



HMT Euro AR Saisonalitäten

Fondscharakteristik

Der Fonds HMT Euro Absolute Return Saisonalitäten strebt einen langfristigen Vermögenszuwachs an. Der aktiv verwaltete Fonds investiert schwerpunktmäßig in passiv verwaltete Indexfonds sowie Futures. Der Fonds muss zu mindestens 51% in Investmentanteilen anlegen, die überwiegend in Aktien oder aktienähnliche Wertpapiere investieren oder die darauf ausgerichtet sind, einen Aktienindex nachzubilden. Das mittlere Renditeziel über einen Investmentzyklus von 5 Jahren beträgt 3-4% p.a.

Anlagestrategie

Die Grundlage für die angestrebte langfristig positive Wertentwicklung des Mandates bilden an den Kapitalmärkten zu beobachtende saisonale Muster. Zu unterschiedlichen Zeitpunkten werden verschiedene Branchen des STOXX Europe 600 unter- bzw. übergewichtet, um von den historischen saisonalen Mustern zu profitieren. Das Marktpreisrisiko des HMT Euro Absolute Return Saisonalitäten ist zudem weitgehend abgesichert. Nach saisonalen Mustern werden kleinere Risikopositionen an den europäischen Aktienmärkten eingegangen.

Wertentwicklung des Fonds (seit Auflage*)



Monatliche Performancezahlen in %

Performance	2018
	absolut
Januar	0,49%
Februar	-1,08%
März	-1,15%
April	-0,71%
Mai	1,52%
Juni	
Juli	
August	
September	
Oktober	
November	
Dezember	

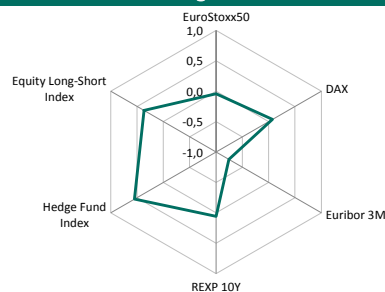
Jährliche Wertentwicklung (in %)

	absolut
2016	-1,90%
2017	0,17%
seit Auflage*	-2,67%

Risikokennzahlen**

Maximum Drawdown	Volatilität, Sharpe Ratio, VaR
Max. Drawdown	-5,44%
Time to Recover	--
Max. Drawdown 1 Monat	-3,38%
annualisierte Volatilität	5,36 %
	Sharpe Ratio
	-0,86
	Value at Risk (99%, 10d)
	2,48%

Korrelation mit anderen Anlageklassen



Fondskennzahlen

WKN / ISIN	A2AJJQ / DE000A2AJJQ2
Fondsvolumen	9,71 Mio. €
KVG	SGSS Deutschland Kapitalanlagegesellschaft mbH
Asset Manager	HMT Trust AG
Ausgabeaufschlag	bis zu 3%
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Verwaltungsvergütung	bis zu 0,50%
Verwahrstellenvergütung	0,04%
Management-Fee	0,40% + performanceabh. Vergütung (15% der Out-performance ggü. „Euribor 3 Monate plus 200 Basispunkte“)
Geschäftsjahr	1.11. - 31.10.

* Fondsaufgabe am 16. September 2016. Datenquelle: SGSS und Bloomberg.

** Die Risikokennzahlen beziehen sich bisher nur auf den Zeitraum seit Fondsaufgabe und besitzen daher nur eingeschränkte Aussagekraft.

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 Werbeunterlage (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