

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



HMT Euro Aktien Protect ESG

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. APRIL 2024

VERWAHRSTELLE:



BNP PARIBAS

ASSET MANAGEMENT UND VERTRIEB:



HanseMerkurTrust

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect ESG

Vermögensübersicht zum 30.04.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	34.219.765,03	100,24
1. Aktien	30.524.459,95	89,41
Belgien	2.702.930,00	7,92
Bundesrep. Deutschland	7.523.093,50	22,04
Finnland	1.138.417,10	3,33
Frankreich	10.228.485,00	29,96
Irland	225.120,00	0,66
Italien	1.933.394,25	5,66
Niederlande	4.599.920,00	13,47
Österreich	80.544,00	0,24
Spanien	2.092.556,10	6,13
2. Derivate	-162.785,00	-0,48
3. Bankguthaben	3.140.287,97	9,20
4. Sonstige Vermögensgegenstände	717.802,11	2,10
II. Verbindlichkeiten	-81.455,21	-0,24
III. Fondsvermögen	34.138.309,82	100,00

Halbjahresbericht

HMT Euro Aktien Protect ESG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	30.524.459,95	89,41
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	30.524.459,95	89,41
Aktien							EUR	30.524.459,95	89,41
A2A S.p.A. Azioni nom. EO 0,52	IT0001233417		STK	181.700	181.700	0	EUR 1,856	337.144,35	0,99
ACCOR S.A. Actions Port. EO 3	FR0000120404		STK	8.800	700	1.000	EUR 41,310	363.528,00	1,06
Ackermans & van Haaren N.V. Actions Nom. o.N.	BE0003764785		STK	1.100	1.100	0	EUR 161,500	177.650,00	0,52
AGEAS SA/NV Actions Nominatives o.N.	BE0974264930		STK	5.200	5.200	0	EUR 43,140	224.328,00	0,66
Alten S.A. Actions au Porteur EO 1,05	FR0000071946		STK	800	150	1.250	EUR 110,700	88.560,00	0,26
Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01	ES0109067019		STK	10.600	10.600	0	EUR 59,760	633.456,00	1,86
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N.	BE0974293251		STK	22.200	17.300	0	EUR 56,160	1.246.752,00	3,65
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	NL0000334118		STK	200	200	0	EUR 595,200	119.040,00	0,35
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215		STK	3.400	3.200	300	EUR 832,700	2.831.180,00	8,29
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835		STK	108.700	67.900	0	EUR 10,175	1.106.022,50	3,24
Banco BPM S.p.A. Azioni o.N.	IT0005218380		STK	29.100	29.100	0	EUR 6,184	179.954,40	0,53
Bolloré SE Actions Port. EO 0,16	FR0000039299		STK	78.400	78.400	0	EUR 6,100	478.240,00	1,40
BPER Banca S.p.A. Azioni nom. EO 3	IT0000066123		STK	24.500	24.500	0	EUR 4,891	119.829,50	0,35
BUZZI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0001347308		STK	10.000	10.000	0	EUR 33,860	338.600,00	0,99
Caixabank S.A. Acciones Port. EO 1	ES0140609019		STK	71.300	71.300	0	EUR 4,952	353.077,60	1,03
Capgemini SE Actions Port. EO 8	FR0000125338		STK	2.200	500	0	EUR 197,900	435.380,00	1,28
Cie Génle Étis Michelin SCpA Actions Nom. EO -,50	FR001400AJ45		STK	19.900	9.800	0	EUR 36,180	719.982,00	2,11
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007		STK	10.000	5.400	0	EUR 74,660	746.600,00	2,19
Continental AG	DE0005439004		STK	4.500	600	0	EUR 60,840	273.780,00	0,80
CTS Eventim AG & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0005470306		STK	2.400	2.400	0	EUR 83,200	199.680,00	0,58
D'Ieteren Group S.A. Parts Sociales au Port. o.N.	BE0974259880		STK	1.200	130	530	EUR 203,200	243.840,00	0,71
Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10	FR0014003TT8		STK	9.600	1.500	0	EUR 37,030	355.488,00	1,04
Elisa Oyj Registered Shares Class A o.N.	FI0009007884		STK	11.900	11.900	0	EUR 42,320	503.608,00	1,48
Engie S.A. Actions Port. EO 1	FR0010208488		STK	17.000	17.000	0	EUR 16,270	276.590,00	0,81
Forvia SE Actions Port. EO 7	FR0000121147		STK	5.700	1.000	8.400	EUR 15,000	85.500,00	0,25
freenet AG Namens-Aktien o.N.	DE000A0Z2ZZ5		STK	7.400	7.400	0	EUR 26,040	192.696,00	0,56
GEA Group AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006602006		STK	6.700	6.700	0	EUR 37,900	253.930,00	0,74
Getlink SE Actions Port. EO -,40	FR0010533075		STK	12.600	12.600	0	EUR 16,000	201.600,00	0,59
Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Actions au Porteur o.N.	BE0003797140		STK	9.600	5.900	0	EUR 69,850	670.560,00	1,96
Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.	DE0008402215		STK	2.600	2.600	0	EUR 232,400	604.240,00	1,77

Halbjahresbericht

HMT Euro Aktien Protect ESG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60	NL0000009165		STK	15.600	15.600	0 EUR	91,300	1.424.280,00	4,17
HOCHTIEF AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006070006		STK	700	700	0 EUR	98,700	69.090,00	0,20
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004		STK	18.100	9.500	0 EUR	32,720	592.232,00	1,73
Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1	FR0010259150		STK	1.400	1.400	0 EUR	114,100	159.740,00	0,47
K+S AG	DE000KSAG888		STK	5.300	1.060	9.760 EUR	14,025	74.332,50	0,22
KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	BE0003565737		STK	2.000	2.000	0 EUR	69,900	139.800,00	0,41
Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000KBX1006		STK	2.400	2.400	0 EUR	69,550	166.920,00	0,49
KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N.	FI0009013403		STK	5.820	420	0 EUR	45,800	266.556,00	0,78
Legrand S.A. Actions au Port. EO 4	FR0010307819		STK	6.900	3.900	0 EUR	96,860	668.334,00	1,96
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000		STK	18.200	14.100	0 EUR	70,940	1.291.108,00	3,78
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	3.400	2.500	0 EUR	412,200	1.401.480,00	4,11
Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0006452907		STK	1.300	1.300	0 EUR	83,550	108.615,00	0,32
Neste Oyj Registered Shs o.N.	FI0009013296		STK	8.400	8.400	0 EUR	21,340	179.256,00	0,53
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	NL0010773842		STK	5.200	600	3.200 EUR	43,350	225.420,00	0,66
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681		STK	55.400	5.080	16.080 EUR	3,412	188.997,10	0,55
Rational AG	DE0007010803		STK	200	200	0 EUR	804,000	160.800,00	0,47
Rubis S.C.A. Actions Port. Nouv. EO 1,25	FR0013269123		STK	15.300	15.300	0 EUR	32,500	497.250,00	1,46
Ryanair Holdings PLC Registered Shares EO -,006	IE00BYTBXV33		STK	11.200	1.470	9.570 EUR	20,100	225.120,00	0,66
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578		STK	13.200	10.400	0 EUR	93,080	1.228.656,00	3,60
Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	DE0007165631		STK	400	400	0 EUR	282,300	112.920,00	0,33
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	9.200	7.500	0 EUR	215,100	1.978.920,00	5,80
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	9.200	9.200	0 EUR	175,900	1.618.280,00	4,74
Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25	FR0000130809		STK	6.200	820	5.320 EUR	25,390	157.418,00	0,46
Sopra Steria Group S.A. Actions Port. EO 1	FR0000050809		STK	800	130	930 EUR	206,000	164.800,00	0,48
Spie S.A. Actions Nom. EO 0,47	FR0012757854		STK	4.300	4.300	0 EUR	34,180	146.974,00	0,43
Talanx AG Namens-Aktien o.N.	DE000TLX1005		STK	5.700	5.700	0 EUR	70,700	402.990,00	1,18
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005239360		STK	27.700	12.200	0 EUR	34,580	957.866,00	2,81
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	FR0000125486		STK	11.200	8.400	0 EUR	110,250	1.234.800,00	3,62
Wendel SE Actions Port. EO 4	FR0000121204		STK	2.500	220	520 EUR	96,050	240.125,00	0,70
Wienerberger AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000831706		STK	2.400	2.400	0 EUR	33,560	80.544,00	0,24
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	30.524.459,95	89,41

Halbjahresbericht

HMT Euro Aktien Protect ESG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	-162.785,00	-0,48
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-189.580,00	-0,56
Wertpapier-Optionsrechte Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-189.580,00	-0,56
Optionsrechte auf Aktien							EUR	-189.580,00	-0,56
ASM INTL CALL 17.05.24 BP 580,00 EOE		203	STK	-200			EUR 27,620	-5.524,00	-0,02
ASML HOLDING CALL 17.05.24 BP 920,00 EUREX		185	STK	-1.500			EUR 2,130	-3.195,00	-0,01
ASML HOLDING CALL 21.06.24 BP 880,00 EUREX		185	STK	-1.800			EUR 21,190	-38.142,00	-0,11
CTS EVENT KGAA CALL 21.06.24 BP 76,00 EUREX		185	STK	-2.400			EUR 7,850	-18.840,00	-0,06
HANN.RUECKVER.AG CALL 17.05.24 BP 250,00 EUREX		185	STK	-2.500			EUR 0,080	-200,00	0,00
INFINEON TECH.AG CALL 21.06.24 BP 36,00 EUREX		185	STK	-18.000			EUR 0,700	-12.600,00	-0,04
SCHNEIDER ELEC. CALL 21.06.24 BP 172,00 EUREX		185	STK	-1.700			EUR 43,800	-74.460,00	-0,22
SIEMENS AG CALL 21.06.24 BP 180,00 EUREX		185	STK	-4.600			EUR 4,390	-20.194,00	-0,06
UNICREDIT S.p.A. CALL 20.06.24 BP 36,00 EUREX		185	STK	-15.000			EUR 1,095	-16.425,00	-0,05
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	26.795,00	0,08
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	9.070,00	0,03
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 21.06.24 EUREX		185	EUR	Anzahl -66				9.070,00	0,03
Optionsrechte							EUR	17.725,00	0,05
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	17.725,00	0,05
ESTX 50 PR.EUR PUT 17.05.24 BP 4500,00 EUREX		185		Anzahl 1350			EUR 3,500	4.725,00	0,01
ESTX 50 PR.EUR PUT 21.06.24 BP 4200,00 EUREX		185		Anzahl 2000			EUR 6,500	13.000,00	0,04

Halbjahresbericht

HMT Euro Aktien Protect ESG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	3.140.287,97	9,20
Bankguthaben							EUR	3.140.287,97	9,20
EUR - Guthaben bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			EUR	3.045.651,95			% 100,000	3.045.651,95	8,92
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland			USD	101.175,37			% 100,000	94.636,02	0,28
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	717.802,11	2,10
Zinsansprüche			EUR	7.079,95				7.079,95	0,02
Dividendenansprüche			EUR	36.860,00				36.860,00	0,11
Quellensteueransprüche			EUR	41.492,26				41.492,26	0,12
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	632.369,90				632.369,90	1,85
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-81.455,21	-0,24
Verwaltungsvergütung			EUR	-68.171,65				-68.171,65	-0,20
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.012,56				-1.012,56	0,00
Lagerstellenkosten			EUR	-1.071,00				-1.071,00	0,00
Prüfungskosten			EUR	-10.500,00				-10.500,00	-0,03
Veröffentlichungskosten			EUR	-700,00				-700,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	34.138.309,82	100,00 1)
HMT Euro Aktien Protect ESG Anteilklasse I									
Anteilwert			EUR					116,71	
Ausgabepreis			EUR					116,71	
Rücknahmepreis			EUR					116,71	
Anzahl Anteile			STK					282.226	

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect ESG

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
HMT Euro Aktien Protect ESG Anteilklasse R									
Anteilwert							EUR	115,98	
Ausgabepreis							EUR	119,46	
Rücknahmepreis							EUR	115,98	
Anzahl Anteile							STK	10.351	
Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind:				EUR	5.930.100,00				

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 ESG

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 30.04.2024 1,0691000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
203	Amsterdam Euronext Der.

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50	ES0167050915	STK	990	12.225	
Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	NL0012969182	STK	20	220	
Aedifica S.A. Actions au Port. o.N.	BE0003851681	STK	290	4.090	
Arcadis N.V. Aandelen aan toonder EO -,02	NL0006237562	STK	580	8.180	
ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN	LU1598757687	STK	0	10.200	
ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0011872643	STK	530	7.430	
Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072	STK	1.080	15.180	
Banco de Sabadell S.A. Acciones Nom. Serie A EO -,125	ES0113860A34	STK	17.340	245.540	
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37	STK	5.960	84.560	
Bankinter S.A. Acciones Nom. EO -,30	ES0113679I37	STK	3.650	51.750	
BAWAG Group AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000BAWAG2	STK	410	5.710	
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003	STK	260	3.560	
BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01	NL0012866412	STK	310	4.310	
Bechtle AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005158703	STK	570	7.970	
Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	FR0000120503	STK	630	8.830	
Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005313704	STK	170	2.370	
Cellnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -,25	ES0105066007	STK	650	9.150	
Cofinimmo S.A. Actions Porteur o.N.	BE0003593044	STK	270	3.770	
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000CBK1001	STK	1.920	27.020	
Covivio S.A. Actions Port. EO 3	FR0000064578	STK	380	5.280	
Davide Campari-Milano N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0015435975	STK	2.010	28.510	
Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N.	DE000A2E4K43	STK	620	8.620	
Deutsche Bank AG	DE0005140008	STK	1.720	24.220	
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	DE0005810055	STK	140	1.940	
E.ON SE Namens-Aktien o.N.	DE000ENAG999	STK	2.290	32.390	
Elia Group Actions au Port. o.N.	BE0003822393	STK	200	2.800	
Elis S.A. Actions au Porteur EO 1,-	FR0012435121	STK	1.470	20.770	
Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50	ES0130960018	STK	1.370	19.270	
ENI S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003132476	STK	0	20.200	
Erste Bk d. oest.Sparkassen AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000652011	STK	600	8.400	
Evotec SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0005664809	STK	1.300	18.400	

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 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
Finecobank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -,33	IT0000072170	STK	1.430	20.230	
FUCHS SE Namens-Vorzugsakt. o.St.o.N.	DE000A3E5D64	STK	600	8.400	
Heidelberg Materials AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006047004	STK	350	4.950	
HelloFresh SE Inhaber-Aktien o.N.	DE000A161408	STK	1.170	16.470	
IMCD N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0010801007	STK	130	1.830	
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202	STK	1.710	24.310	
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618	STK	9.580	135.580	
Italgas SpA	IT0005211237	STK	4.350	61.450	
Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Acções Nominativas EO 1	PTJMT0AE0001	STK	1.000	14.000	
Just Eat Takeaway.com N.V. Registered Shares EO -,04	NL0012015705	STK	1.110	15.610	
Klépierre S.A. Actions Port. EO 1,40	FR0000121964	STK	960	13.460	
Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom. EO 0,50	IT0000062957	STK	2.200	31.100	
Nexi S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0005366767	STK	2.950	41.850	
OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000743059	STK	0	6.100	
Orion Corp. Registered Shares Cl.B o.N.	FI0009014377	STK	480	6.780	
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	NL0013654783	STK	840	11.738	
Reply S.p.A. Azioni nom. EO 0,13	IT0005282865	STK	200	2.800	
Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0010451203	STK	1.030	14.530	
Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N.	FI4000552500	STK	460	6.360	
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600	STK	200	2.800	
Signify N.V. Registered Shares EO -,01	NL0011821392	STK	690	9.690	
Soitec S.A. Actions au Porteur EO 2	FR0013227113	STK	160	2.160	
Stora Enso Oyj Reg. Shares Cl.R EO 1,70	FI0009005961	STK	1.740	24.640	
Telecom Italia S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0003497168	STK	67.120	952.220	
Tenaris S.A. Registered Shares DL 1	LU2598331598	STK	1.500	21.100	
Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22	IT0003242622	STK	2.830	40.130	
Ubisoft Entertainment S.A. Actions Port. EO 0,0775	FR0000054470	STK	1.070	14.970	
Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	FR0013326246	STK	400	5.500	
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141	STK	820	11.620	
Warehouses De Pauw N.V. Actions Nom. o.N.	BE0974349814	STK	820	11.520	
Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N.	FI0009003727	STK	2.510	35.410	

Andere Wertpapiere

ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Anrechte	ES0667050908	STK	11.235	11.235	
----------------------------------------	--------------	-----	--------	--------	--

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Nichtnotierte Wertpapiere

Aktien

ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. -EM.01/24-	ES0167050253	STK	130	130	
---------------------------------------------------------	--------------	-----	-----	-----	--

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 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

Verkaufte Kontrakte:

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

EUR

3.507,47

Optionsrechte

Wertpapier-Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktien

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): ASML HOLDING EO -,09, DEUTSCHE BOERSE NA O.N., INFINEON
TECH.AG NA O.N., SAP SE O.N., SCHNEIDER ELEC. INH. EO 4)

EUR

131,99

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 ESG**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag derzeit (Angabe in %) *)	Verwaltungsvergütung derzeit (Angabe in % p.a.) *)	Ertragsverwendung	Währung
HMT Euro Aktien Protect ESG Anteilklasse I	100.000	0,00	0,800	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR
HMT Euro Aktien Protect ESG Anteilklasse R	keine	3,00	1,100	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR

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

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect ESG

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	89,41
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,48

Sonstige Angaben

HMT Euro Aktien Protect ESG Anteilklasse I

Anteilwert	EUR	116,71
Ausgabepreis	EUR	116,71
Rücknahmepreis	EUR	116,71
Anzahl Anteile	STK	282.226

HMT Euro Aktien Protect ESG Anteilklasse R

Anteilwert	EUR	115,98
Ausgabepreis	EUR	119,46
Rücknahmepreis	EUR	115,98
Anzahl Anteile	STK	10.351

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

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

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

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

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

**Halbjahresbericht
HMT Euro Aktien Protect ESG**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

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

Frankfurt am Main, den 2. Mai 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 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 3%

Mindestanlagesumme

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

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,80 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 1,10 % p.a.

Verwahrstellenvergütung

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

Erfolgsabhängige Vergütung

Anteilklasse I und R	derzeit 15 % der vom Fonds in der Abrechnungsperiode erzielten Wertsteigerung über dem Referenzwert (EURIBOR® 12M TR (EUR) zzgl. 4,00 %).
----------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse R	Euro

Ertragsverwendung

Anteilklasse I	Ausschüttung
Anteilklasse R	Ausschüttung

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	A2PS3G / DE000A2PS3G5
Anteilklasse R	A2PS3H / DE000A2PS3H3

Halbjahresbericht HMT Euro Aktien Protect 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

Gründung: 1968

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

Geschäftsführer:

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

Aufsichtsrat:

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

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