# Fonds Commun de Placement (FCP) nach französischem Recht HSBC MIX MODERE

## Halbjahresbericht zum 30. Juni 2026

*(Halbjahresbericht ohne Bestätigung durch den Abschlussprüfer)*

HSBC Asset Management

# FCP HSBC MIX MODERE

## Vermögensaufstellung in EUR

| Vermögensaufstellung | Betrag bei Rechnungsabschluss (*) |
|---|---|
| a) Zulässige Wertpapiere im Sinne von Artikel L. 214-20 Abschnitt I Punkt 1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes | 65 080 496,55 |
| b) Bankguthaben | 6 001 888,99 |
| c) Sonstige Vermögenswerte im Bestand des OGA | 84 762 500,70 |
| d) Summe der Vermögenswerte im Bestand des OGA (Zeilen a+b+c) | 155 844 886,24 |
| e) Passiva | -1 736 688,02 |
| f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA) | 154 108 198,22 |

(*) Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet.

## Anzahl der umlaufenden Anteile und Nettoinventarwert je Anteil

| Anteilsklasse | Art der Anteile | Nettovermögen je Anteil | Anzahl der umlaufenden Anteile | Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|---|---|
| HSBC MIX MODERE A in EUR | C | 65 299 410,61 | 172 717,67600 | 378,07 |
| HSBC MIX MODERE I in EUR | C | 88 808 787,61 | 65 141,02800 | 1 363,33 |

# FCP HSBC MIX MODERE

## Portfoliobestandteile

| Portfoliobestandteile | % des Nettovermögens (*) | % des Gesamtvermögens (**) |
|---|---|---|
| A) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes regulierten Markt gehandelt werden.<br><br>B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden. | 31,50 | 31,15 |
| C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert oder an einem anderen geregelten Markt eines Drittlandes, der anerkannt, für das Publikum offen ist und ordnungsgemäß funktioniert, gehandelt werden, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist. | 10,73 | 10,61 |
| D) Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R. 214-11 Abschnitt I Satz 4 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes. | | |
| E) Sonstige Vermögenswerte. | 52,30 | 51,72 |

(*) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (f)

(**) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (d)

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufschlüsselung nach Währungen der in A), B), C) und D) der Vermögensaufstellung genannten Vermögenswerte

| Wertpapiere | Währung | Betrag (EUR) | % des Nettovermögens (*) | % des Gesamtvermögens (**) |
|---|---|---|---|---|
| Euro | EUR | 62 460 246,17 | 40,53 | 40,08 |
| Japanischer Yen | JPY | 2 620 250,38 | 1,70 | 1,68 |
| **SUMME** | | **65 080 496,55** | **42,23** | **41,76** |

(*) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (f)

(**) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (d)

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufschlüsselung nach Sitz des Emittenten der in A), B), C) und D) der Vermögensaufstellung genannten Vermögenswerte

| Land | % des Nettovermögens (*) | % des Gesamtvermögens (**) |
|---|---|---|
| BELGIEN | 11,15 | 11,02 |
| KANADA | 9,03 | 8,93 |
| FRANKREICH | 7,10 | 7,02 |
| SPANIEN | 3,78 | 3,74 |
| DEUTSCHLAND | 2,93 | 2,90 |
| LUXEMBURG | 2,47 | 2,44 |
| NORWEGEN | 2,41 | 2,38 |
| JAPAN | 1,70 | 1,68 |
| PORTUGAL | 1,67 | 1,65 |
| **SUMME** | **42,23** | **41,76** |

(*) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (f)

(**) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (d)

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufschlüsselung nach Art der unter E) der Vermögensaufstellung genannten sonstigen Vermögenswerte

| Art der Vermögenswerte | % des Nettovermögens (*) | % des Gesamtvermögens (**) |
|---|---|---|
| OGAW und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union | 51,91 | 51,34 |
| Sonstige OGA und Investmentfonds | | |
| AIF und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union | 0,38 | 0,38 |
| Sonstige | | |
| **SUMME** | **52,30** | **51,72** |

(*) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (f)

(**) Siehe Vermögensaufstellung Abschnitt (d)

# FCP HSBC MIX MODERE

## Veränderungen des Portfoliobestands im Berichtszeitraum in EUR

| Portfoliobestandteile | Veränderung (Betrag) | |
|---|---|---|
| | Käufe | Verkäufe |
| A) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes regulierten Markt gehandelt werden.<br>B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden. | 27 124 683,14 | 38 170 101,41 |
| C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert oder an einem anderen geregelten Markt eines Drittlandes, der anerkannt, für das Publikum offen ist und ordnungsgemäß funktioniert, gehandelt werden, sofern diese Börse bzw. dieser Markt nicht auf einer von der Autorité des Marchés Financiers erstellten Liste der ausgeschlossenen Länder steht bzw. sofern die Wahl dieser Börse bzw. dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften und/oder den Vertragsbedingungen oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist. | 8 169 527,56 | |
| D) Wertpapiere aus Neuemissionen im Sinne von Artikel R. 214-11 Abschnitt I Satz 4 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes. | | |
| E) Sonstige Vermögenswerte. | 32 523 577,73 | 31 222 171,31 |

# FCP HSBC MIX MODERE

## Praktische Informationen

**Verwahrstelle**: Caceis Bank - 89-91 rue Gabriel Péri - 92120 - Montrouge

Die detaillierte Halbjahresaufstellung der Aktiva ist innerhalb von acht Wochen ab dem Ende des Zeitraums verfügbar. Sie kann auf einfache Anfrage an die Verwaltungsgesellschaft übermittelt werden:
**HSBC GLOBAL ASSET MANAGEMENT** – Cœur Défense – 110, esplanade du Général de Gaulle – La Défense 4 – 92400 – Courbevoie

# FCP HSBC MIX MODERE

## Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung von Finanzinstrumenten - SFTR-Verordnung - in der Berichtswährung des OGA (EUR)

Der OGA war im Geschäftsjahr nicht Gegenstand von Geschäften, die in den Anwendungsbereich der SFTR-Verordnung fallen.

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

### Aufstellung der Bilanzposten

| Bezeichnung der Wertpapiere nach Tätigkeitsbereich (*) | Währung | Anzahl oder Nennwert | Zeitwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| **ANLEIHEN UND ÄHNLICHE WERTPAPIERE** | | | **65 080 496,55** | **42,23** |
| **An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere** | | | **65 080 496,55** | **42,23** |
| **Geschäftsbanken** | | | **10 145 682,37** | **6,58** |
| AFD 0.875% 25-05-31 EMTN | EUR | 2.300.000 | 2 060 986,21 | 1,34 |
| AFD 3,0% 17-01-34 | EUR | 2.300.000 | 2 248 189,82 | 1,46 |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 1,125 % 31-03-37 | EUR | 5.500.000 | 4 513 225,41 | 2,92 |
| TORONTO DOMINION BANK 3,247% 16-02-34 | EUR | 1 300 000 | 1 323 280,93 | 0,86 |
| **Private Finanzdienste** | | | **5 963 079,08** | **3,87** |
| OMERS FINANCE TRUST 3.25% 28-01-35 | EUR | 5.900.000 | 5 963 079,08 | 3,87 |
| **Kapitalmärkte** | | | **1 482 831,14** | **0,96** |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC 3,125% 30-05-29 | EUR | 1.469.000 | 1 482 831,14 | 0,96 |
| **Öl und Gas** | | | **1 208 574,00** | **0,78** |
| STE ANONYME DE GEST DES STOCKS DE SEC 3.0% 25-11-31 | EUR | 1 200 000 | 1 208 574,00 | 0,78 |
| **Versorger** | | | **32 614 856,52** | **21,17** |
| BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 0,2% 17-03-36 | EUR | 5 000 000 | 3 804 431,51 | 2,47 |
| COMMUNAUTE EUROPEAN BRU 0,3% 04-11-50 | EUR | 2 440 000 | 1 120 051,75 | 0,73 |
| EUROPEAN UNION 0,25% 22-04-36 | EUR | 7 300 000 | 5 512 385,50 | 3,57 |
| EUROPEAN UNION 3,375 % 04-10-39 | EUR | 5.250.000 | 5 280 283,15 | 3,43 |
| FLEMISH COM 3.675% 22-06-40 | EUR | 4.200.000 | 4 081 924,77 | 2,65 |
| FLEMISH COM 4.25% 22-06-50 | EUR | 1 200 000 | 1 181 267,26 | 0,77 |
| JAPAN 30 YEAR ISSUE 2,8 % 20-06-55 | JPY | 600.000.000 | 2 620 250,38 | 1,70 |
| PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1,95% 15-06-29 | EUR | 0,01 | 0,01 | 0,00 |
| PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 3,625% 12-06-54 | EUR | 2.700.000 | 2 578 598,01 | 1,67 |
| SOCIETE DU GRAND PARIS 0,875% 10-05-46 | EUR | 1 100 000 | 612 293,60 | 0,40 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 0,85% 30-07-37 | EUR | 5.467.000 | 4 223 546,95 | 2,74 |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 1,9% 31-10-52 | EUR | 2.360.000 | 1 599 823,63 | 1,04 |
| **Dienstleistungen für Unternehmen** | | | **1 094 922,00** | **0,71** |
| LA POSTE 0,0000010% 18-07-29 | EUR | 1 200 000 | 1 094 922,00 | 0,71 |
| **Diversifizierte Finanzdienste** | | | **10 764 873,47** | **6,99** |
| CASA PUBLIC SECTOR SCF 0.01% 13-09-28 | EUR | 500 000 | 470 230,00 | 0,31 |
| CDP FIN 3,25 % 30-09-35 EMTN | EUR | 5 050 000 | 5 147 698,82 | 3,34 |
| DNB BOLIGKREDITT 2,875% 12-03-29 | EUR | 1 400 000 | 1 415 276,68 | 0,92 |
| SOCIETE DE FINANCEMENT LOCAL 3.25% 25-11-30 | EUR | 1 400 000 | 1 435 497,00 | 0,93 |
| SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 3,0% 15-05-34 | EUR | 2.300.000 | 2 296 170,97 | 1,49 |
| **Straßen- und Schienenverkehr** | | | **1 805 677,97** | **1,17** |
| SNCF RESEAU 0,75% 25-05-36 | EUR | 2.400.000 | 1 805 677,97 | 1,17 |

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Bilanzposten

| Bezeichnung der Wertpapiere nach Tätigkeitsbereich (*) | Währung | Anzahl oder Nennwert | Zeitwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| **OGA-ANTEILE** | | | **80 595 687,86** | **52,30** |
| **OGAW** | | | **80 003 548,32** | **51,92** |
| **Kollektive Verwaltung** | | | **80 003 548,32** | **51,92** |
| EUROLAND GROWTH ZC | EUR | 183 770,142 | 4 320 987,35 | 2,80 |
| HSBC EURO EQUITY VOLATILITY FOCUSED Z | EUR | 838,449 | 1 541 027,34 | 1,00 |
| HSBC EUROLAND EQ.SMALLER Z C. | EUR | 9 749,832 | 1 277 959,23 | 0,83 |
| HSBC Europe Equity Income Z | EUR | 44,546 | 1 332 889,82 | 0,86 |
| HSBC EURO PME-ZC | EUR | 182,65 | 322 337,07 | 0,21 |
| HSBC GBF ICAV MULTI FACTOR EMU EQUITY FUND ZC USD | EUR | 772 516,173 | 14 504 068,40 | 9,41 |
| HSBC GFI-MULTI FACT US EQ-ZC | USD | 345.113,478 | 4 992 508,83 | 3,24 |
| HSBC GIF-EURO CREDIT BD-ZC | EUR | 124 365,155 | 1 522 726,96 | 0,99 |
| HSBC GIF-GLB EMMK LCL DB-ZC | USD | 87.072,286 | 986 103,35 | 0,64 |
| HSBC GIF MULTI ASSET STYLE FACTORS ZC | EUR | 101.936,986 | 1 397 454,14 | 0,91 |
| HSBC GL.INV.EUR.CURR.H.Y.Z C. | EUR | 25.287,243 | 1 660 815,55 | 1,08 |
| HSBC GLB INVT - EUROLAND VALUE ZC | EUR | 35 235,407 | 4 443 572,41 | 2,88 |
| HSBC GL EURO CREDIT BD TR ZC | EUR | 1 631 852,973 | 23 384 453,10 | 15,18 |
| HSBC GLOBAL FUNDS ICAV CROSS ASSET TREND FUND S1CH EUR ACC | EUR | 183.477,675 | 2 015 025,22 | 1,31 |
| HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS ASIA HIGH YIELD BOND ZC | USD | 272.441,097 | 2 027 878,72 | 1,32 |
| HSBC Global Investment Funds - Global Infrastructure Equity | USD | 72.693,158 | 836 165,24 | 0,54 |
| HSBC Global Investment Funds SICAV - Asia ex Japan Equity Sm | USD | 29.440,285 | 689 103,01 | 0,45 |
| HSBC MSCI PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF USD | EUR | 25.648 | 374 871,17 | 0,24 |
| HSBC NASDAQ Global Semiconductor UCITS ETF USD | USD | 5 523 | 236 972,60 | 0,15 |
| HSBC STANDARD EURO MONEY MARKET Z | EUR | 2 418,573 | 2 635 359,86 | 1,71 |
| ISHARES EDGE MSCI USA MMNTM | USD | 47 201 | 993 726,99 | 0,64 |
| iShares Edge MSCI USA Quality Factor UCITS ETF USD (Acc) | USD | 52 979 | 855 411,83 | 0,56 |
| iShares Edge MSCI USA Value Factor UCITS ETF USD (Acc) | USD | 66 711 | 1 112 433,50 | 0,72 |
| iShares MSCI Poland UCITS ETF USD (Acc) | EUR | 17.500 | 558 075,00 | 0,36 |
| PASSIM STR CRS AST TRD STR B | EUR | 10 011,1715 | 1 077 502,39 | 0,70 |
| SPDR SP 500 Low Volatility UCITS ETF | EUR | 13 206 | 994 015,62 | 0,65 |
| STRUCTURED INVESTMENTS SICAV GS CROSS ASSET TREND PORTFOLIO | EUR | 94 193,566 | 1 021 651,67 | 0,66 |
| WisdomTree Strategic Metals UCITS ETF - USD Acc | USD | 31 180 | 380 334,37 | 0,25 |
| WT EUROPE DEFENCE UCITS ETF | EUR | 10 800 | 320 274,00 | 0,21 |
| Xtrackers Bloomberg Commodity Swap UCITS ETF 1C - USD | USD | 150 341 | 1 856 217,58 | 1,20 |
| Xtrackers Europe Defence Technologies UCITS ETF 1C EUR | EUR | 11 400 | 331 626,00 | 0,22 |
| **AIF und vergleichbare Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union** | | | **592 139,54** | **0,38** |
| **Kollektive Verwaltung** | | | **592 139,54** | **0,38** |
| HSBC UK Multi-Factor Equity Fund Institutional Accumulation | GBP | 227 000 | 592 139,54 | 0,38 |
| **Summe** | | | **145 676 184,41** | **94,53** |

(*) Der Tätigkeitsbereich stellt die Haupttätigkeit des Emittenten des Finanzinstruments dar und stammt aus international anerkannten zuverlässigen Quellen (vor allem GICS und NACE).

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte

| Transaktionsart | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Aktiva | Passiva | Zu empfangende Währungen (+) | | Zu liefernde Währungen (-) | |
| | | | Währung | Betrag (*) | Währung | Betrag (*) |
| A/EUR/CLP/20260728 | 112,74 | | EUR | 188 231,81 | CLP | -188 119,07 |
| A/EUR/INR/20260728 | | -9 133,28 | EUR | 336 189,61 | INR | -345 322,89 |
| A/EUR/KRW/20260728 | 2 275,55 | | EUR | 1 081 295,53 | KRW | -1 079 019,98 |
| A/EUR/TWD/20260728 | | -1 474,41 | EUR | 310 071,91 | TWD | -311 546,32 |
| A BRL/EUR 28/07/26 | 14 089,04 | | BRL | 1 288 194,07 | EUR | -1 274 105,03 |
| A COP/EUR 28/07/26 | 38 117,71 | | COP | 653 220,52 | EUR | -615 102,81 |
| V/AUD/EUR/20260724 | 1 040,27 | | EUR | 211 608,03 | AUD | -210 567,76 |
| V/CAD/EUR/20260724 | 176,77 | | EUR | 272 042,44 | CAD | -271 865,67 |
| V/CAD/EUR/20260724 | 10 278,12 | | EUR | 1 102 056,12 | CAD | -1 091 778,00 |
| V/CAD/EUR/20260724 | 2 008,33 | | EUR | 318 876,70 | CAD | -316 868,37 |
| V/CHF/EUR/20260724 | | -16,23 | EUR | 408 293,88 | CHF | -408 310,11 |
| V/CHF/EUR/20260724 | 19 298,64 | | EUR | 3 590 926,15 | CHF | -3 571 627,51 |
| V/CHF/EUR/20260724 | 15 206,16 | | EUR | 2 862 517,60 | CHF | -2 847 311,44 |
| V/CNH/EUR/20260724 | | -12 539,14 | EUR | 1 808 768,11 | CNH | -1 821 307,25 |
| V/EUR/AUD/20260724 | | -5 217,69 | AUD | 688 986,52 | EUR | -694 204,21 |
| V/EUR/CAD/20260724 | 813,69 | | CAD | 513 547,67 | EUR | -512 733,98 |
| V/EUR/CHF/20260724 | | -1 588,80 | CHF | 550 826,78 | EUR | -552 415,58 |
| V/EUR/CHF/20260724 | | -151,43 | CHF | 182 163,19 | EUR | -182 314,62 |
| V/EUR/CHF/20260724 | | -510,34 | CHF | 448 902,14 | EUR | -449 412,48 |
| V/EUR/GBP/20260724 | 166,33 | | GBP | 292 547,02 | EUR | -292 380,69 |
| V/EUR/HUF/20260724 | 1,12 | | HUF | 359,63 | EUR | -358,51 |
| V/EUR/IDR/20260728 | 3 061,20 | | IDR | 116 097,65 | EUR | -113 036,45 |
| V/EUR/INR/20260728 | 26 795,56 | | INR | 1 006 843,72 | EUR | -980 048,16 |
| V/EUR/JPY/20260724 | | -16 455,42 | JPY | 2 353 036,46 | EUR | -2 369 491,88 |
| V/EUR/JPY/20260724 | 33,18 | | JPY | 303 285,85 | EUR | -303 252,67 |
| V/EUR/NOK/20260724 | | -50 420,43 | NOK | 1 356 609,36 | EUR | -1 407 029,79 |
| V/EUR/NOK/20260724 | | -33 067,64 | NOK | 873 646,53 | EUR | -906 714,17 |
| V/EUR/NOK/20260724 | | -48 259,38 | NOK | 2 041 543,29 | EUR | -2 089 802,67 |
| V/EUR/NZD/20260724 | | -6 971,84 | NZD | 595 566,83 | EUR | -602 538,67 |
| V/EUR/NZD/20260724 | | -648,95 | NZD | 568 201,61 | EUR | -568 850,56 |
| V/EUR/SEK/20260724 | | -1 426,11 | SEK | 1 589 064,62 | EUR | -1 590 490,73 |
| V/EUR/SEK/20260724 | | -9 720,94 | SEK | 692 092,18 | EUR | -701 813,12 |
| V/EUR/SGD/20260724 | 2 378,55 | | SGD | 495 672,17 | EUR | -493 293,62 |
| V/EUR/TRY/20260724 | 18 787,96 | | TRY | 937 361,74 | EUR | -918 573,78 |
| V/EUR/TRY/20260724 | 26 396,76 | | TRY | 1 556 191,09 | EUR | -1 529 794,33 |
| V/EUR/USD/20260724 | 2 878,29 | | USD | 223 913,23 | EUR | -221 034,94 |
| V/EUR/USD/20260724 | 2 091,41 | | USD | 243 155,78 | EUR | -241 064,37 |
| V/GBP/EUR/20260724 | | -330,67 | EUR | 383 500,00 | GBP | -383 830,67 |
| V/GBP/EUR/20260724 | | -3 865,88 | EUR | 882 075,61 | GBP | -885 941,49 |
| V/JPY/EUR/20260724 | 2 167,81 | | EUR | 215 294,06 | JPY | -213 126,25 |

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte

| Transaktionsart | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Aktiva | Passiva | Zu empfangende Währungen (+) | | Zu liefernde Währungen (-) | |
| | | | Währung | Betrag (*) | Währung | Betrag (*) |
| V/JPY/EUR/20260724 | 867,18 | | EUR | 281 489,79 | JPY | -280 622,61 |
| V/JPY/EUR/20260724 | 498,96 | | EUR | 74 657,70 | JPY | -74 158,74 |
| V/MXN/EUR/20260724 | | -4 548,92 | EUR | 427 887,69 | MXN | -432 436,61 |
| V/NOK/EUR/20260724 | 12 797,89 | | EUR | 865 617,96 | NOK | -852 820,07 |
| V/NZD/EUR/20260724 | 14 410,10 | | EUR | 1 257 569,13 | NZD | -1 243 159,03 |
| V/NZD/EUR/20260724 | 4 721,42 | | EUR | 496 711,93 | NZD | -491 990,51 |
| V/PLN/EUR/20260724 | 4 674,56 | | EUR | 379 352,86 | PLN | -374 678,30 |
| V/PLN/EUR/20260724 | 4 412,02 | | EUR | 383 738,94 | PLN | -379 326,92 |
| V/SEK/EUR/20260724 | 18 084,95 | | EUR | 1 173 469,78 | SEK | -1 155 384,83 |
| V/SGD/EUR/20260724 | | -2 319,25 | EUR | 421 226,82 | SGD | -423 546,07 |
| V/SGD/EUR/20260724 | | -5 807,44 | EUR | 1 243 179,85 | SGD | -1 248 987,29 |
| V/USD/EUR/20260724 | | -47 637,46 | EUR | 5 666 496,53 | USD | -5 714 133,99 |
| V/ZAR/EUR/20260724 | | -4,75 | EUR | 208,05 | ZAR | -212,80 |
| **Summe** | **248 642,27** | **-262 116,40** | | **46 214 384,24** | | **-46 227 858,37** |

(*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements berechneter und in der Rechnungswährung ausgedrückter Betrag.

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte

### Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

| Art des Engagements | Anzahl oder Nennwert | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) |
|---|---|---|---|---|
| | | Aktiva | Passiva | +/- |
| **1. Futures** | | | | |
| AEX FUT 0726 | 4 | 1 438,00 | | 865 608,00 |
| CAC 40 FUT 0726 | -23 | 8 556,00 | | -1 934 300,00 |
| CONSUMER DISC 0926 | -6 | | -8 064,38 | -1 255 575,96 |
| DAX 30 IND FU 0926 | -5 | | -475,00 | -3 142 000,00 |
| DJE 600 BANK 0926 | 34 | 20 825,00 | | 680 595,00 |
| DJE 600 EUROP 0926 | -125 | | -47 310,00 | -4 026 875,00 |
| DJE 600 INSUR 0926 | 23 | 21 575,00 | | 603 980,00 |
| DJE 600 OIL G 0926 | 7 | | -5 250,00 | 170 975,00 |
| DJES BANKS 0926 | 65 | 25 620,00 | | 956 637,50 |
| DJE SML200 0926 | 94 | | -60 730,00 | 1 857 910,00 |
| DJS 600 CHEM 0926 | -16 | | -4 680,00 | -994 480,00 |
| DJS 600 MED 0926 | -63 | | -3 150,00 | -1 155 735,00 |
| DJS BAS R FUT 0926 | 9 | | -40 230,00 | 349 065,00 |
| DJS F&B FUT 0926 | -18 | | -19 755,00 | -595 890,00 |
| DJS TECH FUT 0926 | 4 | | -2 950,00 | 211 120,00 |
| DJ STOXX HC 0926 | 7 | 16 485,00 | | 408 975,00 |
| DJS TRAVEL 0926 | 26 | 4 920,00 | | 380 120,00 |
| DJ STX600 AUT 0926 | -18 | 38 700,00 | | -387 000,00 |
| E-MIN RUS 200 0926 | -11 | | -37 737,25 | -1 465 127,26 |
| E MIN SP 500 0926 | 5 | 6 390,27 | | 759 686,87 |
| EUREX MINI MD 0926 | 39 | | -34 905,00 | 1 250 145,00 |
| EURO STOXX 50 0926 | -70 | | -42 700,00 | -4 449 200,00 |
| FCI FTSE Burs 0726 | 21 | | -5 630,87 | 376 254,88 |
| FTSE/MIB 0926 | 1 | 2 300,00 | | 259 400,00 |
| FTSE 100 FUT 0926 | 2 | 377,29 | | 244 752,73 |
| FTSE 250 I 0926 | 10 | | -11 634,55 | 537 090,78 |
| FTSEJSE TOP40 0926 | 10 | | -32 462,85 | 547 600,81 |
| FTSE TAIWAN I 0726 | -3 | | -2 728,94 | -424 350,56 |
| HANG SENG TEC 0726 | 10 | | -1 059,58 | 249 169,06 |
| HHI HANG SENG 0726 | -8 | 9 101,25 | | -336 077,09 |
| IFSC NIFTY 50 0726 | -9 | 994,49 | | -377 924,43 |
| KOSPI2 INDEX 0926 | 3 | 68 571,95 | | 586 428,81 |
| MEFF IBEX35 E 0726 | 6 | 29 208,00 | | 1 163 796,00 |
| MEX BOLSA IDX 0926 | 6 | | -6 525,76 | 202 761,57 |
| MSCI CHIN A50 0726 | 22 | | -7 723,26 | 1 367 471,35 |
| MSCI EMG MKT 0926 | -35 | 41 174,67 | | -2 689 823,32 |
| MSCI WORLD 10 0926 | -51 | 56 730,52 | | -7 008 764,10 |
| OMX COP25 100 0726 | 3 | 2 057,70 | | 73 009,63 |
| OMXS30 FUT 0726 | 43 | 17 322,37 | | 1 250 167,19 |
| OSE TOPIX FUT 0926 | 2 | 13 637,23 | | 430 859,11 |

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

| Art des Engagements | Anzahl oder Nennwert | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) |
|---|---|---|---|---|
| | | Aktiva | Passiva | +/- |
| S&P TORONTO 6 0926 | 6 | 884,07 | | 1 520 816,25 |
| SP 500 MINI 0926 | 2 | 4 259,60 | | 660 216,04 |
| SP EMINI COM 0926 | 5 | | -18 280,42 | 618 112,04 |
| SP E-MINI FIN 0926 | -1 | | -992,74 | -145 716,35 |
| SP E-MINI HEA 0926 | -4 | | -18 857,69 | -565 275,96 |
| SP E-MINI MAT 0926 | -2 | 4 565,73 | | -190 168,81 |
| SP E-MIN INDU 0926 | 2 | 16 286,19 | | 329 204,93 |
| SP EMIN UTILI 0926 | 2 | 3 586,11 | | 161 252,51 |
| SPI 200 FUT 0926 | -12 | 21 269,50 | | -1 595 394,64 |
| STOXX 600 FIN 0926 | 9 | | -700,00 | 415 755,00 |
| STOXX 600 P&H 0926 | 4 | | -200,00 | 200 600,00 |
| TECHNOLOGY SE 0926 | 2 | 19 854,81 | | 677 704,89 |
| TPX BANKS 0926 | 20 | 16 252,74 | | 729 435,98 |
| XAE ENERGY SE 0926 | 4 | | -30 193,30 | 392 827,78 |
| XAPXAP CONSUM 0926 | -3 | 6 113,88 | | -221 674,10 |
| XEUR FSMI SWI 0926 | 9 | 39 642,18 | | 1 387 400,38 |
| XEUR FSTN DJ 0926 | -4 | 940,00 | | -173 540,00 |
| XEUR FSTU DJ 0926 | 21 | 18 900,00 | | 590 730,00 |
| **Zwischensumme 1.** | | **538 539,55** | **-444 926,59** | **-9 667 257,49** |
| **2. Optionen** | | | | |
| EURO STOXX 50 07/2026 CALL 6400 | 350 | 152 950,00 | | 8 017 690,03 |
| HANG SENG TECH INDEX 09/2026 CALL 5500 | 125 | 5 125,03 | | 427 106,00 |
| NASDAQ 100 INDEX 09/2026 PUT 26000 | 7 | 37 072,51 | | -467 206,23 |
| NIKKEI 225 07/2026 CALL 72000 | 6 | 28 415,39 | | 975 655,62 |
| VSTOXX 07/2026 CALL 30 | 1 000 | | -65 000,00 | 132 000,00 |
| **Zwischensumme 2.** | | **223 562,93** | **-65 000,00** | **9 085 245,42** |
| **3. Swaps** | | | | |
| **Zwischensumme 3.** | | | | |
| **4 Sonstige Instrumente** | | | | |
| **Zwischensumme 4.** | | | | |
| **Summe** | | **762 102,48** | **-509 926,59** | **-582 012,07** |

(*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements berechneter Betrag.

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Zinsen

| Art des Engagements | Anzahl oder Nennwert | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) |
|---|---|---|---|---|
| | | Aktiva | Passiva | +/- |
| **1. Futures** | | | | |
| AUST 10Y BOND 0926 | 31 | 24 142,15 | | 2 062 925,31 |
| CBOT USUL 30A 0926 | -49 | | -82 300,14 | -4 978 270,14 |
| EURO BUND 0926 | -89 | | -134 390,00 | -11 333 260,00 |
| EURO-OAT 0926 | -11 | | -10 450,00 | -1 319 780,00 |
| EURO SCHATZ 0926 | 341 | 80 565,00 | | 36 132 360,00 |
| LONG GILT FUT 0926 | 50 | 44 694,68 | | 5 178 198,28 |
| SIMEX MINIJGB 0926 | -114 | | -20 245,97 | -7 838 869,67 |
| TU CBOT UST 2 0926 | 216 | | -49 384,30 | 38 944 010,66 |
| US 10Y ULT 0926 | -30 | | -25 009,84 | -2 951 161,11 |
| XEUR FGBX BUX 0926 | -41 | | -108 500,00 | -4 560 020,00 |
| **Zwischensumme 1.** | | **149 401,83** | **-430 280,25** | **49 336 133,33** |
| **2. Optionen** | | | | |
| **Zwischensumme 2.** | | | | |
| **3. Swaps** | | | | |
| **Zwischensumme 3.** | | | | |
| **4 Sonstige Instrumente** | | | | |
| **Zwischensumme 4.** | | | | |
| **Summe** | | **149 401,83** | **-430 280,25** | **49 336 133,33** |

(*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements berechneter Betrag.

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Währungen

| Art des Engagements | Anzahl oder Nennwert | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) |
|---|---|---|---|---|
| | | Aktiva | Passiva | +/- |
| **1. Futures** | | | | |
| CC EURCAD 0926 | -4 | | -4 022,69 | -499 922,94 |
| EC EURUSD 0926 | -7 | 9 834,47 | | -876 798,52 |
| RF EURCHF 0926 | -5 | | -3 151,26 | -622 323,12 |
| RY EURJPY 0926 | -6 | | -4 601,36 | -747 397,41 |
| **Zwischensumme 1.** | | **9 834,47** | **-11 775,31** | **-2 746 441,99** |
| **2. Optionen** | | | | |
| **Zwischensumme 2.** | | | | |
| **3. Swaps** | | | | |
| **Zwischensumme 3.** | | | | |
| **4 Sonstige Instrumente** | | | | |
| **Zwischensumme 4.** | | | | |
| **Summe** | | **9 834,47** | **-11 775,31** | **-2 746 441,99** |

(*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements berechneter Betrag.

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - mit Kreditrisiko

| Art des Engagements | Anzahl oder Nennwert | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) |
|---|---|---|---|---|
| | | Aktiva | Passiva | +/- |
| **1. Futures** | | | | |
| **Zwischensumme 1.** | | | | |
| **2. Optionen** | | | | |
| **Zwischensumme 2.** | | | | |
| **3. Swaps** | | | | |
| **Zwischensumme 3.** | | | | |
| **4 Sonstige Instrumente** | | | | |
| **Zwischensumme 4.** | | | | |
| **Summe** | | | | |

(*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements berechneter Betrag.

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - sonstige Engagements

| Art des Engagements | Anzahl oder Nennwert | In der Bilanz ausgewiesener Barwert | | Höhe des Engagements (*) |
|---|---|---|---|---|
| | | Aktiva | Passiva | +/- |
| **1. Futures** | | | | |
| S&P600 SCMINI 0926 | 12 | 63 605,35 | | 1 907 215,95 |
| **Zwischensumme 1.** | | **63 605,35** | | **1 907 215,95** |
| **2. Optionen** | | | | |
| **Zwischensumme 2.** | | | | |
| **3. Swaps** | | | | |
| **Zwischensumme 3.** | | | | |
| **4 Sonstige Instrumente** | | | | |
| **Zwischensumme 4.** | | | | |
| **Summe** | | **63 605,35** | | **1 907 215,95** |

(*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements berechneter Betrag.

## Aufstellung der Finanztermin- oder Devisentermingeschäfte zur Absicherung einer Anteilskategorie

Diese Rubrik betrifft den berichtenden OGA nicht.

## Zusammenfassung der Vermögensaufstellung

| | In der Bilanz ausgewiesener Barwert |
|---|---|
| Summe der gehaltenen zulässigen Aktiva und Passiva (ohne FTI) | 145 676 184,41 |
| Aufstellung der FTI (ohne FTI zur Absicherung von begebenen Anteilen): | |
| Summe der Devisentermingeschäfte | -13 474,13 |
| Summe der Finanztermingeschäfte - Aktien | 252 175,89 |
| Summe der Finanztermingeschäfte - Zinsen | -280 878,42 |
| Summe der Finanztermingeschäfte - Währungen | -1 940,84 |
| Summe der Finanztermingeschäfte - Kredite | |
| Summe der Finanztermingeschäfte – Sonstige Engagements | 63 605,35 |
| Aufstellung der Finanztermingeschäfte zur Absicherung von begebenen Anteilen | |
| Sonstige Vermögenswerte (+) | 8 935 115,43 |
| Sonstige Verbindlichkeiten (-) | -522 589,47 |
| Finanzierungsverbindlichkeiten (-) | |
| **Summe = Nettovermögen** | **154 108 198,22** |

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Anteilswährung | Anzahl der Anteile | Nettoinventarwert |
|---|---|---|---|
| Anteilsklasse HSBC MIX MODERE A | EUR | 172 717,67600 | 378,07 |
| Anteilsklasse HSBC MIX MODERE I | EUR | 65 141,02800 | 1 363,33 |