

Man Umbrella SICAV

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

Luxemburg
R.C.S. Nr. B 53.150

Halbjahresbericht und ungeprüfter
Abschluss

Zum 30. Juni 2021

	Seite
Management und Verwaltung	4
Informationen für Anteilinhaber	5
Nettovermögensaufstellung	6
Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile	8
Statistik	13
Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens	16
Man Convertibles Europe	18
Wertpapierbestand	18
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios	20
Man Convertibles Global	21
Wertpapierbestand	21
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios	27
Man AHL Trend Alternative	28
Wertpapierbestand	28
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios	29
Man AHL Alpha Core Alternative	30
Wertpapierbestand	30
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios	31
Man Multi-Strategy Alternative	32
Wertpapierbestand	32
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios	33
Erläuterungen zum Abschluss	34
Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)	64
Ergänzende Informationen	68

Management und Verwaltung

Vorsitzender des Verwaltungsrats:

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

Verwaltungsratsmitglieder:

Thomas Nummer
Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied
Luxemburg

John Morton
CEO Man Asset Management (Ireland) Limited
Man Group Plc
London
Vereinigtes Königreich

Verwaltungsgesellschaft:

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

Vorsitzender der Verwaltungsgesellschaft:

Géry Daeninck
Independent Management Director

Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft:

John Li How Cheong
Independent Management Director

Martin Vogel
Chief Executive Officer,
Waystone Management Company (Lux) S.A.

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 Europe
und des Man Convertibles Global

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

Anlageverwalter des Man Multi-Strategy
Alternative

Man Solutions Limited
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

Wirtschaftsprüfer:

Ernst & Young S.A.
35E, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Luxemburg:

Arendt & Medernach
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-Stadt 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 Veränderung des Nettovermögens, die Aufstellung 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 2021

Erläuterungen	Man Convertible Europe EUR	Man Convertible Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
AKTIVA				
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert (11)	19.633.580,55	277.873.438,73	270.941.939,91	61.993.287,70
Optionen zum Marktwert (Long-Positionen) (15)	0,00	5.015,99	0,00	0,00
Gezahlter Einschuss (18)	0,00	0,00	65.262.429,13	15.066.602,00
Bankguthaben	2.058.745,87	14.105.270,92	43.862.596,41	5.341.104,82
Brokerguthaben (18)	130.000,00	7.207.214,50	61.310.214,65	14.383.126,65
Termineinlagen	0,00	0,00	401.455.085,52	98.232.522,64
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	0,00	0,00	0,00	0,00
Forderungen aus Zeichnungen	0,00	0,00	2.252.347,84	8.117,62
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto	21.722,51	332.526,87	10.009,84	2.438,70
Rückerstattung der Quellensteuer	69.381,00	79.044,40	0,00	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften (12)	5.950,89	539.150,92	35.266.223,73	8.333.321,54
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten (13)	0,00	0,00	5.154.944,61	1.252.760,61
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten (14)	0,00	232.713,00	0,00	0,00
Sonstige Aktiva	1.048,70	19.398,62	0,00	0,00
SUMME AKTIVA	21.920.429,52	300.393.773,95	885.515.791,64	204.613.282,28
PASSIVA				
Überziehung	0,33	17.825,17	140.606,36	0,00
Erhaltener Einschuss (18)	0,00	0,00	5,64	70.324,27
An Broker zahlbar (18)	0,00	0,00	0,00	0,01
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	0,00	844.390,44	3.777.294,44	0,00
Zahlbare Beträge aus Rücknahmen	9.216,50	651.934,42	773.808,38	3.960.039,60
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften (12)	136.163,58	4.995.309,92	50.422.145,11	11.403.587,37
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten (13)	0,00	0,00	5.106.435,62	1.123.612,25
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten (14)	0,00	51.505,19	0,00	0,00
Zahlbare Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (6)	25.967,89	254.449,12	5.916.315,37	1.069.575,67
Ausstehende Gebühren und Aufwendungen (7)	34.188,29	165.520,67	389.722,24	102.063,35
Sonstige Passiva	474,48	1.242,84	20.628,35	24.768,20
SUMME PASSIVA	206.011,07	6.982.177,77	66.546.961,51	17.753.970,72
SUMME NETTOVERMÖGEN	21.714.418,45	293.411.596,18	818.968.830,13	186.859.311,56

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

Zum 30. Juni 2021

Man
Multi-Strategy
Alternative
USD

	Erläuterungen	
AKTIVA		
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	(11)	18.872.887,39
Optionen zum Marktwert (Long-Positionen)	(15)	0,00
Gezahlter Einschuss	(18)	0,00
Bankguthaben		2.503.980,35
Brokerguthaben	(18)	0,00
Termineinlagen		0,00
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		0,00
Forderungen aus Zeichnungen		9.987,75
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		0,00
Rückerstattung der Quellensteuer		0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	(12)	365,93
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	(13)	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten	(14)	0,00
Sonstige Aktiva		35.201,83
SUMME AKTIVA		21.422.423,25
PASSIVA		
Überziehung		0,00
Erhaltener Einschuss	(18)	7,68
An Broker zahlbar	(18)	0,00
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0,00
Zahlbare Beträge aus Rücknahmen		78.301,55
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften	(12)	152.507,74
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(13)	0,00
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten	(14)	0,00
Zahlbare Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren	(6)	5.061,85
Ausstehende Gebühren und Aufwendungen	(7)	83.323,95
Sonstige Passiva		694,72
SUMME PASSIVA		319.897,49
SUMME NETTOVERMÖGEN		21.102.525,76

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

	Man Convertibles Europe	Man Convertibles Global
Man Convertibles Europe D EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	115.404,50	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	212,64	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	10.623,00	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	104.994,14	–
Man Convertibles Europe I EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	10.311,64	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	191,50	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	191,50	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	10.311,64	–
Man Convertibles Europe D H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	13.932,89	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	5.712,46	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	8.220,43	–
Man Convertibles Global D EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	398.769,60
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	93.822,18
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	109.988,45
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	382.603,33
Man Convertibles Global I EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	497.834,94
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	160.614,65
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	184.299,24
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	474.150,35
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	68.306,31
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	930,00
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	3.660,00
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	65.576,31
Man Convertibles Global I H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	486.619,63
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	14.570,00
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	63.926,33
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	437.263,30

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

	Man Convertible Europe	Man Convertible Global
Man Convertibles Global D H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	172.368,63
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	6.008,33
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	6.758,94
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	171.618,02
Man Convertibles Global D H USD Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	175.153,19
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	3.518,00
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	5.336,13
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	173.335,06
Man Convertibles Global I H USD Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	34.660,03
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	13.125,00
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	21.535,03
Man Convertibles Global DR EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	12.832,35
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	494,28
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	808,27
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	12.518,36
Man Convertibles Global DR H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	33.642,34
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	3.871,63
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	29.770,71
Man Convertibles Global DR H USD Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	6.875,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	2.210,00
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	1.000,00
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	8.085,00

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

	Man AHL Trend Alternative	Man AHL Alpha Core Alternative
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	779.877,17	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	103.452,31	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	142.411,00	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	740.918,48	–
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	1.664.564,75	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	163.250,99	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	126.284,70	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	1.701.531,04	–
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	327.967,87	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	24.403,57	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	24.865,69	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	327.505,75	–
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	545.277,79	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	396.871,46	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	118.606,35	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	823.542,90	–
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	110.316,71	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	1.807,49	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	7.231,68	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	104.892,52	–
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	13.080,64	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	746,63	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	1.581,69	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	12.245,58	–
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	32.790,92	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	313,65	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	1.388,54	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	31.716,03	–
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	14.694,71	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	1.094,79	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	7.089,76	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	8.699,74	–
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	397.550,61	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	30.274,68	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	8.728,16	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	419.097,13	–
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	50,00	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	50,00	–

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

	Man AHL Trend Alternative	Man AHL Alpha Core Alternative
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	5.210,17	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	5.210,17	–
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	26.257,17	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	1.943,94	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	3.729,40	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	24.471,71	–
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	90.112,48	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	5.014,72	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	5.337,64	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	89.789,56	–
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	522.203,13	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	100.398,63	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	168.650,12	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	453.951,64	–
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	21.853,11	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	161.127,56	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	17.799,79	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	165.180,88	–
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	3.297,64
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	139,32
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	3.158,32
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	117.202,84
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	8.130,72
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	7.446,12
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	117.887,44
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	265.157,98
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	74.980,30
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	5.057,01
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	335.081,27
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc		
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	1.275.685,62
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	34.339,24
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	268.740,23
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	1.041.284,63

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

	Man Multi-Strategy Alternative
Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	122.334,06
Anzahl der ausgegebenen Anteile	9.459,07
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	1.103,03
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	130.690,10
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	3.518,74
Anzahl der ausgegebenen Anteile	260,21
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	852,41
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	2.926,54
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	6.419,48
Anzahl der ausgegebenen Anteile	889,64
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	7.090,09
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	219,03
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	10.189,93
Anzahl der ausgegebenen Anteile	9.775,41
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	405,91
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	19.559,43
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	2.644,85
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	2.644,85
Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	6.506,18
Anzahl der ausgegebenen Anteile	2.018,15
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	1.057,09
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	7.467,24
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	13.685,71
Anzahl der ausgegebenen Anteile	69,96
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	3.097,95
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	10.657,72
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	4.012,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	4.012,00
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	50,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	50,00

	Man Convertible Europe EUR	Man Convertible Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
Summe Nettoinventarwert				
30. Juni 2021	21.714.418,45	293.411.596,18	818.968.830,13	186.859.311,56
31. Dezember 2020	23.819.464,28	304.366.124,99	738.766.695,25	206.764.530,88
31. Dezember 2019	26.997.185,28	282.413.821,43	536.858.249,35	215.020.605,03
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums				
30. Juni 2021				
Man Convertibles Europe D EUR Acc	184,02	-	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	132,17	-	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	137,48	-	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	189,28	-	-
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	169,41	-	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	157,07	-	-
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	188,22	-	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	154,83	-	-
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	152,23	-	-
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	155,84	-	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	129,04	-	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	124,20	-	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	143,14	-	-
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	-	-	145,45	-
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	-	-	153,83	-
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	-	-	156,50	-
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	-	-	169,76	-
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	-	-	132,26	-
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	-	-	153,70	-
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	-	-	151,26	-
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	-	-	110,47	-
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	-	-	122,95	-
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	-	-	135,68	-
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	-	-	124,10	-
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	-	-	131,85	-
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	-	-	126,85	-
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	-	-	120,37	-
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	-	-	129,86	-
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	-	-	-	149,85
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	-	-	-	162,14
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	-	-	-	119,42
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	-	-	-	11.985,49
31. Dezember 2020				
Man Convertibles Europe D EUR Acc	179,88	-	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	128,69	-	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	134,58	-	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	184,77	-	-
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	164,72	-	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	153,11	-	-
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	183,35	-	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	151,42	-	-
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	147,92	-	-
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	150,83	-	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	125,50	-	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	121,02	-	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	138,59	-	-
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	-	-	139,09	-
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	-	-	146,90	-
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	-	-	149,32	-
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	-	-	161,37	-
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	-	-	125,79	-

Statistik zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

	Man Convertibles Europe EUR	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
Nettoinventarwert je Anteil zum Ende des Berichtszeitraums (Fortsetzung)				
31. Dezember 2020 (Fortsetzung)				
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	-	-	146,24	-
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	-	-	143,50	-
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	-	-	105,15	-
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	-	-	117,00	-
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	-	-	128,62	-
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	-	-	117,92	-
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	-	-	125,76	-
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	-	-	120,37	-
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	-	-	114,99	-
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	-	-	123,86	-
Man AHL Trend Alternative IN H CAD Acc ⁽¹⁾	-	-	104,64	-
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	-	-	-	144,98
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	-	-	-	157,12
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	-	-	-	115,85
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	-	-	-	11.607,03
31. Dezember 2019				
Man Convertibles Europe D EUR Acc	169,84	-	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	120,56	-	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	127,56	-	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	158,78	-	-
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	140,44	-	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	131,44	-	-
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	156,92	-	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	130,55	-	-
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	125,22	-	-
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	126,49	-	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	107,04	-	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	103,66	-	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	116,24	-	-
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	-	-	138,81	-
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	-	-	145,12	-
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	-	-	148,03	-
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	-	-	157,97	-
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	-	-	126,00	-
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	-	-	144,44	-
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	-	-	141,62	-
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	-	-	104,84	-
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	-	-	116,00	-
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	-	-	125,78	-
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	-	-	116,70	-
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	-	-	124,81	-
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	-	-	118,93	-
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	-	-	115,03	-
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	-	-	122,11	-
Man AHL Trend Alternative IN H CAD Acc	-	-	112,83	-
Man AHL Diversity Alternative DN H GBP Acc	-	-	-	144,35
Man AHL Diversity Alternative DNR H GBP Acc	-	-	-	155,54
Man AHL Diversity Alternative IN H EUR Acc	-	-	-	115,64
Man AHL Diversity Alternative IN H JPY Acc	-	-	-	11.586,45

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 13. November 2020 geschlossen. Der angegebene NIW je Anteil bezieht sich auf das Datum der Schließung der Anteilsklasse.

Summe Nettoinventarwert	
30. Juni 2021	21.102.525,76
31. Dezember 2020	19.958.425,11
31. Dezember 2019	23.082.286,26

Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums

30. Juni 2021

Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	103,46
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	120,05
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	102,75
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	111,31
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	122,74
Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	109,51
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	129,57
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	108,03
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	106,85

31. Dezember 2020

Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	102,17
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	118,05
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	101,58
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	109,59
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	120,79
Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	107,93
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	127,03
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	106,26
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	104,93

31. Dezember 2019

Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	101,37
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	115,48
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	101,17
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	108,25
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	119,17
Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	106,74
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	123,86
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	104,66
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	103,11

**Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021**

Erläuterungen	Man Convertible Europe EUR	Man Convertible Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS	23.819.464,28	304.366.124,99	738.766.695,25	206.764.530,88
ERTRÄGE				
Zinsen aus Anleihen, netto	0,00	3.505,70	67.491,75	35.109,15
Zinsertrag aus Swap-Kontrakten	8.922,91	1.200,00	0,00	0,00
Bankzinsen	210,13	2.255,95	159.746,29	44.941,68
Verwaltungszuschüsse (10)	0,00	0,00	0,00	0,00
Sonstige Einnahmen	0,00	0,00	0,00	515,89
Nachlass auf Anlageverwaltungsgebühr (6)	0,00	0,00	0,00	0,00
SUMME ERTRÄGE	9.133,04	6.961,65	227.238,04	80.566,72
AUFWENDUNGEN				
Managementgebühr (6)	160.191,17	1.608.059,49	6.824.970,48	991.754,43
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	2.133,76	35.164,95	92.318,53	20.644,12
Erfolgsgebühren (6)	0,00	0,00	7.676.581,20	980.490,10
Depotbankgebühr (4)	14.218,29	65.410,87	91.509,87	35.892,56
Domizilstellen-, Administrations- und Transferstellengebühren	21.822,07	132.888,19	349.242,00	86.677,77
Revisionskosten, Druck- und Veröffentlichungskosten	5.206,38	21.950,53	60.373,04	13.529,14
Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) (5)	5.124,04	39.807,86	95.410,36	14.888,38
Bankzinsen	9.228,83	95.839,87	77.570,14	35.836,89
Zinsverbindlichkeiten auf Swap-Kontrakte	3.434,48	134.160,36	0,00	0,00
Transaktionskosten (8)	114,94	78,07	185.028,89	47.904,50
Sonstige Aufwendungen (9)	158.561,84	295.279,92	201.456,91	64.707,69
SUMME AUFWENDUNGEN	380.035,80	2.428.640,11	15.654.461,42	2.292.325,58
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN	(370.902,76)	(2.421.678,46)	(15.427.223,38)	(2.211.758,86)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen	735.337,43	16.247.270,96	9.429.627,07	(0,11)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften (144.764,01)	(144.764,01)	(4.213.140,03)	18.415.157,47	(1.783.931,07)
Realisierter Nettogewinn aus Futures- Kontrakten	0,00	4.631,24	49.040.051,58	12.668.624,10
Realisierter Nettogewinn aus Swap-Kontrakten	290.816,32	3.395.154,10	0,00	0,00
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften	109.728,33	3.714.141,02	714.951,83	106.262,30
REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST)	991.118,07	19.148.057,29	77.599.787,95	10.990.955,22
Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus:				
- Wertpapieren	288.604,41	(1.731.879,65)	12.578.651,50	(16.653,23)
- Devisentermingeschäften	(180.129,41)	(5.622.610,92)	(49.486.172,51)	(11.003.268,23)
- Optionen	0,00	(5.780,33)	0,00	0,00
- Futures-Kontrakten	0,00	0,00	(7.648.021,75)	(1.837.940,95)
- Swap-Kontrakten	(230.605,68)	(2.157.506,53)	0,00	0,00
ANSTIEG/(RÜCKGANG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT	498.084,63	7.208.601,40	17.617.021,81	(4.078.666,05)
KAPITALBEWEGUNGEN				
Ausgabe von Anteilen	64.032,19	48.754.753,12	165.055.432,19	16.410.269,22
Rücknahme von Anteilen	(2.667.162,65)	(66.890.512,05)	(102.470.319,12)	(32.236.822,49)
Gezahlte Dividende (16)	0,00	(27.371,28)	0,00	0,00
Währungsdifferenz (2f)	0,00	0,00	0,00	0,00
Wegfall der gegenseitigen Anlagen in Teilfonds (11)	0,00	0,00	0,00	0,00
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	21.714.418,45	293.411.596,18	818.968.830,13	186.859.311,56

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Man
Multi-Strategy
Alternative
USD

	Erläuterungen	
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		19.958.425,11
ERTRÄGE		
Zinsen aus Anleihen, netto		0,00
Zinsertrag aus Swap-Kontrakten		0,00
Bankzinsen		0,00
Verwaltungszuschüsse	(10)	60.865,18
Sonstige Einnahmen		0,00
Nachlass auf Anlageverwaltungsgebühr	(6)	1.105,30
SUMME ERTRÄGE		61.970,48
AUFWENDUNGEN		
Managementgebühr	(6)	21.018,63
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft		2.229,03
Erfolgsgebühren	(6)	0,00
Depotbankgebühr	(4)	12.598,52
Domizilstellen-, Administrations- und Transferstellengebühren		43.428,26
Revisionskosten, Druck- und Veröffentlichungskosten		6.217,63
Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement)	(5)	4.301,02
Bankzinsen		53,18
Zinsverbindlichkeiten auf Swap-Kontrakte		0,00
Transaktionskosten	(8)	0,00
Sonstige Aufwendungen	(9)	104.091,08
SUMME AUFWENDUNGEN		193.937,35
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		(131.966,87)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen		0,00
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		69.835,04
Realisierter Nettogewinn aus Futures-Kontrakten		0,00
Realisierter Nettogewinn aus Swap-Kontrakten		0,00
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisengeschäften		(3.170,45)
REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST)		66.664,59
Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachs(es)/(Wertverlusts) aus:		
- Wertpapieren		490.188,66
- Devisentermingeschäften		(694.146,68)
- Optionen		0,00
- Futures-Kontrakten		0,00
- Swap-Kontrakten		0,00
ANSTIEG/(RÜCKGANG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		(269.260,30)
KAPITALBEWEGUNGEN		
Ausgabe von Anteilen		2.820.215,39
Rücknahme von Anteilen		(1.406.854,44)
Gezahlte Dividende	(16)	0,00
Währungsdifferenz	(2f)	0,00
Wegfall der gegenseitigen Anlagen in Teilfonds	(11)	0,00
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		21.102.525,76

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
Man Convertibles Europe
Wertpapierbestand
zum 30. Juni 2021
(in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Anleihen					
Belgien					
Umicore SA 0.00% 23/Jun/2025	200.000	EUR	206.220,00	222.000,00	1,02
			206.220,00	222.000,00	1,02
Summe Anleihen			206.220,00	222.000,00	1,02
Anleihen – Wandelanleihen					
Österreich					
AMS AG 0.88% 28/Sep/2022	400.000	EUR	339.307,76	330.972,26	1,53
AMS AG 2.13% 3/Nov/2027	200.000	EUR	207.020,00	198.446,66	0,91
			546.327,76	529.418,92	2,44
Frankreich					
Archer Obligations SA 0.00% 31/Mar/2023	100.000	EUR	128.830,00	179.048,50	0,82
Atos SE 0.00% 6/Nov/2024	200.000	EUR	236.402,00	252.855,14	1,16
Carrefour SA 0.00% 27/Mar/2024	600.000	EUR	492.716,14	527.447,51	2,43
Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.00% 10/Jan/2022	400.000	EUR	348.409,96	362.634,29	1,67
Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.00% 10/Nov/2023	400.000	EUR	317.368,01	347.246,82	1,60
Electricite de France SA 0.00% 14/Sep/2024	46.000	EUR	665.702,14	701.638,00	3,23
Elis SA 0.00% 6/Oct/2023	7.500	EUR	245.423,93	234.396,45	1,08
Kering SA 0.00% 30/Sep/2022	400.000	EUR	404.160,00	462.525,00	2,13
Maisons du Monde SA 0.13% 6/Dec/2023	12.000	EUR	599.724,00	557.287,04	2,57
Remy Cointreau SA 0.13% 7/Sep/2026	1.200	EUR	166.301,53	209.998,94	0,97
TotalEnergies SE 0.50% 2/Dec/2022	800.000	EUR	684.745,48	688.928,24	3,17
Vinci SA 0.38% 16/Feb/2022	400.000	EUR	380.019,30	382.915,93	1,77
Worldline SA/France 0.00% 30/Jul/2026	1.800	EUR	187.578,58	205.596,56	0,95
			4.857.381,07	5.112.518,42	23,55
Deutschland					
BASF SE 0.93% 9/Mar/2023	1.250.000	EUR	1.040.389,28	1.057.445,82	4,88
Delivery Hero SE 0.25% 23/Jan/2024	400.000	EUR	400.034,29	510.420,00	2,35
Delivery Hero SE 1.00% 23/Jan/2027	200.000	EUR	190.520,00	267.085,00	1,23
Deutsche Post AG 0.05% 30/Jun/2025	600.000	EUR	599.256,00	733.440,00	3,38
Deutsche Wohnen SE 0.33% 26/Jul/2024	200.000	EUR	213.048,00	264.566,66	1,22
Deutsche Wohnen SE 0.60% 5/Jan/2026	300.000	EUR	305.512,50	378.588,00	1,74
RAG-Stiftung 0.00% 17/Jun/2026	200.000	EUR	229.320,00	228.626,00	1,05
Symrise AG 0.24% 20/Jun/2024	300.000	EUR	362.580,00	391.594,57	1,80
Tui AG 5.00% 16/Apr/2028	100.000	EUR	112.010,00	105.061,00	0,48
			3.452.670,07	3.936.827,05	18,13
Italien					
Nexi SpA 1.75% 24/Apr/2027	200.000	EUR	223.058,00	247.100,00	1,14
Prismian SpA 0.00% 17/Jan/2022	400.000	EUR	400.000,00	404.670,00	1,86
Snam SpA 0.00% 20/Mar/2022	100.000	EUR	106.501,00	106.445,71	0,49
			729.559,00	758.215,71	3,49
Luxemburg					
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.50% 4/Aug/2023	300.000	EUR	333.282,00	323.730,00	1,49
Elliott Capital Sarl 0.00% 30/Dec/2022	600.000	EUR	605.360,00	619.864,26	2,86
Klockner & Company 2.00% 8/Sep/2023	200.000	EUR	214.500,00	218.142,00	1,00
			1.153.142,00	1.161.736,26	5,35
Niederlande					
America Movil BV 0.00% 2/Mar/2024	600.000	EUR	640.460,00	616.912,50	2,84
BE Semiconductor Industries NV 0.50% 6/Dec/2024	100.000	EUR	95.766,67	151.395,83	0,70
Brenntag Finance BV 1.88% 2/Dec/2022	250.000	EUR	239.698,24	248.967,03	1,15
ELM BV for Swiss Reinsurance Company Limited 3.25% 13/Jun/2024	200.000	EUR	170.088,15	187.832,03	0,87
Iberdrola International BV 0.00% 11/Nov/2022	200.000	EUR	236.420,00	245.654,00	1,13
Just Eat Takeaway.com NV 0.00% 9/Aug/2025	200.000	EUR	188.120,00	189.536,00	0,87
Just Eat Takeaway.com NV 2.25% 25/Jan/2024	100.000	EUR	129.580,00	129.376,00	0,60
Qiagen NV 0.50% 13/Sep/2023	800.000	EUR	764.179,41	836.495,49	3,85
			2.464.312,47	2.606.168,88	12,01

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
 Man Convertibles Europe
 Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)
 (in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- Vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Spanien					
Amadeus IT Group SA 1.50% 9/Apr/2025	200.000	EUR	242.408,00	270.440,00	1,24
Cellnex Telecom SA 0.50% 5/Jul/2028	400.000	EUR	425.240,00	547.400,00	2,52
Cellnex Telecom SA 1.50% 16/Jan/2026	200.000	EUR	310.220,00	369.700,00	1,70
			977.868,00	1.187.540,00	5,46
Schweiz					
Sika AG 0.15% 5/Jun/2025	500.000	EUR	509.951,28	735.404,34	3,39
Swiss Prime Site AG 0.33% 16/Jan/2025	200.000	EUR	189.422,77	185.369,84	0,85
			699.374,05	920.774,18	4,24
Vereinigtes Konigreich					
BP Capital Markets 1.00% 28/Apr/2023	200.000	EUR	279.513,84	240.802,78	1,11
J Sainsbury plc FRN 30/Jan/2168	100.000	EUR	118.130,57	118.743,67	0,55
Ocado Group plc 0.88% 9/Dec/2025	200.000	EUR	226.134,29	302.232,27	1,39
			623.778,70	661.778,72	3,05
USA					
Glencore Funding LLC 0.00% 27/Mar/2025	200.000	EUR	153.157,38	166.206,98	0,77
			153.157,38	166.206,98	0,77
Summe Anleihen – Wandelanleihen			15.657.570,50	17.041.185,12	78,49
Aktien					
Frankreich					
Ubisoft Entertainment SA	1.113	EUR	88.355,33	65.711,52	0,30
			88.355,33	65.711,52	0,30
Summe Aktien			88.355,33	65.711,52	0,30
Summe ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Borsennotierung			15.952.145,83	17.328.896,64	79,81
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte ubertragbare Wertpapiere					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
Frankreich					
France (Govt of) 0.00% 20/Oct/2021	2.100.000	EUR	2.104.757,63	2.104.402,65	9,69
			2.104.757,63	2.104.402,65	9,69
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			2.104.757,63	2.104.402,65	9,69
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte ubertragbare Wertpapiere			2.104.757,63	2.104.402,65	9,69
Sonstige ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Anleihen – Wandelanleihen					
Italien					
ENI SpA 0.00% 13/Apr/2022	200.000	EUR	205.760,00	200.281,26	0,92
			205.760,00	200.281,26	0,92
Summe Anleihen – Wandelanleihen			205.760,00	200.281,26	0,92
Summe sonstige ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			205.760,00	200.281,26	0,92
SUMME WERTPAPIERBESTAND			18.262.663,46	19.633.580,55	90,42

Die beigefugten Erlauterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Geografische Aufteilung	%
Frankreich	33,54
Deutschland	18,13
Niederlande	12,01
Spanien	5,46
Luxemburg	5,35
Italien	4,41
Schweiz	4,24
Vereinigtes Königreich	3,05
Österreich	2,44
Belgien	1,02
USA	0,77
	90,42

Wirtschaftliche Aufteilung	%
Regierungen	9,69
Chemie	8,85
Nahrungsmittel	6,81
Öl- und Gasproduzenten	5,20
Industrie	4,47
Finanzdienstleistungen	4,35
Immobilien Gesellschaften	4,31
Gesundheitsprodukte und -ausrüstung	3,85
Internet-Software und -Dienstleistungen	3,58
Grundstoffe und Rohstoffe	3,39
Transport	3,38
Elektrizitätsversorgung	3,23
Halbleiter	3,14
Elektrische Ausrüstung	2,99
Telekommunikationsdienste	2,84
Ingenieurs- und Bauwesen	2,52
Software	2,41
Gewerbliche Dienstleistungen	2,38
Bekleidung	2,13
Immobilienanlagefonds	2,07
Autoteile und -ausrüstung	1,67
Automobilhersteller	1,60
Energie und Wasserversorgung	1,08
Kohle	1,05
Versicherungen	0,87
Investmentgesellschaften	0,82
Bergbau (Nichtedelmetalle)	0,77
Erdgas	0,49
Tourismus	0,48
	90,42

Man Umbrella SICAV
Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
zum 30. Juni 2021
(in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Anleihen					
Belgien					
Umicore SA 0.00% 23/Jun/2025	2.200.000	EUR	2.263.442,50	2.442.000,00	0,83
			<u>2.263.442,50</u>	<u>2.442.000,00</u>	<u>0,83</u>
Summe Anleihen			2.263.442,50	2.442.000,00	0,83
Anleihen – Wandelanleihen					
Australien					
Afterpay Limited 0.00% 12/Mar/2026	2.600.000	EUR	1.692.531,09	1.522.209,09	0,52
Cromwell SPV Finance Pty Limited 2.50% 29/Mar/2025	600.000	EUR	651.000,00	589.650,00	0,20
DEXUS Finance Pty Limited 2.30% 19/Jun/2026	1.000.000	EUR	633.361,40	642.559,45	0,22
Flight Centre Travel Group Limited 2.50% 17/Nov/2027	1.000.000	EUR	691.022,71	672.524,43	0,23
Seven Group Holdings Limited 2.20% 5/Mar/2025	800.000	EUR	579.524,43	538.547,12	0,18
			<u>4.247.439,63</u>	<u>3.965.490,09</u>	<u>1,35</u>
Österreich					
AMS AG 2.13% 3/Nov/2027	1.700.000	EUR	1.732.920,00	1.686.796,61	0,57
			<u>1.732.920,00</u>	<u>1.686.796,61</u>	<u>0,57</u>
Belgien					
Sagerpar SA 0.00% 1/Apr/2026	800.000	EUR	813.080,00	805.402,48	0,27
			<u>813.080,00</u>	<u>805.402,48</u>	<u>0,27</u>
Bermuda					
Luye Pharma Group Limited 1.50% 9/Jul/2024	1.823.000	EUR	1.723.672,39	1.594.875,20	0,54
			<u>1.723.672,39</u>	<u>1.594.875,20</u>	<u>0,54</u>
Kanada					
Shopify Inc. 0.13% 1/Nov/2025	862.000	EUR	834.668,91	947.596,04	0,32
			<u>834.668,91</u>	<u>947.596,04</u>	<u>0,32</u>
Kaimaninseln					
Bosideng International Holdings Limited 1.00% 17/Dec/2024	400.000	EUR	361.555,80	435.112,57	0,15
Cathay Pacific Finance III Limited 2.75% 5/Feb/2026	10.000.000	EUR	1.142.970,29	1.112.306,17	0,38
China Yuhua Education Corp. Limited 0.90% 27/Dec/2024	5.000.000	EUR	584.242,65	639.329,72	0,22
ESR Cayman Limited 1.50% 30/Sep/2025	912.000	EUR	809.564,06	828.251,96	0,28
Hansoh Pharmaceutical Group Company Limited 0.00% 22/Jan/2026	1.351.000	EUR	1.108.412,73	1.073.714,06	0,37
Meituan 0.00% 27/Apr/2027	5.600.000	EUR	4.663.162,79	5.142.615,67	1,76
MicroPort Scientific Corp. 0.00% 11/Jun/2026	300.000	EUR	244.997,90	259.611,69	0,09
Sino Biopharmaceutical Limited 0.00% 17/Feb/2025	2.073.000	EUR	2.006.166,63	2.004.197,13	0,69
XD Inc. 1.25% 12/Apr/2026	540.000	EUR	500.045,68	582.848,47	0,20
Zhen Ding Technology Holding Limited 0.00% 30/Jun/2025	2.000.000	EUR	1.775.163,37	1.713.624,76	0,58
			<u>13.196.281,90</u>	<u>13.791.612,20</u>	<u>4,72</u>
China					
Zhejiang Expressway Company Limited 0.00% 20/Jan/2026	500.000	EUR	501.500,00	527.497,50	0,18
			<u>501.500,00</u>	<u>527.497,50</u>	<u>0,18</u>
Dänemark					
GN Store Nord AS 0.00% 21/May/2024	600.000	EUR	691.500,00	760.986,00	0,26
			<u>691.500,00</u>	<u>760.986,00</u>	<u>0,26</u>

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)
(in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Frankreich					
Air France-KLM 0.13% 25/Mar/2026	32.634	EUR	584.801,28	525.865,81	0,18
Carrefour SA 0.00% 27/Mar/2024	2.400.000	EUR	1.901.353,20	2.109.790,03	0,72
Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.00% 10/Jan/2022	1.400.000	EUR	1.165.054,58	1.269.220,00	0,43
Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.00% 10/Nov/2023	3.800.000	EUR	3.253.793,16	3.298.844,76	1,13
Electricite de France SA 0.00% 14/Sep/2024	53.142	EUR	742.694,65	810.574,93	0,28
Kering SA 0.00% 30/Sep/2022	1.300.000	EUR	1.366.674,40	1.503.206,25	0,51
Korian SA 0.88% 6/Mar/2027	7.000	EUR	405.190,61	397.817,25	0,14
Safran SA 0.88% 15/May/2027	13.475	EUR	1.663.337,64	1.903.396,18	0,65
Schneider Electric SE 0.00% 15/Jun/2026	5.030	EUR	961.987,50	989.312,98	0,34
Selena Sarl 0.00% 25/Jun/2025	600.000	EUR	710.760,00	741.265,74	0,25
TotalEnergies SE 0.50% 2/Dec/2022	3.800.000	EUR	3.252.541,05	3.272.409,14	1,11
Ubisoft Entertainment SA 0.00% 24/Sep/2024	8.130	EUR	980.868,24	925.602,78	0,32
Vinci SA 0.38% 16/Feb/2022	1.400.000	EUR	1.389.474,57	1.340.205,75	0,46
Worldline SA 0.00% 30/Jul/2025	37.880	EUR	4.747.562,34	4.676.428,05	1,60
			23.126.093,22	23.763.939,65	8,12
Deutschland					
Acidas AG 0.05% 12/Sep/2023	1.600.000	EUR	1.901.620,00	2.014.536,00	0,69
Delivery Hero SE 0.25% 23/Jan/2024	600.000	EUR	867.120,00	765.630,00	0,26
Deutsche Lufthansa AG 2.00% 17/Nov/2025	500.000	EUR	563.150,00	535.166,65	0,18
Deutsche Post AG 0.05% 30/Jun/2025	1.000.000	EUR	1.142.100,00	1.222.400,00	0,42
Deutsche Wohnen SE 0.33% 26/Jul/2024	1.100.000	EUR	1.244.650,00	1.455.116,63	0,50
Deutsche Wohnen SE 0.60% 5/Jan/2026	1.900.000	EUR	2.130.280,00	2.397.724,00	0,82
LEG Immobilien AG 0.88% 1/Sep/2025	1.800.000	EUR	2.195.100,00	2.238.030,00	0,76
RAG-Stiftung 0.00% 17/Jun/2026	1.600.000	EUR	1.638.615,38	1.829.008,00	0,62
Symrise AG 0.24% 20/Jun/2024	900.000	EUR	1.148.220,00	1.174.783,70	0,40
TAG Immobilien AG 0.63% 27/Aug/2026	600.000	EUR	619.800,00	624.450,00	0,21
Tui AG 5.00% 16/Apr/2028	500.000	EUR	558.050,00	525.305,00	0,18
Zalando SE 0.63% 6/Aug/2027	1.800.000	EUR	2.048.143,30	2.399.326,92	0,81
			16.056.848,68	17.181.476,90	5,85
Israel					
CyberArk Software Limited 0.00% 15/Nov/2024	1.504.000	EUR	1.420.029,71	1.377.578,27	0,47
			1.420.029,71	1.377.578,27	0,47
Italien					
DiaSorin SpA 0.00% 5/May/2028	1.100.000	EUR	1.104.900,00	1.133.345,18	0,39
Nexi SpA 0.00% 24/Feb/2028	1.000.000	EUR	961.800,00	1.020.678,10	0,35
Nexi SpA 1.75% 24/Apr/2027	1.600.000	EUR	1.802.928,00	1.976.800,00	0,67
Pirelli & Company SpA 0.00% 22/Dec/2025	1.700.000	EUR	1.794.390,00	1.762.560,00	0,60
Prismian SpA 0.00% 17/Jan/2022	2.000.000	EUR	2.047.200,00	2.023.350,00	0,69
Prismian SpA 0.00% 2/Feb/2026	1.800.000	EUR	1.856.882,00	1.822.165,74	0,62
Snam SpA 0.00% 20/Mar/2022	3.000.000	EUR	3.142.133,33	3.193.371,30	1,09
			12.710.233,33	12.932.270,32	4,41
Japan					
Ana Holdings Inc. 0.00% 16/Sep/2022	340.000.000	EUR	2.596.478,74	2.558.271,49	0,87
Cosmo Energy Holdings Company Limited 0.00% 5/Dec/2022	140.000.000	EUR	1.105.432,26	1.071.177,58	0,37
Ezaki Glico Company Limited 0.00% 30/Jan/2024	50.000.000	EUR	388.107,42	379.041,70	0,13
Kansai Paint Company Limited 0.00% 17/Jun/2022	120.000.000	EUR	969.698,48	943.755,69	0,32
Kyoritsu Maintenance Company Limited 0.00% 29/Jan/2026	70.000.000	EUR	577.646,67	553.626,43	0,19
Kyushu Electric Power Company Inc. 0.00% 31/Mar/2022	270.000.000	EUR	2.228.645,03	2.050.286,76	0,70
Mitsubishi Chemical Holdings Corp. 0.00% 30/Mar/2022	450.000.000	EUR	3.506.427,81	3.446.546,75	1,18
Mitsubishi Chemical Holdings Corp. 0.00% 29/Mar/2024	220.000.000	EUR	1.813.735,52	1.766.990,45	0,60
Nagoya Railroad Company Limited 0.00% 11/Dec/2024	180.000.000	EUR	1.624.789,68	1.393.046,27	0,48
Park24 Company Limited 0.00% 29/Oct/2025	40.000.000	EUR	309.071,44	296.665,36	0,10
Rohm Company Limited 0.00% 5/Dec/2024	110.000.000	EUR	950.583,73	909.681,08	0,31
SBI Holdings Inc. 0.00% 13/Sep/2023	470.000.000	EUR	3.905.771,13	3.685.604,42	1,25
Shizuoka Bank Limited FRN 25/Jan/2023	2.000.000	EUR	1.741.783,18	1.658.608,99	0,56

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)
(in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Japan (Fortsetzung)					
Sumitomo Metal Mining Company 0.00% 15/Mar/2023	70.000.000	EUR	585.686,55	534.081,98	0,18
Teijin Limited 0.00% 10/Dec/2021	40.000.000	EUR	329.945,05	306.531,93	0,10
Toray Industries Inc. 0.00% 31/Aug/2021	300.000.000	EUR	2.737.707,50	2.289.635,04	0,78
			25.371.510,19	23.843.551,92	8,12
Jersey - Kanalinseln					
Cornwall Jersey Limited 0.75% 16/Apr/2026	600.000	EUR	673.985,24	682.302,89	0,23
			673.985,24	682.302,89	0,23
Luxemburg					
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.00% 25/Jul/2024	10.000.000	EUR	1.188.786,80	1.186.951,79	0,40
Elliott Capital Sarl 0.00% 30/Dec/2022	900.000	EUR	924.840,00	929.796,39	0,32
Iwg Group Holding Sarl 0.50% 9/Dec/2027	500.000	EUR	589.768,53	569.511,83	0,19
Lagfin SCA 2.00% 2/Jul/2025	300.000	EUR	349.080,00	369.500,01	0,13
Oliver Capital Sarl 0.00% 29/Dec/2023	2.300.000	EUR	2.413.610,00	2.473.098,00	0,84
			5.466.085,33	5.528.858,02	1,88
Malaysia					
Cerah Capital Limited 0.00% 8/Aug/2024	1.206.000	EUR	1.045.109,87	1.014.607,12	0,35
Cindai Capital Limited 0.00% 8/Feb/2023	1.742.000	EUR	1.522.491,45	1.507.485,88	0,51
			2.567.601,32	2.522.093,00	0,86
Niederlande					
America Movil BV 0.00% 2/Mar/2024	2.400.000	EUR	2.549.103,00	2.467.650,00	0,84
Dufry One BV 0.75% 30/Mar/2026	600.000	EUR	575.680,57	542.992,61	0,19
ELM BV for Swiss Reinsurance Company Limited 3.25% 13/Jun/2024	1.200.000	EUR	1.097.874,92	1.126.992,16	0,38
Iberdrola International BV 0.00% 11/Nov/2022	1.300.000	EUR	1.500.586,00	1.596.751,00	0,54
Just Eat Takeaway.com NV 0.00% 9/Aug/2025	1.200.000	EUR	1.193.520,00	1.137.216,00	0,39
Qiagen NV 0.50% 13/Sep/2023	1.800.000	EUR	1.668.955,22	1.882.114,85	0,64
STMicroelectronics NV 0.00% 4/Aug/2027	2.800.000	EUR	2.483.434,66	2.847.457,63	0,97
Yandex NV 0.75% 3/Mar/2025	2.000.000	EUR	1.699.088,36	2.159.119,66	0,74
			12.768.242,73	13.760.293,91	4,69
Neuseeland					
Xero Investments Limited 0.00% 2/Dec/2025	1.570.000	EUR	1.337.694,64	1.317.931,53	0,45
			1.337.694,64	1.317.931,53	0,45
Republik Korea (Süd)					
Kakao Corp. 0.00% 28/Apr/2023	600.000	EUR	527.332,72	866.784,72	0,30
LG Display Company Limited 1.50% 22/Aug/2024	1.400.000	EUR	1.242.156,12	1.586.347,92	0,54
			1.769.488,84	2.453.132,64	0,84
Singapur					
SGX Treasury I Pte Limited 0.00% 1/Mar/2024	700.000	EUR	709.000,00	724.780,00	0,25
Singapore Airlines Limited 1.63% 3/Dec/2025	1.750.000	EUR	1.184.894,38	1.218.726,23	0,42
			1.893.894,38	1.943.506,23	0,67
Spanien					
Cellnex Telecom SA 0.50% 5/Jul/2028	600.000	EUR	780.060,00	821.100,00	0,28
International Consolidated Airlines Group SA 0.63% 17/Nov/2022	700.000	EUR	676.830,00	680.283,31	0,23
International Consolidated Airlines Group SA 1.13% 18/May/2028	700.000	EUR	713.680,00	672.175,00	0,23
			2.170.570,00	2.173.558,31	0,74
Schweiz					
Swiss Prime Site AG 0.33% 16/Jan/2025	1.630.000	EUR	1.494.173,29	1.510.764,18	0,51
			1.494.173,29	1.510.764,18	0,51
Taiwan					
Asia Cement Corp. 0.00% 21/Sep/2023	500.000	EUR	517.666,57	638.755,38	0,22
GlobalWafers Company Limited 0.00% 1/Jun/2026	2.000.000	EUR	1.747.727,85	1.817.185,26	0,62
Hon Hai Precision Industry Company Limited 0.00% 6/Nov/2022	600.000	EUR	581.797,95	561.598,79	0,19
United Microelectronics Corp. 0.00% 7/Jul/2026**	300.000	EUR	251.994,96	252.972,43	0,09
Win Semiconductors Corp. 0.00% 14/Jan/2026	600.000	EUR	527.152,92	530.293,45	0,18
			3.626.340,25	3.800.805,31	1,30

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)
(in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich					
BP Capital Markets 1.00% 28/Apr/2023	1.400.000	EUR	1.720.028,10	1.685.619,47	0,57
Ocado Group plc 0.75% 18/Jan/2027	400.000	EUR	497.574,18	478.201,46	0,16
Ocado Group plc 0.88% 9/Dec/2025	300.000	EUR	474.725,61	453.348,40	0,15
WH Smith plc 1.63% 7/May/2026	700.000	EUR	832.779,20	801.053,26	0,27
			<u>3.525.107,09</u>	<u>3.418.222,59</u>	<u>1,15</u>
USA					
Asahi Refining USA Inc. 0.00% 16/Mar/2026	500.000	EUR	421.302,36	454.823,34	0,16
Euronet Worldwide Inc. 0.75% 15/Mar/2049	1.450.000	EUR	1.291.661,48	1.398.856,41	0,48
Glencore Funding LLC 0.00% 27/Mar/2025	800.000	EUR	613.440,17	664.827,93	0,23
Illumina Inc. 0.00% 15/Aug/2023	2.653.000	EUR	2.404.840,90	2.849.240,57	0,97
JPMorgan Chase Bank 0.00% 28/Dec/2023	800.000	EUR	707.365,57	686.398,52	0,23
JPMorgan Chase Bank 0.00% 18/Feb/2024	500.000	EUR	568.295,00	547.312,50	0,19
Morgan Stanley Finance LLC 0.00% 17/Dec/2021	400.000	EUR	398.840,00	401.510,00	0,14
New Relic Inc. 0.50% 1/May/2023	1.712.000	EUR	1.558.088,00	1.438.443,80	0,49
NRG Energy Inc. 2.75% 1/Jun/2048	2.122.000	EUR	2.087.069,57	2.077.767,06	0,70
Nutanix Inc. 0.00% 15/Jan/2023	1.453.000	EUR	1.193.088,34	1.302.099,97	0,44
Palo Alto Networks Inc. 0.75% 1/Jul/2023	3.000	EUR	2.697,06	3.695,47	0,00
Pure Storage Inc. 0.13% 15/Apr/2023	1.999.000	EUR	1.736.717,51	1.780.568,75	0,61
Snap Inc. 0.00% 1/May/2027	902.000	EUR	764.281,32	818.182,00	0,28
Teladoc Health Inc. 1.25% 1/Jun/2027	703.000	EUR	681.412,16	668.155,29	0,23
Uber Technologies Inc. 0.00% 15/Dec/2025	997.000	EUR	904.659,27	854.425,72	0,29
Vishay Intertechnology Inc. 2.25% 15/Jun/2025	1.246.000	EUR	989.260,98	1.107.152,80	0,38
Zynga Inc. 0.00% 15/Dec/2026	1.661.000	EUR	1.439.196,83	1.502.543,91	0,51
Zynga Inc. 0.25% 1/Jun/2024	385.000	EUR	366.243,96	448.920,81	0,15
			<u>18.128.460,48</u>	<u>19.004.924,85</u>	<u>6,48</u>
Vietnam					
Vingroup JSC 3.00% 20/Apr/2026	1.000.000	EUR	861.251,91	942.322,29	0,32
			<u>861.251,91</u>	<u>942.322,29</u>	<u>0,32</u>
Britische Jungferninseln					
ADM AG Holding Limited 0.00% 26/Aug/2023	600.000	EUR	554.050,39	540.096,13	0,18
China Conch Venture Holdings International Limited 0.00% 5/Sep/2023	6.000.000	EUR	665.945,41	718.506,91	0,24
China Yangtze Power International BVI 2 Limited 0.00% 9/Nov/2021	500.000	EUR	505.919,64	503.250,00	0,17
CP Foods Capital Limited 0.50% 18/Jun/2025	800.000	EUR	706.001,01	691.457,96	0,24
Link 2019 CB Limited 1.60% 3/Apr/2024	8.000.000	EUR	912.540,25	881.479,67	0,30
Smart Insight International Limited 4.50% 5/Dec/2023	20.000.000	EUR	2.253.776,40	2.363.642,46	0,82
Strategic International Group Limited 0.00% 29/Jun/2025	645.000	EUR	718.276,20	643.065,00	0,22
Universe Trek Limited 2.50% 8/Jul/2025	690.000	EUR	614.836,26	693.112,83	0,24
Viva Biotech 1.00% 30/Dec/2025	500.000	EUR	429.395,33	443.970,99	0,15
Weimob Investment Limited 0.00% 7/Jun/2026	575.000	EUR	499.491,22	523.955,97	0,18
			<u>7.860.232,11</u>	<u>8.002.537,92</u>	<u>2,74</u>
Summe Anleihen – Wandelanleihen			166.568.905,57	170.240.326,85	58,04
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			168.832.348,07	172.682.326,85	58,87
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen – Wandelanleihen					
Bermuda					
Jazz Investments 1.50% 15/Aug/2024	1.450.000	EUR	1.214.930,84	1.347.431,85	0,46
Jazz Investments 2.00% 15/Jun/2026	1.545.000	EUR	1.400.756,06	1.735.731,09	0,59
			<u>2.615.686,90</u>	<u>3.083.162,94</u>	<u>1,05</u>
Kaimaninseln					
Herbalife Nutrition Limited 2.63% 15/Mar/2024	1.249.000	EUR	1.057.562,37	1.150.314,36	0,39
Huazhu Group Limited 0.38% 1/Nov/2022	7.000	EUR	6.374,97	7.512,13	0,00
iQIYI Inc. 2.00% 1/Apr/2025	4.495.000	EUR	3.698.454,46	3.552.264,81	1,22
iQIYI Inc. 3.75% 1/Dec/2023	1.600.000	EUR	1.319.601,17	1.375.117,63	0,47
JOYY Inc. 0.75% 15/Jun/2025	1.806.000	EUR	1.644.584,48	1.539.843,66	0,52
Pinduoduo Inc. 0.00% 1/Dec/2025	2.075.000	EUR	1.927.895,96	1.797.963,61	0,61
			<u>9.654.473,41</u>	<u>9.423.016,20</u>	<u>3,21</u>

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)
(in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Japan					
Digital Garage Inc. 0.00% 14/Sep/2023	80.000.000	EUR	653.042,07	675.818,83	0,23
Lixil Corp. 0.00% 4/Mar/2022	120.000.000	EUR	963.770,28	915.284,21	0,31
Medipal Holdings Corp. 0.00% 7/Oct/2022	80.000.000	EUR	736.645,93	638.996,46	0,21
Menicon Company Limited 0.00% 29/Jan/2025	10.000.000	EUR	86.240,91	89.569,23	0,03
Relo Group Inc. 0.00% 17/Dec/2027	50.000.000	EUR	421.059,62	394.619,33	0,13
Ship Healthcare Holdings Inc. 0.00% 13/Dec/2023	80.000.000	EUR	674.488,48	675.983,42	0,23
			3.535.247,29	3.390.271,48	1,14
USA					
Airbnb Inc. 0.00% 15/Mar/2026	3.175.000	EUR	2.638.656,43	2.523.347,25	0,86
Akamai Technologies Inc. 0.13% 1/May/2025	2.467.000	EUR	2.188.642,59	2.723.469,60	0,93
Akamai Technologies Inc. 0.38% 1/Sep/2027	2.721.000	EUR	2.549.068,29	2.659.444,46	0,90
BioMarin Pharmaceuticals Inc. 0.60% 1/Aug/2024	3.852.000	EUR	3.458.473,02	3.388.143,06	1,16
BlackLine Inc. 0.00% 15/Mar/2026	524.000	EUR	407.559,21	424.086,78	0,14
Booking Holdings Inc. 0.75% 1/May/2025	1.383.000	EUR	1.411.351,44	1.655.340,80	0,56
Cable One Inc. 0.00% 15/Mar/2026	850.000	EUR	706.340,54	716.069,99	0,24
Chegg Inc. 0.00% 1/Sep/2026	2.968.000	EUR	2.541.020,06	2.606.912,61	0,89
Coupa Software 0.38% 15/Jun/2026	500.000	EUR	576.923,08	490.349,10	0,17
DexCom Inc. 0.25% 15/Nov/2025	1.571.000	EUR	1.284.609,19	1.388.111,43	0,47
DISH Network Corp. 0.00% 15/Dec/2025	2.031.000	EUR	1.682.272,04	1.997.055,81	0,69
DISH Network Corp. 3.38% 15/Aug/2026	4.332.000	EUR	3.626.051,93	3.730.538,02	1,27
DraftKings Inc. 0.00% 15/Mar/2028	1.688.000	EUR	1.348.434,67	1.282.075,78	0,44
Dropbox Inc. 0.00% 1/Mar/2026	1.497.000	EUR	1.288.580,92	1.354.625,95	0,46
Dropbox Inc. 0.00% 1/Mar/2028	693.000	EUR	595.977,10	639.042,54	0,22
Enphase Energy Inc. 0.00% 1/Mar/2028	1.250.000	EUR	961.387,63	1.027.294,25	0,35
Etsy Inc. 0.13% 1/Sep/2027	1.763.000	EUR	1.592.311,34	1.909.632,72	0,65
Everbridge Inc. 0.13% 15/Dec/2024	529.000	EUR	547.749,37	612.011,07	0,21
Exact Sciences Corp. 0.38% 15/Mar/2027	738.000	EUR	776.427,72	823.891,03	0,28
Exact Sciences Corp. 0.38% 1/Mar/2028	2.199.000	EUR	1.652.693,16	2.300.250,61	0,78
FireEye Inc. 0.88% 1/Jun/2024	888.000	EUR	786.622,47	851.674,67	0,29
Ford Motor Credit Company LLC 0.00% 15/Mar/2026	2.287.000	EUR	1.930.224,78	2.152.738,31	0,73
Fortive Corp. 0.88% 15/Feb/2022	4.491.000	EUR	3.919.500,33	3.796.997,92	1,30
Halozyme Therapeutics Inc. 0.25% 1/Mar/2027	1.242.000	EUR	978.711,37	983.145,06	0,34
Insmed Inc. 1.75% 15/Jan/2025	960.000	EUR	977.362,08	850.055,19	0,29
Integra LifeSciences Holdings Corp. 0.50% 15/Aug/2025	1.510.000	EUR	1.327.540,78	1.405.777,15	0,48
Ionis Pharmaceuticals Inc. 0.00% 1/Apr/2026	580.000	EUR	458.678,37	479.608,99	0,16
Ionis Pharmaceuticals Inc. 0.13% 15/Dec/2024	755.000	EUR	704.726,72	591.990,93	0,20
J2 Global Inc. 1.75% 1/Nov/2026	650.000	EUR	565.802,81	702.208,56	0,24
JPMorgan Chase & Company 0.25% 1/May/2023	2.240.000	EUR	1.880.805,52	2.045.872,33	0,70
JPMorgan Chase Bank 0.13% 1/Jan/2023	1.380.000	EUR	1.338.007,02	1.295.866,43	0,44
LendingTree Inc. 0.50% 15/Jul/2025	2.228.000	EUR	1.860.107,16	1.710.664,94	0,58
Liberty Broadband Corp. 1.25% 30/Sep/2050	2.000.000	EUR	1.658.232,18	1.703.803,02	0,58
Liberty Broadband Corp. 2.75% 30/Sep/2050	1.405.000	EUR	1.232.164,71	1.241.503,92	0,42
Liberty Media Corp. 0.50% 1/Dec/2050	1.459.000	EUR	1.249.279,62	1.419.721,66	0,48
Liberty Media Corp. 1.38% 15/Oct/2023	2.055.000	EUR	1.963.561,09	2.310.120,48	0,79
Liberty Media Corp. 2.75% 1/Dec/2049	2.799.000	EUR	2.345.153,81	2.473.093,40	0,85
Liberty Media Corp-Liberty Formula One 1.00% 30/Jan/2023	1.491.000	EUR	1.476.540,98	1.702.856,78	0,58
Live Nation Entertainment Inc. 2.50% 15/Mar/2023	86.000	EUR	77.244,25	102.106,81	0,03
LivePerson Inc. 0.00% 15/Dec/2026	484.000	EUR	444.776,12	438.393,11	0,15
Lumentum Holdings Inc. 0.50% 15/Dec/2026	2.189.000	EUR	1.932.198,74	2.008.510,78	0,68
Medallia Inc. 0.13% 15/Sep/2025	1.416.000	EUR	1.284.868,16	1.307.615,76	0,45
MP Materials Corp. 0.25% 1/Apr/2026	1.125.000	EUR	814.083,39	1.012.815,90	0,34
NextEra Energy Partners LP 0.00% 15/Nov/2025	500.000	EUR	458.857,50	458.548,99	0,16
NortonLifeLock Inc. 2.00% 15/Aug/2022	1.179.000	EUR	1.171.572,71	1.372.668,87	0,47
Oak Street Health Inc. 0.00% 15/Mar/2026	1.125.000	EUR	977.056,01	972.216,00	0,33
ON Semiconductor Corp. 0.00% 1/May/2027	417.000	EUR	353.888,23	367.281,60	0,13
Palo Alto Networks Inc. 0.38% 1/Jun/2025	2.568.000	EUR	2.408.094,26	2.974.886,92	1,01
Pegasystems Inc. 0.75% 1/Mar/2025	1.364.000	EUR	1.115.087,48	1.377.957,33	0,47
Proofpoint Inc. 0.25% 15/Aug/2024	1.826.000	EUR	1.633.713,05	1.930.373,32	0,66

Die beigefugten Erlauerungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV
 Man Convertibles Global
 Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)
 (in EUR)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
USA (Fortsetzung)					
Rapid7 Inc. 0.25% 15/Mar/2027	704.000	EUR	620.320,03	660.852,09	0,23
Redfin Corp. 0.00% 15/Oct/2025	1.574.000	EUR	1.301.465,94	1.494.286,50	0,51
Redfin Corp. 0.50% 1/Apr/2027	1.167.000	EUR	878.059,21	974.442,63	0,33
RingCentral Inc. 0.00% 15/Mar/2026	850.000	EUR	727.662,74	728.176,06	0,25
Shift4 Payments Inc. 0.00% 15/Dec/2025	604.000	EUR	609.041,40	690.226,39	0,24
SolarEdge Technologies Inc. 0.00% 15/Sep/2025	300.000	EUR	288.970,50	316.932,17	0,11
Splunk Inc. 0.50% 15/Sep/2023	1.102.000	EUR	1.057.806,21	1.088.964,92	0,36
Splunk Inc. 1.13% 15/Sep/2025	1.328.000	EUR	1.335.034,79	1.372.968,91	0,47
Splunk Inc. 1.13% 15/Jun/2027	939.000	EUR	764.842,41	770.843,55	0,26
Square Inc. 0.25% 1/Nov/2027	1.818.000	EUR	1.721.842,22	1.795.566,51	0,61
Sunnova Energy International Inc. 0.25% 1/Dec/2026	301.000	EUR	267.813,55	313.927,08	0,11
Twitter Inc. 1.00% 15/Sep/2021	1.198.000	EUR	995.570,62	1.030.292,02	0,35
Tyler Technologies Inc. 0.25% 15/Mar/2026	509.000	EUR	465.170,92	472.741,93	0,16
Viavi Solutions Inc. 1.00% 1/Mar/2024	922.000	EUR	939.951,01	1.110.769,37	0,38
			83.132.542,98	89.113.758,12	30,37
Summe Anleihen – Wandelanleihen			98.937.950,58	105.010.208,74	35,77
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			98.937.950,58	105.010.208,74	35,77
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen					
Bermuda					
Rexlot Holdings Limited 4.50% 17/Apr/2022*	10.447.626	EUR	793.280,23	113.443,83	0,04
			793.280,23	113.443,83	0,04
Summe forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere			793.280,23	113.443,83	0,04
Anleihen – Wandelanleihen					
Kaimaninseln					
China Milk Products Group Limited 0.00% 5/Jan/2021*	1.700.000	EUR	–	–	0,00
			–	–	0,00
Taiwan					
Promos Technologies Inc. 0.00% 14/Feb/2022*	1.500.000	EUR	–	–	0,00
			–	–	0,00
USA					
Sunedis 0.00% 1/Jun/2023**	8.000.000	EUR	7.183.483,43	67.459,31	0,02
			7.183.483,43	67.459,31	0,02
Summe Anleihen – Wandelanleihen			7.183.483,43	67.459,31	0,02
Aktien					
Thailand					
Alphatec Electronics**	34.000	EUR	–	–	0,00
			–	–	0,00
Summe Aktien			–	–	0,00
Optionsscheine Aktien					
Indonesien					
Graha Andrasentra Propertindo 17/Jan/2022**	48.700.536	EUR	–	–	0,00
			–	–	0,00
Summe Optionsscheine Aktien			–	–	0,00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			7.976.763,66	180.903,14	0,06
SUMME WERTPAPIERBESTAND			275.747.062,31	277.873.438,73	94,70

* Notleidende Wertpapiere

** Illiquide Wertpapiere

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV

Man Convertibles Global

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios

zum 30. Juni 2021

(als Prozentsatz des Nettovermögens)



Geografische Aufteilung	%	Wirtschaftliche Aufteilung	%
USA	36,87	Internet-Software und -Dienstleistungen	11,37
Japan	9,26	Software	7,13
Frankreich	8,12	Finanzdienstleistungen	6,80
Kaimaninseln	7,93	Immobilienanlagefonds	5,09
Deutschland	5,85	Biotechnologie	4,33
Niederlande	4,69	Gewerbliche Dienstleistungen	4,29
Italien	4,41	Chemie	4,21
Britische Jungferninseln	2,74	Telekommunikationsdienste	4,10
Luxemburg	1,88	Pharmazeutika	3,96
Bermuda	1,63	Elektronikgeräte	2,99
Australien	1,35	Halbleiter	2,87
Taiwan	1,30	Fluggesellschaften	2,49
Vereinigtes Königreich	1,15	Computer und Peripheriegeräte	2,43
Belgien	1,10	Öl- und Gasproduzenten	2,05
Malaysia	0,86	Investmentgesellschaften	1,95
Republik Korea (Süd)	0,84	Automobilhersteller	1,86
Spanien	0,74	Nahrungsmittel	1,79
Singapur	0,67	Elektrizitätsversorgung	1,68
Österreich	0,57	Elektrische Ausrüstung	1,57
Schweiz	0,51	Banken	1,56
Israel	0,47	Einzelhandel	1,42
Neuseeland	0,45	Freizeit und Unterhaltung	1,41
Kanada	0,32	Gesundheitsprodukte und -ausrüstung	1,39
Vietnam	0,32	Radio- und Fernsehsender	1,27
Dänemark	0,26	Bekleidung	1,20
Jersey - Kanalinseln	0,23	Energie und Wasserversorgung	1,11
China	0,18	Erdgas	1,09
	94,70	Autoteile und -ausrüstung	1,03
		Alternative Energiequellen	0,92
		Immobilienunternehmen	0,82
		Bergbau (Nichtedelmetalle)	0,73
		Hotelgewerbe	0,67
		Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	0,65
		Industrie	0,64
		Kohle	0,62
		Drähte und Seile	0,62
		Transport	0,60
		Medizin	0,57
		Baumaterialien	0,53
		Medien	0,47
		Tourismus	0,41
		Versicherungen	0,38
		Telekommunikationsausrüstung	0,38
		Gesundheitswesen – Dienstleistungen	0,35
		Ingenieurs- und Bauwesen	0,28
		Gesundheitswesen – Produkte	0,26
		Landwirtschaft	0,18
		Vertrieb und Großhandel	0,18
			94,70

Man Umbrella SICAV
 Man AHL Trend Alternative
 Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2021
 (in USD)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Structured Notes					
Vereinigtes Königreich					
Credit Suisse 0.00% 30/Dec/2049	27.700.000	USD	54.528.225,56	75.513.136,20	9,22
			54.528.225,56	75.513.136,20	9,22
Summe Structured Notes			54.528.225,56	75.513.136,20	9,22
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			54.528.225,56	75.513.136,20	9,22
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% 2/Sep/2021	30.000.000	USD	29.992.635,42	29.997.471,00	3,66
United States Treasury Bill 0.00% 9/Sep/2021	30.000.000	USD	29.994.531,25	29.997.486,00	3,67
United States Treasury Bill 0.00% 4/Nov/2021	30.000.000	USD	29.995.479,17	29.994.678,00	3,66
United States Treasury Bill 0.00% 18/Nov/2021	30.000.000	USD	29.996.791,67	29.994.384,00	3,66
			119.979.437,51	119.984.019,00	14,65
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			119.979.437,51	119.984.019,00	14,65
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			119.979.437,51	119.984.019,00	14,65
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Structured Notes					
Schweiz					
Credit Suisse AG 0.00% perpetual	7.580.712	USD	58.228.896,27	75.444.784,71	9,21
			58.228.896,27	75.444.784,71	9,21
Summe Structured Notes			58.228.896,27	75.444.784,71	9,21
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			58.228.896,27	75.444.784,71	9,21
SUMME WERTPAPIERBESTAND			232.736.559,34	270.941.939,91	33,08

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV

Man AHL Trend Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios zum 30. Juni 2021

(als Prozentsatz des Nettovermögens)



Geografische Aufteilung	%
USA	14,65
Vereinigtes Königreich	9,22
Schweiz	9,21
	33,08

Wirtschaftliche Aufteilung	%
Banken	18,43
Regierungen	14,65
	33,08

Man Umbrella SICAV
 Man AHL Alpha Core Alternative
 Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2021
 (in USD)



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					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
USA					
United States Treasury Bill 0,00 % 8. Jul. 2021	12.000.000	USD	11.995.268,00	11.999.935,20	6,42
United States Treasury Bill 0.00% 2/Sep/2021	10.000.000	USD	9.997.569,44	9.999.157,00	5,35
United States Treasury Bill 0.00% 9/Sep/2021	10.000.000	USD	9.998.177,08	9.999.162,00	5,35
United States Treasury Bill 0.00% 16/Sep/2021	5.000.000	USD	4.999.319,44	4.999.566,50	2,68
United States Treasury Bill 0.00% 4/Nov/2021	15.000.000	USD	14.997.739,58	14.997.339,00	8,03
United States Treasury Bill 0.00% 18/Nov/2021	10.000.000	USD	9.998.906,25	9.998.128,00	5,35
			<u>61.986.979,79</u>	<u>61.993.287,70</u>	<u>33,18</u>
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			61.986.979,79	61.993.287,70	33,18
Summe Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
			61.986.979,79	61.993.287,70	33,18
SUMME WERTPAPIERBESTAND			61.986.979,79	61.993.287,70	33,18

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV

Man AHL Alpha Core Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios zum 30. Juni 2021

(als Prozentsatz des Nettovermögens)



Geografische Aufteilung	%
USA	33,18
	33,18

Wirtschaftliche Aufteilung	%
Regierungen	33,18
	33,18

Man Umbrella SICAV
 Man Multi-Strategy Alternative
 Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2021
 (in USD)



Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren					
Fonds					
Irland					
GLG Funds plc - GLG Global Convertible UCITS*	21.731	USD	2.820.092,48	3.391.630,05	16,07
Man Funds VI plc - Man AHL TargetRisk*	8.872	USD	1.474.462,75	1.690.175,25	8,01
Man Funds VI plc - Man European Mid-Cap Eq Alt*	23.632	USD	2.962.681,91	2.960.791,39	14,03
Man Funds VI plc - Man GLG Alpha Select Alternative *	22.943	USD	3.386.094,20	3.695.360,07	17,50
Man Funds VI plc - Man GLG European Equity Alternative*	27.479	USD	3.376.641,28	3.578.338,43	16,96
Man Funds VI plc - Man GLG Event Driven Alternative*	14.850	USD	1.501.460,72	1.803.705,78	8,55
			15.521.433,34	17.120.000,97	81,12
Luxemburg					
Man AHL Trend Alternative**	10.326	USD	1.729.653,65	1.752.886,42	8,31
			1.729.653,65	1.752.886,42	8,31
Summe Fonds			17.251.086,99	18.872.887,39	89,43
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren			17.251.086,99	18.872.887,39	89,43
SUMME WERTPAPIERBESTAND			17.251.086,99	18.872.887,39	89,43

* Fonds verbundener Parteien

** Gegenseitige Anlage (siehe Erläuterung 11).

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Man Umbrella SICAV

Man Multi-Strategy Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Portfolios zum 30. Juni 2021

(als Prozentsatz des Nettovermögens)



Geografische Aufteilung	%
Irland	81,12
Luxemburg	8,31
	89,43

Wirtschaftliche Aufteilung	%
Offene Fonds	89,43
	89,43

Erläuterungen zum Abschluss Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

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 Umbrella SICAV – Man Convertibles Europe
- Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Global
- Man Umbrella SICAV – Man AHL Trend Alternative
- Man Umbrella SICAV – Man AHL Alpha Core Alternative
- Man Umbrella SICAV – Man Multi-Strategy Alternative

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

Das Anlageziel des Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Europe (ein „Teilfonds“) ist die Wertsteigerung der Anlagen in aktienbezogenen Wertpapieren verbunden mit einer angestrebten Sicherheit des Kapitals zugunsten der Anleger. Zu diesem Zweck wird das Vermögen dieses Teilfonds zu mindestens zwei Dritteln in Wandelanleihen, Umtauschanleihen, wandelbaren Notes, Optionsanleihen, Notes mit Optionsscheinen auf übertragbare Wertpapiere, Zwangswandelanleihen, wandelbaren Vorzugsaktien angelegt, die von Emittenten mit Sitz oder einem überwiegenden Teil ihrer Produktion oder ihres Umsatzes in einem Mitgliedstaat der europäischen Wirtschafts- und Währungsunion oder einem anderen europäischen Land begeben werden.

Das Anlageziel des Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Global (ein „Teilfonds“) 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 2021

Erläuterung 1 – Allgemeines (Fortsetzung)

Der Man Umbrella SICAV – Man AHL Trend Alternative (ein „Teilfonds“) 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 Man Umbrella SICAV – Man AHL Alpha Core Alternative (ein „Teilfonds“) 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.

Das Anlageziel des Man Umbrella SICAV – Man Multi-Strategy Alternative (ein „Teilfonds“) besteht in einem beständigen und langfristigen Kapitalzuwachs für die Anteilhaber jeder Anteilsklasse. Um sein Anlageziel zu erreichen, wird der Teilfonds vornehmlich in ein diversifiziertes Portfolio aus OGAW und zulässigen Nicht-OGAW investieren, von denen eine Mehrheit in alternative Anlagestrategien anlegt („Zielfonds“) und direkte und indirekte Handelsgeschäfte mit und Anlagen in Wertpapieren, insbesondere Aktien, Anleihen mit und ohne Investment-Grade-Rating, Währungen, Derivaten (insbesondere Futures, Optionen und Swaps), OTC-Derivaten und anderen Anlageklassen, tätigen („direkte Anlagen“ und zusammen mit den Zielfonds die „Anlagestrategien“). In Übereinstimmung mit den OGAW-Auflagen kann der Teilfonds bis zu 20 % seines Nettovermögens in beliebige Zielfonds und insgesamt bis zu 100 % seines Gesamtvermögens in Zielfonds anlegen, sofern die Gesamtheit der Anlagen in zulässige Nicht-OGAW 30 % des Nettovermögens des Teilfonds nicht übersteigt. Ungeachtet der vorstehenden Angaben werden die Zielfonds vornehmlich OGAW sein. Der Teilfonds darf in anderen Teilfonds des Fonds anlegen.

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 je Anteil wird berechnet, indem das Nettofondsvermögen des betreffenden Teilfonds durch die Gesamtzahl der Anteile dieses Teilfonds dividiert wird.

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

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

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

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.

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 Futures-Kontrakten, Devisenterminkontrakten, Optionen 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 Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten“ angegeben.

Devisentermingeschäfte

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

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

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

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

c) Bewertung von Futures-Kontrakten, Devisenterminkontrakten, Optionen und Swap-Kontrakten (Fortsetzung)

Optionen

Ausstehende Optionen werden, soweit vorhanden, zum Marktpreis bei Geschäftsschluss oder zum letzten verfügbaren Marktpreis der Instrumente bewertet. Die Bewertung von OTC-Optionen erfolgt auf Basis von Kursen externer Preisanbieter/Modelle.

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

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Optionen wird in der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionsverkäufen“ ausgewiesen.

Swap-Kontrakte

Ausstehende Swap-Kontrakte werden unter Verwendung der Bewertung durch die Gegenpartei basierend auf Daten zum Geschäftsschluss bewertet und mit den Angaben eines unabhängigen Bewertungsanbieters abgestimmt. 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 Nettovermögensaufstellung unter „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten“ erfasst.

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 Teilfonds

Wechselkurse zum 30. Juni 2021:

1 EUR =	1,579620	AUD	1 EUR =	4,923260	MYR
1 EUR =	5,950655	BRL	1 EUR =	10,204889	NOK
1 EUR =	1,468500	CAD	1 EUR =	1,697174	NZD
1 EUR =	1,096187	CHF	1 EUR =	4,544967	PEN
1 EUR =	863,729060	CLP	1 EUR =	57,888314	PHP
1 EUR =	7,661942	CNH	1 EUR =	4,514722	PLN
1 EUR =	4.425,000000	COP	1 EUR =	4,924507	RON
1 EUR =	0,858446	GBP	1 EUR =	86,631602	RUB
1 EUR =	9,209515	HKD	1 EUR =	10,141965	SEK
1 EUR =	351,030388	HUF	1 EUR =	1,594087	SGD
1 EUR =	17.194,432362	IDR	1 EUR =	38,008397	THB
1 EUR =	3,864251	ILS	1 EUR =	10,302499	TRY
1 EUR =	88,144790	INR	1 EUR =	33,041710	TWD
1 EUR =	131,623051	JPY	1 EUR =	1,185900	USD
1 EUR =	1.335,503052	KRW	1 EUR =	16,933204	ZAR
1 EUR =	23,611747	MXN			

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

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.

Mit Wirkung zum 31. Dezember 2020 gilt, dass 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, der Verwaltungsrat beschließen kann, 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.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

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 verminderter 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.

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren

Die Anlageverwalter erhalten folgende Anlageverwaltungsgebühren p.a. aus dem Netto-Teilfondsvermögen folgender Teilfonds:

Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Europe:	
Man Convertibles Europe D EUR Acc	1,50%
Man Convertibles Europe I EUR Acc	0,75%
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	1,50%
Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Global:	
Man Convertibles Global D EUR Acc	1,50%
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 D H CHF Acc	1,50%
Man Convertibles Global D H USD Acc	1,50%
Man Convertibles Global I H USD Acc	0,75%
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 Umbrella SICAV – Man AHL Trend Alternative:	
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	2,50%
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	1,50%
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	2,50%
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	1,50%
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	2,50%
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	2,50%
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	2,50%
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	2,00%
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	1,50%
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	1,50%
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	2,50%
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	2,00%
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	1,50%
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	1,50%
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	1,50%
Man Umbrella SICAV – Man AHL Alpha Core Alternative:	
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 H EUR Acc	1,00%
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	1,00%
Man Umbrella SICAV – Man Multi-Strategy Alternative*:	
Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	2,00%

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	2,00%
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	2,00%

* Die Verwaltungsgebühr wird nur für direkte Anlagen erhoben. Für Anlagen in den Zielfonds des Man Umbrella SICAV – Man Multi-Strategy Alternative wird keine Verwaltungsgebühr erhoben. Die maximale erhobene Anlageverwaltungsgebühr eines Zielfonds beträgt 3,00 % für Man Umbrella SICAV – Man Multi-Strategy Alternative.

Die Anteilsklassen Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc, INW H AUD Acc und I H SEK Acc erhalten vom Anlageverwalter einen Nachlass auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der Beteiligung der Anleger an den Anteilsklassen. Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 hat die Anteilsklasse INW H AUD Acc einen Betrag von 1.105,30 USD erhalten.

Darüber hinaus erhalten die Anlageverwalter der Teilfonds eine Erfolgsgebühr auf Grundlage des Wertzuwachses im Nettovermögen jedes der unten genannten Teilfonds. 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.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 haben die Anlageverwalter die folgenden Erfolgsgebühren erhalten:

Teilfonds	Währung	Erfolgsgebühren	Zu entrichtende Erfolgsgebühren
Man AHL Trend Alternative	USD	7.676.581,20	4.713.185,68
Man AHL Alpha Core Alternative	USD	980.490,10	908.274,52
Man Multi-Strategy Alternative	USD	-	-

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 am letzten Bewertungstag im März zu bezahlen.

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) 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.

„Performance-Zeitraum“ bezeichnet im Zusammenhang mit jedem Anteil den Zeitraum, der entweder am (i) 26. August 2019 oder (ii) 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.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Erfolgsgebühren werden bewertungstäglich berechnet und abgegrenzt, jedoch jährlich bezahlt, 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.

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.

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 nach dem Ende jedes Geschäftsjahrs zu bezahlen.

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) 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.

Erfolgsgebühren werden bewertungstäglich berechnet und abgegrenzt, jedoch jährlich bezahlt, 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.

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.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Bitte beachten Sie, dass die von jedem Anteilinhaber der Anteilklassen 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.

Abweichend von den vorstehenden Ausführungen ist der Performance-Zeitraum für die Anteilsklasse „Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc“ der Zeitraum, der entweder am (i) 26. August 2019 oder (ii) an dem Datum, an dem eine Erfolgsgebühr zuletzt gezahlt wurde (oder dem Beginn des ersten Performance-Zeitraums), beginnt, je nachdem, welcher Zeitpunkt später eintritt, bis zum und einschließlich des letzten Bewertungstags im Geschäftsjahr des Fonds (der „Performance-Tag“) und anschließend jeder 12-Monatszeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der auf den unmittelbar vorausgehenden Performance-Tag (wie oben definiert) folgt, und am letzten Bewertungstag im Geschäftsjahr des Fonds endet.

Man Multi-Strategy Alternative

Der Anlageverwalter hat Anspruch auf eine Erfolgsgebühr, die bezüglich jeder Anteilsklasse zahlbar ist und bis zu zwanzig Prozent (20 %) des gesamten Wertzuwachses beim Teilfonds-Nettoinventarwert von direkten Anlagen („NIW der direkten Anlage“) entspricht, der wie nachfolgend beschrieben berechnet wird. Der Anlageverwalter hat ausnahmsweise keinen Anspruch auf eine Erfolgsgebühr für Anteile der Klasse MG.

Der Anlageverwalter stellt sicher, dass eine Erfolgsgebühr nur im Hinblick auf den kombinierten realisierten und nicht realisierten Nettowertzuwachs beim NIW der direkten Anlage zahlbar ist, wie nachstehend näher ausgeführt.

Erfolgsgebühren werden an jedem Bewertungstag abgegrenzt und sind jährlich rückwirkend zahlbar. Sie werden vom Verwalter zum letzten Bewertungstag des zwölfmonatigen Zeitraums, der am 31. Dezember jedes Jahres endet, berechnet („Berechnungstag“); dies gilt jedoch unter der Voraussetzung, dass, wenn ein Anteil zu einem anderen Zeitpunkt als an einem Berechnungstag zurückgegeben wird, jede Erfolgsgebühr, die bezüglich des zurückgenommenen Anteils abgegrenzt worden ist, zum Zeitpunkt der Zahlung der Rücknahmeerlöse an den Anlageverwalter gezahlt wird.

Für die Zwecke der Berechnung der Erfolgsgebühren beginnt eine Performanceperiode im Allgemeinen an dem Geschäftstag, der auf den unmittelbar vorhergehenden Berechnungstag folgt, und endet an dem Berechnungstag, an dem die Erfolgsgebühr berechnet werden soll. Falls jedoch ein Anteil nach dem vorhergehenden Berechnungstag ausgegeben wurde, so beginnt die Performanceperiode für diesen Anteil an seinem Ausgabetag und endet an dem Berechnungstag, an dem die Erfolgsgebühr berechnet werden soll. Schließlich gilt: Wenn ein Anteil zwischen dem unmittelbar vorausgehenden Berechnungstag und dem Berechnungstag, zu dem die Erfolgsgebühr berechnet werden soll, zurückgegeben wurde, beginnt die Performanceperiode für diesen Anteil an dem Geschäftstag nach: (i) dem unmittelbar vorausgehenden Berechnungstag; (ii) dem Datum der Ausgabe dieses Anteils, wie jeweils zutreffend, und dem Ende des Handelstages, an dem dieser Anteil zurückgegeben wurde.

Der Wertzuwachs des NIW der direkten Anlage hinsichtlich jedes Anteils einer Klasse wird zu jedem Berechnungstag berechnet, indem der „Referenznettoinventarwert der direkten Anlage“ für diese Anteile dieser Klasse vom „Endnettoinventarwert der direkten Anlage“ dieser Anteile für die betreffende Performanceperiode abgezogen wird (der „aktuelle Wertzuwachs“). Für die Zwecke dieser Berechnung ist der „Referenznettoinventarwert der direkten Anlage“ für jede Anteilsklasse der letzte NIW der direkten Anlage pro Anteil dieser Anteilsklasse, für den eine Erfolgsgebühr hinsichtlich eines positiven Wertzuwachses in Zusammenhang mit dieser Anteilsklasse zahlbar war, oder, im Falle einer Anteilsklasse, für die zuvor noch keine Erfolgsgebühr zahlbar gewesen ist, der NIW der direkten Anlage je Anteilsklasse, zu dem diese Anteilsklasse ausgegeben wurde, je nachdem, welcher Betrag höher ist. Der „Endnettoinventarwert der direkten Anlage“ ist der NIW der direkten Anlage pro Anteil einer Anteilsklasse zum Berechnungstag, an dem die Berechnung erfolgt, vor Berücksichtigung der Erfolgsgebühr. Falls jedoch ein Anleger Anteile in der betreffenden Performanceperiode zu einem anderen Zeitpunkt als zum Berechnungstag zurückgibt, so ist der Endnettoinventarwert der direkten Anlage der NIW der direkten Anlage pro Anteil einer Anteilsklasse zum Rücknahmetag vor Berücksichtigung der Erfolgsgebühr.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Wie nachstehend näher beschrieben, erfolgt die Berechnung der Erfolgsgebühr auf Anteilsklassenbasis, um einen einheitlichen NIW der direkten Anlage innerhalb jeder Anteilsklasse aufrechtzuerhalten. Zu jedem Berechnungstag wird die Gesamthöhe des aktuellen Wertzuwachses des NIW der direkten Anlage in Bezug auf alle Anteile einer Anteilsklasse für die betreffende Performanceperiode ermittelt. Eine Erfolgsgebühr von bis zu zwanzig Prozent (20 %) eines solchen Gesamtbetrags des aktuellen Wertzuwachses wird der gesamten Anteilsklasse belastet. Dies hat zur Folge, dass dann, wenn in Bezug auf eine Anteilsklasse eine Erfolgsgebühr zu zahlen ist, der NIW der direkten Anlage pro Anteil aller Anteile dieser Anteilsklasse in gleichem Umfang reduziert wird, um die Zahlung des auf jeden Anteil entfallenden Durchschnittsbetrags der für diese Anteilsklasse insgesamt zu zahlenden Erfolgsgebühr widerzuspiegeln (und nicht die individuelle Wertentwicklung der Anteile dieser Anteilsklasse während der betreffenden Performanceperiode). Daher ist es möglich, dass der NIW der direkten Anlage von Anteilen einer Anteilsklasse, die von einem Anteilinhaber gehalten werden, die Zahlung einer Erfolgsgebühr widerspiegelt, obwohl der NIW der direkten Anlage dieser Anteile in dem betreffenden Zeitraum keinen Wertzuwachs oder sogar einen Wertverlust verzeichnet hat. Da der NIW der direkten Anlage pro Anteil sämtlicher Anteile der jeweiligen Anteilsklasse reduziert wird, um die Zahlung der auf diese Anteilsklasse entfallenden Erfolgsgebühr widerzuspiegeln, ist es ferner möglich, dass dem NIW der direkten Anlage von Anteilen, die von einem Anteilinhaber gehalten werden, ein Betrag an Erfolgsgebühr belastet wird, der gemessen an dem realen Wertzuwachs, den diese Anteile in dem betreffenden Zeitraum verzeichnet haben, unverhältnismäßig hoch ist. Die Erfolgsgebühr, die auf einen Anteil entfällt, der zu einem anderen Zeitpunkt als einem Berechnungstag zurückgegeben wird, basiert dagegen auf der Differenz zwischen dem Endnettoinventarwert der direkten Anlage dieses Anteils (vor Berücksichtigung der Erfolgsgebühr) zum Ende des Handelstages, an dem dieser Anteil zurückgegeben wird, und dem Referenznettoinventarwert der direkten Anlage dieses Anteils. Daher gilt, wenn ein Anteil zu einem anderen Zeitpunkt als einem Berechnungstag zurückgegeben wird, Folgendes: (i) Die auf diesen Anteil entfallende Erfolgsgebühr kann sich von der Erfolgsgebühr unterscheiden, die zu zahlen wäre, wenn dieser Anteil nicht vor dem Berechnungstag zurückgegeben worden wäre; und (ii) der Anteilinhaber, der den Anteil zurückgibt, erhält möglicherweise nicht die Vorteile oder Nachteile, die die Verteilung der Erfolgsgebühr auf die gesamte Anteilsklasse mit sich bringt.

Vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass nur dann eine Erfolgsgebühr bezüglich der Performance eines Anteils innerhalb einer Anteilsklasse in die Berechnung des von der gesamten Anteilsklasse zu zahlenden Gesamtbetrags einbezogen wird, wenn der Endnettoinventarwert der direkten Anlage den Referenznettoinventarwert der direkten Anlage für diese Anteilsklasse übersteigt. Außerdem basiert der bezüglich eines Anteils in die Berechnung aufgenommene Betrag der Erfolgsgebühr nur auf der Differenz zwischen dem Endnettoinventarwert der direkten Anlage und dem Referenznettoinventarwert der direkten Anlage für diese Anteilsklasse.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 7 – Steuern und zahlbare Aufwendungen

	Man Convertibles Europe EUR	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD	Man Multi-Strategy Alternative USD
Abonnementsteuer (Erläuterung 5)	2.580,30	19.799,67	48.818,29	7.383,83	2.484,40
Verwaltungsgebühren, Gebühren der Domizilstelle, Verwahrstelle, Zahl- und Transferstelle	13.366,79	91.765,27	222.253,37	58.038,67	11.871,26
Honorare	13.983,18	37.601,92	57.671,42	22.633,78	14.688,48
Sonstige Aufwendungen	4.258,02	16.353,81	60.979,16	14.007,07	54.279,81
Summe	34.188,29	165.520,67	389.722,24	102.063,35	83.323,95

Erläuterung 8 – Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten beziehen sich hauptsächlich auf Maklergebühren.

Erläuterung 9 – Sonstige Aufwendungen

Die sonstigen Aufwendungen umfassen die Gebühr für die Dokumente mit den wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“), die Aufsichtsgebühr, die Notierungsgebühr, die Zahlstellengebühr, die Beratungsgebühr, die Vergütung für Verwaltungsratsmitglieder, die gezahlte luxemburgische Umsatzsteuer, die Steuervertretergebühr, die CSSF-Gebühr, die Versicherungskosten und die Verbreitungsgebühr.

Erläuterung 10 – Verwaltungszuschüsse

Gemäß einer Verwaltungskostenzuschuss-Vereinbarung vom 23. August 2011 zahlt der Anlageverwalter an den Teilfonds Man Multi-Strategy Alternative am Ende jedes Kalendermonats einen Betrag in US-Dollar, der gleich den vom Verwalter berechneten Verwaltungskosten für den entsprechenden Monat abzüglich 1/12 von 0,40 % des durchschnittlichen Nettoinventarwerts der Anteile des Teilfonds während dieses Monats ist, wobei dieser Betrag ein Minimum von Null nicht unterschreitet.

Wenn die Berechnung eine negative Zahl ergibt, vereinbaren der Fonds und die Verwaltungsgesellschaft, dass die am Ende jedes Kalendermonats von dem Fonds im Namen des Teilfonds zahlbare Kundendienstgebühr gleich 1/12 von 0.40 % des durchschnittlichen Nettoinventarwerts der Anteile des Teilfonds im entsprechenden Monat abzüglich der vom Verwalter berechneten Verwaltungskosten für diesen Monat ist.

Erläuterung 11 – Gegenseitige Anlagen in Teilfonds

Zum 30. Juni 2021 investierte der Teilfonds Man Multi-Strategy Alternative in Anteile des Teilfonds Man AHL Trend Alternative. Der Wert der gehaltenen Anteile beläuft sich auf 1.478.106,43 EUR (1.752.886,42 USD) und stellt 8,31 % des Nettovermögens des Teilfonds Man AHL Trend Alternative dar.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte

Man Convertibles Europe

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							5.950,89
EUR	CHF	Citigroup	15. Juli 21	917.790,60	(999.454,14)	917.790,60	5.950,89
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(134.994,31)
EUR	GBP	Citigroup	15. Juli 21	662.487,01	(570.293,99)	662.487,01	(1.661,86)
EUR	USD	Citigroup	15. Juli 21	5.474.123,40	(6.651.973,01)	5.474.123,40	(133.332,45)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(1.169,27)
CHF	EUR	Citigroup	30. Juli 21	1.125.038,17	(1.027.676,13)	1.026.319,57	(1.169,27)

Man Convertibles Global

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							349.735,60
CHF	EUR	Citigroup	5. Juli 21	74.365,50	(67.819,62)	67.840,16	22,52
EUR	AUD	Citigroup	15. Juli 21	1.639.078,73	(2.585.450,00)	1.639.078,73	2.719,66
EUR	CHF	Citigroup	1. Juli 21	55.013,15	(60.259,20)	55.013,15	41,51
EUR	CHF	Citigroup	15. Juli 21	1.242.394,74	(1.352.970,61)	1.242.394,74	8.028,62
HKD	EUR	Citigroup	15. Juli 21	58.186.854,45	(6.234.818,53)	6.318.123,64	81.467,05
USD	EUR	Citigroup	1. Juli 21	146.959,85	(123.015,40)	123.922,63	907,23
USD	EUR	Citigroup	15. Juli 21	11.975.426,63	(9.838.374,99)	10.098.175,76	256.549,01
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(4.877.648,23)
EUR	GBP	Citigroup	15. Juli 21	4.945.788,85	(4.257.341,91)	4.945.788,85	(12.195,71)
EUR	HKD	Citigroup	15. Juli 21	11.716.534,83	(109.938.073,13)	11.716.534,83	(217.500,01)
EUR	JPY	Citigroup	15. Juli 21	26.498.794,21	(3.543.089.382,00)	26.498.794,21	(414.332,93)
EUR	SGD	Citigroup	15. Juli 21	1.015.569,05	(1.636.372,20)	1.015.569,05	(10.594,73)
EUR	USD	Citigroup	15. Juli 21	174.292.865,09	(211.768.573,76)	174.292.865,09	(4.223.024,85)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							189.415,32
USD	EUR	Citigroup	30. Juli 21	31.097.885,90	(26.016.815,53)	26.223.025,47	189.415,32
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(117.661,69)
CHF	EUR	Citigroup	30. Juli 21	112.694.765,00	(102.941.646,13)	102.806.149,86	(116.735,80)
EUR	CHF	Citigroup	30. Juli 21	67.917,69	(74.463,64)	67.917,69	(24,38)
EUR	USD	Citigroup	30. Juli 21	122.942,33	(146.959,85)	122.942,33	(901,51)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							35.263.367,92
AUD	EUR	HSBC London	19. Juli 21	14.568.373,23	(9.200.000,00)	10.937.208,93	11.584,18
AUD	JPY	HSBC London	1. Juli 21	300.000,00	(24.902.841,00)	225.225,06	812,19
AUD	JPY	HSBC London	2. Juli 21	600.000,00	(49.838.000,00)	450.450,11	1.332,52
BRL	USD	HSBC London	2. Juli 21	663.700.000,00	(124.626.205,35)	132.268.093,89	8.903.597,66
BRL	USD	HSBC London	3. Aug. 21	598.300.000,00	(117.749.641,10)	119.234.594,81	2.178.397,32
CAD	EUR	Citigroup	2. Juli 21	1.471.979,00	(1.000.000,00)	1.188.709,52	1.444,45
CAD	EUR	Citigroup	6. Aug. 21	70.794.822,51	(47.924.585,00)	57.170.978,37	228.062,23
CAD	USD	HSBC London	2. Juli 21	1.900.000,00	(1.532.010,97)	1.534.361,62	369,43
CAD	USD	HSBC London	7. Juli 21	37.600.000,00	(30.310.531,87)	30.364.209,00	14.244,13
CAD	USD	HSBC London	15. Juli 21	326.262,59	(261.899,48)	263.476,21	1.234,56
CLP	USD	HSBC London	10. Aug. 21	200.000.000,00	(270.445,69)	274.600,00	2.354,31
CLP	USD	HSBC London	17. Aug. 2021	9.600.000.000,00	(12.884.610,66)	13.180.800,01	200.189,34
CLP	USD	HSBC London	6. Okt. 21	150.000.000,00	(204.159,41)	205.950,00	140,59
COP	USD	HSBC London	12. Aug. 2021	1.400.000.000,00	(371.247,34)	375.200,00	1.152,66
EUR	AUD	HSBC London	1. Juli 21	100.000,00	(158.032,00)	118.590,00	77,60
EUR	AUD	HSBC London	19. Juli 21	18.900.000,00	(29.749.911,63)	22.413.510,00	110.104,75
EUR	CHF	HSBC London	1. Juli 21	200.000,00	(219.128,00)	237.180,00	232,02
EUR	CHF	HSBC London	26. Juli 21	3.700.000,00	(4.053.828,14)	4.387.830,00	3.623,28
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	1.700.000,00	(1.457.256,60)	2.016.030,00	967,19
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	3.800.000,00	(1.330.782.210,00)	4.506.420,00	18.127,95
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	400.000,00	(52.622.400,00)	474.360,00	673,67
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	100.000,00	(13.151.800,00)	118.590,00	204,56
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	1.600.000,00	(210.531.754,00)	1.897.440,00	3.009,26
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	500.000,00	(5.091.016,65)	592.950,00	1.014,22
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	13. Juli 21	11.700.000,00	(118.632.667,02)	13.875.030,00	84.417,97
EUR	PLN	HSBC London	1. Juli 21	3.300.000,00	(14.905.817,80)	3.913.470,00	3.758,98
EUR	PLN	HSBC London	28. Juli 21	28.800.000,00	(130.036.973,29)	34.153.920,00	61.044,10
EUR	RON	HSBC London	2. Juli 21	3.207.947,00	(15.801.525,79)	3.804.304,35	1.516,82
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	23.200.000,00	(234.030.147,20)	27.512.880,00	155.067,54
GBP	AUD	HSBC London	1. Juli 21	300.000,00	(552.051,00)	414.435,05	942,27
GBP	AUD	HSBC London	10. Aug. 2021	21.500.000,00	(39.348.087,55)	29.701.178,52	226.615,02
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	7.218.914,06	(8.400.000,00)	9.972.570,01	23.154,06
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	45.854.530,16	(53.300.000,00)	63.345.748,19	198.149,44
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Sep. 2021	4.905.487,72	(5.700.000,00)	6.776.686,81	17.373,85
GBP	JPY	Citigroup	2. Juli 21	50.000,00	(7.661.550,00)	69.072,51	189,99
GBP	JPY	Citigroup	19. Juli 21	4.450.000,00	(675.835.269,00)	6.147.453,23	70.698,56
GBP	JPY	Citigroup	11. Aug. 2021	12.000.000,00	(1.838.591.840,00)	16.577.401,96	43.166,65
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	210.991.000,00	(600.000,00)	712.799,33	524,57
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	247.324.890,00	(700.000,00)	835.547,57	4.016,02
INR	USD	Citigroup	23. Juli 21	135.000.000,00	(1.809.531,70)	1.816.289,99	953,30
INR	USD	Citigroup	6. Aug. 2021	168.518.908,00	(2.255.735,47)	2.267.253,38	227,15
JPY	AUD	HSBC London	1. Juli 21	16.696.900,00	(200.000,00)	150.436,06	313,59
JPY	AUD	HSBC London	20. Juli 21	116.928.225,00	(1.400.000,00)	1.053.502,27	2.714,60
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	7.630.357.786,00	(57.300.000,00)	68.748.150,61	708.156,36
JPY	GBP	Citigroup	19. Juli 21	1.559.662.258,00	(10.100.000,00)	14.052.276,29	71.238,93
JPY	GBP	Citigroup	11. Aug. 2021	471.705.128,00	(3.050.000,00)	4.249.978,32	28.601,78
KRW	USD	HSBC London	28. Juli 21	5.946.551.724,00	(5.255.898,11)	5.280.419,00	2.756,51
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	7. Juli 21	1.057.048.388,00	(52.075.879,97)	53.090.255,78	861.103,30
MXN	USD	Citigroup	8. Juli 21	3.500.000,00	(174.394,52)	175.787,50	864,48
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	416.500.000,00	(20.687.810,19)	20.918.712,70	112.199,82
MXN	USD	Citigroup	30.7.2021	179.000.000,00	(8.908.199,89)	8.990.275,08	29.986,11
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	13. Aug. 21	232.000.000,00	(11.546.395,82)	11.652.200,11	17.644,18
MXN	USD	Citigroup	16.8.2021	148.500.000,00	(7.382.769,51)	7.458.412,57	16.391,49
NOK	SEK	Citigroup	22. Juli 21	15.000.000,00	(14.904.225,00)	1.743.135,10	1.238,76
NZD	AUD	HSBC London	29. Juli 21	20.861.046,72	(19.400.000,00)	14.576.656,52	29.749,00
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	5.500.000,00	(3.838.009,19)	3.843.125,03	5.638,31
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 21	1.000.000,00	(253.631,95)	260.926,02	7.039,05
PLN	EUR	HSBC London	28. Juli 21	23.570.192,20	(5.200.000,00)	6.191.275,55	12.914,35
PLN	USD	HSBC London	15. Juli 21	1.582,00	(414,88)	415,55	0,04
PLN	USD	HSBC London	22. Juli 21	10.500.000,00	(2.749.128,02)	2.758.076,50	4.832,98
RUB	USD	HSBC London	4. Aug. 2021	4.212.500.000,00	(56.179.610,05)	57.664.912,58	1.085.114,98
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	3.044.544,00	(300.000,00)	355.998,54	209,37
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	6.092.775,06	(600.000,00)	712.428,20	697,36

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte		Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung								
SEK	NOK			Citigroup	1. Juli 21	996.671,00	(1.000.000,00)	116.540,74	263,81
SEK	NOK			Citigroup	22. Juli 21	497.388,00	(500.000,00)	58.159,58	26,57
SEK	USD			Citigroup	15. Juli 21	197.357,22	(22.960,36)	23.076,98	115,03
SEK	USD			Citigroup	4. Aug. 2021	4.000.000,00	(466.362,36)	467.720,01	1.409,64
THB	USD			Citigroup	23. Juli 21	7.500.000,00	(233.432,52)	234.007,50	559,98
THB	USD			Citigroup	16. Aug. 2021	772.500.000,00	(24.031.056,34)	24.102.772,35	67.081,16
TWD	USD			Citigroup	29. Juli 21	12.500.000,00	(448.276,11)	448.637,50	361,39
USD	AUD			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	4.450.367,00	(5.900.000,00)	4.450.367,00	26.547,00
USD	AUD			Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	75.024,00	(100.000,00)	75.024,00	43,50
USD	AUD			Royal Bank of Scotland	6. Juli 21	4.438.307,16	(5.900.000,00)	4.438.307,16	14.339,19
USD	AUD			Citigroup	15. Juli 21	1.261,80	(1.678,59)	1.261,80	3,10
USD	AUD			Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	6.528.846,30	(8.619.242,98)	6.528.846,30	65.632,92
USD	AUD			Royal Bank of Scotland	23. Juli 21	85.816.029,33	(113.500.000,00)	85.816.029,33	703.887,59
USD	BRL			HSBC London	2. Juli 21	16.064.732,13	(79.300.000,00)	16.064.732,13	110.378,85
USD	BRL			HSBC London	3. Aug. 2021	181.199,78	(900.000,00)	181.199,78	799,63
USD	CAD			HSBC London	7. Juli 21	164.345.728,62	(202.140.115,00)	164.345.728,62	1.317.715,90
USD	CAD			HSBC London	15. Juli 21	4.241,17	(5.216,73)	4.241,17	33,84
USD	CAD			HSBC London	30. Juli 21	732.101,97	(900.000,00)	732.101,97	6.243,01
USD	CHF			Citigroup	1. Juli 21	30.825,57	(28.310,70)	30.825,57	217,74
USD	CHF			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	1.086.504,51	(1.000.000,00)	1.086.504,51	5.364,51
USD	CHF			Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	1.084.154,56	(1.000.000,00)	1.084.154,56	2.981,49
USD	CHF			Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	33.183,34	(30.479,90)	33.183,34	216,87
USD	CHF			Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	87.706.792,74	(79.600.000,00)	87.706.792,74	1.566.756,44
USD	CLP			HSBC London	10. Aug. 2021	14.226.229,93	(10.050.000.000,00)	14.226.229,93	518.789,50
USD	CNH			HSBC London	12. Juli 21	5.624.634,37	(36.000.000,00)	5.624.634,37	64.132,47
USD	CNH			HSBC London	29. Juli 21	311.478,17	(2.000.000,00)	311.478,17	2.948,50
USD	CNH			HSBC London	12. Aug. 2021	15.646.640,58	(101.500.000,00)	15.646.640,58	4.184,26
USD	COP			HSBC London	8. Juli 21	3.388.697,35	(12.600.000.000,00)	3.388.697,35	24.497,34
USD	COP			HSBC London	12. Aug. 2021	1.665.347,43	(6.200.000.000,00)	1.665.347,43	16.208,13
USD	EUR			Citigroup	1. Juli 21	441.456,61	(369.890,99)	441.456,61	2.876,86
USD	EUR			HSBC London	1. Juli 21	4.521.568,00	(3.800.000,00)	4.521.568,00	15.907,99
USD	EUR			HSBC London	2. Juli 21	5.709.912,00	(4.800.000,00)	5.709.912,00	18.407,57
USD	EUR			HSBC London	6. Juli 21	3.094.366,60	(2.600.000,00)	3.094.366,60	11.155,18
USD	EUR			HSBC London	12. Juli 21	219.292.461,12	(182.900.000,00)	219.292.461,12	2.371.721,48
USD	EUR			HSBC London	15. Juli 21	12.184.501,32	(10.040.072,38)	12.184.501,32	276.104,33
USD	EUR			HSBC London	10. Aug. 2021	14.295.967,93	(12.000.000,00)	14.295.967,93	55.304,43
USD	GBP			HSBC London	1. Juli 21	484.529,80	(350.000,00)	484.529,80	514,80
USD	GBP			HSBC London	2. Juli 21	2.352.751,00	(1.700.000,00)	2.352.751,00	1.812,48
USD	GBP			HSBC London	15. Juli 21	44.806,93	(31.960,71)	44.806,93	606,49
USD	GBP			HSBC London	21. Juli 21	113.380.459,17	(80.850.000,00)	113.380.459,17	1.566.025,78
USD	GBP			HSBC London	16. Aug. 2021	90.480.768,03	(65.100.000,00)	90.480.768,03	443.510,71
USD	HUF			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	1.118.328,39	(330.000.000,00)	1.118.328,39	4.789,59
USD	HUF			Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	642.322,58	(190.000.000,00)	642.322,58	1.192,28
USD	HUF			Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	672.072,48	(196.735.516,84)	672.072,48	8.285,74
USD	HUF			Royal Bank of Scotland	4. Aug. 2021	10.607.178,56	(3.100.000.000,00)	10.607.178,56	151.159,60
USD	IDR			HSBC London	6. Juli 21	69.268,87	(1.000.000.000,00)	69.268,87	520,53
USD	ILS			Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	307.323,52	(1.000.000,00)	307.323,52	554,52
USD	ILS			Royal Bank of Scotland	10. Aug. 2021	15.166.725,35	(49.357.805,00)	15.166.725,35	19.399,64
USD	INR			Citigroup	7. Juli 21	48.795.187,71	(3.618.981.092,00)	48.795.187,71	163.514,26
USD	INR			Citigroup	23. Juli 21	13.394.769,38	(997.126.620,00)	13.394.769,38	22.375,83
USD	INR			Citigroup	6. Aug. 2021	133.978,76	(10.000.000,00)	133.978,76	109,30
USD	JPY			HSBC London	1. Juli 21	12.489.268,79	(1.380.000.000,00)	12.489.268,79	69.144,60
USD	JPY			HSBC London	15. Juli 21	664.452,24	(73.441.056,00)	664.452,24	3.394,90
USD	JPY			HSBC London	19. Juli 21	56.318.648,51	(6.170.000.000,00)	56.318.648,51	779.208,91
USD	JPY			HSBC London	11. Aug. 2021	105.994.619,09	(11.650.000.000,00)	105.994.619,09	1.105.779,66
USD	KRW			HSBC London	14. Juli 21	61.891.940,76	(69.500.000.000,00)	61.891.940,76	428.568,35
USD	KRW			HSBC London	15. Juli 21	5.795.788,15	(6.462.014.000,00)	5.795.788,15	81.241,57
USD	KRW			HSBC London	28. Juli 21	5.910.108,43	(6.676.344.086,00)	5.910.108,43	6.109,01
USD	MXN			Citigroup	1. Juli 21	4.952.278,95	(98.000.000,00)	4.952.278,95	40.126,95
USD	MXN			Royal Bank of Scotland	7. Juli 21	54.170.661,55	(1.073.500.000,00)	54.170.661,55	410.141,58
USD	MXN			Citigroup	8. Juli 21	10.233.350,77	(203.500.000,00)	10.233.350,77	43.335,00
USD	MXN			Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	20.966.524,04	(416.500.000,00)	20.966.524,04	167.127,55
USD	MXN			Royal Bank of Scotland	13. Aug. 2021	11.659.463,26	(232.000.000,00)	11.659.463,26	95.957,38
USD	NOK			Citigroup	1. Juli 21	2.158.440,66	(18.500.000,00)	2.158.440,66	7.797,16

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte		Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung								
USD	NOK			Citigroup	2. Juli 21	2.158.668,14	(18.500.000,00)	2.158.668,14	8.006,11
USD	NOK			Citigroup	15. Juli 21	13.072,12	(110.329,49)	13.072,12	245,20
USD	NOK			Citigroup	26. Juli 21	73.098.508,87	(614.500.000,00)	73.098.508,87	1.652.210,01
USD	NOK			Citigroup	8. Sep. 2021	34.118.261,30	(292.500.000,00)	34.118.261,30	103.988,20
USD	NZD			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	840.427,10	(1.200.000,00)	840.427,10	1.807,10
USD	NZD			Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	1.469.661,00	(2.100.000,00)	1.469.661,00	2.071,80
USD	NZD			Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	49.446.759,57	(68.400.000,00)	49.446.759,57	1.645.773,33
USD	NZD			Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	8.788,51	(12.309,74)	8.788,51	185,93
USD	NZD			Royal Bank of Scotland	30. Juli 21	53.377.421,38	(74.800.000,00)	53.377.421,38	1.106.496,80
USD	PEN			Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	3.143.585,68	(11.750.000,00)	3.143.585,68	80.482,24
USD	PHP			HSBC London	14. Juli 21	1.905.955,85	(92.500.000,00)	1.905.955,85	14.169,37
USD	PHP			HSBC London	23. Juli 21	9.638.682,18	(465.000.000,00)	9.638.682,18	134.856,57
USD	PLN			HSBC London	1. Juli 21	79.003,63	(300.000,00)	79.003,63	328,63
USD	PLN			HSBC London	15. Juli 21	12.720,20	(47.151,90)	12.720,20	353,51
USD	PLN			HSBC London	22. Juli 21	25.644.017,48	(96.700.000,00)	25.644.017,48	281.313,75
USD	PLN			HSBC London	25. Aug. 2021	20.564.652,27	(75.800.000,00)	20.564.652,27	682.025,43
USD	RON			HSBC London	15. Juli 21	2.047,41	(8.372,25)	2.047,41	33,67
USD	RUB			HSBC London	4. Aug. 2021	7.401.419,03	(540.000.000,00)	7.401.419,03	61.002,60
USD	RUB			HSBC London	22. Sep. 2021	135.481,60	(10.000.000,00)	135.481,60	558,87
USD	SEK			Citigroup	1. Juli 21	2.461.939,09	(21.000.000,00)	2.461.939,09	6.955,09
USD	SEK			Citigroup	2. Juli 21	293.487,86	(2.500.000,00)	293.487,86	1.222,84
USD	SEK			Citigroup	15. Juli 21	12.670,45	(106.246,48)	12.670,45	247,87
USD	SEK			Citigroup	4. Aug. 2021	17.644.895,48	(149.500.000,00)	17.644.895,48	161.862,99
USD	SGD			Citigroup	1. Juli 21	3.648.024,15	(4.900.000,00)	3.648.024,15	5.712,05
USD	SGD			Citigroup	2. Juli 21	4.834.120,72	(6.500.000,00)	4.834.120,72	2.495,22
USD	SGD			Citigroup	7. Juli 21	41.324.945,55	(55.300.000,00)	41.324.945,55	219.463,35
USD	SGD			Citigroup	19. Juli 21	33.264.907,77	(44.400.000,00)	33.264.907,77	262.487,54
USD	SGD			Citigroup	28. Juli 21	18.199.003,98	(24.407.573,00)	18.199.003,98	57.297,93
USD	SGD			Citigroup	11. Aug. 2021	25.254.007,84	(33.949.060,00)	25.254.007,84	21.201,35
USD	THB			Citigroup	14. Juli 21	3.397.011,21	(107.500.000,00)	3.397.011,21	43.121,48
USD	THB			Citigroup	23. Juli 21	3.060.561,95	(97.500.000,00)	3.060.561,95	18.660,65
USD	TWD			Citigroup	16. Juli 21	7.266.041,43	(202.500.000,00)	7.266.041,43	6.220,87
USD	TWD			Citigroup	29. Juli 21	1.617.459,60	(45.000.000,00)	1.617.459,60	2.364,60
USD	ZAR			Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	17.453.812,87	(249.210.962,00)	17.453.812,87	62.543,83
USD	ZAR			Royal Bank of Scotland	25. Aug. 2021	1.118.062,34	(16.000.000,00)	1.118.062,34	6.573,49
ZAR	USD			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	6.500.000,00	(453.094,29)	455.221,00	1.730,21
ZAR	USD			Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	215.000.000,00	(14.866.385,64)	15.057.309,87	137.604,36
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften									(45.728.593,34)
AUD	EUR			HSBC London	1. Juli 21	947.465,00	(600.000,00)	711.309,53	(1.010,73)
AUD	EUR			HSBC London	19. Juli 21	44.046.004,36	(28.000.000,00)	33.067.546,02	(184.010,31)
AUD	GBP			HSBC London	1. Juli 21	552.332,01	(300.000,00)	414.663,36	(731,34)
AUD	GBP			HSBC London	10. Aug. 2021	734.377,59	(400.000,00)	551.334,11	(2.476,66)
AUD	JPY			HSBC London	20. Juli 21	30.100.000,00	(2.546.889.065,00)	22.597.580,63	(354.754,59)
AUD	NZD			HSBC London	2. Juli 21	100.000,00	(107.458,00)	75.075,02	(116,71)
AUD	NZD			HSBC London	29. Juli 21	25.000.000,00	(26.928.481,38)	18.768.754,68	(70.273,81)
AUD	USD			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	5.900.000,00	(4.438.214,59)	4.429.426,10	(14.394,59)
AUD	USD			Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	131.505,43	(99.119,92)	98.727,73	(509,52)
AUD	USD			Royal Bank of Scotland	23. Juli 21	3.500.000,00	(2.640.218,59)	2.627.625,65	(15.617,59)
BRL	USD			HSBC London	3. Aug. 2021	97.700.000,00	(19.715.779,96)	19.470.533,03	(132.010,35)
CAD	EUR			Citigroup	2. Juli 21	882.006,00	(600.000,00)	712.271,66	(86,14)
CAD	EUR			Citigroup	6. Aug. 2021	24.369.576,87	(16.575.415,00)	19.679.865,03	(14.476,75)
CAD	USD			HSBC London	7. Juli 21	219.100.000,00	(180.943.215,38)	176.936.122,10	(4.236.874,39)
CAD	USD			HSBC London	15. Juli 21	24.686,39	(20.077,47)	19.935,71	(167,66)
CAD	USD			HSBC London	30. Juli 21	51.600.000,00	(42.123.263,38)	41.670.031,49	(507.347,38)
CAD	USD			HSBC London	31. Aug. 2021	60.900.000,00	(49.219.237,98)	49.180.327,87	(103.570,65)
CHF	EUR			HSBC London	1. Juli 21	219.213,00	(200.000,00)	237.153,68	(140,12)
CHF	USD			Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	1.000.000,00	(1.085.001,21)	1.081.841,29	(3.861,21)
CHF	USD			Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	900.000,00	(973.647,91)	973.657,16	(592,21)
CHF	USD			Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	4.314,11	(4.794,69)	4.667,18	(128,64)
CHF	USD			Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	118.800.000,00	(132.219.065,24)	128.522.745,71	(3.660.476,82)
CLP	USD			HSBC London	10. Aug. 2021	36.550.000.000,00	(50.699.264,52)	50.183.150,03	(845.064,56)
CNH	USD			HSBC London	12. Juli 21	100.000.000,00	(15.448.450,34)	15.477.798,88	(2.450,34)
CNH	USD			HSBC London	29. Juli 21	5.500.000,00	(849.754,25)	851.278,94	(1.280,25)
COP	USD			HSBC London	8. Juli 21	29.200.000.000,00	(7.985.058,66)	7.825.600,00	(188.658,66)
COP	USD			HSBC London	12. Aug. 2021	21.600.000.000,00	(5.924.565,43)	5.788.800,00	(178.965,43)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte				Nicht realisierter	
Währung	Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Gewinn/(Verlust) (in USD)
EUR	AUD	HSBC London	1. Juli 21	500.000,00	(791.392,60)	592.950,00	(536,18)
EUR	AUD	HSBC London	2. Juli 21	500.000,00	(791.937,00)	592.950,00	(933,50)
EUR	AUD	HSBC London	19. Juli 21	8.200.000,00	(12.987.894,01)	9.724.380,00	(12.607,30)
EUR	CAD	Citigroup	2. Juli 21	1.600.000,00	(2.361.296,00)	1.897.440,00	(7.254,78)
EUR	CAD	Citigroup	6. Aug. 2021	2.900.000,00	(4.284.182,14)	3.439.110,00	(14.024,48)
EUR	CHF	HSBC London	2. Juli 21	1.200.000,00	(1.317.328,00)	1.423.080,00	(1.383,43)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	8.400.000,00	(7.221.339,10)	9.961.560,00	(26.507,71)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	7.200.000,00	(6.181.418,00)	8.538.480,00	(11.058,04)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	59.000.000,00	(50.742.802,03)	69.968.100,00	(197.966,67)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	300.000,00	(105.498.930,00)	355.770,00	(281,37)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	200.000,00	(70.370.600,00)	237.180,00	(310,44)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	4.500.000,00	(1.593.245.208,00)	5.336.550,00	(36.972,91)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	134.500.000,00	(17.849.606.639,00)	159.503.550,00	(1.113.078,03)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	13. Juli 21	19.300.000,00	(198.477.396,59)	22.887.870,00	(184.411,72)
EUR	PLN	HSBC London	28. Juli 21	28.400.000,00	(129.509.534,32)	33.679.560,00	(275.124,49)
EUR	RON	HSBC London	1. Juli 21	1.400.000,00	(6.899.085,97)	1.660.260,00	(147,07)
EUR	RON	HSBC London	2. Juli 21	2.692.053,00	(13.267.167,36)	3.192.505,65	(364,21)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	300.000,00	(3.044.509,42)	355.770,00	(205,33)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	42.900.000,00	(437.796.401,62)	50.875.110,00	(302.733,03)
EUR	USD	Citigroup	1. Juli 21	30.957,53	(36.947,12)	36.712,53	(240,78)
EUR	USD	HSBC London	1. Juli 21	3.800.000,00	(4.520.171,08)	4.506.420,00	(14.511,08)
EUR	USD	HSBC London	12. Juli 21	181.000.000,00	(220.450.437,70)	214.647.900,00	(5.783.713,71)
EUR	USD	HSBC London	10. Aug. 2021	91.100.000,00	(111.113.966,87)	108.035.490,00	(3.003.957,06)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	8.476.624,91	(9.900.000,00)	11.710.034,87	(19.113,19)
GBP	JPY	Citigroup	19. Juli 21	24.600.000,00	(3.790.253.703,00)	33.983.674,02	(96.757,15)
GBP	JPY	Citigroup	11. Aug. 2021	6.350.000,00	(984.105.617,00)	8.772.208,54	(77.815,56)
GBP	USD	Citigroup	1. Juli 21	120.296,15	(167.400,12)	166.183,14	(1.042,57)
GBP	USD	HSBC London	1. Juli 21	550.000,00	(761.747,09)	759.977,59	(1.152,09)
GBP	USD	HSBC London	15. Juli 21	8.653,92	(12.181,84)	11.954,96	(213,80)
GBP	USD	HSBC London	21. Juli 21	85.950.000,00	(121.276.042,90)	118.735.641,55	(2.408.482,14)
GBP	USD	HSBC London	16. Aug. 2021	86.150.000,00	(121.754.462,33)	119.011.931,59	(2.603.843,33)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	105.342.700,00	(300.000,00)	355.883,46	(245,82)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	4.738.644.107,32	(13.600.000,00)	16.008.750,91	(146.304,66)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	330.000.000,00	(1.114.522,60)	1.114.852,20	(983,80)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	1.618.300,00	(5.684,19)	5.467,17	(224,03)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	4. Aug. 2021	4.260.000.000,00	(14.833.482,03)	14.391.728,38	(464.800,24)
IDR	USD	HSBC London	6. Juli 21	1.000.000.000,00	(69.652,43)	68.970,00	(902,43)
IDR	USD	HSBC London	23. Juli 21	7.000.000.000,00	(488.790,34)	482.790,00	(9.010,34)
INR	USD	Citigroup	7. Juli 21	3.755.000.000,00	(51.210.358,28)	50.519.769,72	(750.668,28)
INR	USD	Citigroup	23. Juli 21	8.145.000.000,00	(110.600.886,43)	109.582.829,40	(1.368.291,42)
INR	USD	Citigroup	6. Aug. 2021	1.793.981.092,00	(24.067.890,32)	24.136.221,48	(51.865,44)
JPY	AUD	HSBC London	1. Juli 21	8.304.700,00	(100.000,00)	74.823,85	(236,96)
JPY	AUD	HSBC London	2. Juli 21	24.918.400,00	(300.000,00)	224.510,30	(671,61)
JPY	AUD	HSBC London	20. Juli 21	2.348.707.054,00	(28.400.000,00)	21.161.427,92	(154.337,82)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	52.600.240,00	(400.000,00)	473.918,70	(873,03)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	3.568.465.453,00	(27.200.000,00)	32.151.231,60	(146.287,25)
JPY	GBP	Citigroup	19. Juli 21	1.911.529.507,00	(12.500.000,00)	17.222.536,89	(80.561,97)
JPY	USD	HSBC London	1. Juli 21	1.380.000.000,00	(12.478.050,35)	12.433.551,68	(57.926,15)
JPY	USD	HSBC London	15. Juli 21	103.150.652,00	(936.881,90)	929.368,81	(8.403,29)
JPY	USD	HSBC London	19. Juli 21	4.410.000.000,00	(40.080.777,73)	39.733.306,44	(384.118,63)
JPY	USD	HSBC London	11. Aug. 2021	3.830.000.000,00	(35.069.164,77)	34.507.610,81	(586.525,77)
KRW	USD	HSBC London	14. Juli 21	81.800.000.000,00	(73.532.756,87)	72.636.763,99	(1.189.654,89)
KRW	USD	HSBC London	28. Juli 21	1.253.448.276,00	(1.111.592,59)	1.113.037,00	(3.143,21)
KRW	USD	HSBC London	12. Aug. 2021	300.000.000,00	(265.771,45)	266.394,00	(496,45)
MXN	USD	Citigroup	1. Juli 21	98.000.000,00	(4.943.370,65)	4.922.050,05	(31.218,65)
MXN	USD	Citigroup	2. Juli 21	52.500.000,00	(2.644.018,98)	2.636.812,52	(12.876,48)
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	7. Juli 21	16.451.612,00	(823.943,15)	826.282,22	(46,42)
MXN	USD	Citigroup	8. Juli 21	1.754.500.000,00	(88.456.389,47)	88.119.763,32	(601.556,47)
MXN	USD	Citigroup	30. Juli 21	709.000.000,00	(35.738.435,77)	35.609.525,33	(335.229,77)
MXN	USD	Citigroup	16. Aug. 2021	435.500.000,00	(21.839.681,69)	21.872.987,70	(140.458,67)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	5.092.236,00	(500.000,00)	591.763,69	(872,46)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	13. Juli 21	603.747.375,05	(59.800.000,00)	70.160.882,66	(733.263,30)
NOK	SEK	Citigroup	1. Juli 21	1.000.000,00	(996.380,00)	116.209,01	(229,79)
NOK	SEK	Citigroup	22. Juli 21	30.500.000,00	(30.365.978,83)	3.544.374,70	(4.579,74)
NOK	USD	Citigroup	1. Juli 21	18.500.000,00	(2.161.658,84)	2.149.866,62	(11.015,34)
NOK	USD	Citigroup	15. Juli 21	209.447,79	(24.785,27)	24.339,72	(434,87)
NOK	USD	Citigroup	26. Juli 21	294.500.000,00	(34.347.386,81)	34.223.552,43	(106.755,32)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
NZD	AUD	HSBC London	29. Juli 21	2.146.060,92	(2.000.000,00)	1.499.560,08	(120,95)
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	1.200.000,00	(839.323,80)	838.500,01	(703,80)
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	47.400.000,00	(33.469.335,32)	33.120.750,29	(344.082,33)
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	4.503,71	(3.230,09)	3.146,97	(82,69)
PHP	USD	HSBC London	14. Juli 21	95.000.000,00	(1.977.495,53)	1.946.170,00	(34.555,53)
PHP	USD	HSBC London	16. Aug. 2021	17.500.000,00	(357.851,26)	358.505,00	(781,26)
PLN	EUR	HSBC London	1. Juli 21	14.898.822,60	(3.300.000,00)	3.913.532,62	(5.593,46)
PLN	EUR	HSBC London	28. Juli 21	321.109.187,62	(71.600.000,00)	84.347.019,51	(722.408,00)
PLN	EUR	HSBC London	13. Sep. 2021	74.178.091,07	(16.400.000,00)	19.484.652,37	(18.480,41)
PLN	USD	HSBC London	1. Juli 21	300.000,00	(78.914,14)	78.802,19	(239,14)
PLN	USD	HSBC London	15. Juli 21	828.184,63	(222.079,57)	217.542,53	(4.869,11)
PLN	USD	HSBC London	22. Juli 21	103.900.000,00	(27.805.355,30)	27.291.823,67	(554.255,45)
PLN	USD	HSBC London	25. Aug. 2021	43.700.000,00	(11.550.901,78)	11.478.851,73	(88.304,38)
RON	EUR	HSBC London	1. Juli 21	6.896.967,00	(1.400.000,00)	1.660.900,01	(362,80)
RON	EUR	HSBC London	2. Juli 21	41.863.425,43	(8.500.000,00)	10.081.382,67	(5.317,93)
RON	EUR	HSBC London	2. Aug. 2021	6.910.281,93	(1.400.000,00)	1.664.106,45	(107,73)
RUB	USD	HSBC London	4. Aug. 2021	20.000.000,00	(275.094,21)	273.780,00	(3.214,21)
RUB	USD	HSBC London	22. Sep. 2021	137.500.000,00	(1.873.084,72)	1.882.237,50	(17.797,22)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	2.023.050,00	(200.000,00)	236.555,24	(639,30)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	770.244.155,25	(76.200.000,00)	90.064.651,21	(324.986,30)
SEK	NOK	Citigroup	22. Juli 21	24.827.999,70	(25.000.000,00)	2.903.138,07	(3.511,65)
SEK	USD	Citigroup	1. Juli 21	21.000.000,00	(2.461.918,72)	2.455.530,06	(6.934,72)
SEK	USD	Citigroup	15. Juli 21	208.505,74	(24.991,89)	24.380,58	(612,99)
SEK	USD	Citigroup	4. Aug. 2021	1.000.000,00	(117.242,67)	116.930,00	(299,67)
SGD	USD	Citigroup	1. Juli 21	4.900.000,00	(3.645.426,48)	3.645.290,88	(3.114,38)
SGD	USD	Citigroup	2. Juli 21	6.900.000,00	(5.131.637,67)	5.133.164,71	(2.681,37)
SGD	USD	Citigroup	7. Juli 21	34.600.000,00	(26.090.869,76)	25.740.217,23	(372.066,96)
SGD	USD	Citigroup	19. Juli 21	29.600.000,00	(22.357.366,74)	22.020.532,66	(355.745,94)
SGD	USD	Citigroup	28. Juli 21	34.800.000,00	(26.224.071,25)	25.889.004,61	(357.857,65)
THB	USD	Citigroup	14. Juli 21	880.000.000,00	(28.211.967,57)	27.456.879,83	(756.847,57)
THB	USD	Citigroup	23. Juli 21	75.000.000,00	(2.407.560,50)	2.340.074,99	(67.635,50)
TWD	USD	Citigroup	16. Juli 21	385.000.000,00	(14.005.872,78)	13.818.035,07	(203.237,79)
TWD	USD	Citigroup	29. Juli 21	570.000.000,00	(20.689.197,93)	20.457.870,10	(231.327,93)
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	299.878,00	(400.000,00)	299.878,00	(44,00)
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	4.924,88	(6.568,64)	4.924,88	(0,67)
USD	BRL	HSBC London	2. Juli 21	115.356.947,11	(584.400.000,00)	115.356.947,11	(2.218.764,56)
USD	BRL	HSBC London	3. Aug. 2021	2.464.840,16	(12.400.000,00)	2.464.840,16	(20.794,30)
USD	CAD	HSBC London	7. Juli 21	16.067.741,18	(19.959.885,00)	16.067.741,18	(30.105,90)
USD	CLP	HSBC London	10. Aug. 2021	15.908.306,99	(11.800.000.000,00)	15.908.306,99	(187.167,00)
USD	CLP	HSBC London	17. Aug. 2021	5.772.288,48	(4.300.000.000,00)	5.772.288,48	(88.806,57)
USD	CNH	HSBC London	12. Juli 21	9.863.194,19	(64.000.000,00)	9.863.194,19	(22.265,98)
USD	CNH	HSBC London	29. Juli 21	3.158.805,92	(20.500.000,00)	3.158.805,92	(3.696,01)
USD	COP	HSBC London	8. Juli 21	4.316.501,63	(16.600.000.000,00)	4.316.501,63	(115.698,36)
USD	COP	HSBC London	12. Aug. 2021	4.167.688,29	(15.800.000.000,00)	4.167.688,29	(35.243,71)
USD	COP	HSBC London	20. Okt. 21	317.869,49	(1.200.000.000,00)	317.869,49	(131,50)
USD	EUR	HSBC London	2. Juli 21	236.999,00	(200.000,00)	236.999,00	(147,00)
USD	EUR	HSBC London	12. Juli 21	355.784,70	(300.000,00)	355.784,70	(16,49)
USD	GBP	HSBC London	1. Juli 21	276.505,80	(200.000,00)	276.505,80	(74,21)
USD	GBP	HSBC London	2. Juli 21	1.036.250,50	(750.000,00)	1.036.250,50	(928,24)
USD	GBP	HSBC London	15. Juli 21	3.353,60	(2.425,04)	3.353,60	(0,14)
USD	GBP	HSBC London	21. Juli 21	2.972.370,40	(2.150.000,00)	2.972.370,40	(1.047,29)
USD	GBP	HSBC London	16. Aug. 2021	20.031.222,41	(14.500.000,00)	20.031.222,41	(23.145,05)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	4. Aug. 2021	15.795.559,11	(4.700.000.000,00)	15.795.559,11	(57.236,16)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	10. Aug. 2021	10.316.317,17	(33.642.195,00)	10.316.317,17	(8.065,59)
USD	INR	Citigroup	7. Juli 21	1.827.209,11	(136.018.908,00)	1.827.209,11	(613,71)
USD	INR	Citigroup	23. Juli 21	2.652.874,14	(197.873.380,00)	2.652.874,14	(808,33)
USD	INR	Citigroup	6. Aug. 2021	66.917,83	(5.000.000,00)	66.917,83	(17,25)
USD	KRW	HSBC London	14. Juli 21	10.864.620,66	(12.300.000.000,00)	10.864.620,66	(13.430,64)
USD	KRW	HSBC London	28. Juli 21	43.567.689,30	(49.423.655.914,00)	43.567.689,30	(139.211,81)
USD	MXN	Citigroup	8. Juli 21	52.871.806,54	(1.078.500.000,00)	52.871.806,54	(1.134.133,76)
USD	MXN	Citigroup	30. Juli 21	42.979.452,89	(888.000.000,00)	42.979.452,89	(1.367.121,28)
USD	MXN	Citigroup	16. Aug. 2021	8.484.399,16	(174.500.000,00)	8.484.399,16	(211.495,26)
USD	NOK	Citigroup	26. Juli 21	5.844.518,08	(50.500.000,00)	5.844.518,08	(26.961,72)
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	627.792,00	(900.000,00)	627.792,00	(1.174,80)
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	36.201,54	(51.900,07)	36.201,54	(68,46)
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	30. Juli 21	906.339,07	(1.300.000,00)	906.339,07	(2.114,05)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	7.190.713,66	(27.750.000,00)	7.190.713,66	(42.790,09)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte		Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung	Gegenpartei						
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	5. Okt. 21	439.585,03	(1.750.000,00)	439.585,03	(16.683,70)	
USD	PHP	HSBC London	14. Juli 21	51.123,70	(2.500.000,00)	51.123,70	(6,31)	
USD	PLN	HSBC London	22. Juli 21	235.797,66	(900.000,00)	235.797,66	(256,11)	
USD	PLN	HSBC London	25. Aug. 2021	576.805,59	(2.200.000,00)	576.805,59	(258,75)	
USD	RUB	HSBC London	4. Aug. 2021	929.732,74	(70.000.000,00)	929.732,74	(21.971,02)	
USD	SEK	Citigroup	4. Aug. 2021	3.202.181,09	(27.500.000,00)	3.202.181,09	(13.746,84)	
USD	SGD	Citigroup	2. Juli 21	297.313,76	(400.000,00)	297.313,76	(17,04)	
USD	SGD	Citigroup	19. Juli 21	4.459.086,79	(6.000.000,00)	4.459.086,79	(701,23)	
USD	SGD	Citigroup	28. Juli 21	23.838.101,70	(32.092.427,00)	23.838.101,70	(15.622,58)	
USD	SGD	Citigroup	11. Aug. 2021	14.149.198,47	(19.050.940,00)	14.149.198,47	(10.508,99)	
USD	THB	Citigroup	14. Juli 21	24.065.559,79	(772.500.000,00)	24.065.559,79	(35.670,00)	
USD	THB	Citigroup	23. Juli 21	467.786,68	(15.000.000,00)	467.786,68	(198,33)	
USD	THB	Citigroup	16. Aug. 2021	467.040,51	(15.000.000,00)	467.040,51	(884,66)	
USD	TWD	Citigroup	16. Juli 21	4.559.398,39	(127.500.000,00)	4.559.398,39	(11.617,04)	
USD	TWD	Citigroup	29. Juli 21	2.239.457,20	(62.500.000,00)	2.239.457,20	(3.730,30)	
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	454.524,37	(6.500.000,00)	454.524,37	(300,13)	
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	9.607.610,96	(138.289.038,00)	9.607.610,96	(43.143,13)	
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	25. Aug. 2021	1.348.428,55	(19.500.000,00)	1.348.428,55	(6.301,16)	
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	202.000.000,00	(14.294.753,70)	14.146.867,88	(197.981,70)	
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	25. Aug. 2021	423.500.000,00	(30.426.005,48)	29.659.398,75	(1.005.036,98)	

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte		Verkaufte		Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung	Gegenpartei						
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften								2.855,81
USD	CHF	Citigroup	30. Juli 21	3.637,46	(3.351,49)	3.637,46	11,04	
USD	EUR	Citigroup	30. Juli 21	386.396,46	(324.165,74)	386.396,46	1.788,87	
USD	GBP	Citigroup	30. Juli 21	184.739,96	(132.813,67)	184.739,96	1.055,90	
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften								(4.693.551,77)
CHF	USD	Citigroup	30. Juli 21	65.939.208,68	(71.991.375,30)	71.335.758,84	(643.239,27)	
EUR	USD	Citigroup	30. Juli 21	436.578.573,04	(521.837.047,71)	517.738.529,77	(3.858.399,72)	
GBP	USD	Citigroup	30. Juli 21	23.318.709,03	(32.432.243,49)	32.213.634,40	(182.002,53)	
SEK	USD	Citigroup	30. Juli 21	648.927,00	(76.691,59)	75.879,04	(807,37)	
SGD	USD	Citigroup	30. Juli 21	4.768.063,64	(3.553.104,45)	3.547.138,55	(9.102,88)	

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							8.313.517,71
AUD	EUR	HSBC London	19. Juli 21	3.167.040,37	(2.000.000,00)	2.377.656,15	2.520,33
AUD	JPY	HSBC London	2. Juli 21	100.000,00	(8.306.000,00)	75.075,02	225,08
BRL	USD	HSBC London	2. Juli 21	153.700.000,00	(28.854.655,46)	30.630.715,73	2.068.247,65
BRL	USD	HSBC London	3. Aug. 2021	131.900.000,00	(25.953.600,56)	26.286.216,04	485.490,64
CAD	EUR	Citigroup	2. Juli 21	147.219,00	(100.000,00)	118.887,99	161,46
CAD	EUR	Citigroup	6. Aug. 2021	16.459.823,53	(11.143.189,00)	13.292.274,51	52.189,27
CAD	USD	HSBC London	2. Juli 21	400.000,00	(322.528,62)	323.023,50	77,78
CAD	USD	HSBC London	7. Juli 21	9.500.000,00	(7.658.201,92)	7.671.808,12	3.643,08
CAD	USD	HSBC London	15. Juli 21	101.348,25	(81.354,88)	81.844,67	383,50
CLP	USD	HSBC London	17. Aug. 2021	2.400.000.000,00	(3.221.152,67)	3.295.200,00	50.047,33
CNH	USD	HSBC London	29. Juli 21	500.000,00	(77.047,65)	77.388,99	86,36
COP	USD	HSBC London	12. Aug. 2021	200.000.000,00	(53.035,33)	53.600,00	164,67
EUR	AUD	HSBC London	19. Juli 21	4.200.000,00	(6.610.324,64)	4.980.780,00	25.042,68
EUR	CHF	HSBC London	26. Juli 21	800.000,00	(876.497,76)	948.720,00	789,51
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	400.000,00	(342.778,60)	474.360,00	373,21
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	900.000,00	(315.267.680,00)	1.067.310,00	4.015,35
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	400.000,00	(52.618.542,00)	474.360,00	881,88
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	13. Juli 21	2.700.000,00	(27.373.766,30)	3.201.930,00	19.830,16
EUR	PLN	HSBC London	1. Juli 21	600.000,00	(2.710.112,12)	711.540,00	693,04
EUR	PLN	HSBC London	28. Juli 21	6.800.000,00	(30.698.141,90)	8.064.120,00	15.732,96
EUR	RON	HSBC London	2. Juli 21	701.986,00	(3.457.807,53)	832.485,20	330,92
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	5.300.000,00	(53.463.859,65)	6.285.270,00	35.416,02
GBP	AUD	HSBC London	10. Aug. 2021	5.350.000,00	(9.791.650,44)	7.390.758,37	56.103,73
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	1.375.031,25	(1.600.000,00)	1.899.537,15	4.410,29
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	10.841.030,13	(12.600.000,00)	14.976.342,85	48.393,88
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	1. Sep. 2021	1.376.979,01	(1.600.000,00)	1.902.227,88	4.876,87
GBP	JPY	Citigroup	19. Juli 21	950.000,00	(144.279.439,00)	1.312.377,66	15.092,95
GBP	JPY	Citigroup	11. Aug. 2021	2.950.000,00	(451.987.160,00)	4.075.277,98	10.611,83
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	70.306.400,00	(200.000,00)	237.518,92	94,10
INR	USD	Citigroup	23. Juli 21	25.000.000,00	(335.098,46)	336.350,00	176,54
INR	USD	Citigroup	6. Aug. 2021	41.540.616,00	(556.030,81)	558.887,44	73,42
JPY	AUD	HSBC London	20. Juli 21	33.430.452,00	(400.000,00)	301.202,36	977,10
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	1.824.282.206,00	(13.700.000,00)	16.436.454,41	168.603,46
JPY	GBP	Citigroup	19. Juli 21	378.170.528,00	(2.450.000,00)	3.407.248,41	15.810,08
JPY	GBP	Citigroup	11. Aug. 2021	108.253.685,00	(700.000,00)	975.346,22	6.505,76
KRW	USD	HSBC London	28. Juli 21	1.672.413.793,00	(1.477.849,63)	1.485.070,00	1.099,33
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	7. Juli 21	251.338.710,00	(12.383.160,02)	12.623.486,83	203.882,58
MXN	USD	Citigroup	8. Juli 21	500.000,00	(24.931,23)	25.112,50	105,77
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	105.000.000,00	(5.215.414,33)	5.273.625,05	28.285,67
MXN	USD	Citigroup	30. Juli 21	36.000.000,00	(1.791.590,34)	1.808.100,02	6.033,67
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	13. Aug. 2021	58.500.000,00	(2.911.483,42)	2.938.162,53	4.449,08
MXN	USD	Citigroup	16. Aug. 2021	28.500.000,00	(1.416.893,61)	1.431.412,51	3.147,37
NOK	SEK	Citigroup	22. Juli 21	3.000.000,00	(2.980.845,00)	348.627,02	247,75
NZD	AUD	HSBC London	29. Juli 21	5.053.886,00	(4.700.000,00)	3.531.402,87	7.152,12
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	100.000,00	(69.850,90)	69.875,00	33,60
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	250.000,00	(63.176,46)	65.231,50	1.991,29
PLN	EUR	HSBC London	28. Juli 21	5.439.393,30	(1.200.000,00)	1.428.786,94	3.011,26
PLN	USD	HSBC London	22. Juli 21	1.800.000,00	(471.141,45)	472.813,11	966,15
RUB	USD	HSBC London	4. Aug. 2021	1.045.000.000,00	(13.933.199,98)	14.305.005,02	272.530,00
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	1.015.739,28	(100.000,00)	118.770,40	148,58
SEK	NOK	Citigroup	22. Juli 21	498.059,50	(500.000,00)	58.238,10	105,08
SEK	USD	Citigroup	15. Juli 21	39.323,33	(4.575,37)	4.598,08	22,39
THB	USD	Citigroup	16. Aug. 2021	167.500.000,00	(5.210.617,40)	5.226.167,47	14.545,10
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	679.827,00	(900.000,00)	679.827,00	5.007,00
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	6. Juli 21	451.356,90	(600.000,00)	451.356,90	1.461,85
USD	AUD	Citigroup	15. Juli 21	310,45	(413,00)	310,45	0,76
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	1.827.530,19	(2.372.361,58)	1.827.530,19	48.592,12
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	23. Juli 21	18.975.751,49	(25.100.000,00)	18.975.751,49	153.595,29
USD	BRL	HSBC London	2. Juli 21	4.213.680,75	(20.800.000,00)	4.213.680,75	28.932,35
USD	BRL	HSBC London	3. Aug. 2021	302.422,38	(1.500.000,00)	302.422,38	1.757,07
USD	CAD	HSBC London	7. Juli 21	38.304.205,96	(47.075.582,00)	38.304.205,96	337.281,36
USD	CAD	HSBC London	15. Juli 21	1.289,02	(1.585,58)	1.289,02	10,23

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	CAD	HSBC London	30. Juli 21	485.442,03	(600.000,00)	485.442,03	1.536,04
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	325.858,20	(300.000,00)	325.858,20	1.516,20
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	216.797,47	(200.000,00)	216.797,47	562,86
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	7.945,75	(7.296,45)	7.945,75	54,05
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	20.602.183,26	(18.700.000,00)	20.602.183,26	365.769,85
USD	CLP	HSBC London	10. Aug. 2021	3.326.590,64	(2.350.000.000,00)	3.326.590,64	121.368,34
USD	CNH	HSBC London	12. Juli 21	1.093.533,66	(7.000.000,00)	1.093.533,66	12.324,81
USD	CNH	HSBC London	12. Aug. 2021	3.545.471,21	(23.000.000,00)	3.545.471,21	874,97
USD	COP	HSBC London	8. Juli 21	807.580,34	(3.000.000.000,00)	807.580,34	6.580,34
USD	COP	HSBC London	12. Aug. 2021	374.756,32	(1.400.000.000,00)	374.756,32	2.365,16
USD	EUR	HSBC London	1. Juli 21	714.174,00	(600.000,00)	714.174,00	2.753,97
USD	EUR	HSBC London	2. Juli 21	1.427.348,00	(1.200.000,00)	1.427.348,00	4.471,89
USD	EUR	HSBC London	6. Juli 21	714.084,60	(600.000,00)	714.084,60	2.574,27
USD	EUR	HSBC London	12. Juli 21	48.115.574,22	(40.100.000,00)	48.115.574,22	556.671,07
USD	EUR	HSBC London	15. Juli 21	3.021.015,40	(2.489.327,42)	3.021.015,40	68.457,09
USD	EUR	HSBC London	10. Aug. 2021	4.766.658,52	(4.000.000,00)	4.766.658,52	19.769,55
USD	GBP	Citigroup	1. Juli 21	5.970,89	(4.290,77)	5.970,89	37,19
USD	GBP	HSBC London	1. Juli 21	138.446,90	(100.000,00)	138.446,90	156,91
USD	GBP	HSBC London	2. Juli 21	553.591,50	(400.000,00)	553.591,50	429,50
USD	GBP	HSBC London	15. Juli 21	1.888.318,86	(1.338.445,09)	1.888.318,86	37.299,84
USD	GBP	HSBC London	21. Juli 21	27.856.128,41	(19.850.000,00)	27.856.128,41	403.851,34
USD	GBP	HSBC London	16. Aug. 2021	21.064.603,72	(15.150.000,00)	21.064.603,72	111.231,80
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	135.567,88	(40.000.000,00)	135.567,88	593,48
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	135.228,44	(40.000.000,00)	135.228,44	253,64
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	171.280,30	(50.140.745,44)	171.280,30	2.105,14
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	4. Aug. 2021	2.258.878,56	(660.000.000,00)	2.258.878,56	32.758,61
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	10. Aug. 2021	2.648.324,46	(8.620.556,00)	2.648.324,46	2.778,16
USD	INR	Citigroup	7. Juli 21	12.128.398,16	(898.459.384,00)	12.128.398,16	54.966,33
USD	INR	Citigroup	23. Juli 21	3.959.856,05	(294.820.576,00)	3.959.856,05	6.036,58
USD	INR	Citigroup	6. Aug. 2021	66.992,27	(5.000.000,00)	66.992,27	57,56
USD	JPY	HSBC London	1. Juli 21	2.986.564,27	(330.000.000,00)	2.986.564,27	16.534,57
USD	JPY	HSBC London	15. Juli 21	1.701.972,12	(187.365.992,00)	1.701.972,12	15.453,34
USD	JPY	HSBC London	19. Juli 21	12.605.470,61	(1.380.000.000,00)	12.605.470,61	183.357,89
USD	JPY	HSBC London	11. Aug. 2021	24.849.250,81	(2.730.000.000,00)	24.849.250,81	270.145,46
USD	KRW	HSBC London	14. Juli 21	14.695.729,68	(16.500.000.000,00)	14.695.729,68	103.713,99
USD	KRW	HSBC London	15. Juli 21	1.719.718,37	(1.917.400.000,00)	1.719.718,37	24.105,89
USD	KRW	HSBC London	28. Juli 21	1.278.304,41	(1.444.086.022,00)	1.278.304,41	1.275,50
USD	MXN	Citigroup	1. Juli 21	934.868,99	(18.500.000,00)	934.868,99	7.574,99
USD	MXN	Royal Bank of Scotland	7. Juli 21	12.892.970,68	(255.500.000,00)	12.892.970,68	97.616,37
USD	MXN	Citigroup	8. Juli 21	2.715.483,73	(54.000.000,00)	2.715.483,73	11.499,20
USD	MXN	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	5.285.678,32	(105.000.000,00)	5.285.678,32	42.132,98
USD	MXN	Royal Bank of Scotland	13. Aug. 2021	2.939.993,97	(58.500.000,00)	2.939.993,97	24.196,15
USD	NOK	Citigroup	1. Juli 21	116.727,66	(1.000.000,00)	116.727,66	476,66
USD	NOK	Citigroup	2. Juli 21	466.912,96	(4.000.000,00)	466.912,96	1.904,96
USD	NOK	Citigroup	15. Juli 21	2.888,27	(24.396,88)	2.888,27	51,90
USD	NOK	Citigroup	26. Juli 21	16.107.550,40	(135.500.000,00)	16.107.550,40	353.323,28
USD	NOK	Citigroup	8. Sep. 2021	7.406.870,41	(63.500.000,00)	7.406.870,41	22.575,23
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	139.954,00	(200.000,00)	139.954,00	184,00
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	279.932,00	(400.000,00)	279.932,00	391,20
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	10.624.573,00	(14.700.000,00)	10.624.573,00	351.554,01
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	1.793,41	(2.513,07)	1.793,41	37,17
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	30. Juli 21	11.842.347,00	(16.600.000,00)	11.842.347,00	242.114,92
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	869.571,99	(3.250.000,00)	869.571,99	22.330,44
USD	PHP	HSBC London	14. Juli 21	1.031.605,75	(50.000.000,00)	1.031.605,75	9.020,72
USD	PHP	HSBC London	23. Juli 21	1.762.205,87	(85.000.000,00)	1.762.205,87	24.948,11
USD	PLN	HSBC London	15. Juli 21	3.080,95	(11.416,42)	3.080,95	86,72
USD	PLN	HSBC London	22. Juli 21	5.851.326,88	(22.100.000,00)	5.851.326,88	54.887,99
USD	PLN	HSBC London	25. Aug. 2021	4.475.937,94	(16.500.000,00)	4.475.937,94	147.925,61
USD	RON	HSBC London	15. Juli 21	441,47	(1.808,62)	441,47	6,45
USD	RUB	HSBC London	4. Aug. 2021	2.123.924,53	(155.000.000,00)	2.123.924,53	16.950,01
USD	RUB	HSBC London	22. Sep. 2021	33.872,46	(2.500.000,00)	33.872,46	141,81
USD	SEK	Citigroup	1. Juli 21	410.585,44	(3.500.000,00)	410.585,44	1.421,44
USD	SEK	Citigroup	2. Juli 21	58.689,72	(500.000,00)	58.689,72	236,72
USD	SEK	Citigroup	15. Juli 21	3.158,29	(26.548,21)	3.158,29	54,22

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	SEK	Citigroup	4. Aug. 2021	3.351.453,94	(28.500.000,00)	3.351.453,94	18.572,24
USD	SGD	Citigroup	1. Juli 21	818.932,55	(1.100.000,00)	818.932,55	1.270,65
USD	SGD	Citigroup	2. Juli 21	595.125,19	(800.000,00)	595.125,19	463,59
USD	SGD	Citigroup	7. Juli 21	9.792.098,93	(13.100.000,00)	9.792.098,93	54.633,91
USD	SGD	Citigroup	19. Juli 21	8.092.061,16	(10.800.000,00)	8.092.061,16	64.445,47
USD	SGD	Citigroup	28. Juli 21	4.215.301,50	(5.655.713,00)	4.215.301,50	11.512,56
USD	SGD	Citigroup	11. Aug. 2021	5.365.217,17	(7.212.319,00)	5.365.217,17	4.625,44
USD	THB	Citigroup	14. Juli 21	712.300,50	(22.500.000,00)	712.300,50	10.323,66
USD	THB	Citigroup	23. Juli 21	705.959,62	(22.500.000,00)	705.959,62	3.982,37
USD	TWD	Citigroup	16. Juli 21	1.255.919,75	(35.000.000,00)	1.255.919,75	1.136,02
USD	TWD	Citigroup	29. Juli 21	359.401,88	(10.000.000,00)	359.401,88	491,88
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	3.834.477,57	(54.707.037,00)	3.834.477,57	16.737,04
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	25. Aug. 2021	244.666,31	(3.500.000,00)	244.666,31	1.528,77
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	50.000.000,00	(3.456.410,04)	3.501.699,97	32.889,96
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(10.519.628,35)
AUD	EUR	HSBC London	1. Juli 21	157.797,00	(100.000,00)	118.466,13	(253,81)
AUD	EUR	HSBC London	19. Juli 21	10.531.971,19	(6.700.000,00)	7.906.879,34	(49.734,15)
AUD	GBP	HSBC London	10. Aug. 2021	459.541,64	(250.000,00)	345.000,97	(1.131,25)
AUD	JPY	HSBC London	20. Juli 21	7.300.000,00	(617.671.176,00)	5.480.476,37	(85.920,87)
AUD	NZD	HSBC London	29. Juli 21	5.700.000,00	(6.139.444,52)	4.279.276,07	(15.848,26)
AUD	USD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	900.000,00	(676.881,48)	675.675,17	(2.061,48)
AUD	USD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	20.890,49	(15.753,26)	15.683,54	(88,36)
AUD	USD	Royal Bank of Scotland	23. Juli 21	800.000,00	(603.322,94)	600.600,15	(3.414,14)
BRL	USD	HSBC London	3. Aug. 2021	22.800.000,00	(4.603.051,44)	4.543.788,67	(32.837,03)
CAD	EUR	Citigroup	6. Aug. 2021	5.229.344,82	(3.556.811,00)	4.223.003,17	(3.078,21)
CAD	USD	HSBC London	7. Juli 21	46.900.000,00	(38.745.987,34)	37.874.505,37	(920.668,30)
CAD	USD	HSBC London	15. Juli 21	5.008,88	(4.076,89)	4.044,96	(37,17)
CAD	USD	HSBC London	30. Juli 21	12.500.000,00	(10.204.293,26)	10.094.484,37	(122.918,24)
CAD	USD	HSBC London	31. Aug. 2021	12.700.000,00	(10.264.110,38)	10.255.996,12	(21.598,48)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	300.000,00	(325.685,48)	324.552,39	(1.343,48)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	200.000,00	(216.306,25)	216.368,26	(71,65)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	835,50	(929,75)	903,88	(26,08)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	26.600.000,00	(29.613.965,13)	28.776.978,42	(828.961,34)
CLP	USD	HSBC London	10. Aug. 2021	8.100.000.000,00	(11.236.302,57)	11.121.300,01	(187.902,54)
CNH	USD	HSBC London	12. Juli 21	23.000.000,00	(3.552.961,45)	3.559.893,74	(381,45)
CNH	USD	HSBC London	29. Juli 21	1.500.000,00	(231.752,80)	232.166,98	(350,80)
COP	USD	HSBC London	8. Juli 21	7.600.000.000,00	(2.077.446,51)	2.036.800,00	(48.246,50)
COP	USD	HSBC London	12. Aug. 2021	5.200.000.000,00	(1.426.610,10)	1.393.600,00	(43.410,13)
EUR	AUD	HSBC London	1. Juli 21	100.000,00	(158.210,00)	118.590,00	(55,86)
EUR	AUD	HSBC London	2. Juli 21	100.000,00	(158.488,00)	118.590,00	(262,13)
EUR	AUD	HSBC London	19. Juli 21	2.100.000,00	(3.325.732,52)	2.490.390,00	(2.902,20)
EUR	CAD	Citigroup	2. Juli 21	100.000,00	(147.581,00)	118.590,00	(453,42)
EUR	CAD	Citigroup	6. Aug. 2021	600.000,00	(884.214,81)	711.540,00	(1.153,33)
EUR	CHF	HSBC London	2. Juli 21	300.000,00	(329.362,70)	355.770,00	(379,05)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	1.600.000,00	(1.375.535,00)	1.897.440,00	(5.106,93)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	1.500.000,00	(1.287.694,00)	1.778.850,00	(2.163,48)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	13.200.000,00	(11.352.278,19)	15.653.880,00	(43.808,57)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	100.000,00	(35.198.000,00)	118.590,00	(198,07)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	1.100.000,00	(389.554.961,00)	1.304.490,00	(9.358,46)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	30.800.000,00	(4.087.079.293,00)	36.525.720,00	(251.162,25)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	13. Juli 21	4.200.000,00	(43.194.461,19)	4.980.780,00	(40.420,38)
EUR	PLN	HSBC London	28. Juli 21	6.700.000,00	(30.567.318,69)	7.945.530,00	(68.581,03)
EUR	RON	HSBC London	1. Juli 21	300.000,00	(1.478.375,56)	355.770,00	(31,51)
EUR	RON	HSBC London	2. Juli 21	698.014,00	(3.440.019,04)	827.774,80	(98,46)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	10.100.000,00	(103.064.555,06)	11.977.590,00	(70.525,50)
EUR	USD	HSBC London	1. Juli 21	600.000,00	(714.007,80)	711.540,00	(2.587,80)
EUR	USD	HSBC London	12. Juli 21	39.400.000,00	(47.989.800,81)	46.724.460,00	(1.261.243,21)
EUR	USD	HSBC London	10. Aug. 2021	21.000.000,00	(25.614.264,00)	24.903.900,00	(693.186,00)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	1.883.781,98	(2.200.000,00)	2.602.350,92	(4.126,29)
GBP	JPY	Citigroup	19. Juli 21	5.750.000,00	(885.843.988,00)	7.943.338,44	(21.812,32)
GBP	JPY	Citigroup	11. Aug. 2021	1.400.000,00	(216.968.167,00)	1.934.030,23	(17.156,18)
GBP	USD	HSBC London	1. Juli 21	150.000,00	(207.749,21)	207.217,52	(314,21)
GBP	USD	HSBC London	15. Juli 21	1.673,68	(2.356,13)	2.312,11	(41,50)
GBP	USD	HSBC London	21. Juli 21	19.950.000,00	(28.148.003,63)	27.559.930,76	(557.452,88)
GBP	USD	HSBC London	16. Aug. 2021	20.350.000,00	(28.760.538,70)	28.112.510,83	(615.267,68)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	22. Juli 21	1.184.501.398,99	(3.400.000,00)	4.001.648,45	(37.114,42)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	40.000.000,00	(135.093,65)	135.133,60	(119,25)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte		Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung								
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21		398.080,00	(1.398,60)	1.344,85	(55,47)	
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	4. Aug. 2021	1.010.000.000,00		(3.517.057,81)	3.412.123,40	(110.398,51)	
IDR	USD	HSBC London	23. Juli 21	2.000.000.000,00		(139.794,36)	137.940,00	(2.714,36)	
INR	USD	Citigroup	7. Juli 21	930.000.000,00		(12.684.050,43)	12.512.219,93	(186.710,43)	
INR	USD	Citigroup	23. Juli 21	1.945.000.000,00		(26.425.284,41)	26.168.029,86	(340.889,39)	
INR	USD	Citigroup	6. Aug. 2021	345.959.384,00		(4.641.139,43)	4.654.537,53	(9.781,17)	
JPY	AUD	HSBC London	2. Juli 21	8.309.000,00		(100.000,00)	74.862,59	(198,07)	
JPY	AUD	HSBC London	20. Juli 21	562.277.579,00		(6.800.000,00)	5.066.019,81	(37.754,25)	
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	29. Juli 21	787.380.810,00		(6.000.000,00)	7.094.159,41	(30.296,14)	
JPY	GBP	Citigroup	19. Juli 21	427.961.310,00		(2.800.000,00)	3.855.854,39	(20.037,75)	
JPY	USD	HSBC London	1. Juli 21	330.000.000,00		(2.983.739,86)	2.973.240,62	(13.710,16)	
JPY	USD	HSBC London	15. Juli 21	219.276.929,00		(1.991.668,02)	1.975.645,67	(17.914,73)	
JPY	USD	HSBC London	19. Juli 21	1.010.000.000,00		(9.175.052,10)	9.099.918,26	(83.527,00)	
JPY	USD	HSBC London	11. Aug. 2021	780.000.000,00		(7.142.949,62)	7.027.659,64	(120.375,61)	
KRW	USD	HSBC London	14. Juli 21	19.500.000.000,00		(17.531.642,27)	17.315.610,00	(286.037,27)	
KRW	USD	HSBC London	28. Juli 21	327.586.207,00		(289.973,56)	290.890,00	(282,52)	
KRW	USD	HSBC London	12. Aug. 2021	100.000.000,00		(88.702,02)	88.798,00	(277,02)	
MXN	USD	Citigroup	1. Juli 21	18.500.000,00		(933.655,43)	929.162,51	(6.361,43)	
MXN	USD	Citigroup	2. Juli 21	12.500.000,00		(629.466,32)	627.812,51	(3.003,82)	
MXN	USD	Royal Bank of Scotland	7. Juli 21	4.161.290,00		(208.409,15)	209.000,79	(11,75)	
MXN	USD	Citigroup	8. Juli 21	420.000.000,00		(21.173.934,28)	21.094.500,20	(142.854,28)	
MXN	USD	Citigroup	30. Juli 21	165.000.000,00		(8.315.707,74)	8.287.125,08	(76.597,74)	
MXN	USD	Citigroup	16. Aug. 2021	112.500.000,00		(5.641.425,89)	5.650.312,55	(36.000,89)	
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	13. Juli 21	136.272.338,12		(13.500.000,00)	15.836.073,03	(168.458,70)	
NOK	SEK	Citigroup	22. Juli 21	6.500.000,00		(6.471.264,36)	755.358,54	(955,70)	
NOK	USD	Citigroup	1. Juli 21	1.000.000,00		(116.766,70)	116.209,01	(515,70)	
NOK	USD	Citigroup	15. Juli 21	49.714,50		(5.894,58)	5.777,27	(114,77)	
NOK	USD	Citigroup	26. Juli 21	70.000.000,00		(8.169.025,60)	8.134.630,46	(30.335,59)	
NZD	AUD	HSBC London	29. Juli 21	214.601,60		(200.000,00)	149.952,87	(15,23)	
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	1. Juli 21	200.000,00		(139.887,30)	139.750,00	(117,30)	
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	14. Juli 21	11.900.000,00		(8.391.132,78)	8.315.125,07	(74.877,26)	
NZD	USD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	1.124,85		(806,58)	785,99	(20,49)	
PHP	USD	HSBC London	14. Juli 21	50.000.000,00		(1.044.192,01)	1.024.300,00	(21.592,01)	
PHP	USD	HSBC London	16. Aug. 2021	22.500.000,00		(460.094,47)	460.935,00	(1.004,47)	
PLN	EUR	HSBC London	1. Juli 21	2.708.547,20		(600.000,00)	711.464,80	(1.103,46)	
PLN	EUR	HSBC London	28. Juli 21	74.891.544,70		(16.700.000,00)	19.672.058,06	(169.552,04)	
PLN	EUR	HSBC London	13. Sep. 2021	16.735.301,03		(3.700.000,00)	4.395.927,67	(4.169,36)	
PLN	USD	HSBC London	15. Juli 21	195.505,24		(52.430,77)	51.354,13	(1.155,03)	
PLN	USD	HSBC London	22. Juli 21	24.400.000,00		(6.541.952,32)	6.409.244,44	(142.271,54)	
PLN	USD	HSBC London	25. Aug. 2021	10.200.000,00		(2.695.372,45)	2.679.274,32	(19.892,05)	
RON	EUR	HSBC London	1. Juli 21	1.477.876,00		(300.000,00)	355.896,19	(88,69)	
RON	EUR	HSBC London	2. Juli 21	9.850.169,54		(2.000.000,00)	2.372.078,43	(1.262,85)	
RON	EUR	HSBC London	2. Aug. 2021	1.480.774,70		(300.000,00)	356.594,24	(23,07)	
RUB	USD	HSBC London	4. Aug. 2021	2.500.000,00		(34.598,02)	34.222,50	(613,02)	
RUB	USD	HSBC London	22. Sep. 2021	17.500.000,00		(239.014,65)	239.557,50	(2.887,15)	
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	1.010.550,00		(100.000,00)	118.163,61	(433,63)	
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	19. Juli 21	179.941.317,20		(17.800.000,00)	21.040.538,72	(74.101,85)	
SEK	NOK	Citigroup	22. Juli 21	4.965.104,70		(5.000.000,00)	580.569,71	(760,24)	
SEK	USD	Citigroup	1. Juli 21	3.500.000,00		(410.319,79)	409.255,01	(1.155,79)	
SEK	USD	Citigroup	15. Juli 21	49.101,68		(5.885,62)	5.741,46	(144,55)	
SEK	USD	Citigroup	4. Aug. 2021	2.000.000,00		(239.677,24)	233.860,01	(5.791,24)	
SGD	USD	Citigroup	1. Juli 21	1.100.000,00		(818.361,05)	818.330,61	(699,15)	
SGD	USD	Citigroup	2. Juli 21	1.000.000,00		(743.715,60)	743.936,91	(388,60)	
SGD	USD	Citigroup	7. Juli 21	8.400.000,00		(6.334.925,18)	6.249.070,08	(91.053,98)	
SGD	USD	Citigroup	19. Juli 21	7.500.000,00		(5.664.930,50)	5.579.526,86	(90.195,50)	
SGD	USD	Citigroup	28. Juli 21	8.600.000,00		(6.480.659,55)	6.397.857,46	(88.434,35)	
THB	USD	Citigroup	14. Juli 21	192.500.000,00		(6.171.263,30)	6.006.192,46	(165.455,80)	
THB	USD	Citigroup	23. Juli 21	15.000.000,00		(481.647,04)	468.015,00	(13.662,04)	
TWD	USD	Citigroup	16. Juli 21	87.500.000,00		(3.183.724,56)	3.140.462,52	(46.762,06)	
TWD	USD	Citigroup	29. Juli 21	127.500.000,00		(4.628.322,68)	4.576.102,52	(52.220,18)	
USD	AUD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	1.203,77		(1.605,55)	1.203,77	(0,17)	
USD	BRL	HSBC London	2. Juli 21	26.232.320,83		(132.900.000,00)	26.232.320,83	(505.893,00)	
USD	BRL	HSBC London	3. Aug. 2021	516.700,58		(2.600.000,00)	516.700,58	(4.481,28)	
USD	CAD	HSBC London	7. Juli 21	1.868.534,37		(2.324.418,00)	1.868.534,37	(6.132,07)	
USD	CLP	HSBC London	10. Aug. 2021	3.506.303,84		(2.600.000.000,00)	3.506.303,84	(40.154,96)	
USD	CLP	HSBC London	17. Aug. 2021	1.541.589,55		(1.150.000.000,00)	1.541.589,55	(25.917,36)	
USD	CNH	HSBC London	12. Juli 21	2.466.382,09		(16.000.000,00)	2.466.382,09	(4.982,41)	
USD	CNH	HSBC London	29. Juli 21	77.031,10		(500.000,00)	77.031,10	(103,12)	

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	COP	HSBC London	8. Juli 21	1.196.445,61	(4.600.000.000,00)	1.196.445,61	(31.754,38)
USD	COP	HSBC London	12. Aug. 2021	950.117,71	(3.600.000.000,00)	950.117,71	(7.510,42)
USD	COP	HSBC London	20. Okt. 21	52.978,25	(200.000.000,00)	52.978,25	(21,91)
USD	GBP	HSBC London	1. Juli 21	69.124,30	(50.000,00)	69.124,30	(20,70)
USD	GBP	HSBC London	2. Juli 21	207.276,00	(150.000,00)	207.276,00	(159,75)
USD	GBP	HSBC London	15. Juli 21	696,64	(503,75)	696,64	(0,03)
USD	GBP	HSBC London	21. Juli 21	207.401,35	(150.000,00)	207.401,35	(46,40)
USD	GBP	HSBC London	16. Aug. 2021	5.249.796,85	(3.800.000,00)	5.249.796,85	(5.830,43)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	4. Aug. 2021	3.461.624,97	(1.030.000.000,00)	3.461.624,97	(12.498,22)
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	10. Aug. 2021	1.803.034,52	(5.879.444,00)	1.803.034,52	(1.295,78)
USD	INR	Citigroup	7. Juli 21	423.700,66	(31.540.616,00)	423.700,66	(142,31)
USD	INR	Citigroup	23. Juli 21	639.231,87	(47.679.424,00)	639.231,87	(197,52)
USD	KRW	HSBC London	14. Juli 21	2.649.922,80	(3.000.000.000,00)	2.649.922,80	(3.260,39)
USD	KRW	HSBC London	28. Juli 21	10.098.431,29	(11.455.913.978,00)	10.098.431,29	(32.396,05)
USD	MXN	Citigroup	8. Juli 21	12.584.169,30	(256.500.000,00)	12.584.169,30	(260.071,13)
USD	MXN	Citigroup	30. Juli 21	9.729.255,11	(201.000.000,00)	9.729.255,11	(308.648,86)
USD	MXN	Citigroup	16. Aug. 2021	1.796.595,87	(37.000.000,00)	1.796.595,87	(47.247,00)
USD	NOK	Citigroup	26. Juli 21	1.331.120,27	(11.500.000,00)	1.331.120,27	(5.949,42)
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	2. Juli 21	139.452,00	(200.000,00)	139.452,00	(318,40)
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	15. Juli 21	9.413,39	(13.495,43)	9.413,39	(17,80)
USD	NZD	Royal Bank of Scotland	30. Juli 21	209.142,69	(300.000,00)	209.142,69	(500,34)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	3. Aug. 2021	1.555.065,25	(6.000.000,00)	1.555.065,25	(8.936,41)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	5. Okt. 21	125.584,00	(500.000,00)	125.584,00	(4.778,46)
USD	PLN	HSBC London	22. Juli 21	78.493,14	(300.000,00)	78.493,14	(191,44)
USD	PLN	HSBC London	25. Aug. 2021	131.116,97	(500.000,00)	131.116,97	(34,02)
USD	RUB	HSBC London	4. Aug. 2021	335.412,39	(25.000.000,00)	335.412,39	(4.462,76)
USD	SEK	Citigroup	4. Aug. 2021	814.988,39	(7.000.000,00)	814.988,39	(3.611,42)
USD	SGD	Citigroup	2. Juli 21	148.661,30	(200.000,00)	148.661,30	(4,10)
USD	SGD	Citigroup	19. Juli 21	817.454,27	(1.100.000,00)	817.454,27	(173,54)
USD	SGD	Citigroup	28. Juli 21	5.529.490,48	(7.444.287,00)	5.529.490,48	(3.714,27)
USD	SGD	Citigroup	11. Aug. 2021	3.258.737,85	(4.387.681,00)	3.258.737,85	(2.428,24)
USD	THB	Citigroup	14. Juli 21	5.295.936,93	(170.000.000,00)	5.295.936,93	(7.893,58)
USD	THB	Citigroup	23. Juli 21	155.941,78	(5.000.000,00)	155.941,78	(53,22)
USD	THB	Citigroup	16. Aug. 2021	77.876,77	(2.500.000,00)	77.876,77	(110,75)
USD	TWD	Citigroup	16. Juli 21	1.340.804,35	(37.500.000,00)	1.340.804,35	(3.612,17)
USD	TWD	Citigroup	29. Juli 21	626.952,53	(17.500.000,00)	626.952,53	(1.139,97)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	2.625.577,32	(37.792.963,00)	2.625.577,32	(11.874,13)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	25. Aug. 2021	414.962,44	(6.000.000,00)	414.962,44	(1.877,02)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	21. Juli 21	48.500.000,00	(3.432.193,18)	3.396.648,97	(47.572,14)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	25. Aug. 2021	100.000.000,00	(7.183.268,81)	7.003.399,94	(236.168,81)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							19.803,83
USD	JPY	Citigroup	30. Juli 21	3.980.856,06	(440.000.000,00)	3.980.856,06	19.803,83
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(883.959,02)
EUR	USD	Citigroup	30. Juli 21	40.120.217,97	(47.955.670,70)	47.578.566,49	(355.038,09)
GBP	USD	Citigroup	30. Juli 21	19.632.423,18	(27.305.036,48)	27.121.214,21	(153.002,57)
JPY	USD	Citigroup	30. Juli 21	12.952.209.687,00	(116.976.631,80)	116.697.078,60	(375.918,36)

Man Multi-Strategy Alternative

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							60,26
USD	GBP	Credit Suisse Europe	1. Juli 21	10.048,01	(7.229,90)	10.048,01	60,26
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(308,98)
EUR	USD	Credit Suisse Europe	2. Juli 21	9,30	(11,10)	11,03	(0,07)
EUR	USD	Credit Suisse Europe	6. Juli 21	66.007,48	(78.597,08)	78.278,27	(308,91)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 12 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man Multi-Strategy Alternative (Fortsetzung)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							305,67
USD	EUR	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	78.642,22	(66.014,15)	78.642,22	305,67
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(152.198,76)
AUD	USD	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	1.375.510,32	(1.044.346,58)	1.032.664,63	(11.517,15)
CHF	USD	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	22.713,14	(24.797,44)	24.572,01	(205,20)
EUR	USD	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	13.972.091,13	(16.698.618,96)	16.569.502,87	(118.497,30)
GBP	USD	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	2.169.182,99	(3.017.360,55)	2.996.618,20	(20.482,41)
NOK	USD	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	323.462,60	(38.089,55)	37.589,27	(494,46)
SEK	USD	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	819.680,90	(96.875,40)	95.845,29	(1.002,24)
USD	EUR	Credit Suisse Europe	30. Juli 21	3,12	(2,63)	3,12	0,00

Erläuterung 13 – Ausstehende Finanzterminkontrakte

Man AHL Trend Alternative

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	18. Sep. 2023	495.000,00	12,50
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	24	AUD	9. Dez. 2021	18.014.450,98	18,48
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	AUD	8. Jun. 2023	1.498.802,52	55,28
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	1	EUR	16. Jun. 2025	296.578,77	74,11
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	CAD	13. Mär. 2023	1.592.505,85	80,65
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	CAD	19. Jun. 2023	1.590.083,18	161,30
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	14. Sep. 26	245.300,00	225,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	6	USD	15. Sep. 2025	1.474.425,00	275,00
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	13	AUD	9. Sep. 2021	9.758.789,93	425,11
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	2	USD	15. Jun. 26	490.775,00	675,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	59	USD	13. Dez. 2021	14.719.762,50	975,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	5	USD	16. Mär. 2026	1.227.500,00	1.025,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	6	USD	15. Dez. 2025	1.473.525,00	1.237,50
Sale Euro Stoxx 50 Volatility Index Future	Credit Suisse Europe	(99)	EUR	15. Sep. 2021	235.395,22	1.505,84
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	49	USD	13. Sep. 2021	12.232.850,00	3.150,00
Purchase UK Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	350	GBP	28. Sep. 2021	66.057.285,98	6.810,78
Purchase Australian Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	90	AUD	15. Sep. 2021	9.539.790,14	9.709,02
Purchase 10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	JP Morgan Chase Bank NA	297	CAD	21. Sep. 2021	23.809.647,90	13.025,28
Purchase MSCI Singapore Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	314	SGD	29. Juli 21	8.303.176,61	21.844,31
Purchase 10 Year Japanese Bond (TSE)	JP Morgan Chase Bank NA	17	JPY	13. Sep. 2021	23.233.893,27	30.690,31
Sale Euro Stoxx 50 Volatility Index Future	Credit Suisse Europe	(223)	EUR	18. Aug. 21	503.788,11	31.266,91
Sale Euro Stoxx 50 Volatility Index Future	Credit Suisse Europe	(113)	EUR	21. Juli 21	240.542,03	36.922,69
Purchase Swiss Market Index Future (EUZ)	JP Morgan Chase Bank NA	261	CHF	17. Sep. 2021	33.671.498,89	73.743,92
Purchase Refinitiv Taiwan Banking Services Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	252	USD	29. Juli 21	15.374.520,00	166.992,00
Sale CBOE Volatility Index (VIX)	JP Morgan Chase Bank NA	(82)	USD	15. Sep. 2021	1.723.148,00	262.952,00
Purchase US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	128	USD	21. Sep. 2021	18.618.000,00	281.250,00
Purchase US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	81	USD	21. Sep. 2021	9.602.296,88	330.593,75
Purchase S&P 60 Future (TSX)	JP Morgan Chase Bank NA	195	CAD	16. Sep. 2021	37.878.785,43	361.932,57
Purchase KOSPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	322	KRW	9. Sep. 2021	31.370.046,85	368.398,48
Purchase E-mini S&P 500 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	190	USD	17. Sep. 2021	40.741.700,00	457.505,00
Purchase MSCI Tawain Index Future	Credit Suisse Europe	151	TWD	21. Juli 21	19.198.182,14	484.866,02
Sale CBOE Volatility Index (VIX)	JP Morgan Chase Bank NA	(341)	USD	18. Aug. 21	6.734.306,70	537.523,30
Sale CBOE Volatility Index (VIX)	JP Morgan Chase Bank NA	(165)	USD	21. Juli 21	2.954.044,50	828.355,50
Purchase Nasdaq 100 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	79	USD	17. Sep. 2021	22.987.420,00	840.667,00
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						5.154.944,61

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 13 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Purchase Buoni Poliennali Del Tesoro Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	1.066	EUR	8. Sep. 2021	134.133.430,02	(759.660,18)
Sale U.S. Dollar Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(210)	USD	13. Sep. 2021	19.410.510,00	(515.644,00)
Purchase S&P 200 Future	JP Morgan Chase Bank NA	462	AUD	16. Sep. 2021	62.631.822,35	(455.840,91)
Purchase MSCI EAFE Future	Merrill Lynch	125	USD	17. Sep. 2021	14.400.625,00	(331.338,09)
Purchase FTSE 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	255	GBP	17. Sep. 2021	24.590.192,81	(315.751,49)
Purchase Hang Seng Index Future (HKG)	JP Morgan Chase Bank NA	101	HKD	29. Juli 21	18.617.613,41	(283.990,33)
Purchase Euro Stoxx 50 Future (EUX)	JP Morgan Chase Bank NA	357	EUR	17. Sep. 2021	17.169.620,30	(277.094,38)
Sale Bundesrepublik Deutschland Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(100)	EUR	8. Sep. 2021	18.558.504,87	(272.924,43)
Purchase FTSE MIB Future	JP Morgan Chase Bank NA	100	EUR	17. Sep. 2021	14.826.121,80	(260.350,08)
Purchase FTSE/JSE Top40 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	239	ZAR	16. Sep. 2021	10.022.120,24	(254.031,97)
Purchase Hang Seng China Enterprises Index (HSCEI)	JP Morgan Chase Bank NA	176	HKD	29. Juli 21	11.978.709,34	(175.041,50)
Purchase Topix Index Future (TSE)	JP Morgan Chase Bank NA	119	JPY	9. Sep. 2021	20.832.235,64	(151.653,45)
Purchase DAX Index Future (EUX)	JP Morgan Chase Bank NA	31	EUR	17. Sep. 2021	14.271.357,78	(127.631,71)
Purchase CAC40 Index Future (FSE)s	JP Morgan Chase Bank NA	89	EUR	16. Juli 21	6.865.708,76	(126.049,40)
Purchase 10 Year Korean Treasury Bond future (KRX)	JP Morgan Chase Bank NA	377	KRW	17. Sep. 2021	42.110.524,58	(108.298,04)
Sale France Government Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(115)	EUR	8. Sep. 2021	16.740.051,74	(96.314,41)
Purchase Nikkei 225 Future	JP Morgan Chase Bank NA	53	JPY	9. Sep. 2021	6.861.969,05	(83.253,71)
Purchase MSCI Tawain Index Future	Merrill Lynch	283	USD	17. Sep. 2021	19.311.920,00	(76.635,00)
Purchase Russel 2000 Future	JP Morgan Chase Bank NA	150	USD	17. Sep. 2021	17.308.500,00	(69.230,00)
Purchase Nifty Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	399	USD	29. Juli 21	12.566.106,00	(55.436,22)
Purchase FTSE China A50 Index Future (SGX)	JP Morgan Chase Bank NA	454	USD	29. Juli 21	7.854.200,00	(41.544,26)
Purchase Mexican Bolsa Index Future	Credit Suisse Europe	100	MXN	17. Sep. 2021	2.544.599,42	(41.129,25)
Purchase Amsterdam Index Future (AEX)	JP Morgan Chase Bank NA	41	EUR	16. Juli 21	7.092.282,07	(36.500,59)
Purchase Stockholm 30 Index Future (OMX)	JP Morgan Chase Bank NA	235	SEK	16. Juli 21	6.226.639,58	(35.945,06)
Sale Sterling Overnight Index Average Future (SONIA)	JP Morgan Chase Bank NA	(150)	GBP	20. Dez. 2022	51.669.689,74	(26.102,24)
Purchase US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	101	USD	21. Sep. 2021	11.207.843,75	(16.281,31)
Purchase FTSE Bursa Malaysia index Future (KLCI)	JP Morgan Chase Bank NA	106	MYR	30. Juli 21	1.957.101,26	(14.121,41)
Purchase SET50 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	1.583	THB	29. Sep. 2021	9.359.629,12	(11.171,61)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	48	CAD	14. Mär. 2022	9.630.138,09	(10.646,02)
Sale Nikkei 225 Future	Credit Suisse Europe	(1)	JPY	9. Sep. 2021	259.302,62	(8.460,08)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(76)	GBP	15. Mär. 2023	13.057.501,48	(6.767,57)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(53)	GBP	20. Sep. 2023	9.095.364,27	(6.248,98)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(78)	GBP	21. Dez. 2022	13.408.527,97	(6.205,76)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(63)	GBP	21. Jun. 2023	10.817.454,14	(6.197,12)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(43)	GBP	20. Dez. 2023	7.375.173,89	(5.082,16)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	13	CAD	13. Jun. 2022	2.603.175,72	(4.758,45)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(59)	GBP	21. Sep. 2022	10.149.479,81	(4.062,27)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	58	USD	14. Mär. 2022	14.471.000,00	(4.012,50)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(48)	GBP	15. Jun. 2022	8.263.006,01	(2.523,79)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	6	CAD	19. Sep. 2022	1.199.103,61	(2.379,23)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	61	CAD	13. Dez. 2021	12.252.463,05	(1.986,05)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	5	USD	16. Sep. 2024	1.231.750,00	(1.787,50)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	6	USD	16. Dez. 2024	1.476.825,00	(1.725,00)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(36)	GBP	16. Mär. 2022	6.201.606,07	(1.694,05)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	11	EUR	16. Dez. 2024	3.265.464,59	(1.526,59)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 13 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	11	EUR	16. Sep. 2024	3.267.095,21	(1.467,30)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	7	USD	17. Mär. 2025	1.722.087,50	(1.262,50)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	10	AUD	9. Jun. 2022	7.503.616,44	(1.219,14)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	8	EUR	17. Jun. 2024	2.377.017,96	(1.096,77)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	9	EUR	17. Mär. 2025	2.670.543,03	(918,92)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	3	AUD	8. Sep. 2022	2.250.363,96	(830,87)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	14	AUD	10. Mär. 2022	10.507.134,53	(776,12)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	18. Dez. 2023	247.187,50	(512,50)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	4	EUR	18. März 2024	1.188.983,34	(489,10)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	17. Jun. 2024	246.612,50	(387,50)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	EUR	19. Dez. 2022	2.680.148,82	(385,35)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	EUR	19. Sep. 2022	3.574.421,19	(355,71)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	USD	19. Dez. 2022	3.233.100,00	(312,50)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	7	USD	16. Jun. 2025	1.721.037,50	(225,00)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	EUR	14. Mär. 2022	2.681.749,79	(207,50)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	EUR	13. Jun. 2022	2.383.421,82	(192,68)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(62)	GBP	15. Sep. 2021	10.696.067,84	(112,36)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	GBP	20. Mär. 24	171.437,97	(112,36)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	13. Mär. 2023	893.027,17	(103,75)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	23	CAD	13. Sep. 2021	4.622.335,06	(100,81)
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	AUD	8. Dez. 2022	2.999.376,85	(73,77)
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	AUD	9. Mär. 2023	2.998.490,69	(73,72)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	6	EUR	13. Sep. 2021	1.788.366,85	(59,29)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	GBP	15. Dez. 2021	517.396,26	(34,57)
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	CAD	18. Sep. 2023	198.548,41	(30,24)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	13. Mär. 2023	496.825,00	(25,00)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	1	EUR	13. Dez. 2021	298.046,32	(14,82)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	EUR	19. Jun. 2023	297.571,96	(14,82)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	13. Jun. 2022	249.325,00	(12,50)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	USD	19. Jun. 2023	992.200,00	0,00
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	18. März 2024	493.800,00	0,00
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(5.106.435,62)

Man AHL Alpha Core Alternative

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(2)	CAD	19. Jun. 2023	397.520,79	30,24
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(2)	CAD	13. Mär. 2023	398.126,46	50,41
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	15. Sep. 2025	245.737,50	112,50
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	2	USD	16. Jun. 2025	491.725,00	187,50
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	16. Mär. 2026	245.500,00	225,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	15. Dez. 2025	245.587,50	250,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	13	USD	13. Dez. 2021	3.243.337,50	300,00
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	10	USD	13. Sep. 2021	2.496.500,00	412,50
Sale Euro Stoxx 50 Volatility Index Future	Credit Suisse Europe	(18)	EUR	15. Sep. 2021	42.799,13	450,57
Purchase UK Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	82	GBP	28. Sep. 2021	15.476.278,43	988,76
Purchase Australian Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	22	AUD	15. Sep. 2021	2.331.948,70	2.543,96
Purchase 10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	Merrill Lynch	70	CAD	21. Sep. 2021	5.611.701,53	2.685,71
Purchase MSCI Singapore Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	77	SGD	29. Juli 21	2.036.129,30	4.782,58
Sale Euro Stoxx 50 Volatility Index Future	Credit Suisse Europe	(47)	EUR	18. Aug. 2021	106.179,56	6.663,63

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 13 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Purchase 10 Year Japanese Bond (TSE)	Credit Suisse Europe	4	JPY	13. Sep. 2021	5.466.798,42	7.560,08
Sale Euro Stoxx 50 Volatility Index Future	Credit Suisse Europe	(27)	EUR	21. Juli 21	57.474,64	9.058,75
Purchase Swiss Market Index Future (EUZ)	Credit Suisse Europe	60	CHF	17. Sep. 2021	7.740.574,46	19.630,66
Purchase Refinitiv Taiwan Banking Services Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	59	USD	29. Juli 21	3.599.590,00	39.712,00
Purchase S&P 200 Future	JP Morgan Chase Bank NA	107	AUD	16. Sep. 2021	14.505.638,51	46.899,99
Sale CBOE Volatility Index (VIX)	Credit Suisse Europe	(17)	USD	15. Sep. 2021	357.238,00	51.462,00
Purchase US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	30	USD	21. Sep. 2021	4.363.593,75	64.812,50
Purchase US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	19	USD	21. Sep. 2021	2.252.390,63	81.531,25
Purchase S&P 60 Future (TSX)	Merrill Lynch	45	CAD	16. Sep. 2021	8.741.258,18	85.268,20
Purchase KOSPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	76	KRW	9. Sep. 2021	7.404.110,44	86.924,36
Purchase E-mini S&P 500 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	44	USD	17. Sep. 2021	9.434.920,00	104.417,50
Sale CBOE Volatility Index (VIX)	Credit Suisse Europe	(66)	USD	18. Aug. 2021	1.303.414,20	108.095,80
Purchase MSCI Tawain Index Future	Credit Suisse Europe	35	TWD	21. Juli 21	4.449.909,77	111.606,76
Purchase Nasdaq 100 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	18	USD	17. Sep. 2021	5.237.640,00	204.136,00
Sale CBOE Volatility Index (VIX)	Credit Suisse Europe	(42)	USD	21. Juli 21	751.938,60	211.961,40
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						1.252.760,61

Man AHL Alpha Core Alternative

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Purchase Buoni Poliennali Del Tesoro Bond Future	Credit Suisse Europe	251	EUR	8. Sep. 2021	31.583.012,13	(185.888,14)
Sale U.S. Dollar Index Future	Merrill Lynch	(49)	USD	13. Sep. 2021	4.529.119,00	(124.235,01)
Purchase MSCI EAFE Future	Merrill Lynch	29	USD	17. Sep. 2021	3.340.945,00	(75.470,01)
Purchase FTSE 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	60	GBP	17. Sep. 2021	5.785.927,72	(74.982,70)
Purchase Hang Seng Index Future (HKG)	Credit Suisse Europe	23	HKD	29. Juli 21	4.239.654,54	(69.218,18)
Purchase FTSE MIB Future	Credit Suisse Europe	25	EUR	17. Sep. 2021	3.706.530,45	(68.503,82)
Purchase Euro Stoxx 50 Future (EUZ)	Credit Suisse Europe	85	EUR	17. Sep. 2021	4.088.004,83	(65.967,02)
Sale Bundesrepublik Deutschland Bond Future	Credit Suisse Europe	(24)	EUR	8. Sep. 2021	4.454.041,17	(65.877,49)
Purchase FTSE/JSE Top40 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	54	ZAR	16. Sep. 2021	2.264.412,10	(57.349,90)
Purchase Hang Seng China Enterprises Index (HSCEI)	Credit Suisse Europe	42	HKD	29. Juli 21	2.858.555,64	(42.651,27)
Purchase Topix Index Future (TSE)	Credit Suisse Europe	28	JPY	9. Sep. 2021	4.901.702,50	(36.664,60)
Purchase DAX Index Future (EUZ)	Credit Suisse Europe	8	EUR	17. Sep. 2021	3.682.931,04	(35.437,61)
Purchase CAC40 Index Future (FSE)S	Credit Suisse Europe	24	EUR	16. Juli 21	1.851.427,08	(34.425,61)
Purchase 10 Year Korean Treasury Bond future (KRX)	JP Morgan Chase Bank NA	89	KRW	17. Sep. 2021	9.941.211,37	(25.822,46)
Sale France Government Bond Future	Credit Suisse Europe	(28)	EUR	8. Sep. 2021	4.075.838,68	(23.939,28)
Purchase MSCI Tawain Index Future	Merrill Lynch	66	USD	17. Sep. 2021	4.503.840,00	(18.325,00)
Purchase Nikkei 225 Future	JP Morgan Chase Bank NA	13	JPY	9. Sep. 2021	1.683.124,48	(18.046,35)
Purchase Russel 2000 Future	JP Morgan Chase Bank NA	36	USD	17. Sep. 2021	4.154.040,00	(15.435,00)
Purchase Nifty Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	95	USD	29. Juli 21	2.991.930,00	(12.813,91)
Purchase Stockholm 30 Index Future (OMX)	Credit Suisse Europe	67	SEK	16. Juli 21	1.775.254,69	(11.816,07)
Purchase FTSE China A50 Index Future (SGX)	JP Morgan Chase Bank NA	106	USD	29. Juli 21	1.833.800,00	(10.352,16)
Purchase Mexican Bolsa Index Future	Credit Suisse Europe	24	MXN	17. Sep. 2021	610.703,86	(9.598,24)
Purchase Amsterdam Index Future (AEX)	Credit Suisse Europe	11	EUR	16. Juli 21	1.902.807,38	(9.241,35)
Sale Sterling Overnight Index Average Future (SONIA)	JP Morgan Chase Bank NA	(32)	GBP	20. Dez. 2022	11.022.867,14	(5.635,32)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 13 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Purchase US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	23	USD	21. Sep. 2021	2.552.281,25	(4.093,73)
Purchase FTSE Bursa Malaysia index Future (KLCI)	JP Morgan Chase Bank NA	26	MYR	30. Juli 21	480.043,70	(3.486,69)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	10	CAD	14. Mär. 2022	2.006.278,77	(2.137,27)
Purchase SET50 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	354	THB	29. Sep. 2021	2.093.056,67	(1.992,50)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(17)	GBP	15. Mär. 2023	2.920.756,91	(1.452,05)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	GBP	20. Sep. 2023	2.059.327,76	(1.365,61)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(17)	GBP	21. Dez. 2022	2.922.371,48	(1.331,04)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(14)	GBP	21. Jun. 2023	2.403.878,70	(1.313,76)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	GBP	20. Dez. 2023	1.543.641,05	(1.123,61)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	3	CAD	13. Jun. 2022	600.732,86	(1.119,04)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	GBP	21. Sep. 2022	2.236.326,06	(924,81)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	12	USD	14. Mär. 2022	2.994.000,00	(862,50)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(10)	GBP	15. Jun. 2022	1.721.459,58	(544,52)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	13	CAD	13. Dez. 2021	2.611.180,65	(473,83)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	1	CAD	19. Sep. 2022	199.850,60	(403,26)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	GBP	16. Mär. 2022	1.378.134,68	(380,30)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	16. Sep. 2024	246.350,00	(350,00)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	2	EUR	16. Dez. 2024	593.720,84	(326,07)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	17. Mär. 2025	246.012,50	(287,50)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	2	EUR	17. Mär. 2025	593.454,01	(281,60)
Purchase 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	1	USD	16. Dez. 2024	246.137,50	(262,50)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	2	EUR	16. Sep. 2024	594.017,31	(251,96)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	1	EUR	18. März 2024	297.245,84	(177,86)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	2	EUR	17. Jun. 2024	594.254,49	(163,03)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	5	AUD	9. Dez. 2021	3.753.010,62	(92,40)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	19. Dez. 2022	595.588,63	(88,93)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	USD	19. Dez. 2022	746.100,00	(75,00)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	19. Sep. 2022	893.605,30	(74,11)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	2	AUD	9. Jun. 2022	1.500.723,29	(73,87)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	14. Mär. 2022	595.944,40	(59,29)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	13. Jun. 2022	595.855,46	(59,29)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	3	AUD	9. Sep. 2021	2.252.028,44	(55,46)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	3	AUD	10. Mär. 2022	2.251.528,83	(55,45)
Purchase 90 days Australian Bank bill future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	1	AUD	8. Sep. 2022	750.121,32	(36,91)
Purchase Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	5	CAD	13. Sep. 2021	1.004.855,45	(30,24)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	GBP	15. Sep. 2021	2.242.723,90	(25,93)
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	8. Dez. 2022	749.844,21	(18,45)
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	9. Mär. 2023	749.622,67	(18,43)
Sale 90 Day Sterling Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	GBP	15. Dez. 2021	172.465,42	(17,29)
Purchase 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	1	EUR	13. Sep. 2021	298.061,14	(14,82)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	EUR	13. Mär. 2023	297.675,72	(14,82)
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	8. Jun. 2023	749.401,26	(0,02)
Sale 90 Day Eurodollar Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	19. Jun. 2023	248.050,00	0,00
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(1.123.612,25)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 14 – Ausstehende Swap-Kontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Gegenpartei	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Gewinn (in EUR)
TRIS	6. Okt. 23	Electricite de France SA cvt 0.00% 14/Sep/2024	Credit Suisse	EUR	369.000,00	15.867,00
TRIS	2. Mai 22	Fresenius SE & Co. 0.00% 31/Jan/2024 Citigroup Global Markets Funding	Credit Suisse	EUR	3.800.000,00	38.646,00
TRIS	2. Mai 22	Luxembourg SCA cvt 0.50% 4/Aug/2023	Credit Suisse	EUR	3.300.000,00	178.200,00
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten						232.713,00

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Gegenpartei	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
TRIS	2. Mai 22	BASF SE cvt 0.925% 9/Mar/2023	Credit Suisse	USD	6.000.000,00	(51.505,19)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten						(51.505,19)

Erläuterung 15 – Ausstehende Optionskontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeits-termin	Marktwert (in EUR)	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
Call on Seino Holdings Conv 0% 31/Mar/2026 Strike Price JPY 55	Nomura	JPY	20.000.000	31. Mär. 2026	5.015,99	(5.780,33)
Marktwert und nicht realisierter Verlust aus Optionskontrakten					5.015,99	(5.780,33)

Erläuterung 16 – Gezahlte Dividende

Anteilsklasse	Stich-tag	Datum des Dividenden- abschlags	Zahlungsdatum	Gezahlter Betrag (in EUR)	Betrag je Anteil	Währung
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	6. Mai 21	7. Mai 21	11. Mai 21	27.371,28	0,3998	EUR
				27.371,28		

Erläuterung 17 – Kreditaufnahmen

Am 28. September 2012 wurde unter anderem zwischen dem Fonds, der für und im Auftrag des Teilfonds Man Multi-Strategy Alternative handelt, als Kreditnehmer und Credit Suisse AG, Niederlassung London, als Kreditgeber eine Kreditrahmenvereinbarung geschlossen, die zuletzt am 20. Dezember 2017 geändert wurde. Zum 30. Juni 2021 verfügte der Teilfonds über Kreditlinien in Höhe von 3.500.000 USD, die er jedoch nicht in Anspruch genommen hatte.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Erläuterung 18 – Angaben zu Barsicherheiten

Die nachfolgende Tabelle enthält die Barsicherheitssalden der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2021. Diese Sicherheiten beziehen sich auf Terminkontrakte, Futures und Swaps.

Portfolios	Art der Sicherheit	Gegenpartei	Währung	Barsicherheiten	
				Gezahlt	Erhalten
Man Convertibles Europe	Barmittel	Citigroup	EUR	130.000,00	-
Man Convertibles Global	Barmittel	Nomura	EUR	81.545,99	-
Man Convertibles Global	Barmittel	Citigroup	EUR	3.120.203,20	-
Man Convertibles Global	Barmittel	Credit Suisse	EUR	4.005.465,31	-
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Deutsche Bank	USD	4,94	5,30
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Credit Suisse	USD	1.088.484,00	0,34
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Merrill Lynch	USD	3.055.956,95	-
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Royal Bank of Scotland	USD	15.695.972,83	-
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	HSBC	USD	17.958.926,03	-
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	JP Morgan	USD	43.159.057,21	-
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Citigroup	USD	45.614.241,82	-
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Deutsche Bank	USD	4,82	4,97
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Merrill Lynch	USD	1.410.617,03	-
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Royal Bank of Scotland	USD	3.401.233,54	0,01
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	HSBC	USD	3.810.904,55	-
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	JP Morgan	USD	4.526.706,57	70.255,06
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Credit Suisse	USD	5.318.369,03	64,24
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Citigroup	USD	10.981.893,11	-
Man Multi-Strategy Alternative	Barmittel	Credit Suisse	USD	-	7,68

Erläuterung 19 – Wesentliche Ereignisse im Verlauf des Berichtszeitraums

Im März 2021 wurde ein überarbeiteter Prospekt für den Fonds herausgegeben.

Der Verwaltungsrat und die Anlageverwalter nehmen den laufenden Ausbruch von COVID-19 zur Kenntnis, der die Wirtschaftstätigkeit in den meisten Ländern seit dem ersten Quartal 2020 stört, sowie seine möglichen negativen wirtschaftlichen Auswirkungen auf die Emittenten der Instrumente, in die der Fonds investiert. Dies ist ein zusätzlicher Risikofaktor der sich auf den Betrieb und die Bewertung der Vermögenswerte des Fonds nach dem Berichtszeitraum auswirken könnte.

Die Anlageverwalter verfolgen die Entwicklungen. Angesichts der Wesensart des Ausbruchs und der laufenden Entwicklungen besteht ein hohes Maß an Ungewissheit, und das Ausmaß und die Art der allgemeinen zukünftigen Auswirkungen auf den Fonds lassen sich derzeit noch nicht vorhersagen.

Erläuterung 20 -- 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.

Erläuterung 21 – Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, den Teilfonds Multi-Strategy Alternative aufzulösen. Das Datum des Inkrafttretens der Auflösung ist voraussichtlich der 15. September 2021.

Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)
Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Vertreter

Der Vertreter in der Schweiz ist Man Investments (CH) AG, Huobstrasse 3, 8808 Pfäffikon SZ.

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.

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

	Man Convertibles Europe	Man Convertibles Global
Man Convertibles Europe D EUR Acc	2,30%	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	1,51%	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	2,31%	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	1,83%
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	1,06%
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	1,06%
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	1,05%
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	1,84%
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	1,84%
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	1,05%
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	1,09%
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	1,09%
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	1,10%

Anteilsklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird

Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,12%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77%
Erfolgsgebühr:	1,35%
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,92%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,74%
Erfolgsgebühr:	2,18%
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	5,09%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77%
Erfolgsgebühr:	2,32%
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,48%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,74%
Erfolgsgebühr:	2,74%

Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)
(Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Total Expense Ratio (TER) (Fortsetzung)

Anteilklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird (Fortsetzung)

	Man Convertibles Europe
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,80%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77%
Erfolgsgebühr:	0,03%
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,66%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77%
Erfolgsgebühr:	0,89%
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,56%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77%
Erfolgsgebühr:	0,79%
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,88%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,30%
Erfolgsgebühr:	0,58%
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,92%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,73%
Erfolgsgebühr:	1,19%
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,58%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,50%
Erfolgsgebühr:	1,08%
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,90%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77%
Erfolgsgebühr:	0,13%
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,78%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,28%
Erfolgsgebühr:	1,50%
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,59%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,77%
Erfolgsgebühr:	0,82%
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,87%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,78%
Erfolgsgebühr:	2,09%
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,70%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,75%
Erfolgsgebühr:	1,95%
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,06%
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,06%
Erfolgsgebühr:	0,00%

Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)
(Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Total Expense Ratio (TER) (Fortsetzung)

Anteilklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird (Fortsetzung)

	Man Convertibles Europe
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,41%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,31%
Erfolgsgebühr:	1,10%
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,71%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,27%
Erfolgsgebühr:	0,44%
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,43%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,27%
Erfolgsgebühr:	1,16%
Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,35%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,35%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,35%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,35%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,35%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,35%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,38%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,38%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,35%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,35%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,35%
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,35%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	0,41%
TER ohne Erfolgsgebühr:	0,41%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	0,60%
TER ohne Erfolgsgebühr:	0,60%
Erfolgsgebühr:	0,00%
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	0,62%
TER ohne Erfolgsgebühr:	0,62%
Erfolgsgebühr:	0,00%

Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)
(Fortsetzung)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

Performance

	2021	2020	2019
Man Convertibles Europe			
Man Convertibles Europe D EUR Acc	2,30%	5,91%	3,92%
Man Convertibles Europe I EUR Acc	2,70%	6,74%	4,75%
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	2,15%	5,50%	3,43%
Refinitiv Convertible Europe (BM MCE) (abgesichert gegen EUR)	1,13%	6,18%	7,84%
Refinitiv Convertible Europe (BM MCE CHF) (abgesichert gegen CHF)	1,04%	6,11%	7,49%
Man Convertibles Global			
Man Convertibles Global D EUR Acc	2,44%	16,37%	8,61%
Man Convertibles Global I EUR Acc	2,85%	17,29%	9,47%
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	2,85%	17,28%	9,47%
Man Convertibles Global I H CHF Acc	2,66%	16,84%	8,95%
Man Convertibles Global D H CHF Acc	2,25%	15,99%	8,22%
Man Convertibles Global D H USD Acc	2,91%	18,13%	11,97%
Man Convertibles Global I H USD Acc	3,32%	19,24%	12,73%
Man Convertibles Global DR EUR Acc	2,82%	17,25%	9,43%
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	2,63%	16,75%	8,92%
Man Convertibles Global DR H USD Acc	3,28%	19,23%	12,67%
Refinitiv Convertible Global Focus (BM MCG) (abgesichert gegen EUR)	2,61%	21,49%	10,11%
Refinitiv Convertible Global Focus (BM MCG CHF-D) (abgesichert gegen CHF)	2,52%	21,41%	9,77%
Refinitiv Global Focus Hedged Convertible Bond Index (USD)	2,99%	22,84%	13,10%
Man AHL Trend Alternative			
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	4,57%	0,20%	16,84%
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	4,72%	1,23%	17,12%
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	4,81%	0,87%	19,40%
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	5,20%	2,15%	19,86%
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	5,14%	-0,17%	16,76%
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	5,10%	1,25%	18,07%
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	5,41%	1,33%	19,03%
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	5,06%	0,30%	16,49%
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	5,09%	0,86%	17,47%
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	5,49%	2,26%	19,03%
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	5,24%	1,05%	15,17%
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	4,84%	0,76%	17,71%
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	5,38%	1,21%	18,09%
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	4,68%	-0,03%	15,79%
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	4,84%	1,43%	16,91%
HFRX Investable Global Hedge Fund Index	3,73%	6,81%	8,62%
Man AHL Alpha Core Alternative			
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	3,36%	0,44%	14,51%
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	3,20%	1,02%	14,82%
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	3,08%	0,18%	13,48%
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	3,26%	0,18%	13,89%
HFRX Investable Global Hedge Fund Index	3,73%	6,81%	8,62%
Man Multi-Strategy Alternative			
Man Multi-Strategy Alternative DN H EUR Acc	1,26%	0,79%	2,49%
Man Multi-Strategy Alternative DN USD Acc	1,69%	2,23%	5,60%
Man Multi-Strategy Alternative DN H CHF Acc	1,15%	0,41%	2,09%
Man Multi-Strategy Alternative DN H GBP Acc	1,57%	1,24%	3,81%
Man Multi-Strategy Alternative DN H NOK Acc	1,61%	1,36%	3,73%
Man Multi-Strategy Alternative DN H SEK Acc	1,46%	1,11%	2,79%
Man Multi-Strategy Alternative INW H AUD Acc	2,00%	2,56%	5,38%
Man Multi-Strategy Alternative I H EUR Acc	1,67%	1,53%	3,07%
Man Multi-Strategy Alternative I H SEK Acc	1,83%	1,77%	3,22%

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik gemäß den geltenden Gesetzen und Verordnungen mit dem Ziel verabschiedet, sicherzustellen, dass die Vergütungsstruktur mit ihren Interessen und denen der von ihr verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen in Einklang steht und das Eingehen von Risiken vermieden wird, die mit den Risikoprofilen, den Vorschriften, der Satzung oder den Verwaltungsrichtlinien der von ihr verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen unvereinbar sind.

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 2020 (die Verwaltungsgesellschaft beschäftigte zu diesem Zeitpunkt 73 Mitarbeiter) belief sich die gesamte von der Verwaltungsgesellschaft an ihre Mitarbeiter gezahlte feste bzw. variable Vergütung auf 5.236.688 EUR bzw. 1.448.313 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 3.569.815 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 2019 aktualisiert und vom Verwaltungsrat genehmigt, wobei die aktuelle Fassung aus dem Juli 2019 stammt.

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-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 30. Juni 2021 hielt der Teilfonds Man Convertibles Global 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 30. Juni 2021:

Man Convertibles Global:

Art des Vermögenswerts/der Verbindlichkeit	Betrag (in EUR)	% des NIW
Total Return Swaps	181.207,81	0,06%

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet

Im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 wurden keine Barsicherheiten reinvestiert

Konzentrationsdaten

Zum 30. Juni 2021 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total Return Swaps erhalten

Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Zum 30. Juni 2021 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total Return Swaps erhalten

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

Verwahrung gestellter Sicherheiten

Zum 30. Juni 2021 wurden Sicherheiten für Total Return Swaps in folgender Höhe gestellt:

Man Convertibles Global:

Vermögenswert	Marktwert (in EUR)	% des NIW
Barmittel	4.005.465,31	1,37%

Rendite/Kosten

Für Berichtszeitraums zum 30. Juni 2021 gestalten sich die Daten zu den Renditen und Kosten in Bezug auf Total Return Swaps wie folgt:

Man Convertibles Global:

Renditen	Betrag (in EUR)	% der Gesamtrenditen*
An den Fonds	5.842.067,37	100%

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebenen Renditen aus Total Return Swaps sind in der Veränderung des Nettovermögens in „Zinsen auf Swap-Kontrakte“, „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps“ und „Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus Swaps“ enthalten.

Man Convertibles Global:

Kosten	Betrag (in EUR)	% der Gesamtrenditen*
An den Fonds	135.360,36	100%

* Absolut ausgedrückt.

Aggregierte Transaktionsdaten

Das Laufzeitprofil der Total Return Swaps sieht zum 30. Juni 2021 wie folgt aus:

Man Convertibles Global:

Total Return Swaps

Fälligkeit	Betrag (in EUR)
Weniger als ein Tag	0,00
Ein Tag bis eine Woche	0,00
Eine Woche bis ein Monat	0,00
Ein bis drei Monate	0,00
Drei Monate bis ein Jahr	165.340,81
Mehr als ein Jahr	15.867,00
Offene Laufzeit	0,00

Die Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Total Return Swaps sind zum 30. Juni 2021 wie folgt:

Man Convertibles Global:

Total Return Swaps

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag (in EUR)
Bilateral	181.207,81

Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen von Total Return Swaps gestellte Sicherheitspositionen (einschließlich von Barmitteln) sehen zum 30. Juni 2021 wie folgt aus:

Man Convertibles Global:

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Nennwert	Währung der Sicherheiten	Land
CREDIT SUISSE AG	Barmittel	4.005.465,31	EUR	Irland

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Gesamtrisiko

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

Man Convertibles Europe

Man Convertibles Global

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

Man AHL Trend Alternative

Man AHL Diversity Alternative

Man Multi-Strategy Alternative

Man GLG Flexible Bond