

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

## HMT Wertsicherung 94 ESG

JAHRESBERICHT

ZUM 31. OKTOBER 2024

---

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



# Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

## Tätigkeitsbericht für den Berichtszeitraum vom 1. November 2023 bis 31. Oktober 2024

### Anlageziele und Anlagepolitik zur Erreichung der Anlageziele

Der Fonds strebt eine möglichst hohe Partizipation an den Aktien- und Rentenmärkten des Euroraums an. Der Fonds verfolgt eine Wertsicherungsstrategie mit einer Wertuntergrenze von 94 % auf Kalenderjahresbasis, d.h. eine mögliche negative Wertentwicklung soll auf Kalenderjahresbasis den Wert von -6 % nicht überschreiten. Hierzu werden regelmäßig unterschiedliche, konservative Risikokennziffern für die Aktien- und Rentenmärkte betrachtet und die Portfoliostruktur bei Bedarf so angepasst, dass im Falle eines Eintretens der Risikoszenarien die Wertuntergrenze nicht unterschritten wird. Der Fonds investiert in Aktien und Renten, die ESG-Kriterien einhalten. Das Anlageuniversum ist Ergebnis einer umfangreichen Nachhaltigkeitsanalyse der Wertpapiere, bei der ökologische, soziale und die Unternehmensführung betreffende Nachhaltigkeitskriterien berücksichtigt und in Form von Negativ/Ausschlusskriterien angewendet werden. Grundlage hierfür ist die Analyse der Nachhaltigkeits-Ratingagentur MSCI ESG Research LLC unter Beachtung der von der HanseMerkur Trust AG definierten Negativkriterien. Dieser Fonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale im Sinne des Artikel 8 der Offenlegungs-Verordnung (Verordnung (EU) 2019/2088). Weiterführende Informationen können dem Abschnitt "Anlagegrundsätze und Anlagepolitik" des Verkaufsprospektes des Fonds entnommen werden.

### Struktur des Portfolios und wesentliche Veränderungen im Berichtszeitraum

#### Fondsstruktur

	31.10.2024		31.10.2023	
	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen	Kurswert	% Anteil Fondsvermögen
Renten	17.828.299,00	81,98	15.930.035,00	76,36
Aktien	1.065.277,94	4,90	2.141.817,78	10,27
Optionen	-93.050,00	-0,43	0,00	0,00
Futures	48.140,00	0,22	93.125,00	0,45
Bankguthaben	2.814.968,68	12,94	2.699.873,03	12,94
Zins- und Dividendenansprüche	124.211,44	0,57	28.118,31	0,13
Sonstige Ford./Verbindlichkeiten	-39.393,07	-0,18	-31.490,42	-0,15
Fondsvermögen	21.748.453,99	100,00	20.861.478,70	100,00

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

Für den Berichtszeitraum beträgt die Wertentwicklung des Fonds 6,10% (Anteilklasse I) bzw. 5,67% (Anteilklasse R). Bei der Fondsstruktur sind die Renten ca. 82% und in Aktien ca. 5% des Fondsvermögens zum Ende des Berichtszeitraums investiert. Der Aktienanteil hat sich gegenüber dem Beginn des Berichtszeitraums um ca. 5,4% verringert.

### Wesentliche Risiken

#### Allgemeine Marktpreisrisiken

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken.

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds (Sondervermögen) im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen werden sich entsprechend auch im Fondsvermögen (Wert des Sondervermögens) widerspiegeln.

Zusätzlich belasten Unsicherheiten über den weiteren Verlauf des Konflikts sowie die wirtschaftlichen Folgen der diversen Sanktionen die Märkte.

#### Zinsänderungsrisiken

Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist die Möglichkeit verbunden, dass sich das Marktzinsniveau, das im Zeitpunkt der Begebung eines Wertpapiers besteht, ändern kann. Steigen die Marktzinsen gegenüber den Zinsen zum Zeitpunkt der Emission, so fallen in der Regel die Kurse der festverzinslichen Wertpapiere. Fällt dagegen der Marktzins, so steigt der Kurs festverzinslicher Wertpapiere. Diese Kursentwicklung führt dazu, dass die aktuelle Rendite der festverzinslichen Wertpapiere in etwa dem aktuellen Marktzins entspricht. Diese Kursentwicklungen fallen jedoch je nach Laufzeit der festverzinslichen Wertpapiere unterschiedlich aus. Festverzinsliche Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten haben geringere Zinsänderungs-/Kursrisiken als festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten.

#### Adressenausfallrisiken / Emittentenrisiken

Durch den Ausfall eines Ausstellers oder Kontrahenten können Verluste für das Sondervermögen entstehen. Das Ausstellerrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Ausstellers, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten. Das Kontrahentenrisiko beinhaltet das Risiko der Partei eines gegenseitigen Vertrages, mit der eigenen Forderung teilweise oder vollständig auszufallen. Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung eines Sondervermögens geschlossen werden.

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

### Bonitätsrisiken

Bei Anleihen kann es zu einer Ratingveränderung des Schuldners kommen. Je nachdem, ob die Bonität steigt oder fällt, kann es zu Kursveränderungen des Wertpapiers kommen.

### Aktienrisiken

Mit dem Erwerb von Aktien können besondere Marktrisiken und Unternehmensrisiken verbunden sein. Der Wert von Aktien spiegelt nicht immer den tatsächlichen Wert des Unternehmens wider. Es kann daher zu großen und schnellen Schwankungen dieser Werte kommen, wenn sich Marktgegebenheiten und Einschätzungen von Marktteilnehmern hinsichtlich des Wertes dieser Anlagen ändern. Hinzu kommt, dass die Rechte aus Aktien stets nachrangig gegenüber den Ansprüchen sämtlicher Gläubiger des Emittenten befriedigt werden. Daher unterliegen Aktien im Allgemeinen größeren Wertschwankungen als z.B. festverzinsliche Wertpapiere.

### Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften

Die Gesellschaft darf für Rechnung des Sondervermögens sowohl zu Absicherungszwecken als auch zu Investitionszwecken Geschäfte mit Derivaten tätigen. Die Absicherungsgeschäfte dienen dazu, das Gesamtrisiko des Sondervermögens zu verringern, können jedoch ggf. auch die Renditechancen schmälern.

Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:

- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes bis hin zur Wertlosigkeit vermindern. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann das Sondervermögen ebenfalls Verluste erleiden.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Sondervermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Sondervermögen gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass das Sondervermögen zur Abnahme / Lieferung von Vermögenswerten zu einem abweichenden Preis als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet ist.
- Auch bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass das Sondervermögen infolge unerwarteter Entwicklungen der Marktpreise bei Fälligkeit Verluste erleidet.

### Währungsrisiken

Sofern Vermögenswerte eines Sondervermögens in anderen Währungen als der jeweiligen Fondswährung angelegt sind, erhält es die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der jeweiligen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Sondervermögens.

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

### Fondsergebnis

Die wesentlichen Quellen des positiven Veräußerungsergebnisses während des Berichtszeitraums waren realisierte Gewinne aus ausländischen Aktien.

Wertentwicklung im Berichtszeitraum (1. November 2023 bis 31. Oktober 2024)<sup>1</sup>.

Anteilklasse I: +6,10%

Anteilklasse R: +5,67%

<sup>1</sup>Eigene Berechnung nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese ist nicht prognostizierbar.

**Jahresbericht  
HMT Wertsicherung 94 ESG**

**Vermögensübersicht zum 31.10.2024**

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>21.835.987,06</b>	<b>100,40</b>
1. Aktien	1.065.277,94	4,90
Bundesrep. Deutschland	326.733,40	1,50
Frankreich	232.247,12	1,07
Italien	40.680,00	0,19
Niederlande	354.492,54	1,63
Spanien	111.124,88	0,51
2. Anleihen	17.828.299,00	81,98
< 1 Jahr	5.210.466,00	23,96
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	7.305.355,00	33,59
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	759.140,00	3,49
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	4.553.338,00	20,94
3. Derivate	-44.910,00	-0,21
4. Bankguthaben	2.511.380,38	11,55
5. Sonstige Vermögensgegenstände	475.939,74	2,19
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-87.533,07</b>	<b>-0,40</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>21.748.453,99</b>	<b>100,00</b>

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Vermögensaufstellung zum 31.10.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>18.893.576,94</b>	<b>86,87</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>16.997.130,94</b>	<b>78,15</b>
<b>Aktien</b>							<b>EUR</b>	<b>1.065.277,94</b>	<b>4,90</b>
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037	STK	3.594	3.594	0	EUR 30,310	108.934,14	0,50	
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005	STK	221	221	0	EUR 289,400	63.957,40	0,29	
argenx SE Aandelen aan toonder EO -,10	NL0010832176	STK	224	224	0	EUR 541,600	121.318,40	0,56	
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215	STK	200	0	160	EUR 621,200	124.240,00	0,57	
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628	STK	1.000	0	2.874	EUR 34,520	34.520,00	0,16	
Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10	FR0014003TT8	STK	1.953	0	47	EUR 31,460	61.441,38	0,28	
Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -,75	ES0144580Y14	STK	8.144	189	3.028	EUR 13,645	111.124,88	0,51	
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	634	0	266	EUR 97,110	61.567,74	0,28	
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	882	0	625	EUR 214,800	189.453,60	0,87	
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972	STK	315	0	515	EUR 237,200	74.718,00	0,34	
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101	STK	411	0	249	EUR 178,400	73.322,40	0,34	
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360	STK	1.000	3.721	2.721	EUR 40,680	40.680,00	0,19	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>15.931.853,00</b>	<b>73,26</b>
3,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.23(26)	DE000BHY0SP0	EUR	600	0	0	% 100,671	604.026,00	2,78	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030)	DE0001030708	EUR	1.500	0	0	% 88,230	1.323.450,00	6,09	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) Grüne	DE0001030732	EUR	2.000	0	0	% 86,168	1.723.360,00	7,92	
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) Grüne	DE000BU3Z005	EUR	1.000	1.000	0	% 99,915	999.150,00	4,59	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.2020(25)	DE0001030716	EUR	1.000	0	0	% 97,781	977.810,00	4,50	
0,8750 % Cie Génle Éts Michelin SCpA EO-Obl. 2018(18/25)	FR0013357845	EUR	800	0	0	% 98,482	787.856,00	3,62	
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2020(25)	EU000A284451	EUR	700	0	0	% 97,589	683.123,00	3,14	
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(26)	EU000A3KNYF7	EUR	1.000	0	0	% 96,953	969.530,00	4,46	
0,0000 % Hessen, Land Schatzanw. S.2105 v.2021(2025)	DE000A1RQD68	EUR	1.500	0	0	% 97,986	1.469.790,00	6,76	
0,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau EMTN v.2018 (2026)	XS1897340854	EUR	500	0	0	% 96,570	482.850,00	2,22	
0,0100 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.19(27)	XS1999841445	EUR	500	0	0	% 94,116	470.580,00	2,16	
3,6250 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	XS2591026856	EUR	600	600	0	% 100,750	604.500,00	2,78	
0,7500 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2016(26)	AT0000A1K9C8	EUR	1.600	1.000	0	% 96,940	1.551.040,00	7,13	
4,8500 % Österreich, Republik EO-Med.-Term Nts 2009(26) 144A	AT0000A0DXC2	EUR	1.000	1.000	0	% 103,104	1.031.040,00	4,74	
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25)	AT0000A2QRW0	EUR	1.000	1.000	0	% 98,723	987.230,00	4,54	

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Vermögensaufstellung zum 31.10.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(31)	AT0000A2NW83		EUR	600	0	0 %	84,563	507.378,00	2,33
3,1250 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	FR001400F703		EUR	400	0	0 %	101,120	404.480,00	1,86
0,1250 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2019(29)	FR0013434321		EUR	400	0	0 %	88,665	354.660,00	1,63
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.896.446,00</b>	<b>8,72</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.896.446,00</b>	<b>8,72</b>
3,2500 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/27)	XS2575555938		EUR	500	500	0 %	101,242	506.210,00	2,33
3,5000 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2023(23/25)	XS2631416950		EUR	400	0	0 %	100,614	402.456,00	1,85
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.24/04 f.16.04.25	DE000BU0E162		EUR	1.000	1.000	0 %	98,778	987.780,00	4,54
<b>Summe Wertpapiervermögen 2)</b>							<b>EUR</b>	<b>18.893.576,94</b>	<b>86,87</b>

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Vermögensaufstellung zum 31.10.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate</b>							EUR	-44.910,00	-0,21
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>							EUR	-67.450,00	-0,31
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							EUR	25.600,00	0,12
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 20.12.24 EUREX		185	EUR	Anzahl 80				25.600,00	0,12
<b>Optionsrechte</b>							EUR	-93.050,00	-0,43
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>							EUR	-93.050,00	-0,43
ESTX 50 PR.EUR CALL 20.12.24 BP 4800,00 EUREX		185		Anzahl -500			EUR 142,600	-71.300,00	-0,33
ESTX 50 PR.EUR CALL 20.12.24 BP 4900,00 EUREX		185		Anzahl -250			EUR 87,000	-21.750,00	-0,10
<b>Zins-Derivate</b>							EUR	22.540,00	0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>							EUR	22.540,00	0,10
FUTURE EURO-BOBL 06.12.24 EUREX		185	EUR	-1.500.000				12.900,00	0,06
FUTURE EURO-BUND 06.12.24 EUREX		185	EUR	-200.000				3.540,00	0,02
FUTURE EURO-SCHATZ 06.12.24 EUREX		185	EUR	-6.100.000				6.100,00	0,03

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Vermögensaufstellung zum 31.10.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>2.511.380,38</b>	<b>11,55</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>2.511.380,38</b>	<b>11,55</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	2.393.124,79			% 100,000	2.393.124,79	11,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			GBP	99.831,37			% 100,000	118.255,59	0,54
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>475.939,74</b>	<b>2,19</b>
Zinsansprüche			EUR	123.800,04				123.800,04	0,57
Dividendenansprüche			EUR	258,40				258,40	0,00
Quellensteueransprüche			EUR	153,00				153,00	0,00
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	351.728,30				351.728,30	1,62
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-87.533,07</b>	<b>-0,40</b>
Verwaltungsvergütung			EUR	-22.723,21				-22.723,21	-0,10
Verwahrstellenvergütung			EUR	-648,86				-648,86	0,00
Lagerstellenkosten			EUR	-1.071,00				-1.071,00	0,00
Prüfungskosten			EUR	-14.000,00				-14.000,00	-0,06
Veröffentlichungskosten			EUR	-950,00				-950,00	0,00
Variation Margin			EUR	-48.140,00				-48.140,00	-0,22
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>21.748.453,99</b>	<b>100,00 1)</b>

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Vermögensaufstellung zum 31.10.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.10.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I</b>									
Anteilwert							EUR	103,71	
Ausgabepreis							EUR	103,71	
Rücknahmepreis							EUR	103,71	
Anzahl Anteile							STK	199.850	
<b>HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R</b>									
Anteilwert							EUR	102,27	
Ausgabepreis							EUR	102,27	
Rücknahmepreis							EUR	102,27	
Anzahl Anteile							STK	10.000	

#### Fußnoten:

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

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

Britische Pfund LS	(GBP)	per 31.10.2024 0,8442000	= 1 EUR (EUR)
--------------------	-------	-----------------------------	---------------

### Marktschlüssel

#### Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
-----	-------------------

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

### 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>					
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003	STK	0	1.229	
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041	STK	0	2.054	
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004	STK	0	2.951	
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	0	17.190	
Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072	STK	0	4.500	
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026	STK	0	500	
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681	STK	0	25.500	
Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693	STK	0	500	
Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40	FR0000130577	STK	860	860	
STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	NL0000226223	STK	0	2.000	
Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22	IT0003242622	STK	0	9.000	
TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50	FR0000120271	STK	0	2.666	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2032)	DE0001102580	EUR	0	300	
0,5000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2015(23)	XS1280834992	EUR	0	800	
<b>Andere Wertpapiere</b>					
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809S7	STK	8.144	8.144	

**Jahresbericht  
HMT Wertsicherung 94 ESG**

**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>Nichtnotierte Wertpapiere *)</b>					
<b>Aktien</b>					
Iberdrola S.A. Acciones Port.Em.01/24 EO -,75	ES0144583293	STK	189	189	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.22/11 f.22.11.23	DE0001030906	EUR	0	600	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/01 f.17.01.24	DE000BU0E014	EUR	0	500	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/08 f.17.07.24	DE000BU0E071	EUR	500	500	
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/10 f.18.09.24	DE000BU0E097	EUR	500	500	
1,6500 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2014(24)	AT0000A185T1	EUR	0	1.000	
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(24)	AT0000A28KX7	EUR	0	1.600	
<b>Andere Wertpapiere</b>					
Iberdrola S.A. Anrechte	ES06445809R9	STK	10.983	10.983	

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

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

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

#### Derivate

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

#### Terminkontrakte

##### Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CAC 40, DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR, FTSE MIB)

EUR

10.387,72

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

1.244,25

##### Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

30.436,11

#### Optionsrechte

##### Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

##### Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Kaufoptionen (Call):

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

EUR

138,92

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.

\*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.11.2023 bis 31.10.2024

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	7.710,03	0,04
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	34.409,93	0,17
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	78.650,18	0,41
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	94.599,22	0,47
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	50.334,98	0,25
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer		EUR	-1.156,50	-0,01
10. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	-1.272,50	-0,01
11. Sonstige Erträge		EUR	38,57	0,00
<b>Summe der Erträge</b>		<b>EUR</b>	<b>263.313,90</b>	<b>1,32</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	-42,31	0,00
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-81.338,61	-0,40
- Verwaltungsvergütung	EUR	-81.338,61		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-11.602,94	-0,06
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-8.057,03	-0,04
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-21.084,02	-0,11
- Depotgebühren	EUR	-20.813,09		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	0,00		
- Sonstige Kosten	EUR	-270,93		
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>EUR</b>	<b>-122.124,90</b>	<b>-0,61</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>EUR</b>	<b>141.189,00</b>	<b>0,71</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>				
1. Realisierte Gewinne		EUR	969.993,02	4,85
2. Realisierte Verluste		EUR	-445.012,92	-2,23
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>EUR</b>	<b>524.980,10</b>	<b>2,62</b>

## Jahresbericht

### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	EUR	<b>666.169,10</b>	<b>3,33</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	125.119,59	0,63
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	404.616,00	2,02
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	EUR	<b>529.735,59</b>	<b>2,65</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	EUR	<b>1.195.904,69</b>	<b>5,98</b>

### Entwicklung des Sondervermögens

**2023/2024**

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	EUR		<b>19.875.618,79</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		-345.740,50
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		0,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	0,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		0,00
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		1.195.904,69
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	125.119,59	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	404.616,00	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	EUR		<b>20.725.782,98</b>

### Verwendung der Erträge des Sondervermögens

#### Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>	EUR	<b>2.312.510,92</b>	<b>11,57</b>
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	1.619.277,89	8,10
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	666.169,10	3,33
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	EUR	27.063,93	0,14
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>	EUR	<b>1.992.750,92</b>	<b>9,97</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	1.992.750,92	9,97
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	EUR	<b>319.760,00</b>	<b>1,60</b>
1. Zwischenausschüttung	EUR	0,00	0,00
2. Endausschüttung	EUR	319.760,00	1,60

\*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I

### Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020/2021	Stück	199.850	EUR	20.576.224,04	EUR	102,96
2021/2022	Stück	199.850	EUR	19.208.438,07	EUR	96,11
2022/2023	Stück	199.850	EUR	19.875.618,79	EUR	99,45
2023/2024	Stück	199.850	EUR	20.725.782,98	EUR	103,71

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.11.2023 bis 31.10.2024

			insgesamt	je Anteil
<b>I. Erträge</b>				
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR		381,71	0,04
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR		1.703,40	0,17
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR		3.891,62	0,39
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR		4.679,13	0,47
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR		2.490,94	0,25
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR		0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR		0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften	EUR		0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR		-57,26	-0,01
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR		-62,96	-0,01
11. Sonstige Erträge	EUR		1,91	0,00
<b>Summe der Erträge</b>	<b>EUR</b>		<b>13.028,49</b>	<b>1,30</b>
<b>II. Aufwendungen</b>				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR		-2,10	0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR		-8.048,28	-0,80
- Verwaltungsvergütung	EUR	-8.048,28		
- Beratungsvergütung	EUR	0,00		
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00		
3. Verwahrstellenvergütung	EUR		-574,39	-0,06
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR		-399,02	-0,04
5. Sonstige Aufwendungen	EUR		-1.037,10	-0,10
- Depotgebühren	EUR	-1.030,78		
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	7,07		
- Sonstige Kosten	EUR	-13,39		
<b>Summe der Aufwendungen</b>	<b>EUR</b>		<b>-10.060,90</b>	<b>-1,00</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>	<b>EUR</b>		<b>2.967,59</b>	<b>0,30</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>				
1. Realisierte Gewinne	EUR		48.029,83	4,80
2. Realisierte Verluste	EUR		-22.016,47	-2,20
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>	<b>EUR</b>		<b>26.013,36</b>	<b>2,60</b>

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>28.980,95</b>	<b>2,90</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	6.024,67	0,60
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	20.205,70	2,02
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>26.230,37</b>	<b>2,62</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>55.211,32</b>	<b>5,52</b>

### Entwicklung des Sondervermögens

2023/2024

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>985.859,91</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-17.220,64
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	-1.211,88
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	0,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-1.211,88
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	32,29
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	55.211,32
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	6.024,67
davon nicht realisierte Verluste	EUR	20.205,70
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>EUR</b>	<b>1.022.671,01</b>

### Verwendung der Erträge des Sondervermögens

#### Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil

		insgesamt	je Anteil
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>	<b>EUR</b>	<b>101.331,13</b>	<b>10,14</b>
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	71.027,87	7,11
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	28.980,95	2,90
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	EUR	1.322,31	0,13
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>	<b>EUR</b>	<b>85.531,13</b>	<b>8,56</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	85.531,13	8,56
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>EUR</b>	<b>15.800,00</b>	<b>1,58</b>
1. Zwischenausschüttung	EUR	0,00	0,00
2. Endausschüttung	EUR	15.800,00	1,58

\*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten und beruht auf der Annahme einer nach den Anlagebedingungen maximalen Ausschüttung.

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R

### Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020/2021	Stück	10.012	EUR	1.024.708,33	EUR	102,35
2021/2022	Stück	10.012	EUR	956.558,17	EUR	95,54
2022/2023	Stück	10.012	EUR	985.859,91	EUR	98,47
2023/2024	Stück	10.000	EUR	1.022.671,01	EUR	102,27

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 01.11.2023 bis 31.10.2024

			insgesamt
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)		EUR	8.091,74
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		EUR	36.113,32
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		EUR	82.541,80
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		EUR	99.278,35
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		EUR	52.825,92
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		EUR	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		EUR	0,00
8. Erträge aus Wertpapier- Darlehen- und -Pensionsgeschäften		EUR	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer		EUR	-1.213,76
10. Abzug ausländischer Quellensteuer		EUR	-1.335,46
11. Sonstige Erträge		EUR	40,48
<b>Summe der Erträge</b>		<b>EUR</b>	<b>276.342,39</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		EUR	-44,41
2. Verwaltungsvergütung		EUR	-89.386,89
- Verwaltungsvergütung	EUR	-89.386,89	
- Beratungsvergütung	EUR	0,00	
- Asset Management Gebühr	EUR	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung		EUR	-12.177,33
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		EUR	-8.456,05
5. Sonstige Aufwendungen		EUR	-22.121,12
- Depotgebühren	EUR	-21.843,87	
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	7,07	
- Sonstige Kosten	EUR	-284,32	
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>EUR</b>	<b>-132.185,80</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>EUR</b>	<b>144.156,59</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		EUR	1.018.022,85
2. Realisierte Verluste		EUR	-467.029,39
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>EUR</b>	<b>550.993,46</b>

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>695.150,05</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		EUR	131.144,26
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		EUR	424.821,70
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>555.965,96</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>EUR</b>	<b>1.251.116,01</b>

### Entwicklung des Sondervermögens

**2023/2024**

<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>			<b>EUR</b>	<b>20.861.478,70</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr			EUR	-362.961,14
2. Zwischenausschüttungen			EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)			EUR	-1.211,88
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	0,00		
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-1.211,88		
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich			EUR	32,29
5. Ergebnis des Geschäftsjahres			EUR	1.251.116,01
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	131.144,26		
davon nicht realisierte Verluste	EUR	424.821,70		
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>			<b>EUR</b>	<b>21.748.453,99</b>

**Jahresbericht  
HMT Wertsicherung 94 ESG**

**Anteilklassenmerkmale im Überblick**

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)	Verwaltungsvergütung derzeit (Angabe in % p.a.) *)	Ertragsverwendung	Währung
HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I	100.000	0,00	0,400	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR
HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R	keine	0,00	0,800	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR

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

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben nach der Derivateverordnung

<b>das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure</b>	<b>EUR</b>	<b>14.257.006,83</b>
<b>die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte</b> Baader Bank AG (Broker) DE		
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>		<b>86,87</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>		<b>-0,21</b>

Bei der Ermittlung der Auslastung der Marktrisikoobergrenze für diesen Fonds wendet die Gesellschaft seit 04.05.2020 den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung anhand eines Vergleichsvermögens an. Die Value-at-Risk-Kennzahlen wurden auf Basis der Methode der historischen Simulation mit den Parametern 99 % Konfidenzniveau und 1 Tag Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraums von einem Jahr berechnet. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigen Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.

#### Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potenzieller Risikobetrag	0,19 %
größter potenzieller Risikobetrag	0,36 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	0,26 %

**Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte:** **1,60**

#### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

STOXX Global ESG Leaders Price Return (EUR) (ID: XFI000003072 | BB: SXWESGP) 100,00 %

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Sonstige Angaben

##### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	103,71
Ausgabepreis	EUR	103,71
Rücknahmepreis	EUR	103,71
Anzahl Anteile	STK	199.850

##### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	102,27
Ausgabepreis	EUR	102,27
Rücknahmepreis	EUR	102,27
Anzahl Anteile	STK	10.000

#### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

##### Bewertung

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

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

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

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

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

##### Gesamtkostenquote

##### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

0,60 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

EUR

0,00

##### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für das abgelaufene Geschäftsjahr beträgt

1,00 %

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

EUR

0,00

##### Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendererstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Ausgabeauf- und Rücknahmeabschlüsse, die dem Sondervermögen für den Erwerb und die Rücknahme von

Investmentanteilen berechnet wurden

EUR

0,00

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

##### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse I

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

##### HMT Wertsicherung 94 ESG Anteilklasse R

Wesentliche sonstige Erträge: EUR 0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen: EUR 0,00

#### Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)

Transaktionskosten EUR 5.776,26

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

**Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

**Angaben zur Mitarbeitervergütung**

<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>84,3</b>
davon feste Vergütung	in Mio. EUR	75,0
davon variable Vergütung	in Mio. EUR	9,3
Zahl der Mitarbeiter der KVG		998
Höhe des gezahlten Carried Interest	in EUR	0
<b>Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>4,8</b>
davon Geschäftsleiter	in Mio. EUR	3,9
davon andere Risktaker	in Mio. EUR	0,9

**Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft**

Die Universal-Investment-Gesellschaft mbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die detaillierte Ausgestaltung hat die Gesellschaft in einer Vergütungsrichtlinie geregelt, deren Ziel es ist, eine nachhaltige Vergütungssystematik unter Berücksichtigung von Sustainable Corporate Governance und unter Vermeidung von Fehlanreizen zur Eingehung übermäßiger Risiken (einschließlich einschlägiger Nachhaltigkeitsrisiken) sicherzustellen.

Das Vergütungssystem der Kapitalverwaltungsgesellschaft wird mindestens einmal jährlich durch den Vergütungsausschuss der Universal-Investment auf seine Angemessenheit und die Einhaltung aller rechtlichen sowie interner und externer regulatorischer Vorgaben überprüft. Es umfasst fixe und variable Vergütungselemente. Durch die Festlegung von Bandbreiten für die Gesamtzielvergütung ist gewährleistet, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung sowie ein angemessenes Verhältnis von variabler zu fixer Vergütung besteht. Für die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft und Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Kapitalverwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) gelten besondere Regelungen. Risikorelevante Mitarbeiter, deren variable Vergütung für das jeweilige Geschäftsjahr einen Schwellenwert von 50 TEUR nicht überschreitet, erhalten die variable Vergütung vollständig in Form einer Barleistung ausgezahlt. Wird für risikorelevante Mitarbeiter dieser Schwellenwert überschritten, wird zwingend ein Anteil von 40 % der variablen Vergütung über einen Zeitraum von drei Jahren aufgeschoben. Der aufgeschobene Anteil der Vergütung ist während dieses Zeitraums risikoabhängig, d.h. er kann im Fall von negativen Erfolgsbeiträgen des Mitarbeiters oder der Kapitalverwaltungsgesellschaft insgesamt gekürzt werden. Jeweils am Ende jedes Jahres der Wartezeit wird der aufgeschobene Vergütungsanteil anteilig unverfallbar und zum jeweiligen Zahlungstermin ausgezahlt.

Soweit das Portfolio-Management ausgelagert ist, werden keine Mitarbeitervergütungen direkt aus dem Fonds gezahlt.

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

#### Angaben gemäß § 101 Abs. 2 Nr. 5 KAGB

##### **Wesentliche mittel- bis langfristigen Risiken**

Die Angaben der wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken erfolgt innerhalb des Tätigkeitsberichts.

##### **Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten**

Die Angaben zu der Zusammensetzung des Portfolios erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung.

Die Angaben zu den Portfolioumsätzen erfolgen innerhalb der Vermögensaufstellung und innerhalb der Aufstellung der während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte.

Die Angabe zu den Transaktionskosten erfolgt im Anhang.

##### **Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung**

Die Auswahl von Einzeltiteln richtet sich nach der Anlagestrategie. Die vertraglichen Grundlagen für die Anlageentscheidung finden sich in den vereinbarten Anlagebedingungen und ggf. Anlagerichtlinien. Eine Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Portfoliogesellschaften erfolgt, wenn diese in den Vertragsbedingungen vorgeschrieben ist.

##### **Einsatz von Stimmrechtsberatern**

Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern verweisen wir auf den neuen Mitwirkungsbericht auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

##### **Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten**

Zur grundsätzlichen Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung der Gesellschaft, insbesondere durch die Ausübung von Aktionärsrechten, verweisen wir auf unsere aktuelle Mitwirkungspolitik auf der Homepage <https://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/compliance/mitwirkungspolitik>.

Frankfurt am Main, den 1. November 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Die Geschäftsführung

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Universal-Investment-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

#### *Prüfungsurteil*

Wir haben den Jahresbericht des Sondervermögens HMT Wertsicherung 94 ESG - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. November 2023 bis zum 31. Oktober 2024, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. November 2023 bis zum 31. Oktober 2024, sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Die im Abschnitt "Sonstige Informationen" unseres Vermerks genannten Bestandteile des Jahresberichts haben wir in Einklang mit den deutschen gesetzlichen Vorschriften bei der Bildung unseres Prüfungsurteils zum Jahresbericht nicht berücksichtigt.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf den Inhalt der im Abschnitt "Sonstige Informationen" genannten Bestandteile des Jahresberichts.

#### *Grundlage für das Prüfungsurteil*

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt "Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts" unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Universal-Investment-Gesellschaft mbH unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht zu dienen.

#### *Sonstige Informationen*

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die folgenden Bestandteile des Jahresberichts:

- die im Jahresbericht enthaltenen und als nicht vom Prüfungsurteil zum Jahresbericht umfasst gekennzeichneten Angaben.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir in diesem Vermerk weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die oben genannten sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zu den vom Prüfungsurteil umfassten Bestandteilen des Jahresberichts oder zu unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

### *Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht*

Die gesetzlichen Vertreter der Universal-Investment-Gesellschaft mbH sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts, der den Vorschriften des deutschen KAGB in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts die Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

### *Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts*

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Universal-Investment-Gesellschaft mbH abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Universal-Investment-Gesellschaft mbH bei der Aufstellung des Jahresberichts angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

## Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Universal-Investment-Gesellschaft mbH nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 11. Februar 2025

Deloitte GmbH  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

René Rumpelt  
Wirtschaftsprüfer

Abelardo Rodríguez González  
Wirtschaftsprüfer

## **Jahresbericht HMT Wertsicherung 94 ESG**

### **Sonstige Information - nicht vom Prüfungsurteil zum Jahresbericht umfasst**

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

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

#### **Angaben zu nichtfinanziellen Leistungsindikatoren**

##### **Artikel 8 Offenlegungs-Verordnung (Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben)**

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts PAI) werden im Investitionsprozess auf Gesellschaftsebene berücksichtigt. Eine Berücksichtigung der PAI auf Ebene des Fonds ist verbindlich und erfolgt insoweit.

**Weitere Informationen über die ökologischen und/oder sozialen Merkmale und zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren sind im "Anhang Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten" enthalten.**

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

ANHANG

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:  
HMT Wertsicherung 94 ESG

Unternehmenskennung (LEI-Code):  
5299001DHWFIBEQ82N96

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_\_ % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## **Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?**

Dieser Fonds bewarb ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung.

Der Fonds berücksichtigte bei Investitionen u.a. folgende Faktoren aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung/Governance: Einhaltung anerkannter Normen in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umwelt, Korruption & Bestechung sowie die Vermeidung von kontroversen Geschäftsfeldern. Bei Staaten/öffentlichen Emittenten: Einhaltung von Demokratie und Menschenrechten.

Die HanseMercur Trust AG als Asset Manager des Fonds ist Unterzeichner der Principles for Responsible Investment, eines weltweiten Netzwerks institutioneller Investoren, die sich gemeinsam für Nachhaltigkeit im Finanzwesen einsetzen.

Der Fonds wandte tätigkeitsbezogene Ausschlüsse an. Unternehmen mit den folgenden Aktivitäten sind ganz oder teilweise ausgeschlossen:

- Pornografie/Erwachsenenunterhaltung (Produktion) > 0 % Umsatzerlöse
- Tabak (Produktion) > 0 % Umsatzerlöse
- Glücksspiel (Produktion) > 5,00 % Umsatzerlöse
- Pelzen (Upstream, Produktion, Downstream) > 0 % Umsatzerlöse
- Gentechnik (Produktion) > 1,00 % Umsatzerlöse
- Atom-/Kernenergie > 5,00 % Umsatzerlöse
- Atomwaffen (Produktion, Downstream) > 0 % Umsatzerlöse
- konventionelle Waffen (Produktion, Downstream) > 5,00 % Umsatzerlöse
- unkonventionelle Waffen (Upstream, Produktion, Downstream) > 0 % Umsatzerlöse
- Kohle (Upstream, Produktion, Downstream) > 10,0 % Umsatzerlöse
- Gas (Produktion) > 1,00 % Umsatzerlöse
- Öl (Upstream, Produktion, Downstream) > 30,0 % Umsatzerlöse

Der Fonds wandte normbasiertes Screening in Bezug auf UN Global Compact an.

Der Fonds wandte folgende Ausschlüsse für Staaten an:

- Staaten, die Atomwaffen besitzen und/oder beherbergen,
- Staaten, die das Übereinkommen über die Nichtverbreitung von Kernwaffen nicht ratifiziert haben,
- Staaten mit schwerwiegenden Verstößen gegen die demokratischen Rechte und die Menschenrechte (auf Grundlage der Bewertung von Freedom House),
- Staaten, die der Korruption ausgesetzt sind,
- Staaten, in denen die Todesstrafe legal ist,
- Staaten, die das Pariser Abkommen nicht ratifiziert haben.

## ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Alle Nachhaltigkeitsindikatoren des Fonds, die zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds dienen, wurden im Bezugszeitraum eingehalten. Die Einhaltung der ökologischen und/oder sozialen Kriterien für die Selektion der Vermögensgegenstände wurde vor sowie nach Erwerb geprüft.

Eine ausführliche Auflistung der Kriterien, die zum Ausschluss der Unternehmen, Staaten und/oder Zielfonds geführt haben, ist im vorherigen Abschnitt „Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?“ zu finden.

Als Nachhaltigkeitsindikator wird das ESG-Fonds-Rating angewendet, das auf Daten und der Methodik des Research-Anbieters MSCI ESG Research basiert.

Darüber hinaus berücksichtigte der Fonds verbindlich folgende Nachhaltigkeitsfaktoren in seiner Strategie und legt die nachteiligen Auswirkungen zu diesen offen:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen 0,00%  
(Messgröße: Anteil der Investitionen in Unternehmen, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren)
- Engagement in kontroverse Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) 0,00%  
(Messgröße: Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind)
- Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen 0  
(Messgröße: Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen)
- Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen 0,00%  
(Messgröße: Prozentualer Anteil der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen)
- Geschäftstätigkeiten und Lieferanten, bei denen ein erhebliches Risiko von Kinderarbeit besteht 0,48%  
(Messgröße: Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, bei denen ein erhebliches Risiko besteht, dass bei ihren Tätigkeiten oder den Tätigkeiten ihrer Lieferanten Kinder zur Arbeit herangezogen werden, aufgeschlüsselt nach geografischen Gebieten oder Art der Tätigkeit)

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

<b>Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren</b>			
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
<b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>	<b>Messgröße</b>	<b>Auswirkungen 2024</b>	<b>Auswirkungen 2023</b>
<b>INDIKATOREN IN DEN BEREICHEN SOZIALES UND BESCHÄFTIGUNG, ACHTUNG DER MENSCHENRECHTE UND BEKÄMPFUNG VON KORRUPTION UND BESTECHUNG</b>			
10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren	0,00%	0,00%
14. Engagement in umstrittene Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0,00%	0,00%
<b>Indikatoren für Investitionen in Staaten und supranationale Organisationen</b>			
16. Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen	0	0
	Prozentualer Anteil der Länder, in die investiert wird, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen, der Grundsätze der Vereinten Nationen oder, falls anwendbar, nationaler Rechtsvorschriften gegen soziale Bestimmungen verstoßen	0,00%	0,00%
<b>Zusätzliche Klimaindikatoren und andere umweltbezogene Indikatoren</b>			
<b>Zusätzliche Indikatoren für die Bereiche Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung</b>			
<b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>	<b>Messgröße</b>	<b>Auswirkungen 2024</b>	<b>Auswirkungen 2023</b>
<b>Indikatoren für Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird</b>			
	12. Geschäftstätigkeiten und Lieferanten, bei denen ein erhebliches Risiko von Kinderarbeit besteht (Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, bei denen ein erhebliches Risiko besteht, dass bei ihren Tätigkeiten oder den Tätigkeiten ihrer Lieferanten Kinder zur Arbeit herangezogen werden, aufgeschlüsselt nach geografischen Gebieten oder Art der Tätigkeit)	0,48%	2,76%

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds vermied nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren durch den Einsatz von Ausschlusskriterien. Ausgeschlossen wurden u.a. Investitionen in Wertpapiere von Unternehmen, die nicht in Einklang mit anerkannten Normen in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umwelt, Korruption & Bestechung handeln oder die Umsatzerlöse (oberhalb gewisser Toleranzen) aus den Geschäftsfeldern Rüstung, Tabak oder Kohle erzielen. Ausgeschlossen wurden außerdem Investitionen in Wertpapiere von öffentlichen Emittenten, die nicht in Einklang mit den Prinzipien von Demokratie und Menschenrechten handeln.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der größte Anteil der im Berichtszeitraum getätigten Investitionen (Hauptinvestitionen) berücksichtigt jeweils die Investitionen in den jeweiligen Quartalen. Aus diesen werden dann die 15 größten Investitionen im Durchschnitt ermittelt und hier dargestellt.

Die Sektoren werden bei Aktien auf erster Ebene der MSCI-Stammdatenlieferungen, bei Renten auf der Ebene der Industriesektoren nach Bloomberg ausgewiesen. Eine Zuteilung in MSCI-Sektoren von Fondsanteilen ist nicht vollumfänglich gegeben.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031) Grüne	Governments	7,98	Deutschland
0,0000 % Hessen, Land Schatzanzw. S.2105 v.2021(2025)	Governments	6,77	Deutschland
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030)	Governments	6,13	Deutschland
0,7500 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2016(26)	Governments	4,91	Österreich
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) Grüne	Governments	4,67	Deutschland
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25)	Governments	4,55	Österreich
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.2020(25)	Governments	4,51	Deutschland
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(26)	Governments	4,46	andere Instit. der EU
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2019(24)	Governments	3,74	Österreich
0,8750 % Cie Génle Étis Michelin SCpA EO-Obl. 2018(18/25)	Corporates	3,63	Frankreich
1,6500 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2014(24)	Governments	3,49	Österreich
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2020(25)	Governments	3,15	andere Instit. der EU
3,0000 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.23(26)	Pfandbriefe	2,81	Deutschland
4,8500 % Österreich, Republik EO-Med.-Term Nts 2009(26) 144A	Governments	2,38	Österreich
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(31)	Governments	2,35	Österreich

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:  
01.11.2023-  
31.10.2024



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Mit nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen (nicht zu verwechseln mit nachhaltigen Investitionen) sind alle Investitionen gemeint, die zur Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Rahmen der Anlagestrategie beitragen.

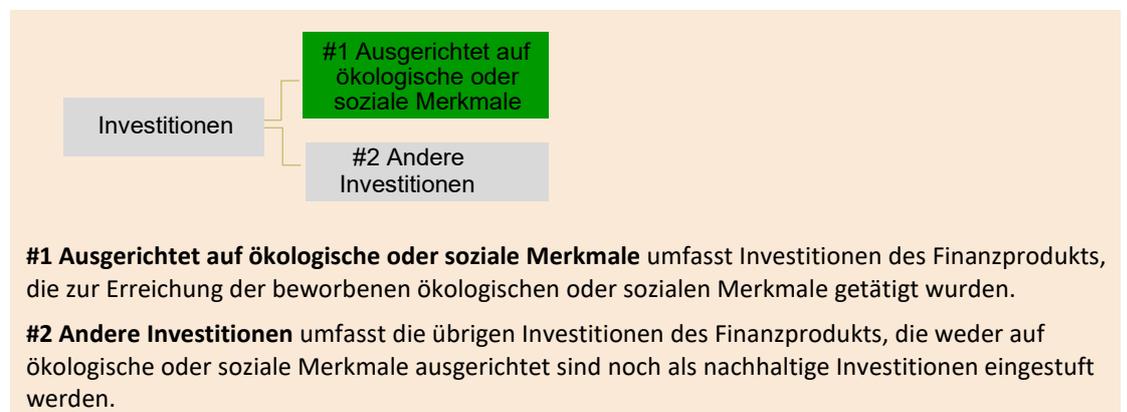
Die Überwachung der Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds erfolgt durch festgelegte Investitionen laut einer fondsspezifischen Anlageliste (Positivliste).

Der Fonds war zum Geschäftsjahresende am 31.10.2024 zu 91,25% nachhaltigkeitsbezogen in Bezug auf die Anlagen laut Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds investiert. Der Prozentsatz weist den Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investments am Wertpapiervermögen aus.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds war zum Geschäftsjahresende am 31.10.2024 zu 4,90 % in Aktien, zu 82,43 % in Renten investiert. Die anderen Investitionen waren Derivate und liquide Mittel.



### ● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Der Fonds investierte zum Geschäftsjahresende am 31.10.2024 bei Aktien hauptsächlich in die Sektoren

- Information Technology 35,21 %,
- Health Care 17,17 %,
- Industrials 13,90 %,
- Financials 13,06 % und
- Utilities 10,43 %.

Bei Renten wurde hauptsächlich investiert in die Sektoren

- Governments 73,96 %,
- Corporates 15,33 %,
- Pfandbriefe / Covered Bonds 5,40 % und
- Sovereigns 5,32 %.

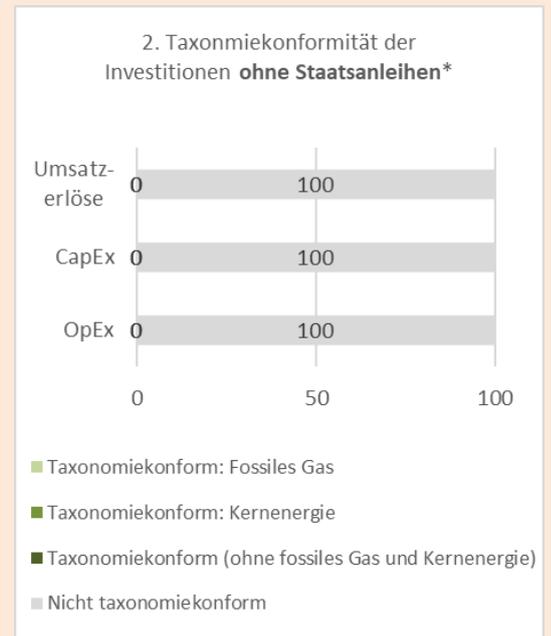
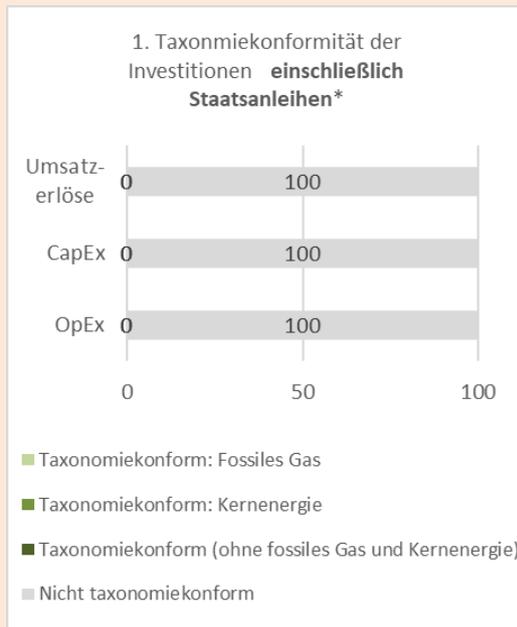
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

- Ja:  
 In fossiles Gas       In Kernenergie
- Nein

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

**Ermöglichende Tätigkeiten**

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten**

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Dieser Fonds verpflichtet sich derzeit nicht zu Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die als Ermöglichende- bzw. Übergangstätigkeiten eingestuft werden.



**Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Unter „Andere Investitionen“ fielen das Bankguthaben zur Liquiditätssteuerung und Derivate zur Risikosteuerung.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonmie erheblich beeinträchtigen. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Für andere Investitionen, die nicht unter die Nachhaltigkeitsstrategie des Fonds fallen, wird sichergestellt, dass diese nicht konträr zur Nachhaltigkeitsstrategie eingesetzt werden. Soweit Derivate erworben werden dürfen, wird sichergestellt, dass der Basiswert mit der Nachhaltigkeitsstrategie konform ist. Sofern ein Index als Basiswert genutzt wird, wird sichergestellt, dass der Index Nachhaltigkeitscharakteristika aufweist. Aufgrund der am Markt verfügbaren Finanzinstrumente kann es zu Abweichungen in den nachhaltigen Merkmalen des zugrundeliegenden Index zu den Fondsmerkmalen kommen. Alle Derivate, deren Basiswert als nicht im Einklang mit der Nachhaltigkeitsstrategie eingestuft werden könnte, sowie Währungsbestände, die nicht mit der Fondswährung übereinstimmen oder die nicht auf EUR, USD, GBP, CHF, JPY, AUD, NZD, CAD, NOK oder SEK lauten, dürfen nicht als wesentlicher Bestandteil im Fonds enthalten sein. Nicht umfasst ist der Derivateinsatz zum Ausgleich von negativen Marktschwankungen. Zudem können gezielt Investitionen von der Nachhaltigkeitsstrategie ausgenommen werden, die nicht einer expliziten Prüfung eines ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzes unterliegen.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Die Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds während des Bezugszeitraums wurde maßgeblich durch die Einhaltung der zuvor beschriebenen quantitativen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie der verbindlichen Elemente der Anlagestrategie gewährleistet. Die Überwachung der Einhaltung der Kriterien erfolgt vor Erwerb der Vermögenswerte durch das Portfoliomanagement und nach Erwerb durch weitere, entsprechende, tägliche Prüfung durch das Investment Controlling der Kapitalverwaltungsgesellschaft sowie fortlaufend durch den Portfolio Manager.

Die Mitwirkungspolitik (Engagement) der Kapitalverwaltungsgesellschaft wurde in Form der Stimmrechtsausübung wahrgenommen. Um die Interessen der Anleger in den verwalteten Fonds zu wahren und der damit verbundenen Verantwortung gerecht zu werden, übte die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Aktionärs- und Gläubigerrechte aus den gehaltenen Aktienbeständen der verwalteten Fonds im Sinne der Anleger aus. Entscheidungskriterium für die Ausübung oder Nichtausübung von Stimmrechten war für die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Interessen der Anleger und die Integrität des Marktes sowie der Nutzen für das betreffende Investmentvermögen und seine Anleger.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft legte ihrem Abstimmungsverhalten für das Inland die als ESG-konform geltenden "Analyserichtlinien für Gesellschafterversammlungen" des BVI zugrunde, die als Branchenstandard die Grundlage für einen verantwortungsvollen Umgang mit Anlegern, Kapital und Rechten bilden.

Bei Abstimmungen im Ausland zog die Kapitalverwaltungsgesellschaft die jeweils länderspezifischen Guidelines von Glass Lewis heran, die die lokalen Rahmenbedingungen berücksichtigen. Zusätzlich kamen die Glass Lewis Guidelines „Environmental, Social & Governance („ESG“) Initiatives“ auf die spezifischen Länderguidelines zum Einsatz und gelangten vorrangig zur Anwendung. Die Anwendung dieser Guidelines gewährleistet, dass länderspezifisch und auf den Kriterien einer transparenten und nachhaltigen Corporate Governance-Politik sowie weiteren Kriterien aus den Bereichen Umwelt und Soziales, die auf einen langfristigen Erfolg der von Investmentvermögen gehaltenen Unternehmen (sog. Portfoliogesellschaften) abzielen, abgestimmt wurde.

Diese genutzten Abstimmungsstandards orientieren sich an den Interessen der von der Kapitalverwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds und wurden daher grundsätzlich für alle Fonds angewandt, es sei denn, es ist im Interesse der Anleger, der Marktintegrität oder des Nutzens für den jeweiligen Investmentfonds erforderlich, von diesen Stimmrechtsrichtlinien für einzelne Fonds abzuweichen.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft veröffentlicht die Grundsätze ihre Mitwirkungspolitik sowie einen jährlichen Mitwirkungsbericht auf ihrer Internetseite.

Der Asset Manager, falls das Portfoliomanagement ausgelagert ist, oder ggf. ein beauftragter Anlageberater können als Teil ihrer unternehmensbezogenen Engagement-Tätigkeiten weitere Maßnahmen zur Erfüllung ökologischer und/oder sozialer Merkmale ergriffen haben. Dieses Engagement erfolgt jedoch nicht im Namen des Fonds.

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### Anteilklassen im Überblick

#### Erstausgabedatum

Anteilklasse I	4. Mai 2020
Anteilklasse R	4. Mai 2020

#### Erstausgabepreise

Anteilklasse I	EUR 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse R	EUR 100,00 zzgl. Ausgabeaufschlag

#### Ausgabeaufschlag

Anteilklasse I	derzeit 0 %
Anteilklasse R	derzeit 0 %

#### Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	Erstinvestition: EUR 100.000,00, Folgeinvestitionen keine
Anteilklasse R	keine

#### Verwaltungsvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,40 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,80 % p.a.

#### Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,03 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,03 % p.a.

#### Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse R	Euro

#### Ertragsverwendung

Anteilklasse I	Ausschüttung
Anteilklasse R	Ausschüttung

#### Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	A2PS3J / DE000A2PS3J9
Anteilklasse R	A2PS3K / DE000A2PS3K7

# Jahresbericht

## HMT Wertsicherung 94 ESG

### 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](http://www.universal-investment.com)

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

##### Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan  
Mathias Heiß, Langen  
Dr. André Jäger, Witten  
Corinna Jäger, Nidderau  
Jochen Meyers, Frankfurt am Main  
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe  
Axel Vespermann, Dreieich

##### Aufsichtsrat:

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

#### 2. Verwahrstelle

BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland

##### Hausanschrift:

Senckenberganlage 19  
60325 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 15205-0  
Telefax: 069 / 15205-550  
[www.bnpparibas.de](http://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

HanseMerkur 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](http://www.hmt-ag.de)