

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

## HMT Euro Aktien Protect 90

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. APRIL 2023

---

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



# Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

## Vermögensübersicht zum 30.04.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>57.287.918,02</b>	<b>100,18</b>
1. Aktien	55.677.950,01	97,37
Belgien	941.758,50	1,65
Bundesrep. Deutschland	14.766.272,86	25,82
Finnland	1.009.705,21	1,77
Frankreich	22.089.831,76	38,63
Irland	1.124.225,10	1,97
Italien	2.849.622,55	4,98
Niederlande	9.339.032,60	16,33
Spanien	3.557.501,43	6,22
2. Derivate	-2.053.020,98	-3,59
3. Bankguthaben	3.449.850,08	6,03
4. Sonstige Vermögensgegenstände	213.138,91	0,37
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-103.863,71</b>	<b>-0,18</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>57.184.054,31</b>	<b>100,00</b>

# Halbjahresbericht

## HMT Euro Aktien Protect 90

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>55.677.950,01</b>	<b>97,37</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>55.677.950,01</b>	<b>97,37</b>
<b>Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>55.677.950,01</b>	<b>97,37</b>
adidas AG Namens-Aktien o.N.	DE000A1EWWW0	STK	2.580	0	1.148	EUR	159,440	411.355,20	0,72
Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	NL0012969182	STK	488	6	33	EUR	1.452,000	708.576,00	1,24
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	17.825	5.798	0	EUR	31,220	556.496,50	0,97
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073	STK	8.992	56	1.091	EUR	163,180	1.467.314,56	2,57
Airbus SE Aandelen op naam EO 1	NL0000235190	STK	10.505	531	1.408	EUR	127,140	1.335.605,70	2,34
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	7.430	433	642	EUR	227,450	1.689.953,50	2,96
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251	STK	15.935	617	1.492	EUR	59,100	941.758,50	1,65
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	7.404	916	0	EUR	573,500	4.246.194,00	7,43
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	37.046	2.804	0	EUR	29,570	1.095.450,22	1,92
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835	STK	117.246	57.246	0	EUR	6,650	779.685,90	1,36
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK	305.447	99.073	0	EUR	3,187	973.306,87	1,70
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111	STK	16.458	551	2.037	EUR	46,850	771.057,30	1,35
Bayer AG Namens-Aktien o.N.	DE000BAY0017	STK	17.569	927	2.199	EUR	59,760	1.049.923,44	1,84
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003	STK	5.638	56	503	EUR	101,440	571.918,72	1,00
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104	STK	23.031	8.292	0	EUR	58,590	1.349.386,29	2,36
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK	13.960	648	2.096	EUR	43,780	611.168,80	1,07
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644	STK	10.901	0	1.477	EUR	59,990	653.950,99	1,14
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	3.288	1.447	0	EUR	172,900	568.495,20	0,99
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	17.133	509	145	EUR	43,520	745.628,16	1,30
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508	STK	60.529	24.902	0	EUR	21,880	1.324.374,52	2,32
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	134.050	0	18.479	EUR	6,199	830.975,95	1,45
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	44.616	15.344	0	EUR	13,746	613.291,54	1,07
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667	STK	5.424	249	715	EUR	179,400	973.065,60	1,70
Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -,09	IE00BWT6H894	STK	2.833	821	148	EUR	181,100	513.056,30	0,90
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292	STK	575	59	30	EUR	1.966,800	1.130.910,00	1,98
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	103.299	3.403	13.091	EUR	11,780	1.216.862,22	2,13
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	ES0148396007	STK	18.859	10.518	182	EUR	31,160	587.646,44	1,03
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004	STK	22.444	2.244	0	EUR	32,905	738.519,82	1,29
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	75.304	29.754	0	EUR	11,200	843.404,80	1,47
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618	STK	320.681	139.714	0	EUR	2,385	764.663,84	1,34

# Halbjahresbericht

## HMT Euro Aktien Protect 90

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485		STK	1.325	70	234 EUR	579,700	768.102,50	1,34
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	4.282	1.560	1.289 EUR	871,000	3.729.622,00	6,52
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000		STK	15.133	1.358	1.876 EUR	70,580	1.068.087,14	1,87
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	2.563	148	347 EUR	340,500	872.701,50	1,53
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681		STK	99.993	49.993	0 EUR	3,842	384.173,11	0,67
Nordea Bank Abp Registered Shares o.N.	FI4000297767		STK	62.242	37.242	0 EUR	10,050	625.532,10	1,09
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	FR0000120321		STK	4.020	0	693 EUR	432,750	1.739.655,00	3,04
Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693		STK	3.526	1.446	0 EUR	209,400	738.344,40	1,29
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783		STK	14.880	2.869	0 EUR	67,870	1.009.905,60	1,77
SAFRAN Actions Port. EO -,20	FR0000073272		STK	6.687	161	428 EUR	140,940	942.465,78	1,65
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	18.804	3.039	6.241 EUR	100,000	1.880.400,00	3,29
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	17.604	1.503	5.130 EUR	122,860	2.162.827,44	3,78
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	10.542	792	959 EUR	157,820	1.663.738,44	2,91
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	13.318	414	518 EUR	148,900	1.983.050,20	3,47
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL00150001Q9		STK	42.590	22.590	0 EUR	15,000	638.850,00	1,12
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271		STK	48.397	14.730	14.140 EUR	57,940	2.804.122,18	4,90
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360		STK	35.713	35.713	0 EUR	17,940	640.691,22	1,12
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486		STK	10.279	5.427	0 EUR	112,200	1.153.303,80	2,02
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	DE0007664039		STK	3.913	1.136	0 EUR	123,680	483.959,84	0,85
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1ML7J1		STK	16.531	11.936	0 EUR	19,625	324.420,88	0,57
<b>Summe Wertpapiervermögen 2)</b>						<b>EUR</b>		<b>55.677.950,01</b>	<b>97,37</b>

# Halbjahresbericht

## HMT Euro Aktien Protect 90

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-2.053.020,98</b>	<b>-3,59</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>-2.647.620,98</b>	<b>-4,63</b>
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b> Forderungen/Verbindlichkeiten							<b>EUR</b>	<b>-2.647.620,98</b>	<b>-4,63</b>
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>-2.647.620,98</b>	<b>-4,63</b>
ADIDAS AG CALL 15.12.23 BP 130,00 EUREX			185	STK	-1.100		EUR 37,530	-41.283,00	-0,07
ADYEN N.V. CALL 15.12.23 BP 1'280,00 EUREX			185	STK	-180		EUR 306,960	-55.252,80	-0,10
AIR LIQUIDE CALL 15.12.23 BP 130,00 EUREX			185	STK	-3.000		EUR 35,350	-106.050,00	-0,19
AIRBUS SE CALL 15.12.23 BP 110,00 EUREX			185	STK	-3.500		EUR 24,690	-86.415,00	-0,15
ALLIANZ SE CALL 15.12.23 BP 200,00 EUREX			185	STK	-2.200		EUR 29,220	-64.284,00	-0,11
ANHEUSER-BUSCH INBEV CALL 15.12.23 BP 56,00 EUREX			185	STK	-5.000		EUR 6,880	-34.400,00	-0,06
ASML HOLDING CALL 15.12.23 BP 520,00 EUREX			185	STK	-3.000		EUR 96,240	-288.720,00	-0,50
AXA S.A. CALL 15.12.23 BP 26,00 EUREX			185	STK	-10.200		EUR 3,870	-39.474,00	-0,07
BASF SE CALL 15.12.23 BP 48,00 EUREX			185	STK	-5.500		EUR 3,770	-20.735,00	-0,04
BAY.MOTOREN WERKE AG CALL 15.12.23 BP 84,00 EUREX			185	STK	-1.800		EUR 17,620	-31.716,00	-0,06
BAYER AG CALL 15.12.23 BP 48,00 EUREX			185	STK	-5.600		EUR 12,250	-68.600,00	-0,12
BCO BIL.VIZ. CALL 15.12.23 BP 5,75 EUREX			185	STK	-30.000		EUR 1,270	-38.100,00	-0,07
BCO SANTANDER CALL 15.12.23 BP 2,80 EUREX			185	STK	-62.000		EUR 0,600	-37.200,00	-0,07
BNP PARIBAS INH. CALL 15.12.23 BP 56,00 EUREX			185	STK	-4.400		EUR 5,280	-23.232,00	-0,04
DEUTSCHE BOERSE NA CALL 15.12.23 BP 160,00 EUREX			185	STK	-500		EUR 20,250	-10.125,00	-0,02
DEUTSCHE POST AG CALL 15.12.23 BP 36,00 EUREX			185	STK	-5.000		EUR 8,030	-40.150,00	-0,07
DT.TELEKOM AG CALL 15.12.23 BP 19,00 EUREX			185	STK	-16.500		EUR 3,650	-60.225,00	-0,11
ENEL S.P.A. CALL 14.12.23 BP 5,20 EUREX			185	STK	-45.000		EUR 1,128	-50.760,00	-0,09
ENI S.P.A. CALL 14.12.23 BP 14,00 EUREX			185	STK	-9.000		EUR 0,818	-7.357,50	-0,01
ESSILORLUXO. CALL 15.12.23 BP 170,00 EUREX			185	STK	-1.700		EUR 19,460	-33.082,00	-0,06
GRUPE DANONE CALL 15.12.23 BP 50,00 EUREX			185	STK	-3.800		EUR 10,280	-39.064,00	-0,07
HERMES INTL SA CALL 15.12.23 BP 1'440,00 EUREX			185	STK	-200		EUR 589,250	-117.850,00	-0,21
IBERDROLA INH. CALL 15.12.23 BP 11,00 EUREX			185	STK	-34.000		EUR 1,090	-37.060,00	-0,06
INDITEX INH. CALL 15.12.23 BP 25,00 EUREX			185	STK	-2.500		EUR 7,190	-17.975,00	-0,03

## Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
INFINEON TECH.AG CALL 15.12.23 BP 28,50 EUREX			185	STK	-6.000	EUR	6,850	-41.100,00	-0,07
ING GROEP CALL 15.12.23 BP 11,92 EUREX			185	STK	-13.087	EUR	0,800	-10.469,68	-0,02
INTESA SANPAOLO CALL 14.12.23 BP 2,20 EUREX			185	STK	-50.000	EUR	0,288	-14.375,00	-0,03
KERING S.A. INH. CALL 15.12.23 BP 480,00 EUREX			185	STK	-400	EUR	119,860	-47.944,00	-0,08
KON. AHOLD DELHAIZE CALL 15.12.23 BP 28,00 EUREX			185	STK	-3.600	EUR	4,280	-15.408,00	-0,03
LVMH SE CALL 15.12.23 BP 680,00 EUREX			185	STK	-1.200	EUR	222,160	-266.592,00	-0,47
MUENCH.RUECKVERS. CALL 15.12.23 BP 300,00 EUREX			185	STK	-800	EUR	48,750	-39.000,00	-0,07
NOKIA CORP. CALL 15.12.23 BP 4,40 EUREX			185	STK	-15.000	EUR	0,160	-2.400,00	0,00
OREAL (L') INH. CALL 15.12.23 BP 340,00 EUREX			185	STK	-1.400	EUR	107,420	-150.388,00	-0,26
PERNOD-RICARD CALL 15.12.23 BP 180,00 EUREX			185	STK	-600	EUR	35,700	-21.420,00	-0,04
PROSUS CALL 15.12.23 BP 64,00 EUREX			185	STK	-3.600	EUR	11,490	-41.364,00	-0,07
SAFRAN INH. CALL 15.12.23 BP 120,00 EUREX			185	STK	-2.000	EUR	27,280	-54.560,00	-0,10
SAP AG CALL 15.12.23 BP 96,00 EUREX			185	STK	-7.000	EUR	29,080	-203.560,00	-0,36
SCHNEIDER ELEC. CALL 15.12.23 BP 130,00 EUREX			185	STK	-3.200	EUR	32,630	-104.416,00	-0,18
SIEMENS AG CALL 15.12.23 BP 130,00 EUREX			185	STK	-5.000	EUR	27,240	-136.200,00	-0,24
TOTALENERGIES SE CALL 15.12.23 BP 56,00 EUREX			185	STK	-15.000	EUR	5,720	-85.800,00	-0,15
VINCI S.A. CALL 15.12.23 BP 96,00 EUREX			185	STK	-2.600	EUR	20,360	-52.936,00	-0,09
VOLKSWAGEN AG VZO. CALL 15.12.23 BP 120,00 EUREX			185	STK	-800	EUR	10,850	-8.680,00	-0,02
VONOVIA SE CALL 15.12.23 BP 22,00 EUREX			185	STK	-1.300	EUR	1,460	-1.898,00	0,00
<b>Aktienindex-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>594.600,00</b>	<b>1,04</b>	
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>						<b>EUR</b>	<b>-252.400,00</b>	<b>-0,44</b>	
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 06.23 EUREX			185	EUR	Anzahl -180		-252.400,00	-0,44	
<b>Optionsrechte</b>						<b>EUR</b>	<b>847.000,00</b>	<b>1,48</b>	
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>						<b>EUR</b>	<b>847.000,00</b>	<b>1,48</b>	
ESTX 50 PR.EUR PUT 15.12.23 BP 3450,00 EUREX			185		Anzahl 2000	EUR	55,700	111.400,00	0,19
ESTX 50 PR.EUR PUT 15.12.23 BP 3500,00 EUREX			185		Anzahl 9000	EUR	60,100	540.900,00	0,95
ESTX 50 PR.EUR PUT 15.12.23 BP 3550,00 EUREX			185		Anzahl 3000	EUR	64,900	194.700,00	0,34

## Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>3.449.850,08</b>	<b>6,03</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>3.449.850,08</b>	<b>6,03</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	3.449.850,08			% 100,000	3.449.850,08	6,03
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>213.138,91</b>	<b>0,37</b>
Zinsansprüche			EUR	8.405,52				8.405,52	0,01
Dividendenansprüche			EUR	192.154,83				192.154,83	0,34
Quellensteueransprüche			EUR	12.578,56				12.578,56	0,02
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-103.863,71</b>	<b>-0,18</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-89.504,98				-89.504,98	-0,16
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.056,68				-1.056,68	0,00
Lagerstellenkosten			EUR	-4.212,60				-4.212,60	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-8.630,56				-8.630,56	-0,02
Veröffentlichungskosten			EUR	-458,89				-458,89	0,00
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>57.184.054,31</b>	<b>100,00 1)</b>

## Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

### Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Anteilwert</b>							EUR	<b>93,07</b>	
<b>Ausgabepreis</b>							EUR	<b>93,07</b>	
<b>Anteile im Umlauf</b>							STK	<b>614.411</b>	
Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind:				EUR	14.926.776,02				

#### Fußnoten:

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

## **Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90**

### **Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

### **Marktschlüssel**

#### **Terminbörsen**

185

Eurex Deutschland

**Halbjahresbericht  
HMT Euro Aktien Protect 90**

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
EuroAPI SAS Actions Nom. EO 1	FR0014008VX5	STK	0	956	
<b>Andere Wertpapiere</b>					
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809P3	STK	112.987	112.987	
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Linde PLC Registered Shares EO 0,001	IE00BZ12WP82	STK	2.490	10.919	

## Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

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

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

#### Derivate

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

#### Terminkontrakte

##### Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)

EUR

33.839,21

#### Optionsrechte

##### Wertpapier-Optionsrechte

##### Optionsrechte auf Aktien

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): ING GROEP NV EO -,01, LINDE PLC

EO 0,001, LVMH

EO

EUR

44,63

0,3, MERCEDES-BENZ GRP NA O.N.)

##### Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

##### Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)

EUR

2.826,82

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

# Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,37
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-3,59

## Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	93,07
Ausgabepreis	EUR	93,07
Anteile im Umlauf	STK	614.411

## Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

### Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

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

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

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

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

Frankfurt am Main, den 2. Mai 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Die Geschäftsführung

# Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 90

## Kurzübersicht über die Partner

### 1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

#### Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70  
60486 Frankfurt am Main

#### Postanschrift:

Postfach 17 05 48  
60079 Frankfurt am Main

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

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,-  
Eigenmittel: EUR 70.241.950,24 (Stand: September 2021)

#### Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München  
Mathias Heiß, Langen  
Katja Müller, Bad Homburg  
Markus Neubauer, Frankfurt am Main  
Michael Reinhard, Bad Vilbel  
Axel Vespermann, Dreieich

#### Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin  
Dr. Axel Eckhardt, Frankfurt am Main  
Ellen Engelhardt  
Daniel Fischer, Frankfurt am Main  
Daniel F. Just, München  
Janet Zirlewagen

### 2. Verwahrstelle

BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland

#### Hausanschrift:

Senckenberganlage 19  
60325 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 15205-0  
Telefax: 069 / 15205-550  
www.bnpparibas.de

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach französischem Recht  
Haftendes Eigenkapital: Mio. € 122.507 (Stand: 31.12.2021)

### 3. Asset Management-Gesellschaft und Vertrieb

HanseMercur Trust AG

#### Postanschrift:

Neue Rabenstraße 3  
20354 Hamburg

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

WKN / ISIN: A2PB6J / DE000A2PB6J1