

**FCP nach französischem Recht
HSBC GLOBAL EMERGING
MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC**

Halbjahresbericht
zum Freitag, 30. Juni 2023

(ungeprüft)

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Aufstellung des Wertpapierportfolios in EUR

Elemente der Vermögensaufstellung	Betrag zum regelmäßigen Abschluss *
a) Zulässige Wertpapiere, genannt in 1° von I des Artikels L. 214-20 des französischen Code Monétaire et Financier	162.339.071,90
b) Bankguthaben	6.250.726,19
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	8.544.056,39
d) Summe der vom OGA gehaltenen Vermögenswerte (Zeilen a+b+c)	177.133.854,48
e) Passiva	-5.888.052,88
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	171.245.801,60

* Die Beträge sind laut der doppelten Buchführung mit einem Minuszeichen versehen

Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile und Nettoinventarwert pro Anteil

Anteil	Anteilsart	Nettovermögen je Anteil	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC	C	171.245.801,60	2.307.283,000	74,21

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Element des Wertpapierportfolios

Elemente des Wertpapierportfolios	Anteil am Nettovermögen *	Anteil am Gesamtvermögen **
A) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et Financier zum Handel zugelassen sind. Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt mit Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum gehandelt werden dürfen.	94,80	91,65
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt eines Drittlandes gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde AMF aufgestellten Liste aufgeführt ist oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften oder in dem Reglement oder der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.		
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen, genannt in 4° von I von Artikel R. 214-11 des französischen Code Monétaire et Financier.		
E) Die sonstigen Vermögenswerte.		

* *Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

** *Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Aufteilung der Vermögenswerte von A), B), C) und D) des Wertpapierportfolios
nach Wahrung

Wertpapiere	Wahrung	Betrag (EUR)	Anteil am Nettovermogen *	Anteil am Gesamtvermogen **
Euro	EUR	162.339.071,90	94,80	91,65
SUMME		162.339.071,90	94,80	91,65

* *Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

** *Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Aufteilung der Vermögenswerte von A), B), C) und D) des Wertpapierportfolios
nach Sitzland des Emittenten

Land	Anteil am Nettovermögen *	Anteil am Gesamtvermögen **
FRANKREICH	94,80	91,65
SUMME	94,80	91,65

* *Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

** *Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Aufteilung der sonstigen Vermögenswerte von E) des Wertpapierportfolios nach Art

Art der Vermögenswerte	Anteil am Nettovermögen *	Anteil am Gesamtvermögen **
Organismen für gemeinsame Anlagen		
OGAW und AIF allgemeiner Ausrichtung für nicht professionelle Anleger und entsprechende anderer Staaten		
Sonstige Fonds für nicht professionelle Anleger und entsprechende anderer EU-Mitgliedstaaten		
Professionellen Anleger vorbehaltene Fonds allgemeiner Ausrichtung und entsprechende anderer EU-Mitgliedstaaten und börsennotierte Verbriefungsorganismen		
Sonstige professionellen Anlegern vorbehaltene Investmentfonds und entsprechende anderer EU-Mitgliedstaaten und nicht börsennotierte Verbriefungsorganismen		
Sonstige nichteuropäische Organismen		
Sonstige Vermögenswerte		
Sonstige		
SUMME		

* *Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

** *Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen*

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Umschichtungen im Wertpapierportfolio im Laufe des Berichtszeitraums in EUR

Portfoliowertpapiere	Umschichtungen (Betrag)	
	Erwerbe	Veräußerungen
A) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et Financier zum Handel zugelassen sind. Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt mit Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum gehandelt werden dürfen.	308.100.134,21	301.412.841,21
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt eines Drittlandes gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde AMF aufgestellten Liste aufgeführt ist oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften oder in dem Reglement oder der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.		
D) Zulässige Wertpapiere aus Neuemissionen, genannt in 4° von I von Artikel R. 214-11 des französischen Code Monétaire et Financier.		
E) Die sonstigen Vermögenswerte.		

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Transparenz von Wertpapierfinanzierungen und Weiterverwendung von Finanzinstrumenten – SFTR-Verordnung – in der Fondswährung des OGA (EUR)

Wertpapier- leihgeschäfte als Verleiher	Wertpapier- leihgeschäfte als Entleiher	Pensions- geschäfte als Pensionsgeber	Pensions- geschäfte als Pensionsnehmer	TRS
---	---	---	--	-----

a) Verleihte Wertpapiere und Rohstoffe

Mindestbetrag					
% des Nettovermögens*					

* % ohne Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

b) Für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und TRS eingesetzte Vermögenswerte, ausgedrückt als absoluter Wert

Mindestbetrag					166.724.270,00
% des Nettovermögens					97,36 %

c) 10 wichtigste Emittenten erhaltener Sicherheiten (ohne Barmittel) für alle Arten von Finanzierungsgeschäften

--	--	--	--	--	--

c) 10 wichtigste Gegenparteien in absoluten Zahlen der Aktiva und Passiva ohne Aufrechnung

HSBC BANK FRANCE SA PARIS FRANKREICH					166.724.270,00
--	--	--	--	--	----------------

e) Art und Qualität der Sicherheiten

Art					
- Aktien					
- Anleihen					
- OGA					
- TCN					
- Barmittel					
Rating					
Währung der Sicherheit					
Euro					

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Wertpapier- leihgeschäfte als Verleiher	Wertpapier- leihgeschäfte als Entleiher	Pensions- geschäfte als Pensionsgeber	Pensions- geschäfte als Pensionsnehmer	TRS
---	---	---	--	-----

c) Abwicklung und Clearing von Kontrakten

Dreigeteilt				X	
Zentrale Gegenpartei					
Bilateral	X			X	

g) Fälligkeit der Sicherheit, aufgeschlüsselt nach Tranchen

Weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
Mehr als 1 Jahr					
Offen					

h) Fälligkeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und TRS nach Tranchen

Weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					166.724.270,00
Mehr als 1 Jahr					
Offen					

i) Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Höchstbetrag (%)					
Verwendeter Betrag (%)					
Erträge für den OGA infolge der Wiederanlage der Barsicherheiten in Euro					

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Wertpapier- leihgeschäfte als Verleiher	Wertpapier- leihgeschäfte als Entleiher	Pensions- geschäfte als Pensionsgeber	Pensions- geschäfte als Pensionsnehmer	TRS
---	---	---	--	-----

j) Angaben zur Verwahrung der vom OGA erhaltenen Sicherheiten

Caceis Bank.					
Wertpapiere					
- Barmittel					

k) Angaben zur Verwahrung von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten

Wertpapiere					
- Barmittel					

l) Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten

Erträge					
- OGA					
- Verwalter					
- Dritte					
Kosten					
- OGA					
- Verwalter					
- Dritte					

e) Angaben zur Art und Qualität der Sicherheiten (Sicherheit)

Die Art der als Sicherheit erhaltenen Wertpapiere wird durch die internen Richtlinien der HSBC-Gruppe bestimmt. Für den betreffenden OGA handelt es sich um Staatsanleihen oder ähnliche Wertpapiere mit gutem Rating in Bezug auf das Kreditrisiko.

i) Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Nicht betroffen.

k) Angaben zur Verwahrung von vom OGA bereitgestellten Sicherheiten

Für jede Gegenpartei ist die Verwaltung der Sicherheiten im Rahmenvertrag (CSA) in Übereinstimmung mit den Risiko- und Rechtsrichtlinien von HSBC festgelegt. Dieser Rahmenvertrag legt die Form der Sicherheit (Barmittel, Wertpapiere und verbundene Haircuts), Mindestbetrag für Nachschussforderungen sowie die anwendbare Gebührenfreiheit fest.

l) Aufgeschlüsselte Angaben zu Erträgen und Kosten

Alle relevanten Erträge kommen dem OGA zugute.
Alle relevanten Kosten werden vom OGA getragen.

FCP HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS PROTECT 80 DYNAMIC

Wertpapierportfolio zum 30.06.2023 in EUR

Wertpapier	Währung	Stück oder nominal	Zeitwert	% Nettovermögen
Schuldtitel				
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel				
FRANKREICH				
0473820FRENCH R ZCP 020823	EUR	29.000.000	28.920.678,91	16,89
FRANCE TREASURY BILL ZCP 130923	EUR	24.000.000	23.834.061,15	13,92
FRANCE TREASURY BILL ZCP 160823	EUR	29.000.000	28.884.777,48	16,87
FRENCH REPUBLIC ZCP 20-09-23	EUR	25.000.000	24.815.679,40	14,49
FREN REP PRES ZCP 09-08-23	EUR	28.000.000	27.907.819,69	16,29
FREN REP PRES ZCP 12-07-23	EUR	28.000.000	27.976.055,27	16,34
FRANKREICH INSGESAMT			162.339.071,90	94,80
An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Schuldtitel			162.339.071,90	94,80
Schuldtitel INSGESAMT			162.339.071,90	94,80
Finanztermingeschäfte				
Fixe Termingeschäfte				
Fixe Termingeschäfte an geregelten oder ähnlichen Märkten				
MME MSCI EMER 0923	USD	2.299	-1.274.609,07	-0,74
SUMME Fixe Termingeschäfte an geregelten oder ähnlichen Märkten			-1.274.609,07	-0,74
Feste Termingeschäfte INSGESAMT			-1.274.609,07	-0,74
Andere Finanztermingeschäfte				
Sonstige Swaps				
GAP SWAP 31-01-23	EUR	166.724.270	-235.236,62	-0,14
Sonstige Swaps INSGESAMT			-235.236,62	-0,14
Andere Finanztermingeschäfte INSGESAMT			-235.236,62	-0,14
SUMME Finanztermingeschäfte			-1.509.845,69	-0,88
Nachschussforderungen				
NACHSCHUSSFORDERUNG CACEIS	USD	1.436.578,5	1.316.753,90	0,77
SUMME Nachschussforderungen			1.316.753,90	0,77
Forderungen			7.227.302,49	4,22
Verbindlichkeiten			-4.378.207,19	-2,56
Finanzkonten			6.250.726,19	3,65
Nettovermögen			171.245.801,60	100,00