



HALBJAHRESBERICHT

HMT CORPORATES RISKCONTROL

OGAW-SONDERVERMÖGEN
NACH DEUTSCHEM RECHT



ZUM 30. APRIL 2018

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

Vermögensübersicht

			Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände				
1. Anleihen				
– Unternehmensanleihen		EUR	28.227.722,50	97,74
2. Derivate				
– Futures (Verkauf)		EUR	-59.340,00	-0,21
– Futures (Kauf)		EUR	6.600,00	0,02
3. Bankguthaben				
– Bankguthaben in EUR		EUR	368.933,43	1,28
4. Sonstige Vermögensgegenstände		EUR	377.763,08	1,31
II. Verbindlichkeiten				
1. Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-39.875,58	-0,14
		EUR	28.881.803,43	100,00¹

¹ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	26.921.709,50	93,22
Verzinsliche Wertpapiere									
XS1501367921	1,000% Lanxess MTN 07.10.26	EUR	350	0	0	% 96,7740	338.709,00	1,17	
DE000A2BPET2	1,375% ThyssenKrupp MTN 03.03.22	EUR	200	0	300	% 101,2950	202.590,00	0,70	
XS1425274484	2,250% HeidelbergCement MTN 03.06.24	EUR	100	0	0	% 106,5870	106.587,00	0,37	
XS1387174375	2,250% HeidelbergCement MTN 30.03.23	EUR	200	0	0	% 106,9560	213.912,00	0,74	
XS1591416679	2,625% K+S Anl. 06.04.23	EUR	300	0	0	% 104,8140	314.442,00	1,09	
XS1152338072	2,625% Merck Nts. 12.12.74V	EUR	200	0	0	% 104,9910	209.982,00	0,73	
XS1219498141	2,750% RWE Anl. 21.04.75V	EUR	200	0	0	% 103,1900	206.380,00	0,71	
DE000A11QR65	3,000% Bayer MTN 01.07.75V	EUR	250	0	0	% 104,2250	260.562,50	0,90	
DE000A1PGZ82	3,000% K+S Anl. 20.06.22	EUR	200	0	0	% 107,0510	214.102,00	0,74	
DE000A1R0410	3,125% ThyssenKrupp MTN 25.10.19	EUR	300	0	0	% 103,7010	311.103,00	1,08	
XS1490153886	3,250% IHO Verwaltungs GmbH Nts. 15.09.23	EUR	300	0	0	% 103,3890	310.167,00	1,07	
XS1222594472	3,500% Bertelsmann Anl. 23.04.75V	EUR	200	0	0	% 103,2020	206.404,00	0,71	
XS1044811591	3,625% EnBW Energie Baden-Württemberg Anl. 02.04.76V	EUR	200	0	0	% 106,7150	213.430,00	0,74	
XS1586555606	0,500% Volkswagen International Finance Nts. 30.03.21	EUR	300	0	0	% 100,6590	301.977,00	1,05	
XS1716243719	0,625% Philip Morris International Nts. 08.11.24	EUR	400	400	0	% 96,9900	387.960,00	1,34	
DE000A185QB3	0,750% Evonik Finance MTN 07.09.28	EUR	500	0	0	% 92,6820	463.410,00	1,60	
XS1571293171	0,875% Ericsson MTN 01.03.21	EUR	300	0	0	% 100,1310	300.393,00	1,04	
FR0013330115	0,875% Thales MTN 19.04.24	EUR	500	800	300	% 100,0420	500.210,00	1,73	
FR0013282571	0,875% Vivendi MTN 18.09.24	EUR	200	0	0	% 99,1540	198.308,00	0,69	
XS1730873731	0,950% ArcelorMittal MTN 17.01.23	EUR	200	300	100	% 98,8360	197.672,00	0,68	

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	%	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
FR0013327962	1,000% Capgemini Nts. 18.10.24	EUR	200	200	0	%	99,6020	199.204,00	0,69
XS1611167856	1,000% Hella Finance Nts. 17.05.24	EUR	100	0	0	%	100,6310	100.631,00	0,35
XS1709433509	1,000% PostNL Nts. 21.11.24	EUR	200	200	0	%	99,4210	198.842,00	0,69
XS1664644710	1,125% BAT Capital MTN 16.11.23	EUR	100	0	0	%	100,4210	100.421,00	0,35
XS1505884723	1,125% easyJet MTN 18.10.23	EUR	300	0	0	%	100,6860	302.058,00	1,05
XS1471646965	1,125% EDP Finance MTN 12.02.24	EUR	300	0	0	%	100,8140	302.442,00	1,05
XS1578294081	1,125% Italgas MTN 14.03.24	EUR	400	0	0	%	100,9600	403.840,00	1,40
XS1485533431	1,125% Koninklijke KPN MTN 11.09.28	EUR	300	0	0	%	94,9600	284.880,00	0,99
XS1199964575	1,125% Ryanair MTN 10.03.23	EUR	300	0	0	%	101,7190	305.157,00	1,06
XS1622624242	1,250% Allergan Funding Nts. 01.06.24	EUR	300	0	0	%	98,5730	295.719,00	1,02
XS1788605936	1,250% Securitas MTN 06.03.25	EUR	200	200	0	%	99,8770	199.754,00	0,69
ES0211845302	1,375% Abertis Infraestructuras OBL 20.05.26	EUR	200	0	0	%	97,9970	195.994,00	0,68
XS1627193359	1,375% Compagnie de Saint-Gobain MTN 14.06.27	EUR	300	0	300	%	99,4540	298.362,00	1,03
XS1505896735	1,375% CRH Finance MTN 18.10.28	EUR	300	0	0	%	96,6270	289.881,00	1,00
XS1170307414	1,375% Gas Natural Fenosa Finance MTN 21.01.25	EUR	200	0	0	%	101,6750	203.350,00	0,70
XS1405766624	1,375% Verizon Communications Nts. 02.11.28	EUR	200	0	0	%	96,1210	192.242,00	0,67
XS1651071877	1,400% Thermo Fisher Scientific Nts. 23.01.26	EUR	300	0	0	%	100,0840	300.252,00	1,04
FR0013252277	1,500% Arkema MTN 20.04.27	EUR	300	0	0	%	101,1240	303.372,00	1,05
XS1382791975	1,500% Deutsche Telekom Internat. Finance MTN 03.04.28	EUR	300	0	0	%	99,8190	299.457,00	1,04
XS1180451657	1,500% ENI MTN 02.02.26	EUR	200	0	0	%	102,1950	204.390,00	0,71
XS1629387462	1,500% HeidelbergCement Finance Luxembourg MTN 14.06.27	EUR	200	0	0	%	98,5520	197.104,00	0,68
XS1704789590	1,500% Iren MTN 24.10.27	EUR	300	0	0	%	97,3850	292.155,00	1,01
FR0013248465	1,500% Téléperformance Nts. 03.04.24	EUR	200	0	0	%	101,3050	202.610,00	0,70
XS1652855815	1,500% Vodafone Group MTN 24.07.27	EUR	200	0	0	%	98,1480	196.296,00	0,68
XS1627947440	1,625% Aeroporti di Roma MTN 08.06.27	EUR	400	0	0	%	101,2060	404.824,00	1,40
XS1322048619	1,625% Amadeus Capital Markets MTN 17.11.21	EUR	400	0	0	%	104,8330	419.332,00	1,45
XS1558491855	1,625% Atlantia MTN 03.02.25	EUR	200	0	0	%	101,4520	202.904,00	0,70
XS1771723167	1,625% McKesson Nts. 30.10.26	EUR	200	200	0	%	101,0120	202.024,00	0,70
FR0012384667	1,625% Publicis Groupe Nts. 16.12.24	EUR	400	0	200	%	104,1630	416.652,00	1,44
XS1765875718	1,625% Societa Iniziative Autostr. e Servizi MTN 08.02.28	EUR	300	300	0	%	98,9350	296.805,00	1,03
BE6282459609	1,625% Solvay Nts. 02.12.22	EUR	300	0	0	%	104,8320	314.496,00	1,09
XS1792505866	1,694% General Motors Financial MTN 26.03.25	EUR	500	500	0	%	101,5680	507.840,00	1,76

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	%	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
XS1789699607	1,750% A.P.Møller-Mærsk MTN 16.03.26	EUR	200	200	0	%	99,3900	198.780,00	0,69
XS1292988984	1,750% ENI MTN 18.01.24	EUR	200	0	0	%	105,5800	211.160,00	0,73
XS1810653540	1,750% Heidelberg Cement Finance Luxembourg MTN 24.04.28	EUR	400	400	0	%	99,0610	396.244,00	1,37
XS1291004270	1,750% Iberdrola International MTN 17.09.23	EUR	200	0	0	%	105,8830	211.766,00	0,73
XS1811198701	1,750% Sydney Airport Finance MTN 26.04.28	EUR	100	100	0	%	100,3930	100.393,00	0,35
XS1645722262	1,875% Atlantia MTN 13.07.27	EUR	300	0	0	%	100,3250	300.975,00	1,04
XS1586555945	1,875% Volkswagen International Finance MTN 30.03.27	EUR	200	0	0	%	101,8640	203.728,00	0,71
XS1117298247	1,900% Discovery Communications Nts. 19.03.27	EUR	500	0	0	%	98,7610	493.805,00	1,71
FR0010154385	1,941% Casino, Guichard-Perrachon Nts. 20.04.2167V	EUR	50	0	0	%	73,4620	36.731,00	0,13
XS1375957294	1,953% BP Capital Markets MTN 03.03.25	EUR	350	0	0	%	106,4630	372.620,50	1,29
XS1117296381	2,000% Mohawk Industries Nts. 14.01.22	EUR	200	0	0	%	105,3490	210.698,00	0,73
XS1577731604	2,000% Nokia MTN 15.03.24	EUR	200	0	0	%	101,0620	202.124,00	0,70
FR0013323326	2,000% Peugeot MTN 20.03.25	EUR	200	200	0	%	100,1690	200.338,00	0,69
AT0000A20F93	2,000% Wienerberger SV 02.05.24	EUR	100	100	0	%	102,4050	102.405,00	0,35
XS1520907814	2,125% AbbVie Nts. 17.11.28	EUR	400	0	0	%	103,1370	412.548,00	1,43
XS1239586594	2,125% ESB Finance MTN 08.06.27	EUR	200	0	0	%	106,9320	213.864,00	0,74
FR0012173862	2,125% Pernod-Ricard Bds. 27.09.24	EUR	300	0	300	%	107,5060	322.518,00	1,12
XS1420338102	2,250% Holcim Finance Luxembourg MTN 26.05.28	EUR	250	0	0	%	103,6250	259.062,50	0,90
XS1195201931	2,250% Total MTN 26.02.99V	EUR	300	0	0	%	103,4470	310.341,00	1,07
XS1468525057	2,375% Cellnex Telecom MTN 16.01.24	EUR	400	0	0	%	101,7960	407.184,00	1,41
XS1698218523	2,375% Telecom Italia MTN 12.10.27	EUR	400	0	0	%	99,5870	398.348,00	1,38
ES0211845294	2,500% Abertis Infraestructuras OBL 27.02.25	EUR	200	0	200	%	107,8460	215.692,00	0,75
ES0205032008	2,500% Ferrovial Emisiones Nts. 15.07.24	EUR	300	0	500	%	108,5550	325.665,00	1,13
XS1067329570	2,500% Wolters Kluwer Nts. 13.05.24	EUR	300	0	0	%	109,2400	327.720,00	1,13
XS1087831688	2,625% ACEA MTN 15.07.24	EUR	300	0	300	%	108,8830	326.649,00	1,13
XS1785467751	2,625% Faurecia Nts. 15.06.25	EUR	200	200	0	%	101,7860	203.572,00	0,70
XS1117298759	2,750% Smurfit Kappa Acquisitions Nts. 01.02.25	EUR	200	0	300	%	105,2450	210.490,00	0,73
XS0222524372	2,771% Südzucker International Fin. Bds. 30.06.99V	EUR	50	0	0	%	97,6850	48.842,50	0,17
XS1041934800	2,875% Gas Natural Fenosa Finance MTN 11.03.24	EUR	200	0	300	%	110,9820	221.964,00	0,77
XS0811555183	2,875% Heineken MTN 04.08.25	EUR	400	0	0	%	112,9340	451.736,00	1,56
XS0940293763	3,000% CEZ MTN 05.06.28	EUR	200	0	0	%	111,2390	222.478,00	0,77
XS1078218218	3,000% Sandvik MTN 18.06.26	EUR	300	0	500	%	113,2060	339.618,00	1,18
XS1205618470	3,000% Vattenfall Secs. 19.03.77V	EUR	100	0	0	%	100,1440	100.144,00	0,35

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
XS1814065345	3,250% Gestamp Automoción Nts. 30.04.26	EUR	200	200	0	%	98,9140	197.828,00	0,68
XS1019326641	3,250% Snam MTN 22.01.24	EUR	500	0	0	%	113,6370	568.185,00	1,97
XS1040508241	3,375% Imperial Brands Finance MTN 26.02.26	EUR	300	0	300	%	112,5980	337.794,00	1,17
XS0975256685	3,625% Repsol International Finance MTN 07.10.21	EUR	200	0	300	%	111,6390	223.278,00	0,77
XS0907289978	3,961% Telefonica Emisiones MTN 26.03.21	EUR	100	0	0	%	111,1690	111.169,00	0,38
XS1028600473	4,250% Orange MTN 07.02.99	EUR	100	0	0	%	106,7960	106.796,00	0,37
XS0553728709	4,500% Deutsche Telekom International Fin. MTN 28.10.30	EUR	200	0	300	%	130,1320	260.264,00	0,90
XS1028959671	4,625% Vonovia Finance Nts. 08.04.74V	EUR	400	0	0	%	103,7050	414.820,00	1,44
XS1048568452	4,750% Fiat Chrysler Finance Europe MTN 22.03.21	EUR	150	0	0	%	111,7510	167.626,50	0,58
XS0970695572	4,875% EDP Finance MTN 14.09.20	EUR	200	0	0	%	111,3100	222.620,00	0,77
XS0943371194	4,875% Orsted Sec. 08.07.10V	EUR	200	0	0	%	100,9610	201.922,00	0,70
XS1014997073	5,000% ENEL Bds. 15.01.75V	EUR	100	0	0	%	107,4840	107.484,00	0,37
XS1050460739	5,000% Telefónica Europe Secs. 31.03.99V	EUR	200	0	0	%	107,7870	215.574,00	0,75
XS0880764435	5,200% Hera MTN 29.01.28	EUR	200	0	300	%	131,6160	263.232,00	0,91
FR0011215508	5,244% Casino, Guichard-Perrachon MTN 09.03.20	EUR	100	0	0	%	107,9830	107.983,00	0,37
FR0011052661	5,976% Casino, Guichard-Perrachon MTN 26.05.21	EUR	200	0	0	%	112,7960	225.592,00	0,78
XS0954675129	6,500% ENEL Bds. 10.01.74V	EUR	200	0	700	%	104,4650	208.930,00	0,72
XS0953215349	6,750% Fiat Chrysler Finance Europe MTN 14.10.19	EUR	300	0	400	%	109,6060	328.818,00	1,14
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	1.306.013,00	4,52
Verzinsliche Wertpapiere									
XS1788515788	1,125% Metro MTN 06.03.23	EUR	400	400	0	%	99,2930	397.172,00	1,38
XS1778825262	1,050% AT&T Nts. 05.09.23	EUR	300	300	0	%	100,9400	302.820,00	1,05
XS1716833352	2,125% Rexel Nts. 15.06.25	EUR	100	100	0	%	97,1110	97.111,00	0,34
XS1808984501	3,625% Piaggio & C. Nts. 30.04.25	EUR	100	100	0	%	102,3300	102.330,00	0,35
XS0969340768	5,125% América Móvil Secs. 06.09.73V	EUR	400	0	0	%	101,6450	406.580,00	1,41
Summe Wertpapiervermögen²							EUR	28.227.722,50	97,74

Vermögensaufstellung zum 30.04.2018

Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
Zins-Derivate						EUR	-52.740,00	-0,19
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsterminkontrakte								
6,000% Euro Bobl Future 06/18	EDT	EUR	-2.300.000				-13.110,00	-0,05
6,000% Euro Bund Future 06/18	EDT	EUR	400.000				6.600,00	0,02
6,000% Long Term Euro OAT Future 06/18	EDT	EUR	-2.300.000				-46.230,00	-0,16
Bankguthaben								
						EUR	368.933,43	1,28
EUR-Guthaben bei:								
Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	368.933,43			% 100,0000	368.933,43	1,28
Sonstige Vermögensgegenstände								
						EUR	377.763,08	1,31
Einschüsse (Initial Margin)		EUR	70.005,13				70.005,13	0,24
Variation Margin		EUR	52.740,00				52.740,00	0,18
Zinsansprüche		EUR	255.017,95				255.017,95	0,89
Sonstige Verbindlichkeiten								
						EUR	-39.875,58	-0,14
Kostenabgrenzung		EUR	-39.875,58				-39.875,58	-0,14
Fondsvermögen								
						EUR	28.881.803,43	100,00 ³
Anteilwert HMT Corporates RiskControl						EUR	49,10	
Umlaufende Anteile HMT Corporates RiskControl						STK	588.252	
² Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.								
³ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.								
Marktschlüssel								
b) Terminbörse								
EDT	EUREX Terminbörse Deutschland							

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

– Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS1619283218	0,250% Bertelsmann MTN 26.05.21	EUR	0	500
XS1616407869	0,000% Amadeus Capital Markets MTN 19.05.19	EUR	0	300
DE000A19HBM3	0,000% Daimler International Finance MTN 11.05.22V	EUR	0	500
XS1057486471	0,271% Volkswagen International Finance MTN 15.04.19V	EUR	0	400
XS1363560548	0,321% BMW Finance MTN 15.07.19V	EUR	0	400
XS1567173809	0,625% McKesson Nts. 27.08.21	EUR	0	300
FR0013257623	0,750% LVMH MTN 26.05.24	EUR	0	300
FR0013241536	0,750% Orange MTN 11.09.23	EUR	0	400
BE6276039425	0,800% Anheuser-Busch InBev MTN 20.04.23	EUR	0	400
XS1554373164	0,875% Fresenius Finance Ireland MTN 31.01.22	EUR	0	600
XS1629865897	1,050% AT&T Nts. 04.09.23	EUR	0	300
XS1082970853	1,375% Tesco MTN 01.07.19	EUR	0	300
XS1139315581	1,375% Total Capital International MTN 19.03.25	EUR	0	300
FR0012861821	1,500% Aéroports de Paris OBL 24.07.23	EUR	0	200
BE6276040431	1,500% Anheuser-Busch InBev MTN 18.04.30	EUR	0	300
FR0013044278	1,500% APRR Nts. 15.01.24	EUR	0	100
FR0012663169	1,590% Veolia Environnement MTN 10.01.28	EUR	0	400
XS1412711217	1,625% ENI MTN 17.05.28	EUR	0	300
XS1346872580	1,625% Mondelez International Nts. 20.01.23	EUR	0	400
XS1316569638	1,875% Autostrade per L'Italia MTN 04.11.25	EUR	0	150
XS1116408235	1,875% Iberdrola International MTN 08.10.24	EUR	0	500
XS1077584024	1,875% Ryanair MTN 17.06.21	EUR	0	400
FR0013323326	2,000% Peugeot MTN 20.03.25	EUR	200	200
XS1040506112	2,177% BP Capital Markets MTN 28.09.21	EUR	0	300
XS1080163964	2,500% Sodexo Nts. 24.06.26	EUR	0	200
FR0011769090	3,125% Renault MTN 05.03.21	EUR	0	400
XS1409506885	3,500% Rexel Nts. 15.06.23	EUR	0	300
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS1611042646	0,800% Kellogg Nts. 17.11.22	EUR	0	500

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Terminkontrakte				
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte: Euro Bund Future)	EUR			5.125
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte: Euro Bobl Future, Euro Bund Future, Euro-BTP Future, Long Term Euro OAT Future)	EUR			14.689
Sondervermögen HMT Corporates RiskControl				
Mindestanlagesumme				keine
Fondsaufgabe				03.08.2012
Ausgabeaufschlag			bis zu 2,00%; derzeit 2,00%	
Rücknahmeabschlag				0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.			derzeit 0,20%; mindestens 20.000,00 EUR	
Stückelung				Globalurkunde
Ertragsverwendung				ausschüttend
Währung				EUR
ISIN				DE000A1JLSJ7

Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

Anteilwert HMT Corporates RiskControl	EUR	49,10
Umlaufende Anteile HMT Corporates RiskControl	STK	588.252

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der Société Générale Securities Services GmbH mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses bei der Société Générale Securities Services GmbH einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand einer weiteren unabhängigen Modellierung verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Für die im Sondervermögen HMT Corporates RiskControl zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

97,74% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse
0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (u.a. anhand der Quelle Interactive Data, indikativer Quotes bzw. Bewertungsmodellen).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder – sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist – auf Basis von Börsenkursen.
Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.
