche	(144.655,20)

Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen von Total Return Swaps gestellte Sicherheitspositionen gestalten sich zum 30. Juni 2023 wie folgt:

Teilfonds	Währungen des Teilfonds	Art der Sicherheit	Kontrahent	Fälligkeit	Währung der Sicherheiten	Wert der Sicherheiten in Währung des Teilfonds*
Man Convertibles Global	EUR	Barmittel	Citigroup	Offene Laufzeit	EUR	3.678.640,11
Man AHL Trend Alternative	USD	Barmittel	Goldman Sachs	Offene Laufzeit	USD	24.004.584,41
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	Barmittel	Goldman Sachs	Offene Laufzeit	USD	2.640.000,00

* Dieser Sicherheitenbetrag kann sich auf andere Transaktionen als TRS beziehen, die nicht unter die Offenlegung gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte fallen.

Gesamtrisiko

Für die folgenden Teilfonds der Man Umbrella SICAV wurde das Gesamtrisiko unter Anwendung des Commitment-Ansatzes ermittelt:

Man Convertibles Global

Für die restlichen nachstehend aufgeführten Teilfonds wurde der absolute Value-at-Risk (VaR)-Ansatz verwendet:

Man AHL Trend Alternative
 Man AHL Alpha Core Alternative