

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. APRIL 2024

VERWAHRSTELLE:



HAUCK
AUFHÄUSER
LAMPE

ASSET MANAGEMENT:



Halbjahresbericht

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

Vermögensübersicht zum 30.04.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	20.423.604,96	100,15
1. Aktien	18.420.635,30	90,33
Bundesrep. Deutschland	635.082,90	3,11
Canada	546.653,77	2,68
Finnland	888.866,88	4,36
Frankreich	2.246.690,46	11,02
Italien	935.532,61	4,59
Niederlande	448.645,00	2,20
Norwegen	870.288,07	4,27
Österreich	397.424,80	1,95
Schweden	1.042.892,55	5,11
USA	10.408.558,26	51,04
2. Derivate	191.175,61	0,94
3. Bankguthaben	1.761.313,07	8,64
4. Sonstige Vermögensgegenstände	50.480,98	0,25
II. Verbindlichkeiten	-30.622,27	-0,15
III. Fondsvermögen	20.392.982,69	100,00

Halbjahresbericht

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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	18.420.635,30	90,33
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	18.420.635,30	90,33
Aktien							EUR	18.420.635,30	90,33
Finning International Inc. Registered Shares o.N.	CA3180714048		STK	18.588	18.588	0	CAD 43,190	546.653,77	2,68
A2A S.p.A. Azioni nom. EO 0,52	IT0001233417		STK	262.238	262.238	0	EUR 1,856	486.582,61	2,39
Alten S.A. Actions au Porteur EO 1,05	FR0000071946		STK	3.282	3.282	0	EUR 110,700	363.317,40	1,78
Andritz AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000730007		STK	7.732	7.732	0	EUR 51,400	397.424,80	1,95
Eiffage S.A. Actions Port. EO 4	FR0000130452		STK	4.458	4.458	0	EUR 100,300	447.137,40	2,19
Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60	NL0006294274		STK	5.300	5.300	0	EUR 84,650	448.645,00	2,20
GEA Group AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006602006		STK	11.799	11.799	0	EUR 37,900	447.182,10	2,19
Hornbach Holding AG&Co.KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0006083405		STK	2.553	2.553	0	EUR 73,600	187.900,80	0,92
Huhtamäki Oyj Registered Shares o.N.	FI0009000459		STK	11.786	11.786	0	EUR 35,960	423.824,56	2,08
Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1	FR0010259150		STK	4.482	4.482	0	EUR 114,100	511.396,20	2,51
Konecranes Oyj Registered Shares o.N.	FI0009005870		STK	9.391	9.391	0	EUR 49,520	465.042,32	2,28
Reply S.p.A. Azioni nom. EO 0,13	IT0005282865		STK	3.650	3.650	0	EUR 123,000	448.950,00	2,20
Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0010451203		STK	19.422	19.422	0	EUR 24,430	474.479,46	2,33
SEB S.A. Actions Port. EO 1	FR0000121709		STK	4.050	4.050	0	EUR 111,200	450.360,00	2,21
Orkla ASA Navne-Aksjer NK 1,25	NO0003733800		STK	67.357	67.357	0	NOK 75,800	431.239,55	2,11
Salmar ASA Navne-Aksjer NK -,25	NO0010310956		STK	7.410	7.410	0	NOK 701,500	439.048,52	2,15
AAK AB Namn-Aktier SK 1,67	SE0011337708		STK	22.372	22.372	0	SEK 284,600	542.617,28	2,66
Thule Group AB (publ) Namn-Aktier o.N.	SE0006422390		STK	18.695	18.695	0	SEK 314,000	500.275,27	2,45
AptarGroup Inc. Registered Shares DL -,01	US0383361039		STK	3.424	3.424	0	USD 144,380	462.404,94	2,27
Armstrong Wld Industries (NEW) Registered Shares o.N.	US04247X1028		STK	4.046	4.046	0	USD 114,880	434.762,40	2,13
Brunswick Corp. Registered Shares DL -,75	US1170431092		STK	5.507	5.507	0	USD 80,640	415.381,61	2,04
CSG Systems Internatl Inc. Registered Shares DL -,01	US1263491094		STK	9.186	9.186	0	USD 47,240	405.899,02	1,99
Donaldson Co. Inc. Registered Shares DL 5	US2576511099		STK	6.707	6.707	0	USD 72,200	452.946,78	2,22
Flowers Foods Inc. Registered Shares DL -,01	US3434981011		STK	21.809	21.809	0	USD 24,940	508.761,07	2,49
Franklin Electric Co. Inc. Registered Shares DL -,10	US3535141028		STK	4.761	4.761	0	USD 96,270	428.717,12	2,10
HNI Corp. Registered Shares DL 1	US4042511000		STK	11.458	11.458	0	USD 41,950	449.596,02	2,20
KB Home Registered Shares DL 1	US48666K1097		STK	7.218	7.218	0	USD 64,760	437.225,40	2,14
Maximus Inc. Registered Shares o.N.	US5779331041		STK	5.779	5.779	0	USD 80,280	433.952,03	2,13
Mosaic Co., The Registered Shares DL -,01	US61945C1036		STK	15.619	15.619	0	USD 31,390	458.591,72	2,25
MSC Industrial Direct Co. Inc. Reg. Shares Class A DL-,001	US5535301064		STK	4.920	4.920	0	USD 91,240	419.886,63	2,06

Halbjahresbericht

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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
New York Times Co. Re. Shares Class A DL -,10	US6501111073		STK	11.497	11.497	0 USD	43,030	462.740,54	2,27
Polaris Inc. Registered Shares DL -,01	US7310681025		STK	5.359	5.359	0 USD	85,160	426.875,35	2,09
Primoris Services Corp. Registered Shares o.N.	US74164F1030		STK	12.673	12.673	0 USD	46,600	552.391,54	2,71
Sonoco Products Co. Registered Shares o.N.	US8354951027		STK	8.578	8.578	0 USD	56,050	449.721,17	2,21
Tennant Co. Registered Shares DL -,375	US8803451033		STK	4.514	4.514	0 USD	116,480	491.806,87	2,41
Terex Corp. Registered Shares DL -,01	US8807791038		STK	8.625	8.625	0 USD	56,050	452.185,25	2,22
Tetra Tech Inc. Registered Shares DL -,01	US88162G1031		STK	2.673	2.673	0 USD	194,720	486.845,53	2,39
Timken Co. Registered Shares o.N.	US8873891043		STK	5.821	5.821	0 USD	89,220	485.782,08	2,38
Valmont Industries Inc. Registered Shares DL 1	US9202531011		STK	2.373	2.373	0 USD	204,800	454.578,99	2,23
Wabash National Corp. Registered Shares DL -,01	US9295661071		STK	18.048	18.048	0 USD	23,110	390.131,21	1,91
Watts Water Technologies Inc. Reg. Shares Class A DL -,10	US9427491025		STK	2.410	2.410	0 USD	198,460	447.374,99	2,19
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	18.420.635,30	90,33

Halbjahresbericht

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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
Derivate							EUR	191.175,61	0,94
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	191.175,61	0,94
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	191.175,61	0,94
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 21.06.24 EUREX		185	EUR	Anzahl	-100			15.280,00	0,07
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 21.06.24 CME		352	USD	Anzahl	-30			175.895,61	0,86

Halbjahresbericht

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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	1.761.313,07	8,64
Bankguthaben						EUR	1.761.313,07	8,64
EUR - Guthaben bei:								
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			EUR	1.586.245,22		% 100,000	1.586.245,22	7,78
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:								
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			NOK	428,89		% 100,000	36,23	0,00
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			SEK	50,82		% 100,000	4,33	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:								
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			CAD	298,24		% 100,000	203,08	0,00
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG			USD	186.904,56		% 100,000	174.824,21	0,86
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	50.480,98	0,25
Zinsansprüche			EUR	2.517,54			2.517,54	0,01
Dividendenansprüche			EUR	37.013,43			37.013,43	0,18
Quellensteueransprüche			EUR	10.950,01			10.950,01	0,05
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-30.622,27	-0,15
Verwaltungsvergütung			EUR	-4.986,06			-4.986,06	-0,02
Verwahrstellenvergütung			EUR	-1.876,25			-1.876,25	-0,01
Prüfungskosten			EUR	-1.186,44			-1.186,44	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-500,00			-500,00	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-22.073,52			-22.073,52	-0,11
Fondsvermögen						EUR	20.392.982,69	100,00 1)

Halbjahresbericht

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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
Anteilwert							EUR	101,96	
Ausgabepreis							EUR	101,96	
Anteile im Umlauf							STK	200.000	

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

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.04.2024	
CAD	(CAD)	1,4686000	= 1 EUR (EUR)
NOK	(NOK)	11,8395000	= 1 EUR (EUR)
SEK	(SEK)	11,7340000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0691000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex

Halbjahresbericht HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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

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.

Während des Berichtszeitraumes wurden keine Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen getätigt, die nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

Halbjahresbericht HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	90,33
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,94

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	101,96
Ausgabepreis	EUR	101,96
Anteile im Umlauf	STK	200.000

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
HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps**

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

HMTS Equities Value ESG Small & Mid Caps

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 Zirlwagen, Wehrheim

2. Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG

Hausanschrift:

Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 10 10 40
60010 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 21 61-0

Telefax: 069 / 21 61-1340

www.hal-privatbank.com

Rechtsform: Aktiengesellschaft

Haftendes Eigenkapital: Mio. € 599 (Stand: 31.12.2022)

3. Asset Management-Gesellschaft

HanseMerkur Trust Swiss AG

Postanschrift:

Bahnhofstrasse 84

CH-8001 Zürich

Telefon +41 (0)44 244 84 90

www.hmts.ch

WKN / ISIN: A3E180 / DE000A3E1809