

# **FCP nach französischem Recht HSBC MIX MODERE**

Halbjahresbericht  
zum 28. Juni 2024

*(ungeprüft)*

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung des Wertpapierportfolios in EUR

Elemente der Vermögensaufstellung	Wert zum Abschluss des Zeitraums (*)
a) Zulässige Wertpapiere, genannt in 1° von I des Artikels L. 214-20 des französischen Code Monétaire et Financier	100.788.620,88
b) Bankguthaben	7.598.725,75
c) Sonstige vom OGA gehaltene Vermögenswerte	103.933.528,06
d) Summe der vom OGA gehaltenen Vermögenswerte (Zeilen a+b+c)	212.320.874,69
e) Passiva	-1.269.487,69
f) Nettoinventarwert (Zeilen d+e = Nettovermögen des OGA)	211.051.387,00

(\*) Die Beträge sind laut der doppelten Buchführung mit einem Minuszeichen versehen

## Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile und Nettoinventarwert pro Anteil

Anteil	Anteilsart	Nettovermögen des Anteils	Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert je Anteil
HSBC MIX MODERE A in EUR	C	94.583.963,53	289.633,36700	326,56
HSBC MIX MODERE I in EUR	C	116.467.423,47	100.910,20400	1.154,16

# FCP HSBC MIX MODERE

## Element des Wertpapierportfolios

Portfoliowertpapiere	Anteil am Nettovermögen (*)	Anteil am Gesamtvermögen (**)
A) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et Financier zum Handel zugelassen sind.  Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt mit Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum gehandelt werden dürfen.	42,90	42,64
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt eines Drittlandes gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde AMF aufgestellten Liste aufgeführt ist oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften oder in dem Reglement oder der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	4,86	4,83
D) Zulässige Wertpapiere als Neuemissionen, genannt in 4° von I des Artikels R. 214-11 des französischen Code Monétaire et Financier.		
E) Die sonstigen Vermögenswerte.	47,12	46,84

(\*) Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

(\*\*) Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufteilung der Vermögenswerte von A), B), C) und D) des Wertpapierportfolios nach Wahrung

Wertpapiere	Wahrung	Betrag (EUR)	Anteil am Nettovermogen (*)	Anteil am Gesamtvermogen (**)
Schwedische Krone	SEK	2.632.961,38	1,25	1,24
Euro	EUR	95.926.818,61	45,45	45,18
Japanischer Yen	JPY	2.228.840,89	1,06	1,05
<b>SUMME</b>		<b>100.788.620,88</b>	<b>47,76</b>	<b>47,47</b>

(\*) Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

(\*\*) Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufteilung der Vermögenswerte von A), B), C) und D) des Wertpapierportfolios nach Sitzland des Emittenten

Land	Anteil am Nettovermögen (*)	Anteil am Gesamtvermögen (**)
LUXEMBURG	9,56	9,50
SPANIEN	8,63	8,58
FRANKREICH	7,04	6,99
BELGIEN	4,14	4,12
KANADA	2,65	2,64
PORTUGAL	2,65	2,63
DEUTSCHLAND	2,59	2,57
NIEDERLANDE	2,56	2,54
ÖSTERREICH	2,28	2,27
NORWEGEN	2,21	2,19
JAPAN	1,63	1,62
SCHWEDEN	1,25	1,24
SÜDKOREA	0,58	0,57
<b>SUMME</b>	<b>47,76</b>	<b>47,47</b>

(\*) Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

(\*\*) Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufteilung der sonstigen Vermögenswerte von E) des Wertpapierportfolios nach Art

Art der Vermögenswerte	Anteil am Nettovermögen (*)	Anteil am Gesamtvermögen (**)
OGAW und entsprechende anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union	47,12	46,84
Andere OGA und Investmentfonds		
AIF und entsprechende anderer Mitgliedstaaten der Europäischen Union		
Sonstige		
<b>SUMME</b>	<b>47,12</b>	<b>46,84</b>

(\*) Sich auf f) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

(\*\*) Sich auf d) der Aufstellung des Wertpapierportfolios beziehen

# FCP HSBC MIX MODERE

## Umschichtungen im Wertpapierportfolio im Laufe des Berichtszeitraums in EUR

Portfoliowertpapiere	Umschichtungen (Betrag)	
	Erwerbe	Veräußerungen
A) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Code Monétaire et Financier zum Handel zugelassen sind. Und B) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt mit Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum gehandelt werden dürfen.	21.312.950,34	33.793.814,09
C) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes amtlich notiert sind oder an einem anderen anerkannten, für die Öffentlichkeit offenen und ordnungsgemäß funktionierenden geregelten Markt eines Drittlandes gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde AMF aufgestellten Liste aufgeführt ist oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes in den gesetzlichen Vorschriften oder in dem Reglement oder der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist.	7.990.809,53	
D) Zulässige Wertpapiere als Neuemissionen, genannt in 4° von I des Artikels R. 214-11 des französischen Code Monétaire et Financier.		
E) Die sonstigen Vermögenswerte.	34.669.426,42	37.801.774,17

# FCP HSBC MIX MODERE

## **Transparenz von Wertpapierfinanzierungen und Weiterverwendung von Finanzinstrumenten – SFTR-Verordnung – in der Fondswährung des OGA (EUR)**

In dem Geschäftsjahr war der OGA nicht Gegenstand von Geschäften, die in den Anwendungsbereich der SFT-Verordnung fallen.



# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Aktiva und Passiva

### Aufstellung der Bilanzposten

Wertpapiere nach Branche (*)	Währung	Menge oder Nominalbetrag	Zeitwert	% Nettovermögen
<b>ANLEIHEN UND ÄHNLICHE WERTPAPIERE</b>			<b>100.788.620,88</b>	<b>47,76</b>
<b>Anleihen und ähnliche Wertpapiere, die an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelt werden</b>			<b>100.788.620,88</b>	<b>47,76</b>
<b>Geschäftsbanken</b>			<b>17.287.954,80</b>	<b>8,19</b>
AFD 3.0% 17-01-34	EUR	2.600.000	2.538.012,16	1,20
BPI FRANCE E 0.05% 26-09-29	EUR	1.200.000	1.017.633,02	0,48
COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 0,0 % 20-01-31	EUR	9.250.000	7.657.242,50	3,63
KFW 1.125% 15-09-32 EMTN	EUR	5.406.000	4.764.062,76	2,26
TORONTO DOMINION BANK 3.247% 16-02-34	EUR	1.300.000	1.311.004,36	0,62
<b>Kapitalmärkte</b>			<b>4.977.348,08</b>	<b>2,36</b>
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC 2.0% 31-08-26	EUR	2.850.000	2.816.188,49	1,33
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC 3.125% 30-05-29	EUR	1.469.000	1.468.405,56	0,70
FMS 0,375 % 29-04-30 EMTN	EUR	800.000	692.754,03	0,33
<b>Versorger</b>			<b>63.085.349,56</b>	<b>29,89</b>
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.25% 20-10-36	EUR	6.807.000	4.816.181,45	2,28
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEM 1.0% 14-03-31	EUR	6.775.000	6.007.349,81	2,85
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 0.01% 15-11-35	EUR	9.000.000	6.363.070,57	3,01
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 0,2 % 17-03-36	EUR	2.093.000	1.499.281,41	0,71
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 1.125% 13-04-33	EUR	5.118.000	4.393.550,96	2,08
COMMUNAUTE EUROPEAN BRU 0.3% 04-11-50	EUR	2.030.000	981.952,43	0,47
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 0,01 % 15-10-31	EUR	1.250.000	1.015.145,39	0,48
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 3.0% 23-08-33	EUR	875.000	899.427,99	0,43
EUROPEAN UNION 0.2% 04.06.1936	EUR	4.740.000	3.358.898,73	1,59
EUROPEAN UNION 1.0% 06.07.1932	EUR	4.300.000	3.732.854,55	1,77
EUROPEAN UNION 3.0% 04.03.1953	EUR	730.000	669.145,75	0,32
JAPAN 30 YEAR ISSUE 1.0% 20-03-52	JPY	500.000.000	2.228.840,89	1,06
KINGDOM OF SWEDEN 0.125% 12-05-31	SEK	34.230.000	2.632.961,38	1,25
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1,95 % 15-06-29	EUR	0,01	0,01	0,00
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.25% 18-04-34	EUR	6.021.000	5.590.969,87	2,65
SOCIETE DU GRAND PARIS 0,875 % 10-05-46	EUR	1.200.000	682.344,66	0,32
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.7% 30.04.1932	EUR	9.500.000	7.896.478,08	3,74
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.85% 30.07.1937	EUR	4.880.000	3.534.045,87	1,67
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.9% 31.10.1952	EUR	4.350.000	2.912.471,07	1,38
SPAIN GOVERNMENT BOND 2.55% 31.10.1932	EUR	4.000.000	3.870.378,69	1,83
<b>Unternehmensdienstleistungen</b>			<b>1.004.454,00</b>	<b>0,48</b>
LA POSTE 0.0000010% 18-07-29	EUR	1.200.000	1.004.454,00	0,48

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Bilanzposten

Wertpapiere nach Branche (*)	Währung	Menge oder Nominalbetrag	Zeitwert	% Nettovermögen
<b>Diversifizierte Finanzdienste</b>			<b>12.484.773,72</b>	<b>5,92</b>
BNG BANK NV 1.5% 15-07-39 EMTN	EUR	5.300.000	4.214.492,23	1,99
DNB BOLIGKREDITT 2.875% 12-03-29	EUR	2.400.000	2.395.924,60	1,14
KOREA HOUSING FINANCE 0.01% 29-06-26	EUR	1.300.000	1.215.098,07	0,58
NEDWBK 0.25% 19-01-32 EMTN	EUR	1.450.000	1.181.441,22	0,56
SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 3.0% 15-05-34	EUR	2.300.000	2.261.371,97	1,07
SUMITOMO MITSUI BANKING 0.267% 18-06-26	EUR	1.300.000	1.216.445,63	0,58
<b>Straßen- und Schienentransport</b>			<b>1.948.740,72</b>	<b>0,92</b>
SNCF RESEAU 0,75 % 25-05-36	EUR	2.700.000	1.948.740,72	0,92
<b>WERTPAPIERE VON OGA</b>			<b>99.447.424,87</b>	<b>47,12</b>
<b>OGAW</b>			<b>99.447.424,87</b>	<b>47,12</b>
<b>Gemeinsame Anlagen</b>			<b>99.447.424,87</b>	<b>47,12</b>
ASIA EX JAPAN EQUITY SMALLER COMPANIES Z	USD	29.440,285	542.409,96	0,26
EUROLAND GROWTH ZC	EUR	118.431,67	2.498.908,24	1,18
HSBC EURO ACTIONS ZC	EUR	1.299,129	2.340.160,04	1,11
HSBC EURO EQUITY VOLATILITY FOCUSED Z	EUR	2.887,509	4.354.969,95	2,06
HSBC EUROLAND EQ.SMALLER Z C.	EUR	24.228,745	2.512.230,11	1,19
HSBC EUROLAND EQUITY Z CAP.	EUR	15.318,988	1.260.185,91	0,60
HSBC Europe Equity Quality Income Z	EUR	43,943	936.419,18	0,44
HSBC EURO PME PART Z	EUR	578,578	733.017,83	0,35
HSBC FTSE 100 ETF	GBP	12,103	1.173.898,93	0,56
HSBC GBF ICAV MLTFAC E E ZC	EUR	1.639.128,079	20.622.362,10	9,77
HSBC GFI-MULTI FACT US EQ-ZC	USD	163.379,745	1.782.336,96	0,84
HSBC GI CHIN EQ ZC	USD	4.082,534	389.729,15	0,18
HSBC GIF-BRAZIL EQUITY-ZA	USD	27.468,607	536.531,67	0,25
HSBC GIF-EURO CREDIT BD-ZC	EUR	862.021,357	9.570.161,11	4,53
HSBC GIF MULTI ASSET STYLE FACTORS ZC	EUR	177.560,885	2.164.822,31	1,03
HSBC GL EURO CREDIT BD TR ZC	EUR	1.813.226,516	23.278.202,01	11,05
HSBC GL INV-IND FIX IN-ZD	USD	177.265,202	1.416.633,04	0,67
HSBC GLOBAL FUNDS ICAV CROSS ASSET TREND FUND S1CH EUR ACC	EUR	222,933	2.243.129,55	1,06
HSBC GLOBAL INV. FD TURKEY Class I	EUR	2,950	228.209,05	0,11
HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS ASIA HIGH YIELD BOND ZC	USD	521.302,896	3.659.213,15	1,73
HSBC MSCI CANADA ETF	EUR	37,123	781.884,63	0,37
HSBC MSCI JAPAN	EUR	43,077	1.610.002,88	0,76
HSBC MSCI PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF USD	EUR	53,807	674.847,39	0,32
HSBC RIF SRI EUROLAND EQUITY Z	EUR	7.832,337	1.074.361,67	0,51
HSBC SRI MONEY ZC	EUR	2.207,068	3.174.944,57	1,50
ISHARES BLOOMBERG ROLL SELECT COMMODITY SWAP UCITS ETF	USD	452,504	3.169.533,50	1,50
PASSIM STR CRS AST TRD STR B	EUR	19.273,9218	2.211.104,31	1,05

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Bilanzposten

Wertpapiere nach Branche (*)	Währung	Menge oder Nominalbetrag	Zeitwert	% Nettovermögen
SPDR SP 500 Low Volatility UCITS ETF	EUR	39.801	2.679.403,32	1,27
STRUCTURED INVESTMENTS SICAV GS CROSS ASSET TREND PORTFOLIO	EUR	159.694,239	1.827.812,35	0,87
<b>Summe</b>			<b>200.236.045,75</b>	<b>94,88</b>

(\*) Die Branche steht für die Haupttätigkeit des Emittenten des Finanzinstruments. Sie stammt aus weltweit anerkannten zuverlässigen Quellen (vor allem GICS und NACE).

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte

Art des Geschäfts	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)			
	Aktiva	Passiva	Zu erhaltende Währungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)	
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
V/AUD/EUR/20240906		-8.239,94	EUR	1.950.473,58	AUD	-1.958.713,52
V/CAD/EUR/20240906	1.934,85		EUR	1.688.793,86	CAD	-1.686.859,01
V/CAD/EUR/20240906	2.230,95		EUR	3.726.527,00	CAD	-3.724.296,05
V/CHF/EUR/20240906	14.850,19		EUR	2.455.521,11	CHF	-2.440.670,92
V/CHF/EUR/20240906	30.276,96		EUR	4.552.665,91	CHF	-4.522.388,95
V/CNH/EUR/20240906	5.893,74		EUR	2.951.646,13	CNH	-2.945.752,39
V/EUR/AUD/20240906	5.893,54		AUD	1.682.452,64	EUR	-1.676.559,10
V/EUR/AUD/20240906	1.294,98		AUD	370.139,58	EUR	-368.844,60
V/EUR/CAD/20240906		-1.670,56	CAD	1.547.168,52	EUR	-1.548.839,08
V/EUR/CHF/20240906		-6.569,78	CHF	1.081.979,13	EUR	-1.088.548,91
V/EUR/GBP/20240906		-598,99	GBP	336.144,37	EUR	-336.743,36
V/EUR/JPY/20240906		-27.961,71	JPY	4.044.211,86	EUR	-4.072.173,57
V/EUR/MXN/20240906		-16.314,06	MXN	1.683.892,55	EUR	-1.700.206,61
V/EUR/NOK/20240906		-24.799,26	NOK	2.921.701,79	EUR	-2.946.501,05
V/EUR/NOK/20240906		-28.984,91	NOK	3.892.301,63	EUR	-3.921.286,54
V/EUR/NZD/20240906		-4.320,71	NZD	907.411,09	EUR	-911.731,80
V/EUR/SEK/20240906		-6.196,67	SEK	555.506,61	EUR	-561.703,28
V/EUR/SEK/20240906		-7.440,72	SEK	879.471,37	EUR	-886.912,09
V/EUR/USD/20240906		-867,27	USD	724.049,45	EUR	-724.916,72
V/EUR/USD/20240906	333,42		USD	9.668.299,51	EUR	-9.667.966,09
V/NOK/EUR/20240906	4.551,78		EUR	735.922,18	NOK	-731.370,40
V/SEK/EUR/20240906	24.035,65		EUR	2.538.117,08	SEK	-2.514.081,43
V/USD/EUR/20240906	231,73		EUR	376.856,51	USD	-376.624,78
V/ZAR/EUR/20240906	10.870,06		EUR	947.813,01	ZAR	-936.942,95
<b>Summe</b>	<b>102.397,85</b>	<b>-133.964,58</b>		<b>52.219.066,47</b>		<b>-52.250.633,20</b>

(\*) Gemäß den Bestimmungen der Verordnung über die Darstellung des Engagements bestimmter und in der Buchungswährung ausgedrückter Betrag.

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte

### Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Engagements	Menge oder Nominalbetrag	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
AEX FUT 0724	3		-258,00	555.732,00
CAC 40 FUT 0724	15		-29.675,00	1.123.875,00
CONSUMER DISC 0924	-3		-8.826,69	-521.763,47
DAX 30 IND FU 0924	-3		-12.375,00	-1.380.225,00
DJE 600 BANK 0924	60	8.250,00		585.600,00
DJE 600 EUROP 0924	-86		-3.870,00	-2.211.060,00
DJE 600 INSUR 0924	28	4.100,00		527.100,00
DJES BANKS 0924	74	7.770,00		508.935,00
DJE SML200 0924	94		-7.050,00	1.575.910,00
DJS 600 CHEM 0924	-25	3.750,00		-1.576.125,00
DJS BAS R FUT 0924	-44		-15.290,00	-1.281.280,00
DJS F&B FUT 0924	-15	16.725,00		-515.400,00
DJS TECH FUT 0924	6	630,00		269.250,00
DJS TELECOM 0924	-52		-785,00	-536.380,00
DJ STOXX HC 0924	-5	125,00		-303.650,00
DJS TRAVEL 0924	22	2.860,00		258.280,00
E-MIN RUS 200 0924	-6		-10.030,32	-578.026,59
EURO STOXX 50 0924	-157	17.620,00		-7.733.820,00
FCI FTSE Burs 0724	-33	1.132,32		-521.009,69
FTSE/MIB 0924	6	11.760,00		1.000.980,00
FTSEJSE TOP40 0924	14	2.499,21		527.531,98
FTSE TAIWAN I 0724	8	1.296,94		575.880,57
HANG SENG TEC 0724	30		-15.058,08	639.789,19
HHI HANG SENG 0724	15		-3.495,63	561.540,94
IFSC NIFTY 50 0724	-6		-5.076,74	-270.281,32
KOSPI2 INDEX 0924	-9		-23.182,29	-589.242,03
MEFF IBEX35 E 0724	15	4.387,50		1.631.400,00
MEX BOLSA IDX 0924	-17		-2.827,92	-462.798,48
MSCI CHIN A50 0724	13		-5.397,71	585.136,46
MSCI EMG MKT 0924	-18		-7.557,73	-913.813,86
MSCI ID NTR 0924	35	29.678,56		537.695,36
OMX COP25 100 0724	8		-938,66	210.098,63
OMXS30 FUT 0724	76	2.936,74		1.726.237,89
OSE TOPIX FUT 0924	-5		-10.295,72	-815.102,17
S&P TORONTO 6 0924	-5		-8.762,06	-893.593,81
SET50 FUTURES 0924	-169	1.674,53		-690.170,36

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Aktien

Art des Engagements	Menge oder Nominalbetrag	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
SP 500 MINI 0924	31	27.189,18		7.985.374,39
SP E-MINI FIN 0924	4	5.691,63		477.863,31
SP E-MINI HEA 0924	-8		-597,15	-1.111.826,45
SP E-MINI MAT 0924	-6	2.220,67		-530.608,82
SP EMIN UTILI 0924	-8	10.431,54		-518.777,70
SPI 200 FUT 0924	-9		-7.898,18	-1.089.668,49
ST600 RETAIL 0924	24		-8.730,00	511.680,00
STOXX 600 FIN 0924	41		-13.965,00	1.555.335,00
XAE ENERGY SE 0924	6	21.777,47		540.573,83
XAK TECHNOLOG 0924	3		-4.366,69	646.102,17
XEUR FSMI SWI 0924	3		-1.464,10	374.528,84
XEUR FSTN DJ 0924	7		-3.260,00	234.605,00
XEUR FSTU DJ 0924	14		-710,00	257.740,00
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>184.506,29</b>	<b>-211.743,67</b>	<b>940.152,32</b>
<b>2. Optionen</b>				
EURO STOXX 50 09/2024 CALL 5250	570	111.150,00		3.905.427,96
EURO STOXX 50 12/2024 PUT 4600	210	200.550,00		-2.569.360,50
<b>Zwischensumme 2.</b>		<b>311.700,00</b>		<b>1.336.067,46</b>
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>				
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
<b>Zwischensumme 4.</b>				
<b>Summe</b>		<b>496.206,29</b>	<b>-211.743,67</b>	<b>2.276.219,78</b>

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

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Zinsen

Art des Engagements	Menge oder Nominalbetrag	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
AUST 10Y BOND 0924	23		-25.569,38	1.627.670,93
CBOT USUL 30A 0924	-13		-12.508,75	-1.520.381,39
EURO BOBL 0924	-178		-185.120,00	-20.726.320,00
EURO BUND 0924	96	149.300,00		12.635.520,00
EURO-OAT 0924	-43	52.890,00		-5.294.160,00
EURO SCHATZ 0924	342	160.740,00		36.149.400,00
LIFFE LG GILT 0924	56	16.877,99		6.444.441,82
MSE CANADA 10 0924	47	30.445,60		3.848.003,82
SIMEX MINIJGB 0924	-115		-5,80	-9.520.758,79
TU CBOT UST 2 0924	410	170.573,83		78.124.271,05
US 10Y ULT 0924	-79		-32.219,50	-8.368.526,94
XEUR FGBX BUX 0924	-101		-217.400,00	-13.154.240,00
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>580.827,42</b>	<b>-472.823,43</b>	<b>80.244.920,50</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>				
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>				
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
<b>Zwischensumme 4.</b>				
<b>Summe</b>		<b>580.827,42</b>	<b>-472.823,43</b>	<b>80.244.920,50</b>

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

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - Währungen

Art des Engagements	Menge oder Nominalbetrag	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
Zwischensumme 1.				
2. Optionen				
Zwischensumme 2.				
3. Swaps				
Zwischensumme 3.				
4. Sonstige Instrumente				
Zwischensumme 4.				
<b>Summe</b>				

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

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - mit Kreditrisiko

Art des Engagements	Menge oder Nominalbetrag	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
1. Futures				
Zwischensumme 1.				
2. Optionen				
Zwischensumme 2.				
3. Swaps				
Zwischensumme 3.				
4. Sonstige Instrumente				
Zwischensumme 4.				
<b>Summe</b>				

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

# FCP HSBC MIX MODERE

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte - andere Engagements

Art des Engagements	Menge oder Nominalbetrag	In der Bilanz verbuchter Zeitwert		Betrag des Engagements (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
<b>1. Futures</b>				
SP EMINI COM 0924	10	18.544,44		1.057.149,52
TPX BANKS 0924	40	28.015,97		814.609,14
<b>Zwischensumme 1.</b>		<b>46.560,41</b>		<b>1.871.758,66</b>
<b>2. Optionen</b>				
<b>Zwischensumme 2.</b>				
<b>3. Swaps</b>				
<b>Zwischensumme 3.</b>				
<b>4. Sonstige Instrumente</b>				
<b>Zwischensumme 4.</b>				
<b>Summe</b>		<b>46.560,41</b>		<b>1.871.758,66</b>

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

## Aufstellung der Finanztermingeschäfte oder der Devisentermingeschäfte zur Absicherung einer Anteilsklasse

Der geprüfte OGA ist nicht von dieser Rubrik betroffen.



# FCP HSBC MIX MODERE

## Zusammenfassung des Vermögensaufstellung

	In der Bilanz verbuchter Zeitwert
Summe der Aufstellung der zulässigen Aktiva und Passiva (ohne FTI)	200.236.045,75
Aufstellung der FTI (ohne FTI zur Absicherung von begebenen Anteilen):	
Summe Devisentermingeschäfte	-31.566,73
Summe Finanztermingeschäfte - Aktien	284.462,62
Summe Finanztermingeschäfte - Zinsen	108.003,99
Summe Finanztermingeschäfte - Währungen	
Summe Finanztermingeschäfte - Kredite	
Summe Finanztermingeschäfte - andere Engagements	46.560,41
Aufstellung der Finanztermingeschäfte zur Absicherung von begebenen Anteilen	
Sonstige Aktiva (+)	10.858.836,97
Sonstige Passiva (-)	-450.956,01
Passiva zur Finanzierung (-)	
<b>Summe + Nettovermögen</b>	<b>211.051.387,00</b>

Bezeichnung des Anteils	Währung des Anteils	Anzahl der Anteile	Nettoinventarwert
Anteilklasse HSBC MIX MODERE A	EUR	289.633,36700	326,56
Anteilklasse HSBC MIX MODERE I	EUR	100.910,20400	1.154,16