

HMT Corporates RiskControl Short Duration

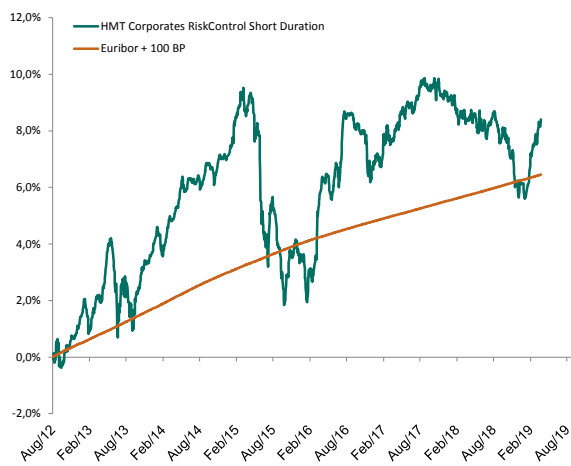
Fondscharakteristik

Der HMT Corporates RiskControl Short Duration soll einen langfristigen Vermögenszuwachs an den europäischen Unternehmensanleihemärkten erzielen. Dafür wird schwerpunktmäßig in auf Euro denominated Corporate Bonds investiert. Die damit verbundenen Ausfallrisiken einzelner Emittenten werden täglich systematisch und datenbankunterstützt überwacht. Die maximale Duration des Fonds beträgt 3,5. Das mittlere Renditeziel über einen Investmentzyklus von 5 Jahren beträgt Euribor + 100 BP p.a.

Anlagestrategie

Der Fonds investiert schwerpunktmäßig in europäische Unternehmensanleihen, die in Euro denominated sind und über ein Mindestrating von B-/B3 verfügen. Sowohl die Einzeltitelselektion als auch das Management der Ausfallrisiken auf Einzeltitelebene erfolgen täglich systematisch daten-bankunterstützt (Alpha-Erzielung). Kursrisiken aus allgemeinen Renditeanstiegen können mit Hilfe börsen-gelisteter Derivate abgesichert werden (Beta-Steuerung).

Wertentwicklung des Fonds (seit Auflage*)



Quelle: Universal-Investment, Bloomberg, eigene Berechnung

Monatliche Performancezahlen in %

Performance	2019		
	absolut	Euribor + 100BP	ggü. Euribor + 100BP
Januar	0,40%	0,06%	0,34%
Februar	0,96%	0,05%	0,90%
März	0,76%	0,06%	0,70%
April			
Mai			
Juni			
Juli			
August			
September			
Oktober			
November			
Dezember			

Jährliche Wertentwicklung (in %)

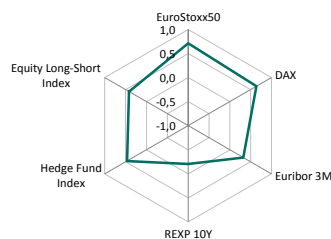
	absolut	Euribor + 100BP	ggü. Euribor + 100BP
2012	1,50%	0,53%	0,97%
2013	2,66%	1,24%	1,42%
2014	2,86%	1,23%	1,63%
2015	-3,55%	1,00%	-4,55%
2016	3,58%	0,75%	2,83%
2017	1,96%	0,68%	1,28%
2018	-2,78%	0,69%	-3,47%
2019	2,13%	0,17%	1,96%
seit Auflage*	8,40%	6,47%	1,93%

* Fondsaufgabe am 3. August 2012

Risikokennzahlen

Maximum Drawdown	Volatilität, Sharpe Ratio, VaR
Max. Drawdown	-7,00%
Time to Recover	481
Max. Drawdown 1 Monat	-3,67%
annualisierte Volatilität	1,91 %
Sharpe Ratio	0,19
Value at Risk (99%, 10d)	0,89%

Korrelation mit anderen Anlageklassen



Fondskennzahlen

WKN / ISIN	A1JLSJ / DE000A1JLSJ7
Fondsvolumen	32,49 Mio. €
KAG	SGSS Deutschland Kapitalanlagegesellschaft mbH
Asset Manager	HM Trust AG
Ausgabeaufschlag	bis zu 2%
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Verwaltungsvergütung	bis zu 0,40%
Depotbankvergütung	0,04%
Management-Fee	0,25% + performanceabh. Vergütung (15% der Out-performance ggü. „Euribor 3 Monate plus 100 Basispunkte“)
Geschäftsjahr	1.11. - 31.10.

Alle Angaben beruhen auf Quellen, die wir für zuverlässig halten, für deren Richtigkeit und Vollständigkeit wir jedoch keine Gewähr übernehmen können. Die Ermittlung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI-Methode. Historische Wertentwicklungen sind keine Garantie für eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft. Das vorgestellte Produkt weist aufgrund seiner Zusammensetzung und seiner Anlagepolitik ein nicht auszuschließendes Risiko erhöhter Volatilität, d.h. in kurzen Zeiträumen nach oben oder unten schwankender Anteile, auf. Diese Unterlage stellt keine Anlageberatung oder Aufforderung zum Kauf oder Verkauf für das Produkt dar, sondern dient ausschließlich der Information. Anlageentscheidungen sollten nur auf der Grundlage der aktuellen Verkaufsunterlagen (Wesentliche Anlegerinformationen, Verkaufsprospekt, Jahres- und Halbjahresbericht) getroffen werden, die auch die allein maßgeblichen Anlagebedingungen enthalten. Die Verkaufsunterlagen für das Sondervermögen sind bei der Verwahrstelle, der Kapitalverwaltungsgesellschaft (Société Générale Securities Services GmbH, Apianstraße 5, 85774 Unterföhring, Tel. 089-33033-0) und den Vertriebspartnern kostenlos erhältlich. Die Verkaufsunterlagen sind zudem im Internet unter www.securities-services.societegenerale.com verfügbar. Weder Société Générale Securities Services noch die HMT AG übernehmen irgendeine Art von Haftung für die Verwendung dieser Werbeunterlagen (im Sinne des § 31 Abs. 2 WPHG) oder deren Inhalt. Änderungen dieser Unterlage oder deren Inhalt bedürfen der vorherigen ausdrücklichen Erlaubnis der HMT AG. Alle von der HMT verwendeten Ratings sind konform mit der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 und stammen von in der EU registrierten Ratingagenturen.