

Man Umbrella SICAV

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital
(„Société d’Investissement à Capital Variable“)
Investmentfonds nach luxemburgischem Recht

Luxemburg
R.C.S. Nr. B 53.150

Halbjahresbericht und ungeprüfter
Abschluss

Zum 30. Juni 2022

Auf der Grundlage der Jahres- und Halbjahresberichte dürfen keine Zeichnungen entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind.

	Seite
Management und Verwaltung	4
Informationen für Anteilinhaber	5
Nettovermögensaufstellung	6
Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile	8
Statistik	12
Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens	15
Man Convertibles Europe	17
Wertpapierbestand	17
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	19
Man Convertibles Global	20
Wertpapierbestand	20
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	27
Man AHL Trend Alternative	28
Wertpapierbestand	28
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	29
Man AHL Alpha Core Alternative	30
Wertpapierbestand	30
Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands	31
Erläuterungen zum Abschluss	32
Informationen für die Anleger in der Schweiz (TER und Performancedaten)	62
Ergänzende Informationen	66

Management und Verwaltung

Vorsitzender des Verwaltungsrats:

Yves Wagner
Direktion
19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsratsmitglieder:

Thomas Nummer
Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied
Großherzogtum Luxemburg

John Morton
CEO, Man Asset Management (Ireland) Limited
2 Dublin Landings, North Wall Quay
Dublin 1
Irland

Verwaltungsgesellschaft:

Waystone Management Company (Lux) S.A.
19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Vorsitzender der Verwaltungsgesellschaft:

Géry Daeninck
Independent Management Director

Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft:

John Li How Cheong
Independent Management Director

Martin Vogel
Chief Executive Officer,
Waystone Management Company (Lux) S.A.

Sitz des Fonds:

19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptverwaltungsstelle:

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung
Luxemburg
31, Zone d'activités Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter:

Anlageverwalter des Man AHL Trend Alternative
und des Man AHL Alpha Core Alternative:

AHL Partners LLP
Riverbank House
2 Swan Lane
London EC4R 3AD
Vereinigtes Königreich

Anlageverwalter des Man Convertibles Europe
und des Man Convertibles Global:

GLG Partners LP
Riverbank House
2 Swan Lane
London EC4R 3AD
Vereinigtes Königreich

Register- und Transferstelle:

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung
Luxemburg
31, Zone d'activités Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Depotbank:

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung
Luxemburg
31, Zone d'activités Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Abschlussprüfer:

Ernst & Young
Société Anonyme
35E, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Luxemburg:

Arendt & Medernach
Société Anonyme
41A, avenue John F. Kennedy
L-2082 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Informationen für Anteilhaber

Die jährliche Gesellschafterversammlung findet am zweiten Freitag des Monats Mai um 11:00 Uhr am Sitz von Man Umbrella SICAV (der „Fonds“) in Luxemburg-Stadt oder an einem anderen, im Einberufungsschreiben angegebenen Ort statt.

Die Einberufung zu Gesellschafterversammlungen, jegliche Satzungsänderung, Mitteilungen über die Auflösung und Liquidierung des Fonds oder eines Teilfonds sowie alle sonstigen wesentlichen Informationen an die Anteilhaber werden, soweit gesetzlich erforderlich, im Mémorial sowie in einer Luxemburger Tageszeitung veröffentlicht. Der Verwaltungsrat kann darüber hinaus nach eigenem Ermessen Veröffentlichungen in anderen Zeitungen in Luxemburg und in anderen Ländern, in welchen Anteile vertrieben werden, veranlassen.

Nach jeder Satzungsänderung wird eine koordinierte Fassung der Satzung beim Handels- und Gesellschaftsregister Luxemburg (RCS) hinterlegt und ein Hinweis auf diese Hinterlegung und Satzungsänderung im Mémorial veröffentlicht.

Der Fonds veröffentlicht einen Jahresbericht über seine Aktivitäten und die Verwaltung seiner Vermögenswerte. Dieser Bericht enthält die Aufstellung des Nettovermögens, die Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens, die Aufstellungen der Anlagen und den Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers. Der erste Jahresbericht wurde zum 31. Dezember 1996 veröffentlicht. Des Weiteren veröffentlicht der Fonds Halbjahresberichte, welche insbesondere Auskunft über die dem Portfolio zugrunde liegenden Investitionen und die Anzahl der seit der letzten Veröffentlichung ausgegebenen und zurückgenommenen Anteile geben. Der erste Halbjahresbericht wurde zum 30. Juni 1996 veröffentlicht.

Das Rechnungsjahr des Fonds endet am 31. Dezember jedes Jahres.

Der Verkaufsprospekt, die Dokumente mit den wesentlichen Informationen für die Anleger, die Satzung sowie die Jahres- und die Halbjahresberichte sind bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle kostenlos in Papierform erhältlich. Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie eventuelle Mitteilungen an die Anteilhaber sind außerdem beim eingetragenen Sitz des Fonds erhältlich.

Nettovermögensaufstellung
zum 30. Juni 2022

	Erläute- rungen	Man Convertibles Europe EUR	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD
AKTIVA				
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	(10)	12.182.847,68	240.009.805,21	580.978.324,19
Optionskontrakte zum Marktwert (Long-Positionen)	(15)	0,00	2.513,56	0,00
Gezahlter Einschuss	(17)	0,00	21.502,70	64.289.886,45
Bankguthaben		759.114,09	16.748.496,42	19.098.316,25
Brokerguthaben	(17)	159.955,68	13.993.136,10	45.129.646,60
Termineinlagen		0,00	0,00	351.114.711,87
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		0,00	226.528,35	0,00
Forderungen aus Zeichnungen		0,00	0,00	2.486.942,61
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		17.323,27	382.742,11	0,00
Rückerstattung der Quellensteuer		70.699,76	100.282,20	0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	(12)	12.855,20	1.628.396,31	42.686.767,31
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	(13)	0,00	12.272,23	25.351.927,23
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten	(14)	0,00	190.653,92	0,00
Sonstige Aktiva		0,00	0,00	0,00
SUMME AKTIVA		13.202.795,68	273.316.329,11	1.131.136.522,51
PASSIVA				
Überziehung		0,00	0,00	0,00
Erhaltener Einschuss	(17)	0,00	0,00	4.970.652,74
An Broker zahlbar	(17)	0,00	3.441.479,14	0,00
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		209.387,69	0,00	0,00
Zahlbare Beträge aus Rücknahmen		0,00	659.195,46	1.820.255,96
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften	(12)	26.608,85	259.800,64	55.214.416,78
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(13)	0,00	0,00	2.967.009,05
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten	(14)	63.343,54	4.049.986,49	0,00
Zahlbare Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren	(6)	49.395,75	694.872,84	16.607.783,79
Ausstehende Gebühren und Aufwendungen	(7)	26.614,91	153.357,27	497.449,59
Sonstige Passiva		2.220,99	36.212,87	68.473,74
SUMME PASSIVA		377.571,73	9.294.904,71	82.146.041,65
SUMME NETTOVERMÖGEN		12.825.223,95	264.021.424,40	1.048.990.480,86

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022

	Erläute- rungen	Man AHL Alpha Core Alternative USD
AKTIVA		
Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert	(10)	87.766.752,90
Optionskontrakte zum Marktwert (Long-Positionen)	(15)	0,00
Gezahlter Einschuss	(17)	8.778.640,65
Bankguthaben		3.405.422,94
Brokerguthaben	(17)	11.588.981,93
Termineinlagen		46.053.958,74
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		0,00
Forderungen aus Zeichnungen		10.135,54
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		0,00
Rückerstattung der Quellensteuer		0,00
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	(12)	5.290.908,99
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	(13)	3.464.771,52
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten	(14)	0,00
Sonstige Aktiva		0,00
SUMME AKTIVA		166.359.573,21
PASSIVA		
Überziehung		0,55
Erhaltener Einschuss	(17)	1.703.966,99
An Broker zahlbar	(17)	0,01
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		0,00
Zahlbare Beträge aus Rücknahmen		304.395,33
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften	(12)	7.098.640,56
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(13)	402.337,26
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten	(14)	0,00
Zahlbare Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren	(6)	1.404.630,78
Ausstehende Gebühren und Aufwendungen	(7)	98.038,31
Sonstige Passiva		17.716,04
SUMME PASSIVA		11.029.725,83
SUMME NETTOVERMÖGEN		155.329.847,38

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

	Man Convertibles Europe	Man Convertibles Global	Man AHL Trend Alternative
Man Convertibles Europe D EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	82.677,95	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	-	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	12.556,06	-	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	70.121,89	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	8.316,32	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	-	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	172,54	-	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	8.143,78	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	10.311,64	-	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	-	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	0,42	-	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	10.311,22	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	371.539,23	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	121,16	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	50.918,61	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	320.741,78	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	163.799,49	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	270,00	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	20.765,55	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	143.303,94	-
Man Convertibles Global D H USD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	134.309,90	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	2.110,00	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	33.001,77	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	103.418,13	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	12.861,36	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	15.345,00	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	500,00	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	27.706,36	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	29.185,71	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	1.410,00	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	2.970,81	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	27.624,90	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	8.085,00	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	800,00	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	2.755,93	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	6.129,07	-
Man Convertibles Global I EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	797.066,88	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	4.431,22	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	13.020,52	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	788.477,58	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	-	64.001,31	-
Anzahl der ausgegebenen Anteile	-	31.440,00	-
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	-	42.781,31	-
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	-	52.660,00	-

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

	Man Convertibles Europe	Man Convertibles Global	Man AHL Trend Alternative
Man Convertibles Global I H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	446.039,94	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	10.965,00	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	10.526,73	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	446.478,21	–
Man Convertibles Global I H USD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	21.615,03	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	420,00	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	21.195,03	–
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	8.699,74
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	3.324,63
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	6.763,76
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	5.260,61
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	29.250,49
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	149,78
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	8.468,73
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	20.931,54
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	335.398,65
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	76.779,44
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	23.422,96
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	388.755,13
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	96.297,77
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	2.628,60
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	4.259,19
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	94.667,18
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	735.790,11
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	129.230,60
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	201.328,35
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	663.692,36
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	12.059,18
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	9.128,44
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	1.169,65
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	20.017,97
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	5.210,17
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	5.210,17
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	29.766,85
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	108.975,69
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	13.727,38
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	125.015,16
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	535.930,48
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	18.198,78
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	52.397,36
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	501.731,90

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

	Man Convertibles Europe	Man Convertibles Global	Man AHL Trend Alternative
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	185.000,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	1.643.165,66
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	10.349,17
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	1.817.816,49
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	92.978,81
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	5.831,15
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	9.649,41
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	89.160,55
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	900.693,67
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	128.064,52
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	240.587,45
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	788.170,74
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	381.092,75
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	32.583,00
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	47.786,97
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	365.888,78
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	1.921.984,91
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	564.761,68
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	658.021,87
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	1.828.724,72
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	158.715,56
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	44.672,21
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	16.732,20
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	186.655,57
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	50,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	50,00
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc			
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	10.000,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–	–	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	–	–	–
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	–	–	10.000,00

Veränderungen der im Umlauf befindlichen Anteile (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Man
AHL Alpha
Core
Alternative

Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	2.811,15
Anzahl der ausgegebenen Anteile	–
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	162,09
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	2.649,06
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	119.822,34
Anzahl der ausgegebenen Anteile	5.751,96
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	10.106,44
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	115.467,86
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc⁽¹⁾	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	7.444,13
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	619,56
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	6.824,57
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	624.502,50
Anzahl der ausgegebenen Anteile	88.976,05
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	465.101,09
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	248.377,46
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc⁽²⁾	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	–
Anzahl der ausgegebenen Anteile	2.988,04
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	362,15
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	2.625,89
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	926.788,80
Anzahl der ausgegebenen Anteile	6.649,17
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	102.036,93
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	831.401,04
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	
Anzahl der ausstehenden Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	10,00
Anzahl der ausgegebenen Anteile	345.914,78
Anzahl der zurückgenommenen Anteile	89.918,72
Anzahl der ausstehenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraums	256.006,06

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Statistik
zum 30. Juni 2022

	Man Convertible Europe EUR	Man Convertible Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD
Summe Nettoinventarwert			
30. Juni 2022	12.825.223,95	264.021.424,40	1.048.990.480,86
31. Dezember 2021	17.371.570,66	335.107.688,12	811.972.477,79
31. Dezember 2020	23.819.464,28	304.366.124,99	738.766.695,25
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums			
30. Juni 2022			
Man Convertibles Europe D EUR Acc	153,30	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	114,44	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	110,98	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	148,43	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	121,19	-
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	121,00	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	101,95	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	97,99	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	114,57	-
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	133,90	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	123,44	-
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	148,59	-
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	124,76	-
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	-	-	113,11
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	-	-	135,71
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	-	-	161,21
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	-	-	135,42
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	-	-	148,65
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	-	-	157,47
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	-	-	127,40
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	-	-	156,22
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	-	-	124,29
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	-	-	111,55
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	-	-	130,95
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	-	-	176,27
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	-	-	127,13
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	-	-	158,72
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	-	-	134,89
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	-	-	140,70
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	-	-	104,44
31. Dezember 2021			
Man Convertibles Europe D EUR Acc	180,76	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	134,92	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	130,35	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	181,77	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	148,57	-
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	146,88	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	124,39	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	119,63	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	138,63	-
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	163,33	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	151,04	-
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	181,33	-
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	150,93	-
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	-	-	100,99
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	-	-	120,85
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	-	-	143,83
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	-	-	120,25
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	-	-	132,98
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	-	-	140,74
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	-	-	113,05

Statistik (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022

	Man Convertibles Europe EUR	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD
Nettoinventarwert je Anteil zum Ende des Berichtszeitraums (Fortsetzung)			
31. Dezember 2021 (Fortsetzung)			
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	-	-	138,67
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	-	-	110,64
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc ⁽¹⁾	-	-	99,74
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	-	-	116,44
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	-	-	156,78
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	-	-	113,00
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	-	-	141,48
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	-	-	119,47
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	-	-	125,01
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc ⁽²⁾	-	-	92,84
31. Dezember 2020			
Man Convertibles Europe D EUR Acc	179,88	-	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	134,58	-	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	128,69	-	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	184,77	-
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	151,42	-
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	147,92	-
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	125,50	-
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	121,02	-
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	138,59	-
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	164,72	-
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	153,11	-
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	183,35	-
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	150,83	-
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	-	-	105,15
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	-	-	125,76
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	-	-	149,32
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	-	-	125,79
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	-	-	139,09
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	-	-	146,24
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	-	-	117,92
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	-	-	143,50
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	-	-	114,99
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	-	-	120,37
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	-	-	161,37
Man AHL Trend Alternative IN H CAD Acc ⁽³⁾	-	-	104,64
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	-	-	117,00
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	-	-	146,90
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	-	-	123,86
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	-	-	128,62

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 22. Dezember 2021 aufgelegt

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 4. November 2021 aufgelegt

⁽³⁾ Die Anteilsklasse wurde am 13. November 2020 geschlossen. Der angegebene NIW je Anteil bezieht sich auf das Datum der Schließung der Anteilsklasse.

Statistik (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022

Man AHL Alpha
Core Alternative
USD

Summe Nettoinventarwert	
30. Juni 2022	155.329.847,38
31. Dezember 2021	188.257.298,77
31. Dezember 2020	206.764.530,88
Nettoinventarwert je Anteil am Ende des Berichtszeitraums	
30. Juni 2022	
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	147,86
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	161,32
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc ⁽⁴⁾	104,95
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	117,85
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc ⁽⁵⁾	111,52
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	11.918,54
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	102,13
31. Dezember 2021	
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	134,31
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	146,64
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	107,56
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	10.858,78
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc ⁽⁶⁾	94,41
31. Dezember 2020	
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	144,98
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	157,12
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	115,85
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	11.607,03

⁽⁴⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽⁵⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽⁶⁾ Die Anteilsklasse wurde am 15. November 2021 aufgelegt

Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

	Erläute- rungen	Man Convertible Europe EUR	Man Convertible Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		17.371.570,66	335.107.688,12	811.972.477,79
ERTRÄGE				
Zinsen aus Anleihen, netto		0,00	566.514,63	49.040,80
Zinsertrag aus Swap-Kontrakten		0,00	4.554,56	0,00
Bankzinsen		6,48	611,82	689.271,19
Sonstige Einnahmen		339,99	905,08	0,00
Nachlass auf Anlageverwaltungsgebühr	(6)	0,00	0,00	0,00
SUMME ERTRÄGE		346,47	572.586,09	738.311,99
AUFWENDUNGEN				
Managementgebühr	(6)	106.627,37	1.472.637,97	7.072.453,22
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft		1.293,42	26.251,11	73.470,05
Erfolgsgebühren	(6)	0,00	0,00	13.168.346,51
Depotbankgebühr	(4)	14.048,56	58.104,11	97.197,78
Domizilstellen-, Administrations- und Transferstellengebühren		18.688,76	124.548,40	342.585,24
Revisionskosten, Druck- und Veröffentlichungskosten		10.908,51	45.590,81	91.291,18
Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement)	(5)	3.162,04	32.652,99	125.056,65
Bankzinsen		4.481,45	90.952,69	56.994,95
Zinsverbindlichkeiten auf Swap-Kontrakte		198,65	0,00	0,00
Transaktionskosten	(8)	18,96	161,11	242.045,78
Sonstige Aufwendungen	(9)	30.394,70	85.661,62	225.424,44
SUMME AUFWENDUNGEN		189.822,42	1.936.560,81	21.494.865,80
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		(189.475,95)	(1.363.974,72)	(20.756.553,81)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen		(37.514,06)	(15.766.810,86)	26.328.035,81
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		(158.205,62)	(5.682.244,87)	(10.819.169,06)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten		(62.710,00)	(159.112,97)	50.409.084,57
Realisierter Nettogewinn aus Swap-Kontrakten		38.320,00	95.304,42	0,00
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten		(48.868,91)	(5.340.668,78)	(2.223.626,83)
REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST)		(268.978,59)	(26.853.533,06)	63.694.324,49
Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus:				
- Wertpapieren		(1.851.662,51)	(21.289.752,21)	142.893,80
- Devisentermingeschäften		(36.287,65)	(1.719.864,15)	(22.088.379,48)
- Optionskontrakte		0,00	(291,39)	0,00
- Futures-Kontrakten		0,00	12.272,23	17.375.204,99
- Swap-Kontrakten		(63.343,54)	(3.859.332,57)	0,00
ANSTIEG/(RÜCKGANG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		(2.409.748,24)	(55.074.475,87)	38.367.489,99
KAPITALBEWEGUNGEN				
Ausgabe von Anteilen		0,00	9.295.999,64	398.847.092,04
Rücknahme von Anteilen		(2.136.598,47)	(25.269.133,07)	(200.196.578,96)
Gezahlte Dividende	(16)	0,00	(38.654,42)	0,00
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		12.825.223,95	264.021.424,40	1.048.990.480,86

Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Man
AHL Alpha Core
Alternative

	Erläute- rungen	USD
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES BERICHTSZEITRAUMS		188.257.298,77
ERTRÄGE		
Zinsen aus Anleihen, netto		14.561,58
Zinsertrag aus Swap-Kontrakten		0,00
Bankzinsen		142.159,65
Sonstige Einnahmen		0,00
Nachlass auf Anlageverwaltungsgebühr	(6)	0,00
SUMME ERTRÄGE		156.721,23
AUFWENDUNGEN		
Managementgebühr	(6)	873.637,47
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft		15.441,06
Erfolgsgebühren	(6)	1.013.312,42
Depotbankgebühr	(4)	32.485,25
Domizilstellen-, Administrations- und Transferstellengebühren		79.125,41
Revisionskosten, Druck- und Veröffentlichungskosten		21.589,61
Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement)	(5)	12.883,85
Bankzinsen		27.779,23
Zinsverbindlichkeiten auf Swap-Kontrakte		0,00
Transaktionskosten	(8)	45.267,19
Sonstige Aufwendungen	(9)	44.085,32
SUMME AUFWENDUNGEN		2.165.606,81
NETTOERTRAG / (NETTOAUFWAND) AUS ANLAGEN		(2.008.885,58)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen		(58,24)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften		(13.578.375,27)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten		11.035.366,96
Realisierter Nettogewinn aus Swap-Kontrakten		0,00
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenkontrakten		(383.883,76)
REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST)		(2.926.950,31)
Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus:		
- Wertpapieren		74.314,31
- Devisentermingeschäften		(3.243.977,11)
- Optionskontrakte		0,00
- Futures-Kontrakten		1.980.701,19
- Swap-Kontrakten		0,00
ANSTIEG/(RÜCKGANG) DES NETTOVERMÖGENS AUS DER GESCHÄFTSTÄTIGKEIT		(6.124.797,50)
KAPITALBEWEGUNGEN		
Ausgabe von Anteilen		50.940.477,36
Rücknahme von Anteilen		(77.743.131,25)
Gezahlte Dividende	(16)	0,00
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS		155.329.847,38

Man Convertibles Europe

Wertpapierbestand

zum 30. Juni 2022

(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Anleihen – Wandelanleihen					
Österreich					
ams-OSRAM AG 0.88% 28/Sep/2022	200.000	EUR	169.653,88	189.036,30	1,47
ams-OSRAM AG 2.13% 3/Nov/2027	200.000	EUR	207.020,00	146.375,00	1,14
			376.673,88	335.411,30	2,61
Belgien					
Umicore SA 0.00% 23/Jun/2025	200.000	EUR	206.220,00	177.225,00	1,38
			206.220,00	177.225,00	1,38
Frankreich					
Archer Obligations SA 0.00% 31/Mar/2023	100.000	EUR	128.830,00	125.386,00	0,97
Atos SE 0.00% 6/Nov/2024	200.000	EUR	236.402,00	154.960,00	1,21
BNP Paribas SA 0.00% 13/May/2025	100.000	EUR	108.960,00	106.097,50	0,83
Carrefour SA 0.00% 27/Mar/2024	200.000	EUR	164.238,71	185.087,76	1,44
Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA 0.00% 10/Nov/2023	400.000	EUR	317.368,01	360.992,87	2,82
Edenred 0.00% 6/Sep/2024	1.700	EUR	100.427,69	100.874,60	0,79
Elis SA 0.00% 6/Oct/2023	3.000	EUR	98.169,57	91.839,99	0,72
Engie SA 0.00% 2/Jun/2024	750	EUR	84.943,37	90.945,00	0,71
Kering SA 0.00% 30/Sep/2022	100.000	EUR	101.040,00	99.729,58	0,78
Korian SA 0.88% 6/Mar/2027	2.000	EUR	96.506,98	95.377,79	0,74
Orpea SA 0.38% 17/May/2027	800	EUR	91.096,24	71.717,14	0,56
Safran SA 0.00% 1/Apr/2028	1.200	EUR	193.821,71	183.739,50	1,43
Safran SA 0.88% 15/May/2027	1.500	EUR	200.700,44	175.092,02	1,37
Schneider Electric SE 0.00% 15/Jun/2026	850	EUR	169.164,99	147.249,75	1,15
Selena Sarl 0.00% 25/Jun/2025	100.000	EUR	105.410,00	95.972,50	0,75
Soitec 0.00% 1/Oct/2025	450	EUR	85.957,84	83.010,00	0,65
TotalEnergies SE 0.50% 2/Dec/2022	400.000	EUR	342.372,74	392.271,27	3,06
Veolia Environnement SA 0.00% 1/Jan/2025	4.500	EUR	152.383,68	139.087,49	1,08
Worldline SA 0.00% 30/Jul/2025	1.400	EUR	167.876,72	147.017,50	1,15
Worldline SA 0.00% 30/Jul/2026	1.800	EUR	187.578,58	153.896,40	1,20
			3.133.249,27	3.000.344,66	23,41
Deutschland					
Adidas AG 0.05% 12/Sep/2023	200.000	EUR	201.020,00	196.413,84	1,53
BASF SE 0.93% 9/Mar/2023	250.000	EUR	208.077,86	233.990,15	1,82
Delivery Hero SE 0.25% 23/Jan/2024	400.000	EUR	400.034,29	343.866,68	2,68
Delivery Hero SE 1.00% 23/Jan/2027	300.000	EUR	273.130,00	207.532,50	1,62
Deutsche Post AG 0.05% 30/Jun/2025	300.000	EUR	299.628,00	297.915,00	2,32
LEG Immobilien SE 0.88% 1/Sep/2025	100.000	EUR	113.950,00	93.718,75	0,73
RAG-Stiftung 0.00% 17/Jun/2026	200.000	EUR	229.320,00	188.183,34	1,47
TUI AG 5.00% 16/Apr/2028	100.000	EUR	112.010,00	76.083,00	0,59
Zalando SE 0.63% 6/Aug/2027	200.000	EUR	232.770,00	142.050,00	1,11
			2.069.940,15	1.779.753,26	13,87
Italien					
Diasorin SpA 0.00% 5/May/2028	200.000	EUR	212.760,00	165.190,00	1,29
Nexi SpA 1.75% 24/Apr/2027	200.000	EUR	223.058,00	157.200,00	1,22
Pirelli & Company SpA 0.00% 22/Dec/2025	200.000	EUR	206.720,00	180.383,34	1,41
Prismian SpA 0.00% 2/Feb/2026	200.000	EUR	199.240,00	180.756,00	1,41
			841.778,00	683.529,34	5,33
Jersey – Kanalinseln					
Cornwall Jersey Limited 0.75% 16/Apr/2026	200.000	EUR	216.182,16	151.052,05	1,18
			216.182,16	151.052,05	1,18
Luxemburg					
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.50% 4/Aug/2023	100.000	EUR	111.094,00	101.875,00	0,79
Lagfin Sca 2.00% 2/Jul/2025	100.000	EUR	109.960,00	110.112,50	0,86
Oliver Capital Sarl 0.00% 29/Dec/2023	100.000	EUR	105.590,00	100.790,50	0,79
			326.644,00	312.778,00	2,44
Niederlande					
America Movil SAB de CV 0.00% 2/Mar/2024	500.000	EUR	523.500,00	554.650,00	4,32
Brenntag Finance BV 1.88% 2/Dec/2022	250.000	EUR	239.698,24	239.370,61	1,87
ELM BV for Swiss Reinsurance Company Limited 3.25% 13/Jun/2024	200.000	EUR	170.088,15	188.355,89	1,47

Die beigefügten Erluterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Man Convertibles Europe
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Niederlande (Fortsetzung)					
Iberdrola International BV 0.00% 11/Nov/2022	200.000	EUR	233.985,33	238.364,00	1,86
Just Eat Takeaway.com NV 0.00% 9/Aug/2025	300.000	EUR	280.080,00	209.130,00	1,63
Just Eat Takeaway.com NV 2.25% 25/Jan/2024	100.000	EUR	129.580,00	89.370,00	0,70
Qiagen NV 0.50% 13/Sep/2023	200.000	EUR	191.044,85	224.544,45	1,75
STMicroelectronics NV 0.00% 4/Aug/2027	400.000	EUR	424.293,05	383.421,49	2,99
			2.192.269,62	2.127.206,44	16,59
Spanien					
Amadeus IT Group SA 1.50% 9/Apr/2025	200.000	EUR	242.408,00	232.900,00	1,81
Cellnex Telecom SA 0.50% 5/Jul/2028	400.000	EUR	425.240,00	408.866,68	3,19
Cellnex Telecom SA 0.75% 20/Nov/2031	200.000	EUR	181.820,00	136.925,00	1,07
Cellnex Telecom SA 1.50% 16/Jan/2026	100.000	EUR	155.110,00	126.570,83	0,99
International Consolidated Airlines Group SA 1.13% 18/May/2028	200.000	EUR	156.020,00	135.816,00	1,06
			1.160.598,00	1.041.078,51	8,12
Schweden					
Geely Sweden Financials Holding AB 0.00% 19/Jun/2024	100.000	EUR	116.760,00	108.195,00	0,84
			116.760,00	108.195,00	0,84
Schweiz					
Sika AG 0.15% 5/Jun/2025	360.000	EUR	448.439,88	448.681,91	3,50
Swiss Prime Site AG 0.33% 16/Jan/2025	200.000	EUR	189.422,78	195.286,74	1,52
			637.862,66	643.968,65	5,02
Vereinigtes Konigreich					
Barclays Bank plc 0.00% 24/Jan/2025	100.000	EUR	109.010,00	98.424,50	0,77
BP Capital Markets plc 1.00% 28/Apr/2023	100.000	EUR	139.756,92	118.440,19	0,92
Ocado Group plc 0.88% 9/Dec/2025	200.000	EUR	226.134,29	183.512,11	1,43
			474.901,21	400.376,80	3,12
USA					
Glencore Funding LLC 0.00% 27/Mar/2025	200.000	EUR	153.157,38	195.697,55	1,53
JPMorgan Chase Bank 0.00% 18/Feb/2024	100.000	EUR	107.086,00	97.541,67	0,76
JPMorgan Chase Bank NA 0.00% 10/Jun/2024	100.000	EUR	106.480,00	100.235,00	0,78
JPMorgan Chase Financial Company LLC 0.00% 14/Jan/2025	100.000	EUR	105.490,00	106.005,00	0,82
			472.213,38	499.479,22	3,89
Summe Anleihen – Wandelanleihen			12.225.292,33	11.260.398,23	87,80
Aktien					
Frankreich					
Ubisoft Entertainment SA	513	EUR	40.724,42	21.494,70	0,17
			40.724,42	21.494,70	0,17
Summe Aktien			40.724,42	21.494,70	0,17
Summe ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Borsennotierung			12.266.016,75	11.281.892,93	87,97
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte ubertragbare Wertpapiere					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
Frankreich					
France (Govt of) 0.00% 5/Oct/2022	500.000	EUR	502.046,95	500.526,75	3,90
France (Govt of) 0.00% 2/Nov/2022	400.000	EUR	401.299,88	400.428,00	3,12
			903.346,83	900.954,75	7,02
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			903.346,83	900.954,75	7,02
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte ubertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte ubertragbare Wertpapiere			903.346,83	900.954,75	7,02
SUMME WERTPAPIERBESTAND			13.169.363,58	12.182.847,68	94,99

Man Convertibles Europe

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2022

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

Geografische Aufteilung	%	Wirtschaftliche Aufteilung	%
Frankreich	30,60	Regierungen	7,02
Niederlande	16,59	Halbleiter	6,25
Deutschland	13,87	Nahrungsmittel	5,20
Spanien	8,12	Chemie	5,07
Italien	5,33	Gewerbliche Dienstleistungen	4,97
Schweiz	5,02	Telekommunikationsdienste	4,32
USA	3,89	Internet-Software und -Dienstleistungen	4,30
Vereinigtes Königreich	3,12	Ingenieurs- und Bauwesen	4,26
Österreich	2,61	Öl- und Gasproduzenten	3,98
Luxemburg	2,44	Automobilhersteller	3,66
Belgien	1,38	Finanzdienstleistungen	3,58
Jersey – Kanalinseln	1,18	Grundstoffe und Rohstoffe	3,50
Schweden	0,84	Banken	3,14
	94,99	Gesundheitsprodukte und -ausrüstung	3,04
		Elektrische Ausrüstung	3,01
		Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	2,80
		Software	2,58
		Investmentgesellschaften	2,58
		Transport	2,32
		Bekleidung	2,31
		Immobilienanlagefonds	2,25
		Bergbau (Nichtedelmetalle)	1,53
		Versicherungen	1,47
		Kohle	1,47
		Drähte und Seile	1,41
		Autoteile und -ausrüstung	1,41
		Gesundheitswesen – Dienstleistungen	1,30
		Einzelhandel	1,11
		Wasserversorgung	1,08
		Fluggesellschaften	1,06
		Industrie	0,99
		Energie und Wasserversorgung	0,72
		Elektrizitätsversorgung	0,71
		Tourismus	0,59
			94,99

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand
 zum 30. Juni 2022
 (in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Anleihen – Wandelanleihen					
Australien					
Cromwell SPV Finance Pty Limited 2.50% 29/Mar/2025	600.000	EUR	651.000,00	598.275,00	0,23
DEXUS Finance Pty Limited 2.30% 19/Jun/2026	1.000.000	EUR	633.361,40	633.911,41	0,24
Flight Centre Travel Group Limited 1.63% 1/Nov/2028	800.000	EUR	499.559,64	456.703,00	0,17
Flight Centre Travel Group Limited 2.50% 17/Nov/2027	1.000.000	EUR	691.022,71	701.906,84	0,27
Seven Group Holdings Limited 2.20% 5/Mar/2025	800.000	EUR	579.524,43	510.615,23	0,19
			<u>3.054.468,18</u>	<u>2.901.411,48</u>	<u>1,10</u>
Belgien					
Sagerpar SA 0.00% 1/Apr/2026	1.300.000	EUR	1.338.630,00	1.193.806,25	0,45
			<u>1.338.630,00</u>	<u>1.193.806,25</u>	<u>0,45</u>
Kanada					
Shopify Inc. 0.13% 1/Nov/2025	1.247.000	EUR	1.175.929,80	1.006.185,69	0,38
			<u>1.175.929,80</u>	<u>1.006.185,69</u>	<u>0,38</u>
Kaimaninseln					
Bosideng International Holdings Limited 1.00% 17/Dec/2024	600.000	EUR	681.529,34	678.081,21	0,26
Cathay Pacific Finance III Limited 2.75% 5/Feb/2026	14.000.000	EUR	1.610.157,75	1.849.749,56	0,70
ESR Cayman Limited 1.50% 30/Sep/2025	912.000	EUR	809.564,06	828.297,86	0,31
Kingsoft Corp. Limited 0.63% 29/Apr/2025	9.000.000	EUR	1.262.497,05	1.234.763,23	0,47
Trip.com Group Limited 1.50% 1/Jul/2027	740.000	EUR	728.239,57	818.449,98	0,31
Zhen Ding Technology Holding Limited 0.00% 30/Jun/2025	1.300.000	EUR	1.153.856,19	1.212.256,68	0,46
Zhongsheng Group Holdings Limited 0.00% 21/May/2025	12.000.000	EUR	1.845.427,38	1.920.620,91	0,73
			<u>8.091.271,34</u>	<u>8.542.219,43</u>	<u>3,24</u>
China					
Zhejiang Expressway Company Limited 0.00% 20/Jan/2026	1.000.000	EUR	1.026.500,00	1.086.400,00	0,41
			<u>1.026.500,00</u>	<u>1.086.400,00</u>	<u>0,41</u>
Dänemark					
GN Store Nord A/S 0.00% 21/May/2024	900.000	EUR	980.595,00	826.875,00	0,31
			<u>980.595,00</u>	<u>826.875,00</u>	<u>0,31</u>
Frankreich					
Accor SA 0.70% 7/Dec/2027	22.800	EUR	1.201.412,39	938.717,40	0,36
Atos SE 0.00% 6/Nov/2024	900.000	EUR	1.051.890,00	697.320,00	0,26
BNP Paribas SA 0.00% 13/May/2025	800.000	EUR	925.680,00	848.780,00	0,32
Carrefour SA 0.00% 27/Mar/2024	600.000	EUR	475.338,30	555.263,28	0,21
Edenred 0.00% 6/Sep/2024	14.500	EUR	908.905,10	860.401,00	0,33
Edenred 0.00% 14/Jun/2028	11.450	EUR	750.003,40	678.412,50	0,26
Safran SA 0.88% 15/May/2027	3.290	EUR	431.246,29	384.035,15	0,15
Soitec 0.00% 1/Oct/2025	2.820	EUR	579.624,02	520.196,01	0,20
Worldline SA 0.00% 30/Jul/2025	8.680	EUR	1.067.789,93	911.508,50	0,35
			<u>7.391.889,43</u>	<u>6.394.633,84</u>	<u>2,44</u>
Deutschland					
Delivery Hero SE 1.00% 23/Jan/2027	200.000	EUR	225.396,36	138.355,00	0,05
Deutsche Lufthansa AG 2.00% 17/Nov/2025	500.000	EUR	563.150,00	459.250,00	0,17
TAG Immobilien AG 0.63% 27/Aug/2026	600.000	EUR	619.800,00	445.399,98	0,17
TUI AG 5.00% 16/Apr/2028	800.000	EUR	858.830,00	608.664,00	0,23
			<u>2.267.176,36</u>	<u>1.651.668,98</u>	<u>0,62</u>
Hongkong					
Lenovo Group Limited 3.38% 24/Jan/2024	1.478.000	EUR	1.845.044,03	1.698.296,86	0,64
Xiaomi Best Time International Limited 0.00% 17/Dec/2027	600.000	EUR	551.173,53	480.080,35	0,18
			<u>2.396.217,56</u>	<u>2.178.377,21</u>	<u>0,82</u>
Indien					
Bharti Airtel Limited 1.50% 17/Feb/2025	1.715.000	EUR	1.701.432,07	2.014.880,99	0,76
			<u>1.701.432,07</u>	<u>2.014.880,99</u>	<u>0,76</u>

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
 zum 30. Juni 2022
 (in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Israel					
CyberArk Software Limited 0.00% 15/Nov/2024	1.054.000	EUR	995.153,80	1.060.947,55	0,40
			995.153,80	1.060.947,55	0,40
Italien					
Diasorin SpA 0.00% 5/May/2028	900.000	EUR	904.009,09	743.355,00	0,29
Pirelli & Company SpA 0.00% 22/Dec/2025	1.000.000	EUR	1.087.046,47	901.916,70	0,34
Prysmian SpA 0.00% 2/Feb/2026	1.500.000	EUR	1.527.488,25	1.355.670,00	0,51
			3.518.543,81	3.000.941,70	1,14
Japan					
ANA Holdings Inc. 0.00% 10/Dec/2031	300.000.000	EUR	2.296.355,09	2.093.577,87	0,79
Cosmo Energy Holdings Company Limited 0.00% 5/Dec/2022	140.000.000	EUR	1.105.432,26	1.081.940,02	0,41
DMG Mori Company Limited 0.00% 16/Jul/2024	70.000.000	EUR	568.125,94	498.030,02	0,19
Ezaki Glico Company Limited 0.00% 30/Jan/2024	50.000.000	EUR	388.107,42	350.037,09	0,13
Kyoritsu Maintenance Company Limited 0.00% 29/Jan/2026	70.000.000	EUR	577.646,67	587.051,96	0,22
Mercari Inc. 0.00% 14/Jul/2028	40.000.000	EUR	329.538,49	231.585,54	0,09
Mitsubishi Chemical Holdings Corp. 0.00% 29/Mar/2024	180.000.000	EUR	1.483.965,43	1.264.490,01	0,48
Nagoya Railroad Company Limited 0.00% 11/Dec/2024	180.000.000	EUR	1.624.789,68	1.292.751,73	0,49
Nippon Steel Corp. 0.00% 4/Oct/2024	160.000.000	EUR	1.263.417,14	1.146.662,45	0,43
Nippon Steel Corp. 0.00% 5/Oct/2026	380.000.000	EUR	3.004.396,10	2.729.329,82	1,03
Park24 Company Limited 0.00% 29/Oct/2025	40.000.000	EUR	309.071,44	262.621,33	0,10
Rohm Company Limited 0.00% 5/Dec/2024	110.000.000	EUR	950.583,73	785.619,73	0,30
SBI Holdings Inc. 0.00% 13/Sep/2023	380.000.000	EUR	3.070.895,35	2.725.931,93	1,03
Shizuoka Bank Limited FRN 25/Jan/2023	600.000	EUR	522.534,96	564.285,58	0,21
Sosei Group Corp. 0.25% 27/Jul/2026	50.000.000	EUR	378.275,10	329.589,77	0,12
Sumitomo Metal Mining Company 0.00% 15/Mar/2023	70.000.000	EUR	585.686,55	492.855,04	0,19
			18.458.821,35	16.436.359,89	6,21
Jersey – Kanalinseln					
Cornwall Jersey Limited 0.75% 16/Apr/2026	300.000	EUR	325.046,30	226.578,07	0,09
			325.046,30	226.578,07	0,09
Luxemburg					
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.50% 4/Aug/2023	500.000	EUR	557.896,87	509.375,00	0,19
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0.00% 25/Jul/2024	14.000.000	EUR	1.650.613,10	1.753.925,74	0,66
IWG International Holdings 0.50% 9/Dec/2027	900.000	EUR	1.033.141,84	772.179,67	0,29
Lagfin Sca 2.00% 2/Jul/2025	700.000	EUR	854.755,00	770.787,50	0,29
Oliver Capital Sarl 0.00% 29/Dec/2023	800.000	EUR	839.516,52	806.324,00	0,31
			4.935.923,33	4.612.591,91	1,74
Malaysia					
Cerah Capital Limited 0.00% 8/Aug/2024	1.206.000	EUR	1.045.109,87	1.149.196,24	0,44
Cindai Capital Limited 0.00% 8/Feb/2023	1.648.000	EUR	1.442.830,78	1.546.443,35	0,59
			2.487.940,65	2.695.639,59	1,03
Niederlande					
Brenntag Finance BV 1.88% 2/Dec/2022	500.000	EUR	502.965,52	478.741,21	0,18
Dufry One BV 0.75% 30/Mar/2026	1.400.000	EUR	1.306.803,73	1.072.875,59	0,41
ELM BV for Swiss Reinsurance Company Limited 3.25% 13/Jun/2024	600.000	EUR	548.937,46	565.067,66	0,21
Iberdrola International BV 0.00% 11/Nov/2022	200.000	EUR	255.000,00	238.364,00	0,09
Just Eat Takeaway.com NV 0.00% 9/Aug/2025	700.000	EUR	669.366,55	487.970,00	0,18
			3.283.073,26	2.843.018,46	1,07
Neuseeland					
Xero Investments Limited 0.00% 2/Dec/2025	1.570.000	EUR	1.337.694,64	1.183.075,23	0,45
			1.337.694,64	1.183.075,23	0,45
Republik Korea (Süd)					
Kakao Corp. 0.00% 28/Apr/2023	600.000	EUR	682.608,51	566.741,59	0,21
LG Display Company Limited 1.50% 22/Aug/2024	1.200.000	EUR	1.064.705,25	1.140.657,13	0,43
Posco Holdings Inc. 0.00% 1/Sep/2026	2.000.000	EUR	2.050.750,00	1.863.933,40	0,71
			3.798.063,76	3.571.332,12	1,35

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Singapur					
SGX Treasury I Pte Limited 0.00% 1/Mar/2024	700.000	EUR	709.000,00	696.080,00	0,26
Singapore Airlines Limited 1.63% 3/Dec/2025	2.000.000	EUR	1.374.396,80	1.426.335,63	0,54
			2.083.396,80	2.122.415,63	0,80
Spanien					
Amadeus IT Group SA 1.50% 9/Apr/2025	200.000	EUR	246.920,00	232.900,00	0,09
International Consolidated Airlines Group SA 1.13% 18/May/2028	1.500.000	EUR	1.484.680,00	1.018.620,00	0,39
			1.731.600,00	1.251.520,00	0,48
Schweden					
Geely Sweden Financials Holding AB 0.00% 19/Jun/2024	600.000	EUR	771.900,00	649.170,00	0,25
			771.900,00	649.170,00	0,25
Schweiz					
Idorsia Limited 2.13% 4/Aug/2028	1.400.000	EUR	1.285.168,94	1.064.016,61	0,40
Swiss Prime Site AG 0.33% 16/Jan/2025	380.000	EUR	348.334,87	371.044,80	0,14
			1.633.503,81	1.435.061,41	0,54
Taiwan					
GlobalWafers Company Limited 0.00% 1/Jun/2026	2.600.000	EUR	2.282.055,95	2.157.444,16	0,83
Hon Hai Precision Industry Company Limited 0.00% 6/Nov/2022	600.000	EUR	581.797,95	581.376,44	0,22
Hon Hai Precision Industry Company Limited 0.00% 5/Aug/2026	1.100.000	EUR	953.411,69	939.185,04	0,36
Taiwan Cement Corp. 0.00% 7/Dec/2026	1.500.000	EUR	1.348.890,15	1.294.710,41	0,49
United Microelectronics Corp. 0.00% 7/Jul/2026	600.000	EUR	513.942,32	510.308,48	0,19
Win Semiconductors Corp. 0.00% 14/Jan/2026	1.200.000	EUR	1.058.034,70	983.104,46	0,37
			6.738.132,76	6.466.128,99	2,46
Vereinigte Arabische Emirate					
Abu Dhabi National Oil Company 0.70% 4/Jun/2024	2.400.000	EUR	2.065.298,37	2.113.730,93	0,80
			2.065.298,37	2.113.730,93	0,80
Vereinigtes Konigreich					
Barclays Bank plc 0.00% 24/Jan/2025	700.000	EUR	749.700,00	688.971,50	0,26
BP Capital Markets plc 1.00% 28/Apr/2023	900.000	EUR	1.105.732,35	1.065.961,69	0,40
Jet2 plc 1.63% 10/Jun/2026	500.000	EUR	612.279,11	487.894,21	0,18
Ocado Group plc 0.75% 18/Jan/2027	200.000	EUR	248.787,09	160.563,66	0,06
Ocado Group plc 0.88% 9/Dec/2025	1.300.000	EUR	1.833.209,02	1.192.828,74	0,46
WH Smith plc 1.63% 7/May/2026	700.000	EUR	832.779,20	702.234,27	0,27
			5.382.486,77	4.298.454,07	1,63
USA					
Asahi Refining USA Inc. 0.00% 16/Mar/2026	500.000	EUR	421.302,36	449.567,17	0,17
Etsy Inc. 0.13% 1/Oct/2026	1.145.000	EUR	1.312.402,83	1.248.225,89	0,47
Euronet Worldwide Inc. 0.75% 15/Mar/2049	1.050.000	EUR	935.341,07	1.025.455,04	0,39
Expedia Group Inc. 0.00% 15/Feb/2026	814.000	EUR	760.516,84	700.571,79	0,27
Glencore Funding LLC 0.00% 27/Mar/2025	600.000	EUR	460.080,13	587.092,64	0,22
Illumina Inc. 0.00% 15/Aug/2023	1.594.000	EUR	1.494.732,52	1.452.823,09	0,55
JPMorgan Chase Bank 0.00% 28/Dec/2023	800.000	EUR	707.365,57	727.273,42	0,28
JPMorgan Chase Bank 0.00% 18/Feb/2024	1.000.000	EUR	1.114.045,00	975.416,70	0,37
JPMorgan Chase Bank NA 0.00% 10/Jun/2024	600.000	EUR	659.310,00	601.410,00	0,23
JPMorgan Chase Financial Company LLC 0.00% 14/Jan/2025	800.000	EUR	853.080,00	848.040,00	0,32
Marriott Vacations Worldwide Corp. 0.00% 15/Jan/2026	1.400.000	EUR	1.369.333,42	1.235.353,20	0,47
MicroStrategy Inc. 0.75% 15/Dec/2025	1.022.000	EUR	1.179.299,56	596.806,16	0,23
New Relic Inc. 0.50% 1/May/2023	793.000	EUR	721.013,29	732.350,92	0,28
NRG Energy Inc. 2.75% 1/Jun/2048	798.000	EUR	784.864,05	825.899,66	0,31
Pure Storage Inc. 0.13% 15/Apr/2023	1.002.000	EUR	956.535,39	1.069.332,93	0,41
Snap Inc. 0.75% 1/Aug/2026	1.494.000	EUR	1.443.473,59	1.375.363,59	0,52
Spirit Airlines Inc. 1.00% 15/May/2026	900.000	EUR	731.043,25	791.719,10	0,30
Twitter Inc. 0.25% 15/Jun/2024	2.191.000	EUR	2.134.159,57	2.059.235,28	0,79

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
USA (Fortsetzung)					
Uber Technologies Inc. 0.00% 15/Dec/2025	776.000	EUR	667.829,08	597.663,70	0,23
Vishay Intertechnology Inc. 2.25% 15/Jun/2025	1.246.000	EUR	989.260,98	1.132.239,71	0,43
Zillow Group Inc. 0.75% 1/Sep/2024	902.000	EUR	916.197,32	891.714,21	0,34
Zillow Group Inc. 1.38% 1/Sep/2026	1.365.000	EUR	1.385.078,62	1.310.387,34	0,50
			21.996.264,44	21.233.941,54	8,08
Vietnam					
Vingroup JSC 3.00% 20/Apr/2026	1.000.000	EUR	861.251,91	825.410,11	0,31
Vinpearl JSC 3.25% 21/Sep/2026	600.000	EUR	507.657,16	472.045,53	0,18
			1.368.909,07	1.297.455,64	0,49
Britische Jungferninseln					
ADM AG Holding Limited 0.00% 26/Aug/2023	600.000	EUR	554.050,39	565.354,61	0,21
Anllian Capital Limited 0.00% 5/Feb/2025	2.400.000	EUR	2.897.409,00	2.773.000,08	1,04
China Conch Venture Holdings International Limited 0.00% 5/Sep/2023	8.000.000	EUR	949.783,67	1.039.543,99	0,38
Sail Vantage Limited 0.00% 13/Jan/2027	5.000.000	EUR	597.218,37	539.702,28	0,20
Smart Insight International Limited 4.50% 5/Dec/2023	4.000.000	EUR	443.833,28	362.584,85	0,14
Universe Trek Limited 2.50% 8/Jul/2025	1.010.000	EUR	932.495,01	1.004.976,33	0,38
Viva Biotech 1.00% 30/Dec/2025	500.000	EUR	429.395,33	286.240,38	0,11
			6.804.185,05	6.571.402,52	2,46
Summe Anleihen – Wandelanleihen			119.140.047,71	110.866.224,12	42,00
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			119.140.047,71	110.866.224,12	42,00
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen – Wandelanleihen					
Bermuda					
Jazz Investments I Limited 1.50% 15/Aug/2024	2.150.000	EUR	1.860.205,05	2.034.863,70	0,77
Jazz Investments I Limited 2.00% 15/Jun/2026	1.842.000	EUR	1.856.951,21	2.071.202,09	0,78
NCL Corp. Limited 1.13% 15/Feb/2027	2.085.000	EUR	1.742.180,10	1.298.288,58	0,49
			5.459.336,36	5.404.354,37	2,04
Kaimaninseln					
Bilibili Inc. 1.25% 15/Jun/2027	1.582.000	EUR	1.691.025,81	1.577.586,84	0,60
Bilibili Inc. 1.38% 1/Apr/2026	835.000	EUR	845.847,86	1.030.192,08	0,39
Huazhu Group Limited 0.38% 1/Nov/2022	407.000	EUR	404.549,43	399.173,12	0,15
Huazhu Group Limited 3.00% 1/May/2026	1.626.000	EUR	1.614.744,61	1.848.608,42	0,70
JOYY Inc. 0.75% 15/Jun/2025	1.593.000	EUR	1.407.855,02	1.364.919,80	0,52
Li Auto Inc. 0.25% 1/May/2028	1.560.000	EUR	1.660.702,15	2.218.126,17	0,84
Sea Limited 2.38% 1/Dec/2025	2.328.000	EUR	2.776.680,99	2.475.781,07	0,93
			10.401.405,87	10.914.387,50	4,13
Israel					
NICE Limited 0.00% 15/Sep/2025	600.000	EUR	561.780,41	564.385,27	0,22
			561.780,41	564.385,27	0,22
Japan					
CyberAgent Inc. 0.00% 17/Feb/2023	40.000.000	EUR	375.681,12	291.582,42	0,11
CyberAgent Inc. 0.00% 19/Feb/2025	40.000.000	EUR	356.625,32	310.498,67	0,11
Digital Garage Inc. 0.00% 14/Sep/2023	80.000.000	EUR	653.042,07	561.573,11	0,21
Koei Tecmo Holdings Company Limited 0.00% 20/Dec/2024	90.000.000	EUR	731.448,31	671.426,96	0,25
Medipal Holdings Corp. 0.00% 7/Oct/2022	80.000.000	EUR	736.645,93	563.192,49	0,21
Menicon Company Limited 0.00% 29/Jan/2025	40.000.000	EUR	372.680,55	303.199,72	0,11
Nipro Corp. 0.00% 25/Sep/2026	90.000.000	EUR	704.590,52	645.552,09	0,24
Relo Group Inc. 0.00% 17/Dec/2027	50.000.000	EUR	421.059,62	345.614,60	0,13
Ship Healthcare Holdings Inc. 0.00% 13/Dec/2023	60.000.000	EUR	505.866,36	446.632,28	0,17
			4.857.639,80	4.139.272,34	1,54
Jersey – Kanalinseln					
Novocure Limited 0.00% 1/Nov/2025	289.000	EUR	260.798,79	242.710,79	0,09
			260.798,79	242.710,79	0,09

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
 zum 30. Juni 2022
 (in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Wahrung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermogens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
Liberia					
Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 15/Jun/2023	3.648.000	EUR	3.702.957,17	3.333.737,07	1,26
			3.702.957,17	3.333.737,07	1,26
USA					
Airbnb Inc. 0.00% 15/Mar/2026	1.137.000	EUR	948.804,09	903.596,61	0,34
Akamai Technologies Inc. 0.13% 1/May/2025	1.807.000	EUR	1.789.367,88	1.899.593,86	0,72
Akamai Technologies Inc. 0.38% 1/Sep/2027	3.556.000	EUR	3.404.456,22	3.392.794,75	1,29
The Beauty Health Company 1.25% 1/Oct/2026	1.122.000	EUR	842.812,42	874.032,90	0,33
Bentley Systems Inc. 0.13% 15/Jan/2026	400.000	EUR	325.771,56	333.827,54	0,13
Bentley Systems Inc. 0.38% 1/Jul/2027	2.480.000	EUR	1.962.678,00	1.852.009,78	0,70
Bill.com Holdings Inc. 0.00% 15/Nov/2025	2.340.000	EUR	2.458.576,35	2.291.429,53	0,87
BioMarin Pharmaceuticals Inc. 0.60% 1/Aug/2024	3.752.000	EUR	3.367.970,89	3.547.971,16	1,34
Block Inc. 0.13% 1/Mar/2025	2.037.000	EUR	1.982.079,52	1.848.801,82	0,69
Burlington Stores Inc. 2.25% 15/Apr/2025	919.000	EUR	1.048.410,92	876.222,31	0,33
Cable One Inc. 0.00% 15/Mar/2026	850.000	EUR	706.340,54	669.747,48	0,25
Ceridian HCM Holding Inc. 0.25% 15/Mar/2026	750.000	EUR	599.322,58	569.575,30	0,22
Chegg Inc. 0.00% 1/Sep/2026	318.000	EUR	269.081,19	224.846,06	0,09
Coinbase Global Inc. 0.50% 1/Jun/2026	349.000	EUR	288.255,54	192.623,17	0,07
Coupa Software Inc. 0.13% 15/Jun/2025	1.966.000	EUR	1.949.931,62	1.561.838,77	0,59
DexCom Inc. 0.25% 15/Nov/2025	2.371.000	EUR	2.064.463,29	2.086.213,97	0,80
DISH Network Corp. 0.00% 15/Dec/2025	4.347.000	EUR	3.922.505,87	2.934.677,60	1,11
Dropbox Inc. 0.00% 1/Mar/2026	1.697.000	EUR	1.457.997,28	1.465.544,43	0,56
Dropbox Inc. 0.00% 1/Mar/2028	1.393.000	EUR	1.251.881,34	1.180.072,00	0,45
Enphase Energy Inc. 0.00% 1/Mar/2026	1.246.000	EUR	1.036.059,90	1.187.836,25	0,45
Enphase Energy Inc. 0.00% 1/Mar/2028	720.000	EUR	553.759,28	687.640,12	0,26
Envestnet Inc. 0.75% 15/Aug/2025	763.000	EUR	626.717,54	623.166,18	0,24
Etsy Inc. 0.13% 1/Sep/2027	786.000	EUR	734.203,53	586.805,52	0,22
Everbridge Inc. 0.13% 15/Dec/2024	196.000	EUR	173.148,10	163.458,32	0,06
Exact Sciences Corp. 0.38% 15/Mar/2027	828.000	EUR	853.986,22	583.046,64	0,22
Exact Sciences Corp. 0.38% 1/Mar/2028	3.942.000	EUR	3.338.774,74	2.602.032,96	0,99
Fisker Inc. 2.50% 15/Sep/2026	1.429.000	EUR	1.204.694,79	823.363,98	0,31
Five9 Inc. 0.50% 1/Jun/2025	1.510.000	EUR	1.519.267,32	1.415.775,10	0,54
Ford Motor Company 0.00% 15/Mar/2026	5.380.000	EUR	5.190.147,97	4.726.392,65	1,79
Halozyme Therapeutics Inc. 0.25% 1/Mar/2027	1.642.000	EUR	1.282.982,37	1.398.216,91	0,53
Insmed Inc. 0.75% 1/Jun/2028	796.000	EUR	729.596,06	635.637,95	0,24
Insmed Inc. 1.75% 15/Jan/2025	960.000	EUR	977.362,08	864.754,35	0,33
Insulet Corp. 0.38% 1/Sep/2026	1.444.000	EUR	1.610.877,14	1.574.322,29	0,61
Integra Lifesciences Holdings Corp. 0.50% 15/Aug/2025	1.010.000	EUR	887.957,74	915.607,59	0,35
Intercept Pharmaceuticals Inc. 3.50% 15/Feb/2026	1.074.000	EUR	1.020.733,77	972.090,97	0,37
Ionis Pharmaceuticals Inc. 0.00% 1/Apr/2026	880.000	EUR	688.241,48	772.299,01	0,29
Ionis Pharmaceuticals Inc. 0.13% 15/Dec/2024	173.000	EUR	161.480,43	145.885,45	0,06
JetBlue Airways Corp. 0.50% 1/Apr/2026	1.823.000	EUR	1.510.531,45	1.284.984,39	0,49
JPMorgan Chase & Company 0.25% 1/May/2023	1.193.000	EUR	1.001.696,87	1.182.848,34	0,45
LCI Industries 1.13% 15/May/2026	69.000	EUR	62.487,97	59.437,04	0,02
Liberty Broadband Corp. 1.25% 30/Sep/2050	3.000.000	EUR	2.524.027,44	2.705.404,56	1,03
Liberty Media Corp. 0.50% 1/Dec/2050	2.010.000	EUR	2.294.201,56	2.149.359,36	0,81
Liberty Media Corp. 2.75% 1/Dec/2049	1.752.000	EUR	1.467.920,50	1.571.587,82	0,60
Livongo Health Inc. 0.88% 1/Jun/2025	921.000	EUR	898.060,38	748.023,43	0,28
Lucid Group Inc. 1.25% 15/Dec/2026	3.888.000	EUR	2.680.910,52	2.225.725,95	0,84
Lumentum Holdings Inc. 0.50% 15/Dec/2026	2.759.000	EUR	2.702.063,30	2.718.832,53	1,04
Lumentum Holdings Inc. 0.50% 15/Jun/2028	832.000	EUR	721.449,55	695.356,07	0,26
Luminar Technologies Inc. 1.25% 15/Dec/2026	840.000	EUR	749.305,91	467.023,77	0,18
Lyft Inc. 1.50% 15/May/2025	1.330.000	EUR	1.150.494,55	1.088.770,35	0,41
MACOM Technology Solutions Holdings Inc. 0.25% 15/Mar/2026	920.000	EUR	868.420,58	776.087,69	0,29
Mandiant Inc. 0.88% 1/Jun/2024	888.000	EUR	786.622,47	926.847,25	0,35
Match Group Financeco 2 Inc. 0.88% 15/Jun/2026	1.335.000	EUR	1.380.760,51	1.343.185,33	0,51
Match Group Financeco 3 Inc. 2.00% 15/Jan/2030	780.000	EUR	845.546,22	817.841,70	0,31
MP Materials Corp. 0.25% 1/Apr/2026	1.125.000	EUR	814.083,39	1.063.737,78	0,41
NextEra Energy Partners LP 0.00% 15/Jun/2024	1.294.000	EUR	1.122.976,83	1.189.956,80	0,45
NextEra Energy Partners LP 0.00% 15/Nov/2025	900.000	EUR	818.924,70	893.207,37	0,34
NortonLifeLock Inc. 2.00% 15/Aug/2022	1.055.000	EUR	1.115.584,66	1.103.741,21	0,42
Nutanix Inc. 0.25% 1/Oct/2027	1.028.000	EUR	810.443,40	677.262,76	0,26

Die beigefugten Erluterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Anleihen – Wandelanleihen (Fortsetzung)					
USA (Fortsetzung)					
Okta Inc. 0.13% 1/Sep/2025	2.005.000	EUR	2.071.491,53	1.700.485,68	0,64
Okta Inc. 0.38% 15/Jun/2026	361.000	EUR	346.562,37	289.570,34	0,11
ON Semiconductor Corp. 0.00% 1/May/2027	1.465.000	EUR	1.700.215,08	1.621.386,25	0,61
Opendoor Technologies Inc. 0.25% 15/Aug/2026	1.528.000	EUR	1.258.906,46	838.576,69	0,32
Pebblebrook Hotel Trust 1.75% 15/Dec/2026	1.250.000	EUR	1.213.471,02	1.082.433,05	0,41
Rapid7 Inc. 0.25% 15/Mar/2027	976.000	EUR	904.351,12	846.196,53	0,32
Redfin Corp. 0.00% 15/Oct/2025	1.288.000	EUR	1.088.248,59	719.417,21	0,27
Redfin Corp. 0.50% 1/Apr/2027	292.000	EUR	219.702,90	131.457,96	0,05
RingCentral Inc. 0.00% 15/Mar/2026	50.000	EUR	42.803,69	36.642,12	0,01
RingCentral Inc. 0.00% 1/Mar/2025	700.000	EUR	550.554,93	552.946,77	0,21
Shift4 Payments Inc. 0.00% 15/Dec/2025	1.604.000	EUR	1.616.392,26	1.246.592,38	0,47
Shift4 Payments Inc. 0.50% 1/Aug/2027	606.000	EUR	523.412,49	410.233,22	0,16
Snap Inc. 0.00% 1/May/2027	1.000.000	EUR	892.248,82	677.419,77	0,26
Snap Inc. 0.13% 1/Mar/2028	832.000	EUR	734.183,13	560.995,52	0,21
SolarEdge Technologies Inc. 0.00 % 15/Sep/2025	1.352.000	EUR	1.456.717,41	1.564.045,64	0,59
Splunk Inc. 0.50% 15/Sep/2023	1.102.000	EUR	1.057.806,21	1.008.443,05	0,38
Splunk Inc. 1.13% 15/Sep/2025	1.528.000	EUR	1.473.856,27	1.371.866,89	0,52
Splunk Inc. 1.13% 15/Jun/2027	4.702.000	EUR	4.067.586,64	3.726.570,11	1,40
Sunnova Energy International Inc. 0.25% 1/Dec/2026	1.101.000	EUR	846.977,26	821.445,31	0,31
Tyler Technologies Inc. 0.25% 15/Mar/2026	1.175.000	EUR	1.102.577,53	1.061.400,00	0,40
Vail Resorts Inc. 0.00% 1/Jan/2026	900.000	EUR	786.095,55	757.541,82	0,29
Wayfair Inc. 0.63% 1/Oct/2025	700.000	EUR	589.150,09	449.447,61	0,17
Wayfair Inc. 1.00% 15/Aug/2026	1.742.000	EUR	1.819.518,97	1.108.068,30	0,42
Wayfair Inc. 1.13% 1/Nov/2024	1.023.000	EUR	811.232,77	803.002,90	0,30
Wolfspeed Inc. 0.25% 15/Feb/2028	1.297.000	EUR	1.251.662,09	1.036.090,17	0,39
Zendesk Inc. 0.63% 15/Jun/2025	2.060.000	EUR	2.146.699,70	1.909.300,49	0,73
Ziff Davis Inc. 1.75% 1/Nov/2026	1.550.000	EUR	1.440.124,96	1.435.226,31	0,54
Zillow Group Inc. 2.75% 15/May/2025	707.000	EUR	702.489,73	634.443,04	0,24
			112.272.249,89	103.474.217,91	39,22
Summe Anleihen – Wandelanleihen			137.516.168,29	128.073.065,25	48,50
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
			137.516.168,29	128.073.065,25	48,50
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen					
Bermuda					
Rexlot Holdings Limited 4.50% 17/Apr/2023*	10.447.626	EUR	793.280,23	127.354,21	0,05
			793.280,23	127.354,21	0,05
Summe forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere			793.280,23	127.354,21	0,05
Anleihen – Wandelanleihen					
Kaimaninseln					
China Milk Products Group Limited 0.00% 5/Jan/2023*	1.700.000	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
Dänemark					
Ascendis Pharma AS 2.25% 1/Apr/2028	996.000	EUR	826.566,29	866.639,56	0,33
			826.566,29	866.639,56	0,33
Taiwan					
Promos Technologies Inc. 0.00% 14/Feb/2023*	1.500.000	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
USA					
Sunedis 0.00% 1/Jun/2023**	8.000.000	EUR	7.183.483,43	76.522,07	0,03
			7.183.483,43	76.522,07	0,03
Summe Anleihen – Wandelanleihen			8.010.049,72	943.161,63	0,36

* Notleidende Wertpapiere

** Illiquide Wertpapiere

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Man Convertibles Global
Wertpapierbestand (Fortsetzung)
zum 30. Juni 2022
(in EUR)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Aktien					
Thailand					
Alphatec Electronics**	34.000	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
Summe Aktien			0,00	0,00	0,00
Optionsscheine Aktien					
Indonesien					
Graha Andrasentra Propertindo**	48.700.536	EUR	0,00	0,00	0,00
			0,00	0,00	0,00
Summe Optionsscheine Aktien			0,00	0,00	0,00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			8.803.329,95	1.070.515,84	0,41
SUMME WERTPAPIERBESTAND			265.459.545,95	240.009.805,21	90,91

** Illiquide Wertpapiere

Man Convertibles Global

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2022

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

Geografische Aufteilung	%	Wirtschaftliche Aufteilung	%
USA	47,33	Software	12,11
Japan	7,75	Internet-Software und -Dienstleistungen	11,46
Kaimaninseln	7,37	Biotechnologie	5,42
Taiwan	2,46	Finanzdienstleistungen	4,74
Britische Jungferninseln	2,46	Automobilhersteller	4,74
Frankreich	2,44	Fluggesellschaften	3,56
Bermuda	2,09	Computer und Peripheriegeräte	3,54
Luxemburg	1,74	Telekommunikationsdienste	3,45
Vereinigtes Königreich	1,63	Pharmazeutika	3,26
Republik Korea (Süd)	1,35	Einzelhandel	3,24
Liberia	1,26	Halbleiter	3,18
Italien	1,14	Gewerbliche Dienstleistungen	2,75
Australien	1,10	Hotelgewerbe	2,57
Niederlande	1,07	Investmentgesellschaften	2,32
Malaysia	1,03	Eisen und Stahl	2,17
Hongkong	0,82	Immobilienanlagefonds	1,99
Vereinigte Arabische Emirate	0,80	Elektronikgeräte	1,90
Singapur	0,80	Freizeit	1,75
Indien	0,76	Alternative Energiequellen	1,72
Dänemark	0,64	Banken	1,67
Deutschland	0,62	Öl- und Gasproduzenten	1,61
Israel	0,62	Gesundheitswesen – Produkte	1,25
Schweiz	0,54	Radio- und Fernsehsender	1,11
Vietnam	0,49	Nahrungsmittel	1,04
Spanien	0,48	Bergbau (Nichtedelmetalle)	0,80
Belgien	0,45	Tourismus	0,67
Neuseeland	0,45	Chemie	0,66
China	0,41	Autoteile und -ausrüstung	0,52
Kanada	0,38	Drähte und Seile	0,51
Schweden	0,25	Baumaterialien	0,49
Jersey – Kanalinseln	0,18	Transport	0,41
	90,91	Industrie	0,41
		Telekommunikationsausrüstung	0,41
		Gesundheitsprodukte und -ausrüstung	0,40
		Medien	0,39
		Medizin	0,35
		Freizeit und Unterhaltung	0,34
		Kosmetik und Körperpflege	0,33
		Elektrizitätsversorgung	0,31
		Landwirtschaft	0,21
		Versicherungen	0,21
		Gesundheitswesen – Dienstleistungen	0,21
		Maschinenbau	0,19
		Vertrieb und Großhandel	0,19
		Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	0,15
		Konsumgüter	0,09
		Elektrische Ausrüstung	0,09
		Wohnungsbauunternehmen	0,02
			90,91

Man AHL Trend Alternative

Wertpapierbestand

zum 30. Juni 2022

(in USD)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					
Structured Notes					
Vereinigtes Königreich					
Credit Suisse 0.00% 30/Dec/2049*	23.970.000	USD	67.876.720,80	91.511.012,07	8,73
			67.876.720,80	91.511.012,07	8,73
Summe Structured Notes			67.876.720,80	91.511.012,07	8,73
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			67.876.720,80	91.511.012,07	8,73
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
Vereinigtes Königreich					
United States Treasury Bill 0,00% 21. Jul. 2022	50.000.000	USD	49.899.445,48	49.971.395,00	4,75
United States Treasury Bill 0.00% 11/Aug/2022	50.000.000	USD	49.848.165,83	49.925.845,00	4,76
United States Treasury Bill 0.00% 18/Aug/2022	50.000.000	USD	49.847.121,33	49.911.300,00	4,76
United States Treasury Bill 0.00% 29/Sep/2022	50.000.000	USD	49.775.516,67	49.791.940,00	4,75
United States Treasury Bill 0.00% 20/Oct/2022	50.000.000	USD	49.727.769,17	49.692.960,00	4,74
United States Treasury Bill 0.00% 17/Nov/2022	50.000.000	USD	49.655.250,00	49.598.030,00	4,72
United States Treasury Bill 0.00% 25/Nov/2022	50.000.000	USD	49.624.156,25	49.580.490,00	4,73
United States Treasury Bill 0.00% 8/Dec/2022	50.000.000	USD	49.452.906,25	49.490.810,00	4,72
			397.830.330,98	397.962.770,00	37,93
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			397.830.330,98	397.962.770,00	37,93
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			397.830.330,98	397.962.770,00	37,93
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Structured Notes					
Schweiz					
Credit Suisse AG 0.00% perpetual*	6.556.627	USD	70.160.224,40	91.504.542,12	8,72
			70.160.224,40	91.504.542,12	8,72
Summe Structured Notes			70.160.224,40	91.504.542,12	8,72
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			70.160.224,40	91.504.542,12	8,72
SUMME WERTPAPIERBESTAND			535.867.276,18	580.978.324,19	55,38

* Illiquide Wertpapiere

Man AHL Trend Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2022

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

<u>Geografische Aufteilung</u>	<u>%</u>	<u>Wirtschaftliche Aufteilung</u>	<u>%</u>
USA	37,93	Regierungen	37,93
Vereinigtes Königreich	8,73	Banken	17,45
Schweiz	8,72		55,38
	55,38		

Man AHL Alpha Core Alternative

Wertpapierbestand

zum 30. Juni 2022

(in USD)

Beschreibung	Nennwert/ Menge	Währung	Kosten	Marktwert	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente					
USA					
United States Treasury Bill 0,00% 21/Jul/2022	10.000.000	USD	9.981.343,33	9.994.279,00	6,43
United States Treasury Bill 0,00% 11/Aug/2022	15.000.000	USD	14.953.818,75	14.977.753,50	9,64
United States Treasury Bill 0,00% 18/Aug/2022	20.000.000	USD	19.939.610,67	19.964.520,00	12,85
United States Treasury Bill 0,00% 25/Aug/2022	20.000.000	USD	19.932.486,67	19.955.602,00	12,85
United States Treasury Bill 0,00% 29/Sep/2022	8.000.000	USD	7.962.697,78	7.966.710,40	5,13
United States Treasury Bill 0,00% 20/Oct/2022	15.000.000	USD	14.914.757,21	14.907.888,00	9,60
			<u>87.684.714,41</u>	<u>87.766.752,90</u>	<u>56,50</u>
Summe supranationale, staatliche und kommunale Emittenten, Schuldinstrumente			87.684.714,41	87.766.752,90	56,50
Summe auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			87.684.714,41	87.766.752,90	56,50
SUMME WERTPAPIERBESTAND			87.684.714,41	87.766.752,90	56,50

Man AHL Alpha Core Alternative

Geografische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestands

zum 30. Juni 2022

(als Prozentsatz des Nettovermögens)

Geografische Aufteilung	%
USA	56,50
	56,50

Wirtschaftliche Aufteilung	%
Regierungen	56,50
	56,50

Erläuterungen zum Abschluss für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 1 – Allgemeines

Man Umbrella SICAV (der „Fonds“) ist eine Aktiengesellschaft, welche in Luxemburg als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable oder „SICAV“) am 13. Dezember 1995 auf unbestimmte Dauer errichtet wurde.

Der Fonds wurde gemäß Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010, in der jeweils gültigen Fassung, über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz vom 17. Dezember 2010“) aufgelegt. Der Fonds ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß der EU-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 in ihrer jeweils gültigen Fassung. Als selbstverwaltete SICAV entspricht der Fonds den Voraussetzungen des Artikels 27 des Luxemburger Gesetzes vom 20. Dezember 2002 über Organismen für gemeinsame Anlagen, in der jeweils gültigen Fassung („Gesetz vom 20. Dezember 2002“). Das Gesetz vom 20. Dezember 2002 wurde zum 1. Juli 2011 durch das Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung ersetzt. Mit Wirkung zum 31. März 2009 hat der Fonds die Verwaltungsgesellschaft mit der Anlageverwaltungstätigkeit, der administrativen Verwaltung sowie dem Marketing beauftragt. Zum 10. Dezember 2009 wurde der Name des Fonds von RMF Umbrella SICAV in Man Umbrella SICAV geändert. Der Verwaltungsrat des Fonds beabsichtigt, Anteile am Fonds außer in Luxemburg in mehreren Mitgliedstaaten der Europäischen Union sowie in der Schweiz zu vertreiben.

Die Rechtsgrundlagen des Fonds werden durch dessen Satzung festgelegt. Ergänzend finden das Luxemburger Gesetz vom 10. August 1915 über die Handelsgesellschaften (das „Gesetz vom 10. August 1915“) sowie das Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung Anwendung. Die Satzung wurde erstmals am 17. Januar 1996 im Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations (Amtsblatt des Großherzogtums Luxemburg) veröffentlicht. Die Satzung wurde letztmalig am 12. Oktober 2011 geändert. Ein Hinweis auf die Hinterlegung der aktuellen Satzung wurde am 14. Dezember 2011 im Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations, veröffentlicht. Die Änderungen wurden an der Satzung des Fonds am 12. Oktober 2011 vorgenommen, um die Bestimmungen von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung und die Auflagen der EU-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 zu erfüllen.

Folgende Teilfonds bestehen zum gegenwärtigen Zeitpunkt:

- Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Europe
- Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Global
- Man Umbrella SICAV – Man AHL Trend Alternative
- Man Umbrella SICAV – Man AHL Alpha Core Alternative

Die Anteile sind Namensanteile. Sämtliche Anteile werden in einem Globalzertifikat verbrieft. Eine physische Lieferung der Anteile ist ausgeschlossen.

Das Anlageziel des Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Europe (ein „Teilfonds“) ist die Wertsteigerung der Anlagen in aktienbezogenen Wertpapieren verbunden mit einer angestrebten Sicherheit des Kapitals zugunsten der Anleger. Zu diesem Zweck wird das Vermögen dieses Teilfonds zu mindestens zwei Dritteln in Wandelanleihen, Umtauschanleihen, wandelbaren Notes, Optionsanleihen, Notes mit Optionsscheinen auf übertragbare Wertpapiere, Zwangswandelanleihen und wandelbaren Vorzugsaktien angelegt, die von Emittenten mit Sitz oder einem überwiegenden Teil ihrer Produktion oder ihres Umsatzes in einem Mitgliedstaat der europäischen Wirtschafts- und Währungsunion oder einem anderen europäischen Land begeben werden.

Das Anlageziel des Man Umbrella SICAV – Man Convertibles Global (ein „Teilfonds“) ist die Wertsteigerung der Anlagen in aktienbezogenen Wertpapieren verbunden mit einer angestrebten Sicherheit des Kapitals zugunsten der Anleger. Zu diesem Zweck wird das Fondsvermögen dieses Teilfonds weltweit zu mindestens zwei Dritteln in Wandelanleihen, Umtauschanleihen, Optionsanleihen, wandelbaren Notes, Optionsanleihen, Notes mit Optionsscheinen auf Wertpapiere, Zwangswandelanleihen, wandelbaren Vorzugsaktien angelegt.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 1 – Allgemeines (Fortsetzung)

Der Man Umbrella SICAV – Man AHL Trend Alternative (ein „Teilfonds“) strebt ein mittelfristiges Kapitalwachstum bei gleichzeitiger Beschränkung der verbundenen Risiken an. Hierzu betreibt er ein diversifiziertes Portfolio aus Anlagen unter Verwendung des AHL Diversified Programms (das „AHL Diversified Programm“, siehe Beschreibung weiter unten im Abschnitt „AHL Diversified Programm“). Der Teilfonds beabsichtigt, sich unabhängig von klassischen Aktien- und Anleihenanlagen zu entwickeln, was wertvolle Diversifizierungsvorteile bietet und das Risiko-Ertrags-Profil gegenüber einem herkömmlichen Anlageportfolio verbessert. AHL verwaltet das AHL Diversified Programm, das ausgefeilte, computergestützte Prozesse anwendet, um vor allem Trends und andere Gelegenheiten auf Märkten weltweit zu identifizieren. Anschließend wird eine stabile und fein abgestimmte Handels- und Implementierungsinfrastruktur eingesetzt, um diese Handelsgelegenheiten gewinnbringend zu nutzen. Dieser Prozess ist quantitativer und überwiegend direktonaler Natur und wird durch strenge Risikokontrollen, fortlaufende Analysen, Diversifizierung und das beständige Streben nach Effizienz gestützt.

Der Man Umbrella SICAV – Man AHL Alpha Core Alternative (ein „Teilfonds“) strebt einen mittelfristigen Kapitalzuwachs bei gleichzeitiger Beschränkung der verbundenen Risiken an. Hierzu betreibt er ein diversifiziertes Portfolio aus Anlagen. Der Teilfonds beabsichtigt, sich unabhängig von klassischen Aktien- und Anleihenanlagen zu entwickeln, was wertvolle Diversifizierungsvorteile bietet und das Risiko-Ertrags-Profil gegenüber einem herkömmlichen Anlageportfolio verbessert. Um sein Anlageziel zu erreichen, wendet der Teilfonds einen systematischen, auf Statistiken basierenden Ansatz an, der vornehmlich darauf ausgerichtet ist, Aufwärts- und Abwärts-Preistendenzen auf den Märkten weltweit zu identifizieren und daraus Kapital zu schlagen. Der Teilfonds investiert derzeit in über 100 internationalen Märkten über eine große Bandbreite an Sektoren.

Erläuterung 2 – Zusammenfassung der wichtigsten Grundsätze der Rechnungslegung

Der Abschluss wird gemäß den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds erstellt und vorgelegt. Nachfolgend sind die wichtigsten für die Erstellung dieses Halbjahresabschlusses angewandten Rechnungslegungsmethoden dargestellt:

a) Ermittlung des Nettoinventarwerts der Anteile

Der Nettoinventarwert der Anteile jedes Teilfonds wird berechnet, indem das Nettovermögen des jeweiligen Teilfonds durch die Gesamtzahl der Anteile geteilt wird, die sich auf den betreffenden Teilfonds beziehen.

Nettoinventarwerte werden zum Bewertungstag bestimmt. Die tatsächliche Berechnung und Veröffentlichung der Nettoinventarwerte erfolgt am nächsten Bankarbeitstag nach einem solchen Bewertungstag.

b) Bewertung der Vermögenswerte

An offiziellen Börsen notierte Wertpapiere werden zum letzten verfügbaren Kurs an der Börse bewertet, die normalerweise der Hauptmarkt für das jeweilige Wertpapier ist. Wenn ein übertragbares Wertpapier oder sonstiger Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse bzw. an jenem geregelten Markt maßgebend, welche(r) der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 2 – Zusammenfassung der wichtigsten Grundsätze der Rechnungslegung (Fortsetzung)

b) Bewertung der Vermögenswerte (Fortsetzung)

Wertpapiere, die nicht an einer offiziellen Wertpapierbörse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden zum letztverfügbaren Kurs auf diesem Markt bewertet.

Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen werden zu ihrem letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet. Falls die Wertpapiere nicht an einer Börse oder einem anderen regulierten Markt notiert sind oder gehandelt werden oder falls es sich bei den Preisen nicht um angemessene Marktpreise handelt, wird der Wert dieser Wertpapiere und sonstigen gesetzlich zulässigen Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt.

Die flüssigen Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet. Festgelder mit einer ursprünglichen Laufzeit von weniger als 12 Monaten und mehr als 90 Tagen können zum jeweiligen Nennwert zuzüglich der darauf aufgelaufenen Zinsen bewertet werden. Geldmarktinstrumente mit einer Restlaufzeit von höchstens 90 Tagen werden unter Zugrundelegung der fortgeführten Anschaffungskostenmethode, die den annähernden Marktwert ermittelt, bewertet.

c) Bewertung von Future-, Devisentermin-, Options- und Swap-Kontrakten

Futures-Kontrakte

Ausstehende Futures-Kontrakte werden, soweit vorhanden, am Bilanzstichtag zum letzten verfügbaren Marktpreis der Instrumente bewertet. Nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelte Futures-Kontrakte werden vom Verwaltungsrat bewertet.

Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus Future-Kontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn aus Future-Kontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Future-Kontrakten“ erfasst und Einschusskonten werden in den Posten „Gezahlter Einschuss“ einbezogen.

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Futures-Kontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten“ angegeben.

Devisentermingeschäfte

Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus ausstehenden Devisenterminkontrakten wird unter Bezugnahme auf den für die Restlaufzeit des Kontrakts geltenden Devisenterminkurs bewertet und in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten“ erfasst.

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Devisenterminkontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisentermingeschäften“ angegeben.

Optionskontrakte

Ausstehende Optionskontrakte werden, soweit vorhanden, zum Marktpreis bei Geschäftsschluss oder zum letzten verfügbaren Marktpreis der Instrumente bewertet. Die Bewertung von außerbörslich (over the counter, „OTC“) gehandelten Optionskontrakten erfolgt auf Basis von Kursen externer Preisanbieter/Modelle.

Der Marktwert von Optionskontrakten ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter dem Punkt „Optionskontrakte zum Marktwert (Long-Positionen)“ ausgewiesen.

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Optionskontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Verkäufen von Optionskontrakten“ ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 2 – Zusammenfassung der wichtigsten Grundsätze der Rechnungslegung (Fortsetzung)

c) Bewertung von Future-, Devisentermin-, Options- und Swap-Kontrakten (Fortsetzung)

Swap-Kontrakte

Gegebenenfalls ausstehende Swap-Kontrakte werden unter Verwendung der auf Geschäftsschlussdaten basierenden Gegenparteiabwertung bewertet und mit einem unabhängigen Bewertungsanbieter abgeglichen. Die Bewertung stellen Schätzwerte auf der Grundlage eines Berechnungsmodells dar, das Marktdaten zum Geschäftsschluss nutzt. Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) aus ausstehenden Swap-Kontrakten wird in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten“ erfasst. Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus Swap-Kontrakten wird in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter dem Punkt „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten“ angegeben.

d) Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Wertpapierverkäufen

Die aus den Verkäufen von Wertpapieren realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises der verkauften Wertpapiere berechnet.

e) Verbuchung von Erträgen

Zinserträge werden periodengerecht erfasst, abzüglich von nicht erstattungsfähigen Quellensteuern. Abschläge/Aufschläge auf Nullkupon-Anleihen werden als Berichtigung der Zinserträge erfasst. Dividenden werden auf Ex-Dividenden-Basis erfasst, abzüglich von nicht erstattungsfähigen Quellensteuern. Wenn der Fonds einen Anspruch auf Rückerstattung von Quellensteuern hat, wird der Erstattungsanspruch zum Ex-Datum als Forderung erfasst.

f) Währungen der Fonds

Wechselkurse zum 30. Juni 2022:

1 EUR =	1,520323	AUD	1 EUR =	4,607821	MYR
1 EUR =	5,467120	BRL	1 EUR =	10,328799	NOK
1 EUR =	1,348578	CAD	1 EUR =	1,681464	NZD
1 EUR =	1,000862	CHF	1 EUR =	3,973494	PEN
1 EUR =	979,803187	CLP	1 EUR =	57,483367	PHP
1 EUR =	7,008917	CNH	1 EUR =	4,700194	PLN
1 EUR =	4.356,041667	COP	1 EUR =	4,946487	RON
1 EUR =	0,860842	GBP	1 EUR =	57,237887	RUB
1 EUR =	8,203597	HKD	1 EUR =	10,713115	SEK
1 EUR =	396,789853	HUF	1 EUR =	1,454952	SGD
1 EUR =	15.573,514077	IDR	1 EUR =	36,961287	THB
1 EUR =	3,661321	ILS	1 EUR =	17,455295	TRY
1 EUR =	82,559425	INR	1 EUR =	31,084979	TWD
1 EUR =	142,029592	JPY	1 EUR =	1,045450	USD
1 EUR =	1.357,409956	KRW	1 EUR =	17,127013	ZAR
1 EUR =	21,092930	MXN			

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 3 – Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

Die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen erfolgen über die im Verkaufsprospekt aufgeführten Zahl- und Vertriebsstellen des Fonds aufgrund eines schriftlichen, an die Register- und Transferstelle des Fonds zu richtenden Zeichnungs-/Rücknahmeantrages. Zeichnungs-/Rücknahmeanträge, die bis spätestens 12:00 Uhr (Luxemburger Zeit) an einem Bewertungstag bei der Register- und Transferstelle eingehen, werden zum Ausgabe-/Rücknahmepreis dieses Bewertungstages abgerechnet. Zeichnungs-/Rücknahmeanträge, die nach 12:00 Uhr (Luxemburger Zeit) bei der Register- und Transferstelle eingehen, werden zum Ausgabe-/Rücknahmepreis des nächsten Bewertungstages abgerechnet.

Der Ausgabepreis für die Teilfonds ist der ermittelte Anteilswert, zuzüglich einer Verkaufsgebühr von bis zu 5 % des Nettoanteilswertes, welche zugunsten der Vertriebsstellen erhoben wird.

Rücknahmeanträge, die bis spätestens 12:00 Uhr (Luxemburger Ortszeit) („Cut-Off Time“) an dem Bewertungstag bei der Register- und Transferstelle eingehen, werden zum Nettoinventarwert je Anteil (der „Rücknahmepreis“) des Bewertungstags abgerechnet, an dem die Rücknahme erfolgen soll, und am nächsten Bankarbeitstag berechnet und veröffentlicht, sofern der entsprechende Anhang eines Teilfonds keine anderslautenden Vereinbarungen enthält.

Rücknahmeanträge, die nach der Cut-Off Time eingehen, werden zum Rücknahmepreis des nächstfolgenden Bewertungstags abgerechnet, der, vorbehaltlich anderslautender Vereinbarungen im entsprechenden Anhang eines Teilfonds, am nächsten Bankarbeitstag berechnet und veröffentlicht wird. Die Einzelheiten zum Rücknahmepreis werden im entsprechenden Anhang eines Teilfonds erläutert. Die Zahlung erfolgt per Scheck an die vom Anteilinhaber angegebene Anschrift oder per Bankanweisung an ein vom Anteilinhaber angegebenes Konto.

Alle für diese Transaktion anfallenden Kosten trägt der Anteilinhaber, ohne irgendeine diesbezügliche Haftung des Fonds.

Wenn an einem Bewertungstag die Anträge auf eine Rücknahme oder einen Umtausch von Anteilen aus einem Teilfonds oder einer Anteilsklasse heraus insgesamt mehr als zehn Prozent des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse ausmachen, kann der Verwaltungsrat beschließen, dass ein Teil (anteilmäßig) oder die Gesamtheit dieser Rücknahme- oder Umtauschanträge auf den nächsten oder darauffolgende Bewertungstage zurückgestellt werden, bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezogen hatte, zurückgenommen wurden – jeweils unter der Maßgabe, dass der Fonds nicht verpflichtet ist, mehr als zehn Prozent (10 %) des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds oder der betreffenden Anteilsklasse an einem einzelnen Bewertungstag zurückzunehmen. Sollten Anträge auf eine Rücknahme oder einen Umtausch von Anteilen an zehn aufeinanderfolgenden Bewertungstagen zurückgestellt werden, wird der Verwaltungsrat eine Versammlung einberufen, um zu bestimmen, ob eine Aussetzung des Handels (d. h. der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen) mit dem jeweiligen Teilfonds gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „Zeitweilige Aussetzung der Berechnung“ des Prospekts angemessen ist.

Erläuterung 4 – Depotbank

Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg (nachstehend die „Verwahrstelle“) wurde gemäß den Bedingungen einer Vereinbarung mit unbestimmter Dauer, deren aktuelle Version am 20. Februar 2017 in Kraft trat, zur Verwahrstelle für die Vermögenswerte des Fonds ernannt.

Die Verwahrstelle hat in ihrer Eigenschaft als Vermögensverwahrer des Fonds Anspruch auf eine Gebühr durch den Fonds, die in Form eines Prozentsatzes ausgedrückt und auf der Grundlage des mittleren Nettovermögens des jeweiligen Monats berechnet und nachträglich gezahlt wird. Sie beträgt bis zu 0,03 % p. a.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 5 – Abonnementsteuer

Nach Luxemburger Recht und der üblichen Verwaltungspraxis unterliegt der Fonds in Luxemburg keiner Einkommens- oder Vermögenssteuer. Des Weiteren unterliegen eventuelle Ausschüttungen des Fonds vorbehaltlich der Angaben zur EU- Zinsrichtlinie keiner Quellensteuer in Luxemburg. Der Fonds unterliegt jedoch in Luxemburg einer Steuer von 0,05 % pro Jahr („taxe d'abonnement“) auf das Nettovermögen des jeweiligen Teilfonds. Diese Steuer ist vierteljährlich auf der Basis des Teilfondsvermögens am Ende des entsprechenden Quartals zu entrichten. Für Anteilsklassen, die ausschließlich institutionellen Anlegern vorbehalten sind, gilt ein verminderter Steuersatz von 0.01 % p.a. des Nettovermögens der betreffenden Anteilsklasse. Diese Steuer ist vierteljährlich zu entrichten und wird auf der Grundlage des Nettoteilfondsvermögens der jeweiligen Anteilsklasse berechnet.

Auf den Teil des Vermögens jedes Teilfonds, der in andere Luxemburger Organismen für gemeinsame Anlagen investiert ist, die ihrerseits dieser Steuer unterliegen, fällt keine derartige Steuer an.

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren

Die Anlageverwalter erhalten die folgenden Verwaltungsgebühren p. a. aus dem Nettovermögen des Teilfonds:

Man Convertibles Europe:

Man Convertibles Europe D EUR Acc	1,50 %
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	1,50 %
Man Convertibles Europe I EUR Acc	0,75 %

Man Convertibles Global:

Man Convertibles Global D EUR Acc	1,50 %
Man Convertibles Global D H CHF Acc	1,50 %
Man Convertibles Global D H USD Acc	1,50 %
Man Convertibles Global DR EUR Acc	0,75 %
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	0,75 %
Man Convertibles Global DR H USD Acc	0,75 %
Man Convertibles Global I EUR Acc	0,75 %
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	0,75 %
Man Convertibles Global I H CHF Acc	0,75 %
Man Convertibles Global I H USD Acc	0,75 %

Man AHL Trend Alternative:

Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	2,00 %
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	2,00 %
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	2,50 %
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	1,50 %
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	1,50 %

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative:

Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	1,75 %
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc ⁽¹⁾	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc ⁽²⁾	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	1,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	1,00 %

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Darüber hinaus können die Anlageverwalter der Teilfonds eine Erfolgsgebühr auf Grundlage des Wertzuwachses im Nettovermögen jedes der unten genannten Teilfonds erhalten. Entsprechend wird diese Erfolgsgebühr sowohl im Hinblick auf nicht realisierte Wertzuwächse als auch realisierte Gewinne angepasst.

Ebenso kann die Erfolgsgebühr auf nicht realisierte Gewinne entrichtet werden, die möglicherweise im Anschluss nie realisiert werden. Die Erfolgsgebühr kann für den Anlageverwalter einen Anreiz darstellen, riskantere Anlagen für den Teilfonds zu tätigen als im Falle einer nicht vorhandenen Erfolgsgebühr.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 haben die Anlageverwalter die folgenden Erfolgsgebühren erhalten:

	Währung	Erfolgsgebühren	Zu entrichtende Erfolgsgebühren
Man AHL Trend Alternative:			
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	USD	6.060,19	6.060,19
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	USD	37.038,02	37.014,09
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	USD	775.791,73	773.584,59
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	USD	83.838,40	83.864,34
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	USD	1.284.764,82	1.278.663,85
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	USD	60.439,06	59.922,49
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	USD	459,89	459,89
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	USD	112.596,73	112.505,59
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	USD	874.806,63	841.328,06
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	USD	1.999.726,75	1.866.019,77
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	USD	145.351,78	145.004,83
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	USD	2.188.747,65	2.186.655,89
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	USD	642.744,19	642.997,68
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	USD	4.500.955,79	4.357.080,08
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	USD	441.415,01	439.949,73
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	USD	9,66	9,66
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	USD	13.600,21	13.600,21
Man AHL Alpha Core Alternative:			
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	USD	–	–
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	USD	104.912,16	104.511,96
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc ⁽¹⁾	USD	2.787,96	2.787,96
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	USD	51.384,94	51.293,66
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc ⁽²⁾	USD	5.721,92	5.324,95
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	USD	419.858,73	418.764,36
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	USD	428.646,71	400.164,17

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative

Eine jährliche Erfolgsgebühr (die „Erfolgsgebühr“) wird bewertungstäglich zu einem Satz von maximal 20 % des neuen, auf die jeweilige Anteilsklasse entfallenden Nettowertzuwachses berechnet. Der Begriff „Performance-Zeitraum“ hat die Bedeutung, die ihm im Folgenden zugeschrieben wird. Die Erfolgsgebühr wird täglich berechnet und abgegrenzt, ist jedoch jährlich am letzten Bewertungstag im März zu bezahlen.

Unter „neuer Nettowertzuwachs“ ist jede überdurchschnittliche Performance (falls zutreffend) des Nettoinventarwerts jeder Anteilsklasse (vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren, jedoch berichtigt um Erfolgsgebühren, die aufgrund von Anteilsrücknahmen fällig sind) gegenüber der High Water Mark (gemäß nachstehender Definition) am Ende des betroffenen Performance-Zeitraums zu verstehen.

Unter der an jedem Bewertungstag berechneten „High Water Mark“ ist der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse am letzten Tag für die Performance zu verstehen, an dem eine Erfolgsgebühr für die jeweilige Anteilsklasse fällig wurde. Die High Water Mark wird für jede Anteilsklasse anteilig um den Betrag der Rücknahmen, Dividenden und Ausschüttungen vermindert und dann um den Betrag der Zeichnungen an jedem Bewertungstag innerhalb des entsprechenden Performance-Zeitraums erhöht. Zum Zwecke der Berechnung der Erfolgsgebühr wird der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren berechnet. Die Hauptverwaltungsstelle kann (in Absprache mit dem Anlageverwalter) entsprechende Anpassungen an der High Water Mark vornehmen, um die High Water Mark in einer Weise festzulegen, die sonstigen Veränderungen infolge von Zeichnungen, Rücknahmen, Dividenden, Ausschüttungen und weiteren vergleichbaren Ereignissen Rechnung trägt.

„Performance-Zeitraum“ bezeichnet im Zusammenhang mit jedem Anteil den Zeitraum, der entweder am (i) 26. August 2019 oder (ii) an dem Datum, an dem eine Erfolgsgebühr zuletzt fällig war (oder dem Beginn des ersten Performance-Zeitraums für neu ausgegebene Aktien), beginnt, je nachdem, welcher Zeitpunkt später eintritt, bis zum Börsenschluss des letzten Bewertungstags im März (der „Performance-Tag“) und anschließend jeden 12-Monatszeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der auf den unmittelbar vorausgehenden Performance-Tag (wie oben definiert) folgt, und am Börsenschluss des letzten Bewertungstags im März endet.

Erfolgsgebühren werden bewertungstäglich berechnet und abgegrenzt, jedoch jährlich bezahlt, stellen Verbindlichkeiten in den Büchern der entsprechenden Anteilsklassen dar und werden im offiziellen Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse berücksichtigt. Wenn ein Anteilinhaber seine Anteile mitten im betreffenden Performance-Zeitraum zurückgibt, wird die auf dessen Anteile umgelegte Verbindlichkeit durch die am unmittelbar vorangehenden Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühr sofort fällig.

Wenn der Anlageverwalter während des Performance-Zeitraums von seinem Amt abberufen wird, werden am letzten Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühren berechnet und ausgezahlt, als wäre der letzte Bewertungstag auf das Ende des entsprechenden Performance-Zeitraums gefallen.

Bitte beachten Sie, dass die von jedem Anteilinhaber der Anteilsklassen des Teilfonds zu entrichtenden Erfolgsgebühren möglicherweise nicht der Wertentwicklung der betreffenden Anteilsklasse entsprechen. Dies liegt daran, dass der Teilfonds die Erfolgsgebühren nicht nach Verfahren abrechnet, die auf Ausgleichskonten oder Fondsserien basieren. Infolgedessen kann die Erfolgsgebühr, die den Anteilinhabern belastet wird, positiv oder negativ durch das Tagesgeschäft beeinflusst werden.

Für die Performance-Zeiträume zu bezahlende Erfolgsgebühren werden jährlich rückwirkend an die Man Investments AG ausbezahlt, die einen wesentlichen Anteil daraus an den Anlageverwalter für dessen Dienstleistungen weiterleiten wird.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 6 – Anlageverwaltungs- und Erfolgsgebühren (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative

Eine jährliche Erfolgsgebühr (die „Erfolgsgebühr“) wird bewertungstäglich zu einem Satz von maximal 15 % des neuen, auf die jeweilige Anteilsklasse entfallenden Nettowertzuwachses berechnet. Der Performance-Zeitraum ist der Zeitraum ab dem letzten Zeitpunkt einer gezahlten Erfolgsgebühr (oder ab der Auflegung für den ersten Performance-Zeitraum) bis einschließlich dem letzten Bewertungstag im Geschäftsjahr des Fonds (der „Performance-Tag“). Die Erfolgsgebühr wird täglich berechnet und abgegrenzt, ist jedoch jährlich innerhalb des vierzigsten (40.) Geschäftstages nach dem Ende jedes Geschäftsjahrs zahlbar.

Unter „neuer Nettowertzuwachs“ ist jede überdurchschnittliche Performance (falls zutreffend) des Nettoinventarwerts jeder Anteilsklasse (vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren, jedoch berichtigt um Erfolgsgebühren, die aufgrund von Anteilsrücknahmen fällig sind) gegenüber der High Water Mark (gemäß nachstehender Definition) am Ende des betroffenen Performance-Zeitraums zu verstehen.

Unter der an jedem Bewertungstag berechneten „High Water Mark“ ist der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse am letzten Tag für die Performance zu verstehen, an dem eine Erfolgsgebühr für die jeweilige Anteilsklasse fällig wurde. Die High Water Mark wird für jede Anteilsklasse anteilig um den Betrag der Rücknahmen, Dividenden und Ausschüttungen vermindert und dann um den Betrag der Zeichnungen an jedem Bewertungstag innerhalb des entsprechenden Performance-Zeitraums erhöht. Zum Zwecke der Berechnung der Erfolgsgebühr wird der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse vor Abzug aufgelaufener Erfolgsgebühren berechnet. Die Hauptverwaltungsstelle kann (in Absprache mit dem Anlageverwalter) entsprechende Anpassungen an der High Water Mark vornehmen, um die High Water Mark in einer Weise festzulegen, die sonstigen Veränderungen infolge von Zeichnungen, Rücknahmen, Dividenden, Ausschüttungen und weiteren vergleichbaren Ereignissen Rechnung trägt.

Erfolgsgebühren werden an jedem Bewertungstag berechnet und abgegrenzt, sind jedoch jährlich innerhalb des vierzigsten (40.) Geschäftstages nach dem Ende jedes Geschäftsjahrs zahlbar. Sie stellen Verbindlichkeiten in den Büchern der entsprechenden Anteilsklassen dar und werden im offiziellen Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse berücksichtigt. Wenn ein Anteilinhaber seine Anteile mitten im betreffenden Performance-Zeitraum zurückgibt, wird die auf dessen Anteile umgelegte Verbindlichkeit durch die am unmittelbar vorangehenden Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühr sofort fällig. Im Falle einer Verschmelzung des Teilfonds mit einem anderen bestehenden Teilfonds in einen neuen Teilfonds oder einen neuen OGAW wird die anteilig aufgelaufene Verbindlichkeit der Erfolgsgebühr am Bewertungstag, der dem Datum des Inkrafttretens einer solchen Verschmelzung unmittelbar vorausgeht, sofort fällig und zahlbar.

Wenn der Anlageverwalter während des Performance-Zeitraums von seinem Amt abberufen wird, werden am letzten Bewertungstag aufgelaufene Erfolgsgebühren berechnet und ausgezahlt, als wäre der letzte Bewertungstag auf das Ende des entsprechenden Performance-Zeitraums gefallen.

Bitte beachten Sie, dass die von jedem Anteilinhaber der Anteilsklassen des Teilfonds zu entrichtenden Erfolgsgebühren möglicherweise nicht der Wertentwicklung der betreffenden Anteilsklasse entsprechen. Dies liegt daran, dass der Teilfonds die Erfolgsgebühren nicht nach Verfahren abrechnet, die auf Ausgleichskonten oder Fondsserien basieren. Infolgedessen kann die Erfolgsgebühr, die den Anteilinhabern belastet wird, positiv oder negativ durch das Tagesgeschäft beeinflusst werden.

Für die Performance-Zeiträume zu bezahlende Erfolgsgebühren werden jährlich rückwirkend an die Man Investments AG ausbezahlt, die einen wesentlichen Anteil daraus an den Anlageverwalter für dessen Dienstleistungen weiterleiten wird.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 7 – Ausstehende Gebühren und Aufwendungen

	Man Convertibles Europe EUR	Man Convertibles Global EUR	Man AHL Trend Alternative USD	Man AHL Alpha Core Alternative USD
Abonnementsteuer (Erläuterung 5)	1.494,87	14.984,83	78.882,20	6.191,13
Administrationsgebühren, Gebühren der Domizilstelle, Verwahrstelle, Zahl- und Transferstelle	14.379,36	102.089,34	279.718,28	63.404,72
Honorare	5.909,93	16.231,30	31.595,89	13.670,64
Sonstige Aufwendungen	4.830,75	20.051,80	107.253,22	14.771,82
Summe	26.614,91	153.357,27	497.449,59	98.038,31

Erläuterung 8 – Transaktionskosten

Die Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf und Verkauf von Finanzinstrumenten sind unter „Transaktionskosten“ in der Aufstellung der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

Die Transaktionskosten beziehen sich hauptsächlich auf Maklergebühren.

Erläuterung 9 – Sonstige Aufwendungen

Die sonstigen Aufwendungen umfassen die Gebühr für die Dokumente mit den wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“), die Aufsichtsgebühr, die Notierungsgebühr, die Zahlstellengebühr, die Beratungsgebühr, die Vergütung für Verwaltungsratsmitglieder, die gezahlte luxemburgische Umsatzsteuer, die Steuervertretergebühr, die CSSF-Gebühr, die Versicherungskosten und die Verbreitungsgebühr.

Erläuterung 10 – Verbundene Parteien

Parteien gelten als verbunden, wenn eine Partei die andere Partei bei finanziellen oder operativen Entscheidungen kontrollieren oder maßgeblichen Einfluss auf die andere Partei ausüben kann. Es gab keine Transaktionen mit verbundenen Parteien außer jenen im normalen Geschäftsverlauf. Der Anlageverwalter, die Verwaltungsgesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder werden als mit der Gesellschaft verbunden angesehen. Die an den Anlageverwalter, die Verwaltungsgesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder während des Berichtszeitraums entrichteten Gebühren werden in der Gewinn- und Verlustrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte

Man Convertibles Europe

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							870,77
USD	EUR	Citigroup	14. Jul. 22	113.000,00	(107.116,26)	108.087,43	870,77
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(26.608,85)
EUR	CHF	Citigroup	14. Jul. 22	718.212,98	(743.981,03)	718.212,98	(25.074,20)
EUR	GBP	Citigroup	14. Jul. 22	512.963,46	(442.210,05)	512.963,46	(364,84)
EUR	USD	Citigroup	14. Jul. 22	2.692.604,19	(2.818.823,24)	2.692.604,19	(1.169,81)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							11.984,43
CHF	EUR	Citigroup	29. Jul. 22	933.929,13	(921.021,02)	933.124,78	11.984,43

Man Convertibles Global

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							315.467,75
EUR	AUD	Citigroup	14. Jul. 22	2.333.698,59	(3.523.212,77)	2.333.698,59	18.263,45
EUR	JPY	Citigroup	14. Jul. 22	22.181.384,95	(3.113.745.184,00)	22.181.384,95	260.470,62
USD	EUR	Citigroup	14. Jul. 22	12.292.000,00	(11.710.092,48)	11.757.616,34	36.602,45
USD	EUR	Citigroup	1. Jul. 22	12.643,00	(11.962,13)	12.093,36	131,23
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(259.671,94)
EUR	CHF	Citigroup	14. Jul. 22	3.051.676,59	(3.161.164,64)	3.051.676,59	(106.539,88)
EUR	GBP	Citigroup	14. Jul. 22	6.379.997,52	(5.500.000,00)	6.379.997,52	(4.537,72)
EUR	HKD	Citigroup	14. Jul. 22	8.292.729,04	(68.087.882,97)	8.292.729,04	(3.249,93)
EUR	USD	Citigroup	14. Jul. 22	196.251.566,50	(205.506.445,00)	196.251.566,50	(138.206,80)
USD	EUR	Citigroup	14. Jul. 22	4.599.826,55	(4.402.903,90)	4.399.853,22	(7.137,61)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in EUR)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							1.312.928,56
CHF	EUR	Citigroup	29. Jul. 22	87.919.418,35	(86.709.862,74)	87.843.697,08	1.122.601,47
EUR	CHF	Citigroup	29. Jul. 22	905.149,83	(900.781,58)	905.149,83	5.259,81
EUR	USD	Citigroup	29. Jul. 22	160.294,36	(166.734,64)	160.294,36	1.125,59
USD	EUR	Citigroup	29. Jul. 22	16.190.256,05	(15.271.869,66)	15.486.399,21	183.941,69
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(128,70)
EUR	USD	Citigroup	29. Jul. 22	11.941,02	(12.643,00)	11.941,02	(128,70)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							42.417.604,77
AUD	EUR	HSBC London	6. Jul. 22	11.596.714,86	(7.600.000,00)	7.974.481,92	34.361,84
AUD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	41.023.022,41	(26.900.000,00)	28.209.484,61	90.110,27
AUD	GBP	HSBC London	11. Jul. 22	82.325.986,82	(46.450.000,00)	56.611.471,38	248.459,77
AUD	GBP	HSBC London	15. Jul. 22	5.586.004,81	(3.150.000,00)	3.841.216,64	18.815,54
AUD	JPY	HSBC London	6. Jul. 22	37.900.000,00	3.462.606.342,00	26.061.938,18	644.413,37
AUD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	25.400.000,00	2.370.856.629,00	17.466.312,08	52.932,82
AUD	NZD	HSBC London	13. Jul. 22	8.300.000,00	(9.158.088,92)	5.707.495,66	10.283,52
AUD	NZD	HSBC London	15. Jul. 22	900.000,00	(992.999,75)	618.885,08	1.168,57
AUD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	30.800.000,00	(21.215.654,09)	21.179.622,59	46.078,71
AUD	USD	Citigroup	22. Jul. 22	29.800.000,00	(20.510.489,38)	20.491.972,45	62.357,82
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 22	16.129.302,00	(3.035.703,91)	3.084.325,63	1.733,98
CAD	EUR	Citigroup	15. Jul. 22	5.285.751,62	(3.900.000,00)	4.097.640,69	13.328,52
CAD	EUR	Citigroup	9. Aug. 22	209.168.910,20	(153.400.000,00)	162.152.726,92	1.207.527,99
CAD	USD	HSBC London	14. Jul. 22	163.505,83	(126.533,23)	126.753,62	478,59
CAD	USD	HSBC London	15. Jul. 22	202.100.000,00	(155.994.195,69)	156.672.738,59	997.084,33
CAD	USD	HSBC London	16. Aug. 22	78.100.000,00	(60.351.177,66)	60.544.982,37	320.182,53
CHF	EUR	HSBC London	11. Jul. 22	6.185.684,04	(6.000.000,00)	6.461.256,63	185.996,89
CHF	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	16.449.102,04	(16.200.000,00)	17.181.910,56	237.897,61
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	7.600.000,00	(7.938.003,46)	7.938.580,45	26.621,74
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	95.900.000,00	(99.423.559,12)	100.172.350,84	1.144.085,67
CNH	USD	HSBC London	8. Jul. 22	183.000.000,00	(27.075.004,26)	27.296.281,01	258.058,74
CNH	USD	HSBC London	25. Jul. 22	5.500.000,00	(820.089,82)	820.380,03	1.175,68
CNH	USD	HSBC London	3. Aug. 22	1.500.000,00	(223.638,42)	223.740,00	320,58
EUR	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	30.000.000,00	(45.299.750,89)	31.363.496,89	193.414,36
EUR	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	17.800.000,00	(26.814.294,67)	18.609.008,20	168.827,49
EUR	AUD	HSBC London	24. Aug. 22	4.500.000,00	(6.744.305,40)	4.704.524,50	79.046,12
EUR	CAD	Citigroup	9. Aug. 22	300.000,00	(405.105,60)	313.634,97	707,96
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	2.000.000,00	(1.718.412,46)	2.090.899,80	5.435,49
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	108.800.000,00	(91.857.368,02)	113.744.948,21	2.301.921,54
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	5.600.000,00	2.207.894.667,12)	5.854.519,41	66.283,34
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	400.000,00	(55.466.320,00)	418.179,96	10.777,19
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	22.000.000,00	3.004.481.947,00)	22.999.897,65	934.135,31
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	18.900.000,00	(194.161.600,40)	19.759.002,91	116.976,15
EUR	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	6.100.000,00	(28.520.036,04)	6.377.244,37	52.618,92
EUR	PLN	HSBC London	10. Aug. 22	3.900.000,00	(18.432.328,80)	4.077.254,60	13.366,48
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	31.700.000,00	(338.259.508,88)	33.140.761,77	163.391,52
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 22	29.700.000,00	(315.922.484,51)	31.049.861,69	261.783,54
EUR	USD	HSBC London	14. Jul. 22	9.301.942,39	(9.751.914,55)	9.724.714,63	8.790,34
GBP	AUD	HSBC London	11. Jul. 22	43.250.000,00	(75.570.837,76)	52.524.962,97	516.593,46
GBP	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	6.950.000,00	(12.229.251,57)	8.440.427,55	24.348,18
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	4.144.004,74	(4.800.000,00)	5.032.686,61	11.078,85
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	14.285.933,18	(16.500.000,00)	17.349.551,71	83.610,16
GBP	JPY	Citigroup	13. Jul. 22	31.350.000,00	5.079.797.389,00)	38.073.007,86	737.937,78
GBP	JPY	Citigroup	15. Jul. 22	4.300.000,00	(698.587.248,00)	5.222.135,02	87.230,36
GBP	USD	HSBC London	14. Jul. 22	7.866,74	(9.539,11)	9.553,76	43,85
GBP	USD	HSBC London	15. Jul. 22	7.100.000,00	(8.617.816,69)	8.622.595,01	31.311,01
GBP	USD	HSBC London	28. Jul. 22	12.500.000,00	(15.158.194,24)	15.180.625,15	73.168,26
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	79.747.460,00	(200.000,00)	210.116,21	496,87
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	3.851.188.140,00	(9.600.000,00)	10.146.994,99	61.137,42

HUF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	680.000.000,00	(1.781.544,27)	1.791.643,60	12.603,33
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	27. Jul. 22	1.240.000.000,00	(3.245.409,88)	3.267.114,80	19.125,72
JPY	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	1.921.351.310,00	(20.300.014,41)	14.142.663,50	146.323,53
JPY	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	330.235.844,00	(3.500.000,00)	2.430.796,70	18.820,05
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	600.094.181,00	(4.200.000,00)	4.417.167,25	17.211,58
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	14.362.600,00	(100.000,00)	105.720,08	953,75
JPY	GBP	Citigroup	13. Jul. 22	6.285.129.561,00	(37.900.000,00)	46.263.518,81	168.812,73
JPY	GBP	Citigroup	15. Jul. 22	481.225.511,00	(2.900.000,00)	3.542.199,94	15.472,22
JPY	USD	HSBC London	14. Jul. 22	56.147.345,00	(413.892,99)	413.288,82	71,84
JPY	USD	HSBC London	15. Jul. 22	230.000.000,00	(1.686.960,13)	1.692.981,70	8.898,87
JPY	USD	HSBC London	5. Aug. 22	160.000.000,00	(1.177.443,31)	1.177.726,40	3.966,29
KRW	USD	HSBC London	13. Jul. 22	95.200.000,00	(73.475.010,53)	73.321.135,99	443.029,48
MXN	USD	Citigroup	8. Jul. 22	253.500.000,00	(12.437.887,82)	12.564.474,09	149.908,19
MXN	USD	Citigroup	15. Jul. 22	409.362.547,00	(20.182.945,97)	20.289.645,39	116.933,37

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
MXN	USD	Citigroup	28. Jul. 22	152.500.000,00	(7.465.129,72)	7.558.510,05	78.435,28
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	86.889.489,54	(8.400.000,00)	8.794.693,70	10.583,55
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	107.357.820,63	(10.300.000,00)	10.866.436,83	93.035,81
NOK	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	50.000.000,00	(51.375.724,00)	5.060.850,03	50.889,23
NOK	SEK	Citigroup	25. Jul. 22	82.500.000,00	(84.257.940,69)	8.350.402,73	132.788,54
NOK	USD	Citigroup	26. Jul. 22	389.000.000,00	(39.177.911,48)	39.373.414,09	342.543,52
NZD	AUD	HSBC London	13. Jul. 22	14.993.025,06	(13.500.000,00)	9.321.916,21	44.059,55
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	2.500.000,00	(649.374,55)	657.764,91	2.662,95
PHP	USD	HSBC London	12. Aug. 22	48.756.222,00	(884.295,51)	886.729,41	239,87
PLN	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	8.024.154,30	(1.700.000,00)	1.784.788,60	2.271,67
PLN	EUR	HSBC London	18. Jul. 22	4.731.651,90	(1.000.000,00)	1.052.447,15	3.202,43
PLN	USD	HSBC London	15. Jul. 22	600.000,00	(132.897,18)	133.456,20	667,62
PLN	USD	HSBC London	29. Jul. 22	32.759.313,00	(7.236.075,86)	7.286.555,82	40.684,82
RON	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	56.407.986,24	(11.359.894,00)	11.921.941,41	10.956,37
RON	USD	HSBC London	14. Jul. 22	14.288,70	(3.008,74)	3.019,95	14,25
SEK	USD	Citigroup	15. Jul. 22	15.500.000,00	(1.508.153,12)	1.512.582,95	8.692,38
SGD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	9.600.000,00	(6.899.254,75)	6.898.043,35	4.777,25
SGD	USD	Citigroup	5. Aug. 22	16.100.000,00	(11.571.204,23)	11.568.593,50	8.205,57
TWD	USD	Citigroup	18. Jul. 22	15.000.000,00	(504.860,13)	504.480,00	279,87
USD	AUD	Citigroup	14. Jul. 22	8.894.092,37	(12.809.194,89)	8.894.092,37	51.785,43
USD	AUD	Citigroup	15. Jul. 22	98.647.144,11	(141.700.000,00)	98.647.144,11	829.287,80
USD	AUD	Citigroup	22. Jul. 22	101.393.651,24	(143.700.000,00)	101.393.651,24	2.187.983,11
USD	BRL	HSBC London	5. Jul. 22	71.530.818,74	(363.770.700,00)	71.530.818,74	2.413.419,72
USD	BRL	HSBC London	2. Aug. 22	5.012.831,10	(26.429.482,00)	5.012.831,10	36.055,69
USD	CAD	HSBC London	14. Jul. 22	764.751,29	(980.633,54)	764.751,29	2.992,16
USD	CAD	HSBC London	16. Aug. 22	9.419.630,60	(12.100.000,00)	9.419.630,60	19.841,08
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	14. Jul. 22	168.127,44	(160.314,41)	168.127,44	132,73
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.363.300,08	(1.300.000,00)	1.363.300,08	929,12
USD	CLP	HSBC London	28. Jul. 22	25.625.008,97	(22.350.000.000,00)	25.625.008,97	1.406.634,15
USD	CLP	HSBC London	29. Aug. 22	29.292.428,59	(26.023.500.000,00)	29.292.428,59	1.281.564,51
USD	CNH	HSBC London	8. Jul. 22	90.358.297,73	(604.000.000,00)	90.358.297,73	144.263,37
USD	CNH	HSBC London	25. Jul. 22	1.197.866,60	(8.000.000,00)	1.197.866,60	3.299,70
USD	CNH	HSBC London	3. Aug. 22	31.452.114,55	(210.500.000,00)	31.452.114,55	23.211,65
USD	COP	HSBC London	25. Jul. 22	40.177.352,69	(165.000.000.000,00)	40.177.352,69	748.564,86
USD	COP	HSBC London	31. Aug. 22	8.993.586,09	(36.225.287.357,00)	8.993.586,09	376.656,37
USD	EUR	Citigroup	14. Jul. 22	170.294,76	(161.565,58)	170.294,76	760,22
USD	EUR	HSBC London	14. Jul. 22	29.688.418,83	(28.148.191,03)	29.688.418,83	151.846,81
USD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	46.160.021,54	(43.700.000,00)	46.160.021,54	301.291,69
USD	EUR	HSBC London	17. Aug. 22	119.892.797,28	(113.611.199,00)	119.892.797,28	373.313,95
USD	GBP	HSBC London	14. Jul. 22	196.339,58	(159.920,03)	196.339,58	1.530,74
USD	GBP	HSBC London	15. Jul. 22	797.559,63	(650.000,00)	797.559,63	5.736,70
USD	GBP	HSBC London	28. Jul. 22	64.821.782,47	(52.150.000,00)	64.821.782,47	1.275.900,06

USD	HUF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	607.840,13	(230.000.000,00)	607.840,13	1.093,23
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	3.912.088,59	(13.500.000,00)	3.912.088,59	39.758,30
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	21. Jul. 22	60.515.424,85	(208.500.000,00)	60.515.424,85	686.391,17
USD	INR	Citigroup	12. Jul. 22	41.854.746,62	(3.272.500.000,00)	41.854.746,62	458.091,90
USD	INR	Citigroup	29. Jul. 22	4.151.636,42	(327.500.000,00)	4.151.636,42	15.681,03
USD	INR	Citigroup	11. Aug. 22	30.621.684,80	(2.422.500.000,00)	30.621.684,80	64.519,44
USD	JPY	HSBC London	14. Jul. 22	58.645.459,82	(7.640.000.000,00)	58.645.459,82	2.315.127,84
USD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	74.083,68	(10.000.000,00)	74.083,68	350,37
USD	JPY	HSBC London	5. Aug. 22	107.698.275,99	(14.500.000.000,00)	107.698.275,99	631.568,38
USD	KRW	HSBC London	13. Jul. 22	142.766.267,95	(179.200.000.000,00)	142.766.267,95	3.597.143,80
USD	KRW	HSBC London	14. Jul. 22	8.240.292,77	(10.352.115.000,00)	8.240.292,77	200.653,44
USD	KRW	HSBC London	28. Jul. 22	5.705.204,55	(7.338.798.359,00)	5.705.204,55	5.553,59
USD	KRW	HSBC London	8. Aug. 22	16.916.577,28	(21.700.000.000,00)	16.916.577,28	57.994,52
USD	MXN	Citigroup	15. Jul. 22	2.118.979,66	(42.500.000,00)	2.118.979,66	11.479,01
USD	NOK	Citigroup	14. Jul. 22	327.883,27	(3.200.426,02)	327.883,27	2.818,53
USD	NOK	Citigroup	26. Jul. 22	78.801.005,00	(759.500.000,70)	78.801.005,00	1.638.795,57
USD	NZD	Citigroup	15. Jul. 22	44.816.349,79	(71.659.968,00)	44.816.349,79	65.566,18
USD	NZD	Citigroup	15. Aug. 22	75.781.748,12	(117.200.000,00)	75.781.748,12	2.619.206,77
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	7.635.835,10	(28.750.000,00)	7.635.835,10	137.607,75
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	19. Sept. 22	2.686.292,35	(10.250.000,00)	2.686.292,35	32.511,52
USD	PHP	HSBC London	20. Jul. 22	37.511.594,19	(2.035.600.000,00)	37.511.594,19	514.903,92
USD	PHP	HSBC London	12. Aug. 22	2.231.805,20	(122.500.000,00)	2.231.805,20	9.433,54

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	PLN	HSBC London	14. Jul. 22	1.244.004,78	(5.528.718,85)	1.244.004,78	13.106,08
USD	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	987.831,26	(4.400.000,00)	987.831,26	8.374,16
USD	PLN	HSBC London	29. Jul. 22	4.651.615,27	(20.800.000,00)	4.651.615,27	31.488,64
USD	SEK	Citigroup	14. Jul. 22	351.790,73	(3.535.401,11)	351.790,73	5.824,30
USD	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	1.525.260,70	(15.500.000,00)	1.525.260,70	8.411,00
USD	SEK	Citigroup	20. Jul. 22	43.372.027,77	(424.000.000,00)	43.372.027,77	1.870.493,66
USD	SGD	Citigroup	8. Jul. 22	13.817.880,34	(19.000.000,00)	13.817.880,34	153.783,98
USD	SGD	Citigroup	15. Jul. 22	12.538.994,34	(17.400.000,00)	12.538.994,34	25.436,23
USD	SGD	Citigroup	18. Jul. 22	35.097.716,21	(48.300.000,00)	35.097.716,21	361.656,78
USD	SGD	Citigroup	27. Jul. 22	86.859.468,99	(120.400.000,00)	86.859.468,99	270.070,97
USD	SGD	Citigroup	5. Aug. 22	6.208.395,63	(8.600.000,00)	6.208.395,63	23.119,16
USD	THB	Citigroup	20. Jul. 22	6.143.809,00	(215.000.000,00)	6.143.809,00	57.325,37
USD	THB	Citigroup	27. Jul. 22	637.906,54	(22.500.000,00)	637.906,54	728,17
USD	TWD	Citigroup	18. Jul. 22	17.012.501,03	(502.500.000,00)	17.012.501,03	90.193,04
USD	TWD	Citigroup	25. Jul. 22	66.963.603,06	(1.957.500.000,00)	66.963.603,06	1.015.664,22
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	18. Aug. 22	11.786.013,73	(190.000.000,00)	11.786.013,73	173.938,08
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(48.222.970,94)
AUD	EUR	HSBC London	6. Jul. 22	45.299.750,89	(30.000.000,00)	31.150.377,31	(193.325,75)
AUD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	9.676.588,95	(6.400.000,00)	6.654.107,16	(36.169,62)
AUD	EUR	HSBC London	24. Aug. 22	34.486.774,69	(22.800.000,00)	23.714.833,36	(181.993,24)
AUD	GBP	HSBC London	11. Jul. 22	75.570.837,76	(43.250.000,00)	51.966.292,57	(516.542,51)
AUD	GBP	HSBC London	15. Jul. 22	2.184.241,32	(1.250.000,00)	1.501.993,71	(14.913,32)
AUD	JPY	HSBC London	6. Jul. 22	20.300.000,00	(1.904.416.753,00)	13.959.296,62	(21.521,95)
AUD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	33.300.000,00	(3.124.344.505,00)	22.898.747,74	(49.175,06)
AUD	NZD	HSBC London	13. Jul. 22	21.300.000,00	(23.566.344,97)	14.646.946,70	(13.744,21)
AUD	NZD	HSBC London	15. Jul. 22	1.200.000,00	(1.327.862,29)	825.180,11	(854,31)
AUD	USD	Citigroup	14. Jul. 22	13.862.436,15	(9.571.870,24)	9.532.505,33	(2.505,81)
AUD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	103.600.000,00	(72.010.880,11)	71.240.548,95	(494.142,51)
AUD	USD	Citigroup	22. Jul. 22	32.500.000,00	(23.211.637,06)	22.348.627,80	(774.807,06)
BRL	USD	HSBC London	5. Jul. 22	379.900.000,00	(77.434.124,34)	72.646.374,47	(5.248.565,58)
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 22	66.870.698,00	(12.677.384,50)	12.787.348,73	(84.428,40)
CAD	EUR	Citigroup	15. Jul. 22	17.236.574,94	(12.800.000,00)	13.362.203,91	(42.807,72)
CAD	USD	HSBC London	14. Jul. 22	169.331,30	(131.592,45)	131.269,66	(55,39)
CAD	USD	HSBC London	15. Jul. 22	1.300.000,00	(1.012.245,58)	1.007.790,99	(2.405,58)
CHF	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	199.157,20	(200.000,00)	208.029,67	(1.165,03)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.700.000,00	(1.782.553,78)	1.775.735,11	(992,88)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	2.400.000,00	(2.520.929,20)	2.506.920,15	(4.116,40)
CLP	USD	HSBC London	28. Jul. 22	6.250.000.000,00	(7.493.716,47)	6.668.750,04	(718.716,49)
CLP	USD	HSBC London	29. Aug. 22	3.450.000.000,00	(4.102.653,35)	3.681.150,00	(387.003,35)
CNH	USD	HSBC London	8. Jul. 22	604.000.067,11	(90.639.022,93)	90.092.653,35	(424.968,91)
CNH	USD	HSBC London	25. Jul. 22	29.500.000,00	(4.408.601,09)	4.400.220,16	(3.631,59)
CNH	USD	HSBC London	3. Aug. 22	68.000.000,00	(10.168.253,94)	10.142.880,37	(15.445,94)
COP	USD	HSBC London	25. Jul. 22	165.200.000.000,00	(42.321.210,57)	39.647.999,94	(2.838.410,58)
COP	USD	HSBC London	31. Aug. 22	29.200.000.000,00	(7.464.211,19)	7.007.999,97	(514.611,19)
EUR	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	7.600.009,50	(11.680.242,75)	7.945.429,17	(92.013,88)
EUR	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	3.700.000,00	(5.640.760,50)	3.868.164,62	(11.155,20)
EUR	AUD	HSBC London	24. Aug. 22	12.600.000,00	(19.300.268,25)	13.172.668,67	(65.961,98)
EUR	CAD	Citigroup	15. Jul. 22	1.000.000,00	(1.366.326,90)	1.045.449,90	(11.970,26)
EUR	CAD	Citigroup	9. Aug. 22	105.400.000,00	(143.894.991,23)	110.190.418,51	(969.189,43)
EUR	CHF	HSBC London	11. Jul. 22	6.000.000,00	(6.270.748,43)	6.272.699,34	(275.071,20)
EUR	CHF	HSBC London	15. Jul. 22	500.000,00	(503.446,00)	522.724,94	(2.901,27)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	10.800.000,00	(9.329.930,29)	11.290.858,92	(32.155,85)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	10.300.000,00	(8.942.681,02)	10.768.133,94	(82.443,77)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	3.000.000,00	(1.205.404.230,00)	3.136.349,70	(31.781,01)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	14.600.000,00	(5.856.060.099,16)	15.263.568,37	(91.014,90)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	7.800.000,00	(1.114.515.600,00)	8.154.509,19	(32.375,58)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	8.000.000,00	(1.145.983.592,00)	8.363.599,20	(54.028,18)

EUR	NOK	Scotland Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	4.000.000,00	(41.875.026,09)	4.181.799,59	(55.722,40)
EUR	NOK	Scotland Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	7.500.000,00	(78.403.197,16)	7.840.874,25	(91.168,56)
EUR	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	5.000.000,00	(23.631.132,30)	5.227.249,50	(13.546,53)
EUR	PLN	HSBC London	18. Jul. 22	1.000.000,00	(4.730.580,60)	1.045.449,89	(2.975,71)
EUR	PLN	HSBC London	10. Aug. 22	10.000.000,00	(47.546.114,20)	10.454.498,95	(29.024,92)
EUR	SEK	Scotland Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.100.000,00	(11.803.777,37)	1.149.994,89	(792,29)
EUR	USD	HSBC London	14. Jul. 22	11.892.000,00	(12.517.707,09)	12.432.490,07	(39.205,54)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Verkaufte Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
EUR	USD	HSBC London	15. Jul. 22	8.600.000,00	(9.074.417,76)	8.990.869,06	(49.646,56)
EUR	USD	HSBC London	17. Aug. 22	11.500.000,00	(12.174.778,26)	12.022.673,83	(76.858,76)
GBP	AUD	HSBC London	11. Jul. 22	46.450.008,18	(83.374.722,92)	56.411.212,85	(972.364,39)
GBP	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	9.850.000,00	(17.434.229,21)	11.962.332,53	(35.983,55)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	946.131,20	(1.100.000,00)	1.149.029,04	(1.765,00)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	120.062.813,15	(143.300.000,00)	145.810.284,88	(4.150.733,43)
GBP	JPY	Citigroup	13. Jul. 22	23.750.000,00	(3.960.562.626,00)	28.843.187,79	(267.735,93)
GBP	JPY	Citigroup	15. Jul. 22	10.950.000,00	(1.820.151.876,00)	13.298.227,51	(81.313,15)
GBP	JPY	Citigroup	31. Aug. 22	35.150.000,00	(5.815.882.787,00)	42.687.917,92	(168.640,88)
GBP	USD	HSBC London	15. Jul. 22	650.000,00	(794.669,40)	789.392,50	(2.847,85)
GBP	USD	HSBC London	28. Jul. 22	82.000.000,00	(102.488.882,15)	99.584.900,95	(2.571.144,15)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	396.082.480,00	(1.000.000,00)	1.043.586,24	(4.512,21)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	1.299.779.020,00	(3.300.000,00)	3.424.618,79	(42.259,19)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	14. Jul. 22	24.111.883,21	(63.628,31)	63.529,27	(10,07)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.380.000.000,00	(3.659.694,43)	3.635.982,60	(19.226,83)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	27. Jul. 22	5.540.000.000,00	(15.304.707,92)	14.596.625,80	(719.605,31)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	3.000.000,00	(870.653,15)	856.616,88	(10.142,15)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	21. Jul. 22	5.500.000,00	(1.597.687,78)	1.570.464,29	(19.484,78)
INR	USD	Citigroup	12. Jul. 22	3.272.500.000,00	(41.814.781,88)	41.439.667,61	(417.656,87)
INR	USD	Citigroup	29. Jul. 22	2.915.000.000,00	(37.159.621,25)	36.912.645,09	(346.086,25)
INR	USD	Citigroup	11. Aug. 22	1.662.500.000,00	(21.157.380,62)	21.052.237,55	(186.605,62)
JPY	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	3.462.606.342,00	(37.900.000,00)	25.487.518,13	(644.581,77)
JPY	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	408.178.110,00	(4.400.000,00)	3.004.513,35	(27.768,21)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.048.899.557,00	(7.400.000,00)	7.720.729,39	(31.617,15)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	1.380.735.240,00	(10.000.000,00)	10.163.302,13	(313.596,83)
JPY	GBP	Citigroup	13. Jul. 22	2.756.959.466,00	(17.200.000,00)	20.293.399,69	(626.536,72)
JPY	GBP	Citigroup	15. Jul. 22	510.727.855,00	(3.100.000,00)	3.759.360,48	(10.629,47)
JPY	USD	HSBC London	14. Jul. 22	8.874.957.808,00	(65.714.915,82)	65.326.700,65	(281.360,63)
JPY	USD	HSBC London	15. Jul. 22	10.000.000,00	(74.373,91)	73.607,90	(640,91)
JPY	USD	HSBC London	5. Aug. 22	14.500.000.000,00	(107.698.275,99)	106.731.454,96	(633.030,96)
KRW	USD	HSBC London	13. Jul. 22	27.300.000.000,00	(21.268.221,78)	21.025.914,00	(71.136,78)
MXN	USD	Citigroup	8. Jul. 22	520.000.000,00	(25.997.812,27)	25.773.280,18	(176.692,27)
MXN	USD	Citigroup	15. Jul. 22	689.637.453,00	(34.413.410,77)	34.181.190,84	(214.979,10)
MXN	USD	Citigroup	28. Jul. 22	1.040.000.000,00	(52.388.528,48)	51.546.560,35	(943.888,49)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	10.322.193,30	(1.000.000,00)	1.044.781,48	(951,46)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	59.591.983,22	(5.800.000,00)	6.031.721,94	(35.050,96)
NOK	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	4.500.000,00	(4.673.840,50)	455.476,51	(313,04)
NOK	USD	Citigroup	15. Jul. 22	2.000.000,00	(204.452,54)	202.434,00	(1.310,54)
NOK	USD	Citigroup	26. Jul. 22	487.000.000,00	(50.744.041,83)	49.292.680,24	(1.267.276,82)
NZD	AUD	HSBC London	13. Jul. 22	17.725.070,96	(16.100.000,00)	11.020.566,21	(44.557,07)
NZD	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	3.840.620,24	(3.500.000,00)	2.387.906,35	(17.684,89)
NZD	USD	Citigroup	14. Jul. 22	11.792,36	(7.417,22)	7.331,90	(52,96)
NZD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	38.500.000,00	(24.324.501,96)	23.937.382,47	(281.713,96)
NZD	USD	Citigroup	15. Aug. 22	110.600.000,00	(70.579.331,48)	68.765.571,26	(1.535.733,08)
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	28.250.000,00	(7.496.527,85)	7.432.743,43	(128.504,10)
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	19. Sep. 22	49.750.000,00	(13.202.518,54)	13.089.521,69	(320.601,80)
PHP	USD	HSBC London	20. Jul. 22	2.017.500.000,00	(37.817.339,19)	36.692.272,79	(1.149.276,68)
PHP	USD	HSBC London	27. Jul. 22	1.080.000.000,00	(20.230.786,76)	19.641.960,16	(611.506,76)
PHP	USD	HSBC London	12. Aug. 22	238.743.778,00	(4.339.036,46)	4.342.033,13	(7.746,82)
PLN	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	47.393.188,70	(10.100.000,00)	10.541.524,94	(48.711,46)
PLN	EUR	HSBC London	10. Aug. 22	448.749.965,22	(95.200.000,00)	99.814.109,99	(586.004,46)
PLN	USD	HSBC London	15. Jul. 22	75.400.000,00	(16.893.169,54)	16.770.995,86	(108.526,34)
PLN	USD	HSBC London	29. Jul. 22	152.040.687,00	(34.530.017,00)	33.817.954,28	(757.523,27)
RON	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	1.687.124,72	(340.106,00)	356.577,20	(27,96)
RON	USD	HSBC London	14. Jul. 22	232.785,98	(49.448,80)	49.199,79	(199,43)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	20.248.069,51	(1.900.000,00)	1.975.928,03	(12.345,77)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 22	3.191.840,40	(300.000,00)	311.478,92	(2.573,18)
SEK	NOK	Citigroup	15. Jul. 22	4.636.111,00	(4.500.000,00)	452.419,51	(3.378,14)
SEK	USD	Citigroup	14. Jul. 22	999.513,14	(98.974,99)	97.538,49	(1.165,63)
SEK	USD	Citigroup	15. Jul. 22	63.000.000,00	(6.220.739,98)	6.147.917,80	(55.496,98)
SEK	USD	Citigroup	20. Jul. 22	148.000.000,00	(15.262.118,37)	14.442.727,37	(776.174,37)
SGD	USD	Citigroup	8. Jul. 22	19.000.000,00	(13.703.129,97)	13.652.377,44	(39.032,97)
SGD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	66.700.000,00	(48.042.738,57)	47.927.030,20	(74.099,57)
SGD	USD	Citigroup	18. Jul. 22	1.000.000,00	(720.941,03)	718.546,18	(1.768,03)
SGD	USD	Citigroup	27. Jul. 22	10.800.000,00	(7.775.805,62)	7.760.298,73	(8.650,80)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Verkaufte Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
THB	USD	Citigroup	20. Jul. 22	255.000.000,00	(7.344.249,21)	7.212.675,00	(125.454,21)
THB	USD	Citigroup	27. Jul. 22	40.000.000,00	(1.139.642,56)	1.131.400,00	(6.882,56)
THB	USD	Citigroup	17. Aug. 22	10.000.000,00	(283.855,04)	282.850,00	(375,04)
TWD	USD	Citigroup	18. Jul. 22	257.500.000,00	(8.697.090,34)	8.660.240,00	(25.520,34)
USD	AUD	Citigroup	15. Jul. 22	12.751.729,31	(18.500.000,00)	12.751.729,31	(19.114,88)
USD	BRL	HSBC London	5. Jul. 22	3.059.688,33	(16.129.300,00)	3.059.688,33	(5.079,38)
USD	BRL	HSBC London	2. Aug. 22	2.099.725,02	(11.170.518,00)	2.099.725,02	(3.925,07)
USD	CAD	HSBC London	15. Jul. 22	186.173.838,62	(241.400.000,13)	186.173.838,62	(1.345.664,13)
USD	CAD	HSBC London	16. Aug. 22	23.028.632,36	(29.700.000,00)	23.028.632,36	(43.572,10)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	14. Jul. 22	1.178,77	(1.168,10)	1.178,77	(45,25)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	9.848.908,97	(9.500.000,00)	9.848.908,97	(106.774,03)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	223.091.636,21	(218.500.000,00)	223.091.636,21	(6.033.623,94)
USD	CLP	HSBC London	29. Aug. 22	4.771.855,76	(4.476.500.000,00)	4.771.855,76	(49.976,05)
USD	CNH	HSBC London	8. Jul. 22	27.075.004,26	(183.000.000,00)	27.075.004,26	(258.076,01)
USD	CNH	HSBC London	25. Jul. 22	12.136.298,14	(82.000.000,00)	12.136.298,14	(108.060,03)
USD	COP	HSBC London	31. Aug. 22	1.845.285,03	(7.774.712.643,00)	1.845.285,03	(5.160,82)
USD	EUR	HSBC London	14. Jul. 22	14.297.559,44	(13.654.000,00)	14.297.559,44	(29.814,62)
USD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	7.728.214,42	(7.400.000,00)	7.728.214,42	(37.249,38)
USD	EUR	HSBC London	17. Aug. 22	77.927.080,17	(74.288.801,00)	77.927.080,17	(223.442,00)
USD	GBP	HSBC London	28. Jul. 22	15.158.194,24	(12.500.000,00)	15.158.194,24	(73.131,69)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	14. Jul. 22	9.510,20	(3.643.249,00)	9.510,20	(102,60)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.385.249,07	(530.000.000,00)	1.385.249,07	(12.933,29)
USD	JPY	HSBC London	14. Jul. 22	8.638.636,93	(1.175.862.994,00)	8.638.636,93	(30.775,62)
USD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	1.175.360,85	(160.000.000,00)	1.175.360,85	(4.363,27)
USD	JPY	HSBC London	5. Aug. 22	37.311.454,67	(5.060.000.000,00)	37.311.454,67	(50.506,97)
USD	KRW	HSBC London	13. Jul. 22	1.239.969,41	(1.600.000.000,00)	1.239.969,41	(2.331,60)
USD	KRW	HSBC London	28. Jul. 22	113.917.135,58	(147.061.201.641,00)	113.917.135,58	(294.009,99)
USD	KRW	HSBC London	8. Aug. 22	67.910.634,55	(88.000.000.000,00)	67.910.634,55	(450.016,49)
USD	MXN	Citigroup	8. Jul. 22	37.428.318,40	(773.500.000,00)	37.428.318,40	(981.999,69)
USD	MXN	Citigroup	15. Jul. 22	193.854,90	(4.000.000,00)	193.854,90	(4.513,63)
USD	MXN	Citigroup	28. Jul. 22	16.813.430,44	(347.500.000,00)	16.813.430,44	(377.988,47)
USD	NOK	Citigroup	14. Jul. 22	80.758,41	(801.507,75)	80.758,41	(649,78)
USD	NOK	Citigroup	15. Jul. 22	201.387,18	(2.000.000,00)	201.387,18	(1.754,37)
USD	NOK	Citigroup	26. Jul. 22	38.925.507,32	(386.500.000,00)	38.925.507,32	(340.792,42)
USD	NZD	Citigroup	15. Jul. 22	5.826.811,64	(9.340.032,00)	5.826.811,64	(5.926,85)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	519.230,42	(2.000.000,00)	519.230,42	(2.403,15)
USD	PHP	HSBC London	20. Jul. 22	4.120.244,60	(226.900.000,00)	4.120.244,60	(3.665,33)
USD	PHP	HSBC London	12. Aug. 22	1.539.957,47	(85.000.000,00)	1.539.957,47	(2.117,77)
USD	PLN	HSBC London	14. Jul. 22	1.093.839,96	(4.951.651,84)	1.093.839,96	(8.623,03)
USD	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	400.268,90	(1.800.000,00)	400.268,90	(426,43)
USD	PLN	HSBC London	29. Jul. 22	5.835.869,12	(26.500.000,00)	5.835.869,12	(50.741,69)
USD	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	3.266.549,63	(33.500.000,00)	3.266.549,63	(11.787,93)
USD	SGD	Citigroup	15. Jul. 22	13.439.896,80	(18.700.000,00)	13.439.896,80	(8.582,16)
USD	THB	Citigroup	20. Jul. 22	4.302.901,68	(152.500.000,00)	4.302.901,68	(14.208,76)
USD	THB	Citigroup	27. Jul. 22	70.792,85	(2.500.000,00)	70.792,85	(4,64)
USD	TWD	Citigroup	25. Jul. 22	168.261,22	(5.000.000,00)	168.261,22	(183,47)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	18. Aug. 22	3.190.206,63	(52.500.000,00)	3.190.206,63	(18.744,45)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	133.500.000,00	(8.384.915,15)	8.148.973,70	(194.957,15)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland	18. Aug. 22	268.500.000,00	(16.687.346,55)	16.389.508,90	(276.358,05)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Verkaufte Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							269.162,54
CHF	USD	Citigroup	29. Jul. 22	59.992.565,57	(62.723.986,47)	62.665.237,97	205.215,18
EUR	USD	Citigroup	29. Jul. 22	119.084,29	(124.546,71)	124.496,66	540,86
GBP	USD	Citigroup	29. Jul. 22	108.154,27	(131.374,10)	131.347,95	415,45
USD	EUR	Citigroup	29. Jul. 22	6.678.250,12	(6.298.224,80)	6.678.250,12	62.396,49
USD	GBP	Citigroup	29. Jul. 22	80.281,28	(65.618,30)	80.281,28	323,04
USD	SGD	Citigroup	29. Jul. 22	75.200,34	(104.186,02)	75.200,34	271,52
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(6.991.445,84)
CHF	USD	Citigroup	29. Jul. 22	85.597,49	(89.824,06)	89.410,86	(36,57)
EUR	USD	Citigroup	29. Jul. 22	472.043.428,03	(500.441.120,13)	493.497.749,17	(4.601.038,81)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Verkaufte Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
GBP	USD	Citigroup	29. Jul. 22	231.270.559,83	(284.135.590,64)	280.866.534,16	(2.324.781,56)
SEK	USD	Citigroup	29. Jul. 22	671.280,26	(66.659,38)	65.507,56	(934,33)
SGD	USD	Citigroup	29. Jul. 22	20.695.995,89	(14.948.295,40)	14.871.028,78	(64.086,99)
USD	CHF	Citigroup	29. Jul. 22	122.142,21	(116.724,00)	122.142,21	(294,89)
USD	EUR	Citigroup	29. Jul. 22	14.001,77	(13.387,67)	14.001,77	(60,68)
USD	GBP	Citigroup	29. Jul. 22	67.080,98	(55.224,69)	67.080,98	(212,01)

Man AHL Alpha Core Alternative

Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte Währung	Verkaufte Währung	Verkaufte Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften							5.289.982,93
AUD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	5.336.798,85	(3.500.000,00)	3.669.850,12	11.193,99
AUD	GBP	HSBC London	11. Jul. 22	1.590.552,51	(900.000,00)	1.093.743,55	1.660,72
AUD	GBP	HSBC London	15. Jul. 22	797.674,41	(450.000,00)	548.520,87	2.462,74
AUD	JPY	HSBC London	6. Jul. 22	4.900.000,00	(448.070.236,00)	3.369.485,49	80.381,44
AUD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	2.600.000,00	(242.596.001,00)	1.787.890,22	6.082,13
AUD	NZD	HSBC London	13. Jul. 22	1.500.000,00	(1.655.076,32)	1.031.475,12	1.858,46
AUD	NZD	HSBC London	15. Jul. 22	100.000,00	(110.384,30)	68.765,01	97,99
AUD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	2.800.000,00	(1.928.358,49)	1.925.420,24	4.526,31
AUD	USD	Citigroup	22. Jul. 22	4.100.000,00	(2.822.372,00)	2.819.365,41	8.120,40
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 22	2.112.632,00	(397.619,51)	403.988,04	227,12
CAD	EUR	Citigroup	15. Jul. 22	813.319,80	(600.000,00)	630.504,91	2.149,28
CAD	EUR	Citigroup	9. Aug. 22	14.301.074,17	(10.500.000,00)	11.086.533,72	70.086,11
CAD	USD	HSBC London	15. Jul. 22	9.100.000,00	(7.032.599,41)	7.054.536,99	36.280,59
CAD	USD	HSBC London	16. Aug. 22	12.900.000,00	(9.968.376,33)	10.000.387,61	52.885,47
CHF	EUR	HSBC London	11. Jul. 22	1.238.045,84	(1.200.000,00)	1.293.200,87	38.151,08
CHF	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	2.132.304,86	(2.100.000,00)	2.227.299,19	30.853,10
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	800.000,00	(835.300,49)	835.640,06	3.081,11
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	14.900.000,00	(15.456.904,80)	15.563.796,06	168.308,00
CNH	USD	HSBC London	8. Jul. 22	2.000.000,00	(298.304,43)	298.320,01	417,57
CNH	USD	HSBC London	25. Jul. 22	500.000,00	(74.545,00)	74.580,00	115,50
EUR	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	1.900.000,00	(2.863.285,61)	1.986.354,81	16.183,02
EUR	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	2.400.000,00	(3.616.250,35)	2.509.079,76	22.183,55
EUR	AUD	HSBC London	24. Aug. 22	600.000,00	(898.577,20)	627.269,94	10.997,48
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	300.000,00	(257.882,27)	313.634,97	668,67
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	9.300.000,00	(7.958.830,83)	9.722.684,06	66.384,84
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	1.100.000,00	(433.055.052,58)	1.149.994,88	14.708,57
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	500.000,00	(70.699.291,00)	522.724,95	3.405,63
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	3.900.000,00	(532.429.703,00)	4.077.254,59	166.944,87
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	3.300.000,00	(33.898.792,54)	3.449.984,63	20.672,10
EUR	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	800.000,00	(3.743.880,96)	836.359,92	6.109,23
EUR	PLN	HSBC London	10. Aug. 22	300.000,00	(1.417.941,70)	313.634,97	1.012,52
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	4.200.000,00	(44.821.222,17)	4.390.889,58	21.207,45
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 22	4.000.000,00	(42.548.487,95)	4.181.799,55	35.256,54
GBP	AUD	HSBC London	11. Jul. 22	800.000,00	(1.406.830,49)	971.560,00	3.351,23
GBP	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	950.000,00	(1.671.657,02)	1.153.727,50	3.305,60
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	604.241,79	(700.000,00)	733.821,45	1.503,42
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	1.732.011,16	(2.000.000,00)	2.103.440,97	10.600,42
GBP	JPY	Citigroup	13. Jul. 22	4.000.000,00	(646.989.931,00)	4.857.800,04	102.627,14
GBP	JPY	Citigroup	15. Jul. 22	600.000,00	(97.410.097,00)	728.670,00	12.666,68
GBP	USD	HSBC London	15. Jul. 22	900.000,00	(1.092.275,99)	1.093.005,00	4.092,31
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	561.723.500,00	(1.400.000,00)	1.480.012,24	9.157,49
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	90.000.000,00	(235.725,58)	237.129,30	1.696,22
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	27. Jul. 22	10.000.000,00	(26.089,27)	26.347,70	237,63
JPY	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	309.571.757,00	(3.300.000,00)	2.278.692,69	3.404,56
JPY	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	37.671.052,00	(400.000,00)	277.288,70	1.633,39
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	85.772.294,00	(600.000,00)	631.351,84	2.786,99
JPY	GBP	Citigroup	13. Jul. 22	829.122.656,00	(5.000.000,00)	6.102.997,77	21.901,46
JPY	GBP	Citigroup	15. Jul. 22	41.463.665,00	(250.000,00)	305.205,33	1.176,85
JPY	USD	HSBC London	14. Jul. 22	8.739.627,00	(64.424,57)	64.330,56	11,21

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte		Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung	Gegenpartei						
JPY	USD	HSBC London	15. Jul. 22	60.000.000,00	(440.474,98)	441.647,40	1.923,02	
KRW	USD	HSBC London	13. Jul. 22	15.400.000.000,00	(11.887.644,98)	11.860.772,00	69.685,01	
MXN	USD	Citigroup	8. Jul. 22	51.000.000,00	(2.502.296,94)	2.527.764,02	30.159,06	
MXN	USD	Citigroup	15. Jul. 22	53.680.958,00	(2.647.135,79)	2.660.643,00	14.849,24	
MXN	USD	Citigroup	28. Jul. 22	27.000.000,00	(1.322.264,57)	1.338.228,01	13.317,43	
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	12.418.373,50	(1.200.000,00)	1.256.950,55	2.079,10	
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	16.676.943,00	(1.600.000,00)	1.687.990,19	14.452,17	
NOK	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	7.000.000,00	(7.193.839,00)	708.519,00	7.003,44	
NOK	SEK	Citigroup	25. Jul. 22	11.500.000,00	(11.745.046,28)	1.163.995,53	18.509,92	
NOK	USD	Citigroup	26. Jul. 22	23.000.000,00	(2.317.640,18)	2.327.991,01	19.044,82	
NZD	AUD	HSBC London	13. Jul. 22	2.664.307,48	(2.400.000,00)	1.656.533,70	7.133,92	
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	250.000,00	(65.171,17)	65.776,49	32,58	
PHP	USD	HSBC London	12. Aug. 22	5.970.149,00	(108.281,07)	108.579,10	29,38	
PLN	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	943.973,20	(200.000,00)	209.965,13	257,25	
PLN	EUR	HSBC London	18. Jul. 22	946.330,38	(200.000,00)	210.489,43	640,49	
PLN	USD	HSBC London	29. Jul. 22	5.983.736,00	(1.321.271,52)	1.330.944,46	7.883,79	
RON	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	7.663.362,06	(1.543.315,00)	1.619.666,99	1.482,70	
RON	USD	HSBC London	14. Jul. 22	1.691,20	(356,11)	357,44	1,69	
SEK	USD	Citigroup	15. Jul. 22	2.000.000,00	(194.513,59)	195.172,00	1.208,41	
SGD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	1.300.000,00	(934.260,92)	934.110,05	660,08	
SGD	USD	Citigroup	5. Aug. 22	2.200.000,00	(1.581.158,34)	1.580.801,60	1.121,26	
THB	USD	Citigroup	20. Jul. 22	5.000.000,00	(141.126,53)	141.425,00	418,47	
TWD	USD	Citigroup	25. Jul. 22	2.500.000,00	(84.169,42)	84.080,00	53,08	
USD	AUD	Citigroup	14. Jul. 22	1.403.468,41	(2.018.180,14)	1.403.468,41	10.299,61	
USD	AUD	Citigroup	15. Jul. 22	6.615.482,21	(9.500.000,00)	6.615.482,21	57.474,71	
USD	AUD	Citigroup	22. Jul. 22	16.465.281,82	(23.300.000,00)	16.465.281,82	379.737,89	
USD	BRL	HSBC London	5. Jul. 22	10.132.300,03	(51.487.366,00)	10.132.300,03	349.575,05	
USD	BRL	HSBC London	2. Aug. 22	632.024,09	(3.331.538,00)	632.024,09	4.683,85	
USD	CAD	HSBC London	14. Jul. 22	85.719,88	(109.917,81)	85.719,88	335,39	
USD	CAD	HSBC London	16. Aug. 22	1.556.619,51	(2.000.000,00)	1.556.619,51	2.935,33	
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	14. Jul. 22	23.715,89	(22.613,79)	23.715,89	18,72	
USD	CHF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	209.741,86	(200.000,00)	209.741,86	146,32	
USD	CLP	HSBC London	28. Jul. 22	2.973.900,68	(2.600.000.000,00)	2.973.900,68	156.504,86	
USD	CLP	HSBC London	29. Aug. 22	4.593.195,43	(4.070.125.000,00)	4.593.195,43	212.396,35	
USD	CNH	HSBC London	8. Jul. 22	3.066.938,71	(20.500.000,00)	3.066.938,71	5.038,55	
USD	CNH	HSBC London	3. Aug. 22	3.660.500,49	(24.500.000,00)	3.660.500,49	2.504,58	
USD	COP	HSBC London	25. Jul. 22	6.565.928,86	(27.000.000.000,00)	6.565.928,86	113.873,93	
USD	COP	HSBC London	31. Aug. 22	1.598.955,60	(6.432.183.907,00)	1.598.955,60	68.954,15	
USD	EUR	HSBC London	14. Jul. 22	2.203.892,06	(2.097.000,00)	2.203.892,06	3.466,91	
USD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	6.232.570,11	(5.900.000,00)	6.232.570,11	41.116,40	
USD	EUR	HSBC London	17. Aug. 22	15.005.414,35	(14.222.797,00)	15.005.414,35	42.982,11	
USD	GBP	HSBC London	14. Jul. 22	22.638,03	(18.438,84)	22.638,03	176,50	
USD	GBP	HSBC London	15. Jul. 22	245.768,40	(200.000,00)	245.768,40	2.130,51	
USD	GBP	HSBC London	28. Jul. 22	1.596.207,05	(1.300.000,00)	1.596.207,05	12.139,29	
USD	HUF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	52.856,73	(20.000.000,00)	52.856,73	96,57	
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	433.979,65	(1.500.000,00)	433.979,65	3.721,27	
USD	ILS	Royal Bank of Scotland	21. Jul. 22	8.272.268,13	(28.500.000,00)	8.272.268,13	94.198,33	
USD	INR	Citigroup	12. Jul. 22	5.790.953,13	(452.500.000,00)	5.790.953,13	66.896,82	
USD	INR	Citigroup	29. Jul. 22	380.577,87	(30.000.000,00)	380.577,87	1.712,46	
USD	INR	Citigroup	11. Aug. 22	4.139.718,18	(327.500.000,00)	4.139.718,18	8.666,72	
USD	JPY	HSBC London	14. Jul. 22	11.249.025,83	(1.462.121.530,00)	11.249.025,83	468.665,58	
USD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	148.167,35	(20.000.000,00)	148.167,35	700,73	
USD	JPY	HSBC London	5. Aug. 22	11.787.676,31	(1.590.000.000,00)	11.787.676,31	47.308,84	
USD	KRW	HSBC London	13. Jul. 22	22.471.972,21	(28.200.000.000,00)	22.471.972,21	571.430,29	
USD	KRW	HSBC London	14. Jul. 22	1.521.746,03	(1.917.400.000,00)	1.521.746,03	32.695,03	
USD	KRW	HSBC London	28. Jul. 22	685.629,92	(881.812.123,00)	685.629,92	772,88	
USD	KRW	HSBC London	8. Aug. 22	2.728.487,44	(3.500.000.000,00)	2.728.487,44	9.361,13	
USD	MXN	Citigroup	15. Jul. 22	149.575,03	(3.000.000,00)	149.575,03	810,28	
USD	NOK	Citigroup	14. Jul. 22	51.453,29	(502.228,92)	51.453,29	442,30	
USD	NOK	Citigroup	15. Jul. 22	51.075,94	(500.000,00)	51.075,94	290,37	
USD	NOK	Citigroup	26. Jul. 22	6.197.878,06	(59.500.000,00)	6.197.878,06	152.900,27	
USD	NZD	Citigroup	15. Jul. 22	5.445.094,61	(8.703.493,00)	5.445.094,61	9.868,68	
USD	NZD	Citigroup	15. Aug. 22	6.078.120,61	(9.400.000,00)	6.078.120,61	210.135,26	

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte				Nicht realisierter	
Währung	Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Gewinn/(Verlust) (in USD)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	1.595.342,41	(6.000.000,00)	1.595.342,41	30.497,59
USD	PEN	Royal Bank of Scotland	19. Sep. 22	393.217,15	(1.500.000,00)	393.217,15	4.859,86
USD	PHP	HSBC London	20. Jul. 22	5.323.591,50	(288.800.000,00)	5.323.591,50	74.700,81
USD	PHP	HSBC London	12. Aug. 22	227.766,44	(12.500.000,00)	227.766,44	993,91
USD	PLN	HSBC London	14. Jul. 22	146.991,61	(653.152,27)	146.991,61	1.575,65
USD	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	44.774,84	(200.000,00)	44.774,84	253,79
USD	PLN	HSBC London	29. Jul. 22	1.259.538,07	(5.600.000,00)	1.259.538,07	15.688,94
USD	SEK	Citigroup	14. Jul. 22	61.715,67	(619.999,12)	61.715,67	1.043,94
USD	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	246.628,23	(2.500.000,00)	246.628,23	1.974,74
USD	SEK	Citigroup	20. Jul. 22	6.767.313,88	(65.500.000,00)	6.767.313,88	356.064,62
USD	SGD	Citigroup	8. Jul. 22	1.818.142,15	(2.500.000,00)	1.818.142,15	20.234,74
USD	SGD	Citigroup	15. Jul. 22	1.657.616,76	(2.300.000,00)	1.657.616,76	3.525,76
USD	SGD	Citigroup	18. Jul. 22	9.297.670,42	(12.800.000,00)	9.297.670,42	92.255,14
USD	SGD	Citigroup	27. Jul. 22	7.358.760,95	(10.200.000,00)	7.358.760,95	23.114,25
USD	SGD	Citigroup	5. Aug. 22	1.082.859,70	(1.500.000,00)	1.082.859,70	4.032,41
USD	THB	Citigroup	20. Jul. 22	789.030,18	(27.500.000,00)	789.030,18	10.523,75
USD	THB	Citigroup	27. Jul. 22	284.529,73	(10.000.000,00)	284.529,73	1.338,11
USD	TWD	Citigroup	18. Jul. 22	1.354.142,35	(40.000.000,00)	1.354.142,35	7.093,07
USD	TWD	Citigroup	25. Jul. 22	10.280.366,09	(300.000.000,00)	10.280.366,09	173.372,27
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland	18. Aug. 22	1.550.806,88	(25.000.000,00)	1.550.806,88	22.902,27
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften							(6.016.583,55)
AUD	EUR	HSBC London	6. Jul. 22	5.136.453,45	(3.400.000,00)	3.532.082,63	(20.197,85)
AUD	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	1.361.839,84	(900.000,00)	936.469,27	(4.348,78)
AUD	EUR	HSBC London	24. Aug. 22	3.781.631,35	(2.500.000,00)	2.600.439,11	(19.826,94)
AUD	GBP	HSBC London	11. Jul. 22	9.168.233,63	(5.250.000,00)	6.304.536,59	(66.225,13)
AUD	GBP	HSBC London	15. Jul. 22	350.063,70	(200.000,00)	240.721,33	(1.982,34)
AUD	JPY	HSBC London	15. Jul. 22	5.200.000,00	(487.952.693,00)	3.575.780,45	(8.173,05)
AUD	NZD	HSBC London	13. Jul. 22	4.100.000,00	(4.536.258,01)	2.819.365,32	(2.653,84)
AUD	NZD	HSBC London	15. Jul. 22	200.000,00	(221.712,20)	137.530,02	(393,35)
AUD	USD	Citigroup	14. Jul. 22	2.121.630,36	(1.465.041,87)	1.458.939,29	(461,34)
AUD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	5.200.000,00	(3.605.308,94)	3.575.780,48	(15.665,74)
AUD	USD	Citigroup	22. Jul. 22	8.100.000,00	(5.794.378,70)	5.569.965,79	(202.430,30)
BRL	USD	HSBC London	5. Jul. 22	53.600.000,00	(10.899.019,57)	10.249.659,56	(714.376,23)
BRL	USD	HSBC London	2. Aug. 22	8.787.368,00	(1.665.951,30)	1.680.364,39	(11.131,73)
CAD	EUR	Citigroup	15. Jul. 22	2.289.531,12	(1.700.000,00)	1.774.899,11	(5.453,76)
CAD	USD	HSBC London	14. Jul. 22	15.960,83	(12.403,64)	12.373,22	(5,22)
CAD	USD	HSBC London	15. Jul. 22	100.000,00	(77.846,09)	77.522,38	(166,09)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	300.000,00	(314.548,40)	313.365,03	(155,30)
CHF	USD	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	400.000,00	(420.081,86)	417.820,04	(613,06)
CLP	USD	HSBC London	28. Jul. 22	900.000.000,00	(1.079.156,92)	960.300,00	(103.556,93)
CLP	USD	HSBC London	29. Aug. 22	650.000.000,00	(772.247,62)	693.550,00	(72.197,62)
CNH	USD	HSBC London	8. Jul. 22	48.000.000,00	(7.179.251,22)	7.159.680,27	(9.923,22)
CNH	USD	HSBC London	25. Jul. 22	3.000.000,00	(448.318,76)	447.480,02	(355,76)
CNH	USD	HSBC London	3. Aug. 22	10.000.000,00	(1.495.279,91)	1.491.600,05	(2.219,91)
COP	USD	HSBC London	25. Jul. 22	27.000.000.000,00	(6.876.140,94)	6.479.999,99	(423.140,92)
COP	USD	HSBC London	31. Aug. 22	5.600.000.000,00	(1.436.329,21)	1.344.000,00	(103.529,24)
EUR	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	1.500.000,00	(2.291.633,50)	1.568.174,85	(8.721,65)
EUR	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	400.000,00	(609.783,51)	418.179,96	(1.186,34)
EUR	AUD	HSBC London	24. Aug. 22	1.100.000,00	(1.682.523,51)	1.149.994,89	(4.087,80)
EUR	CAD	Citigroup	15. Jul. 22	200.000,00	(273.545,30)	209.089,98	(2.611,49)
EUR	CAD	Citigroup	9. Aug. 22	4.100.000,00	(5.617.159,03)	4.286.344,59	(53.023,72)
EUR	CHF	HSBC London	11. Jul. 22	1.200.000,00	(1.253.460,02)	1.254.539,88	(54.292,15)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	1.600.000,00	(1.382.399,87)	1.672.719,84	(4.992,84)
EUR	GBP	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	1.400.000,00	(1.215.981,24)	1.463.629,86	(11.779,80)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	400.000,00	(160.633.160,00)	418.179,96	(4.006,33)
EUR	HUF	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	2.000.000,00	(802.199.819,83)	2.090.899,78	(12.467,29)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	900.000,00	(128.809.932,00)	940.904,91	(5.297,20)
EUR	JPY	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	1.300.000,00	(186.028.392,00)	1.359.084,87	(7.350,86)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	500.000,00	(5.237.802,40)	522.724,95	(7.313,01)
EUR	NOK	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	1.000.000,00	(10.453.892,20)	1.045.449,90	(12.169,27)
EUR	PLN	HSBC London	15. Jul. 22	700.000,00	(3.308.798,50)	731.814,93	(1.994,66)
EUR	PLN	HSBC London	18. Jul. 22	200.000,00	(946.116,12)	209.089,98	(595,14)
EUR	PLN	HSBC London	10. Aug. 22	800.000,00	(3.802.721,46)	836.359,92	(2.106,11)
EUR	SEK	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	100.000,00	(1.074.038,40)	104.544,99	(166,68)
EUR	USD	HSBC London	14. Jul. 22	1.368.000,00	(1.439.978,41)	1.430.175,45	(4.510,02)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte				Nicht realisierter	
Währung	Währung	Gegenpartei	Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Gewinn/(Verlust) (in USD)
EUR	USD	HSBC London	15. Jul. 22	1.200.000,00	(1.265.018,06)	1.254.539,87	(5.747,66)
EUR	USD	HSBC London	17. Aug. 22	2.300.000,00	(2.433.344,32)	2.404.534,77	(13.760,42)
GBP	AUD	HSBC London	11. Jul. 22	5.350.000,00	(9.485.703,32)	6.497.307,53	(31.099,81)
GBP	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	1.350.000,00	(2.390.326,77)	1.639.507,50	(5.528,07)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	171.884,80	(200.000,00)	208.745,50	(490,13)
GBP	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	11.891.681,42	(14.200.000,00)	14.441.852,63	(418.219,02)
GBP	JPY	Citigroup	13. Jul. 22	4.850.000,00	(808.790.989,00)	5.890.082,55	(54.692,25)
GBP	JPY	Citigroup	15. Jul. 22	1.400.000,00	(232.752.642,00)	1.700.230,00	(10.684,63)
GBP	JPY	Citigroup	31. Aug. 22	4.600.000,00	(761.111.261,00)	5.586.470,05	(22.069,64)
GBP	USD	HSBC London	15. Jul. 22	200.000,00	(244.731,25)	242.890,00	(1.093,85)
GBP	USD	HSBC London	28. Jul. 22	5.400.000,00	(6.799.780,92)	6.558.030,07	(219.832,31)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	79.301.150,00	(200.000,00)	208.940,29	(679,34)
HUF	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	273.859.430,00	(700.000,00)	721.556,60	(13.831,32)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	14. Jul. 22	3.348.719,56	(8.836,86)	8.823,11	(1,40)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	180.000.000,00	(477.413,27)	474.258,60	(2.569,67)
HUF	USD	Royal Bank of Scotland	27. Jul. 22	1.050.000.000,00	(2.897.435,45)	2.766.508,51	(133.110,97)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	500.000,00	(145.277,34)	142.769,48	(1.858,84)
ILS	USD	Royal Bank of Scotland	21. Jul. 22	1.500.000,00	(436.803,96)	428.308,44	(6.384,96)
INR	USD	Citigroup	12. Jul. 22	452.500.000,00	(5.781.764,51)	5.730.007,50	(57.639,52)
INR	USD	Citigroup	29. Jul. 22	425.000.000,00	(5.418.413,89)	5.381.775,00	(51.088,89)
INR	USD	Citigroup	11. Aug. 22	177.500.000,00	(2.258.908,31)	2.247.682,50	(19.923,31)
JPY	AUD	HSBC London	6. Jul. 22	143.131.115,00	(1.600.000,00)	1.053.558,08	(49.669,01)
JPY	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	55.700.690,00	(600.000,00)	410.001,08	(3.491,37)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	170.030.204,00	(1.200.000,00)	1.251.556,63	(5.580,97)
JPY	EUR	Royal Bank of Scotland	25. Jul. 22	361.688.165,00	(2.600.000,00)	2.662.310,64	(61.670,20)
JPY	GBP	Citigroup	13. Jul. 22	616.378.660,00	(3.850.000,00)	4.537.033,88	(145.633,74)
JPY	GBP	Citigroup	15. Jul. 22	74.141.465,00	(450.000,00)	545.739,75	(1.516,81)
JPY	USD	HSBC London	14. Jul. 22	1.541.649.815,00	(11.445.764,13)	11.347.760,55	(79.442,12)
JPY	USD	HSBC London	5. Aug. 22	940.000.000,00	(7.008.857,20)	6.919.142,60	(68.075,79)
KRW	USD	HSBC London	13. Jul. 22	4.200.000.000,00	(3.272.298,79)	3.234.756,00	(11.208,79)
MXN	USD	Citigroup	8. Jul. 22	97.000.000,00	(4.849.591,90)	4.807.708,02	(32.959,90)
MXN	USD	Citigroup	15. Jul. 22	90.819.042,00	(4.531.902,82)	4.501.355,03	(28.277,34)
MXN	USD	Citigroup	28. Jul. 22	144.000.000,00	(7.244.377,07)	7.137.216,05	(121.273,06)
NOK	EUR	Royal Bank of Scotland	20. Jul. 22	13.303.754,30	(1.300.000,00)	1.346.566,14	(13.239,93)
NOK	SEK	Citigroup	15. Jul. 22	500.000,00	(519.345,00)	50.608,50	(37,66)
NOK	USD	Citigroup	15. Jul. 22	500.000,00	(51.137,17)	50.608,50	(351,67)
NOK	USD	Citigroup	26. Jul. 22	26.500.000,00	(2.764.548,54)	2.682.250,53	(72.281,04)
NZD	AUD	HSBC London	13. Jul. 22	3.521.603,05	(3.200.000,00)	2.189.557,36	(9.725,56)
NZD	AUD	HSBC London	15. Jul. 22	548.697,89	(500.000,00)	341.153,02	(2.502,78)
NZD	USD	Citigroup	14. Jul. 22	2.634,29	(1.651,88)	1.637,87	(6,78)
NZD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	4.500.000,00	(2.844.485,81)	2.797.875,87	(34.289,81)
NZD	USD	Citigroup	15. Aug. 22	8.200.000,00	(5.159.434,59)	5.098.351,58	(40.469,79)
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	13. Jul. 22	6.000.000,00	(1.593.835,03)	1.578.635,76	(28.945,03)
PEN	USD	Royal Bank of Scotland	19. Sep. 22	6.750.000,00	(1.787.941,49)	1.775.965,24	(40.143,74)
PHP	USD	HSBC London	20. Jul. 22	275.000.000,00	(5.155.228,10)	5.001.425,01	(157.103,08)
PHP	USD	HSBC London	27. Jul. 22	152.500.000,00	(2.856.657,98)	2.773.517,53	(86.342,98)
PHP	USD	HSBC London	12. Aug. 22	31.529.851,00	(573.041,20)	573.433,41	(1.026,65)
PLN	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	6.568.600,90	(1.400.000,00)	1.461.034,22	(6.919,32)
PLN	EUR	HSBC London	10. Aug. 22	56.074.252,48	(11.900.000,00)	12.472.427,96	(77.560,40)
PLN	USD	HSBC London	14. Jul. 22	39.061,50	(8.748,39)	8.688,33	(51,66)
PLN	USD	HSBC London	15. Jul. 22	10.000.000,00	(2.240.674,75)	2.224.270,00	(14.594,75)
PLN	USD	HSBC London	29. Jul. 22	22.816.264,00	(5.193.830,66)	5.074.953,21	(125.699,58)
RON	EUR	HSBC London	15. Jul. 22	281.190,76	(56.685,00)	59.430,23	(4,65)
RON	USD	HSBC London	14. Jul. 22	41.052,06	(8.718,66)	8.676,44	(33,48)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	15. Jul. 22	2.131.197,50	(200.000,00)	207.975,03	(1.316,98)
SEK	EUR	Royal Bank of Scotland	26. Jul. 22	1.063.965,20	(100.000,00)	103.828,10	(855,93)
SEK	NOK	Citigroup	15. Jul. 22	1.536.467,00	(1.500.000,00)	149.937,67	(1.997,11)
SEK	USD	Citigroup	14. Jul. 22	130.997,20	(12.961,16)	12.783,49	(142,17)
SEK	USD	Citigroup	15. Jul. 22	9.000.000,00	(889.016,30)	878.274,00	(8.267,30)
SEK	USD	Citigroup	20. Jul. 22	28.500.000,00	(2.955.534,27)	2.781.200,94	(166.011,27)
SGD	USD	Citigroup	8. Jul. 22	2.500.000,00	(1.804.189,05)	1.796.365,46	(6.281,55)
SGD	USD	Citigroup	15. Jul. 22	8.500.000,00	(6.122.386,48)	6.107.642,54	(9.441,48)
SGD	USD	Citigroup	18. Jul. 22	2.200.000,00	(1.585.171,63)	1.580.801,62	(2.991,03)
SGD	USD	Citigroup	27. Jul. 22	600.000,00	(431.803,98)	431.127,73	(295,37)
THB	USD	Citigroup	20. Jul. 22	37.500.000,00	(1.081.911,38)	1.060.687,50	(20.323,88)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 11 – Ausstehende Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)
Zu Handelszwecken getätigte Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Gekaufte		Verkaufte		Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung	Gegenpartei						
THB	USD	Citigroup		27. Jul. 22	7.500.000,00	(213.694,16)	212.137,50	(1.301,66)
THB	USD	Citigroup		17. Aug. 22	2.500.000,00	(70.961,85)	70.712,50	(91,85)
TWD	USD	Citigroup		18. Jul. 22	30.000.000,00	(1.014.527,29)	1.008.960,00	(4.247,29)
TWD	USD	Citigroup		25. Jul. 22	15.000.000,00	(507.098,99)	504.480,00	(1.763,99)
USD	AUD	Citigroup		15. Jul. 22	1.171.272,52	(1.700.000,00)	1.171.272,52	(2.264,46)
USD	BRL	HSBC London		5. Jul. 22	400.761,44	(2.112.634,00)	400.761,44	(665,30)
USD	BRL	HSBC London		2. Aug. 22	276.014,00	(1.468.462,00)	276.014,00	(529,27)
USD	CAD	HSBC London		15. Jul. 22	10.941.713,95	(14.200.000,00)	10.941.713,95	(88.844,94)
USD	CAD	HSBC London		16. Aug. 22	4.729.533,66	(6.100.000,00)	4.729.533,66	(9.201,91)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland		15. Jul. 22	1.347.466,40	(1.300.000,00)	1.347.466,40	(14.889,96)
USD	CHF	Royal Bank of Scotland		25. Jul. 22	31.899.277,83	(31.100.000,00)	31.899.277,83	(713.289,79)
USD	CLP	HSBC London		29. Aug. 22	671.651,76	(629.875.000,00)	671.651,76	(6.811,00)
USD	CNH	HSBC London		8. Jul. 22	4.362.774,68	(29.500.000,00)	4.362.774,68	(43.377,71)
USD	CNH	HSBC London		25. Jul. 22	2.219.394,69	(15.000.000,00)	2.219.394,69	(20.427,16)
USD	COP	HSBC London		31. Aug. 22	229.775,23	(967.816.093,00)	229.775,23	(572,12)
USD	EUR	HSBC London		14. Jul. 22	2.091.125,40	(1.997.000,00)	2.091.125,40	(4.360,61)
USD	EUR	HSBC London		15. Jul. 22	1.044.100,76	(1.000.000,00)	1.044.100,76	(5.285,98)
USD	EUR	HSBC London		17. Aug. 22	12.039.296,72	(11.477.203,00)	12.039.296,72	(34.520,52)
USD	GBP	HSBC London		14. Jul. 22	506,01	(417,30)	506,01	(2,33)
USD	GBP	HSBC London		28. Jul. 22	121.265,55	(100.000,00)	121.265,55	(585,06)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland		15. Jul. 22	314.643,18	(120.000.000,00)	314.643,18	(1.923,94)
USD	HUF	Royal Bank of Scotland		27. Jul. 22	288.189,76	(110.000.000,00)	288.189,76	(1.412,45)
USD	JPY	HSBC London		14. Jul. 22	1.179.550,69	(160.562.664,00)	1.179.550,69	(4.247,03)
USD	JPY	HSBC London		15. Jul. 22	220.142,33	(30.000.000,00)	220.142,33	(1.055,74)
USD	KRW	HSBC London		13. Jul. 22	77.506,76	(100.000.000,00)	77.506,76	(137,12)
USD	KRW	HSBC London		28. Jul. 22	13.025.806,56	(16.818.187.877,00)	13.025.806,56	(35.572,53)
USD	KRW	HSBC London		8. Aug. 22	9.874.585,61	(12.800.000.000,00)	9.874.585,61	(68.753,17)
USD	MXN	Citigroup		8. Jul. 22	7.163.133,88	(148.000.000,00)	7.163.133,88	(186.220,01)
USD	MXN	Citigroup		15. Jul. 22	147.190,28	(3.000.000,00)	147.190,28	(1.581,11)
USD	MXN	Citigroup		28. Jul. 22	2.760.190,59	(57.000.000,00)	2.760.190,59	(59.684,66)
USD	NOK	Citigroup		14. Jul. 22	4.261,71	(42.296,41)	4.261,71	(34,29)
USD	NOK	Citigroup		26. Jul. 22	2.618.699,00	(26.000.000,00)	2.618.699,00	(22.759,78)
USD	NZD	Citigroup		15. Jul. 22	684.189,74	(1.096.507,00)	684.189,74	(565,78)
USD	PEN	Royal Bank of Scotland		13. Jul. 22	64.951,43	(250.000,00)	64.951,43	(252,69)
USD	PHP	HSBC London		20. Jul. 22	521.204,05	(28.700.000,00)	521.204,05	(418,72)
USD	PHP	HSBC London		12. Aug. 22	226.323,99	(12.500.000,00)	226.323,99	(452,14)
USD	PLN	HSBC London		14. Jul. 22	237.427,11	(1.074.797,45)	237.427,11	(1.871,70)
USD	PLN	HSBC London		15. Jul. 22	44.506,48	(200.000,00)	44.506,48	(15,15)
USD	PLN	HSBC London		29. Jul. 22	1.144.709,82	(5.200.000,00)	1.144.709,82	(10.400,62)
USD	SEK	Citigroup		15. Jul. 22	438.682,02	(4.500.000,00)	438.682,02	(1.691,62)
USD	SGD	Citigroup		15. Jul. 22	1.796.771,06	(2.500.000,00)	1.796.771,06	(1.153,94)
USD	THB	Citigroup		20. Jul. 22	705.489,62	(25.000.000,00)	705.489,62	(2.233,49)
USD	ZAR	Royal Bank of Scotland		18. Aug. 22	425.333,84	(7.000.000,00)	425.333,84	(2.526,45)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland		15. Jul. 22	18.000.000,00	(1.130.223,52)	1.098.738,02	(25.959,52)
ZAR	USD	Royal Bank of Scotland		18. Aug. 22	35.500.000,00	(2.206.206,96)	2.166.955,55	(36.411,46)

Zu Kapitalabsicherungszwecken getätigte Devisentermingeschäfte

Gekaufte		Verkaufte		Fälligkeit	Käufe	Verkäufe	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (in USD)
Währung	Währung	Gegenpartei						
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften								926,06
EUR	USD	Citigroup		29. Jul. 22	3.630,57	(3.797,10)	3.795,58	16,49
USD	EUR	Citigroup		29. Jul. 22	257.292,00	(244.076,27)	257.292,00	909,57
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften								(1.082.057,01)
EUR	USD	Citigroup		29. Jul. 22	55.939.763,09	(59.305.434,88)	58.482.219,08	(545.636,45)
GBP	USD	Citigroup		29. Jul. 22	19.478.302,21	(23.930.734,46)	23.655.424,34	(195.780,43)
JPY	USD	Citigroup		29. Jul. 22	9.949.176.062,00	(73.764.228,68)	73.233.795,64	(340.403,75)
USD	GBP	Citigroup		29. Jul. 22	74.791,30	(61.572,24)	74.791,30	(236,38)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 12 – Ausstehende Finanzterminkontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in EUR)	Nicht realisierter Gewinn (in EUR)
Purchase E-mini Nasdaq 100 Index Future	Merrill Lynch	3	USD	16. Sep. 22	661.695,92	12.272,23
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						12.272,23

Man AHL Trend Alternative

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	15. Sep. 26	486.350,00	50,00
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(6)	USD	16. Dez. 25	1.460.925,00	587,50
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	AUD	13. Jun. 24	1.362.400,28	1.086,49
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	AUD	7. Dez. 23	3.405.584,78	1.504,50
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	AUD	7. März 24	2.724.667,47	2.341,03
Sale FTSE Bursa Malaysia Index Future (KLCI)	JP Morgan Chase Bank NA	(175)	MYR	29. Jul. 22	2.857.770,85	2.887,12
Sale Mexican Bolsa Index Future	Goldman Sachs	(19)	MXN	15. Sep. 22	449.462,22	3.693,72
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	AUD	8. Sep. 22	5.464.149,23	4.287,47
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	AUD	8. Dez. 22	6.134.697,28	5.061,90
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	CAD	17. Jun. 24	2.430.413,97	5.243,33
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(8)	AUD	8. Jun. 23	5.447.605,13	5.686,75
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(7)	AUD	7. Sep. 23	4.767.236,55	5.703,73
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	EUR	16. März 26	3.069.702,23	11.702,21
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	AUD	9. März 23	6.129.453,78	13.546,36
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(35)	EUR	18. Sep. 23	8.976.167,40	17.730,22
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(23)	CAD	18. März 24	4.298.848,79	20.080,02
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(24)	EUR	16. Sep. 24	6.154.772,58	21.229,09
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(28)	EUR	19. Sep. 22	7.280.094,84	21.478,07
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	EUR	15. Dez. 25	3.327.719,27	22.408,48
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(21)	EUR	16. Dez. 24	5.384.877,15	23.076,80
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(33)	EUR	19. Jun. 23	8.474.024,75	23.234,06
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(15)	EUR	15. Sep. 25	3.841.832,32	23.758,23
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(34)	EUR	18. Dez. 23	8.717.039,58	24.308,62
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(42)	CAD	19. Jun. 23	7.838.675,92	27.352,72
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(30)	EUR	17. Jun. 24	7.693.073,69	27.912,32
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(19)	EUR	17. März 25	4.870.790,23	28.218,13
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(18)	EUR	16. Jun. 25	4.612.551,04	28.816,52
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(33)	CAD	18. Dez. 23	6.165.355,25	31.304,64
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(36)	EUR	18. März 24	9.230.277,07	33.494,77
Sale Euro Stoxx 50 Future (EUX)	JP Morgan Chase Bank NA	(298)	EUR	16. Sep. 22	10.720.231,34	34.747,56
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(40)	CAD	18. Sep. 23	7.470.832,20	36.149,86
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(33)	EUR	13. März 23	8.494.293,41	36.272,91
Sale SET50 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(428)	THB	29. Sep. 22	2.274.955,77	36.938,50
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(47)	CAD	13. März 23	8.764.564,52	38.625,88
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(28)	EUR	19. Dez. 22	7.234.722,32	40.099,39
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(82)	USD	19. Sep. 23	19.849.125,00	48.825,00
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(46)	CAD	19. Dez. 22	8.576.301,41	54.501,53
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(99)	USD	19. März 24	24.048.337,50	56.887,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(97)	USD	19. Dez. 23	23.526.137,50	60.037,50
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(48)	CAD	19. Sep. 22	8.981.278,34	60.337,16
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(54)	USD	20. Dez. 22	13.101.075,00	67.037,50
Sale Nifty Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(580)	USD	28. Jul. 22	18.238.100,00	80.226,88
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(70)	USD	20. Jun. 23	16.910.250,00	87.812,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(66)	USD	14. März 23	15.950.550,00	91.375,00
Sale MSCI Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(70)	TWD	20. Jul. 22	6.885.681,17	209.513,91
Sale E-mini S&P 500 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	(95)	USD	16. Sep. 22	18.000.125,00	236.250,00

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 12 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale FTSE MIB Future	JP Morgan Chase Bank NA	(74)	EUR	16. Sep. 22	8.203.603,46	244.700,62
Sale MSCI EAFE Future	Merrill Lynch	(183)	USD	16. Sep. 22	16.987.890,00	251.130,00
Purchase FTSE China A50 Index Future (SGX)	JP Morgan Chase Bank NA	1.150	USD	28. Jul. 22	17.115.450,00	341.372,88
Sale MSCI Emerging Markets Index Future	Merrill Lynch	(740)	USD	16. Sep. 22	37.099.900,00	367.036,24
Sale Stockholm 30 Index Future (OMX)	JP Morgan Chase Bank NA	(779)	SEK	15. Jul. 22	14.219.445,73	385.307,64
Sale S&P 60 Future (TSX)	JP Morgan Chase Bank NA	(79)	CAD	15. Sep. 22	13.993.953,25	427.402,29
Sale DAX Index Future (EUX)	JP Morgan Chase Bank NA	(42)	EUR	16. Sep. 22	14.019.012,55	522.471,43
Purchase E-mini Nasdaq 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(72)	USD	16. Sep. 22	16.602.480,00	583.909,00
Sale US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	(766)	USD	21. Sep. 22	76.444.406,25	635.250,13
Sale Ultra US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(239)	USD	21. Sep. 22	22.805.828,13	697.182,29
Sale MSCI Singapore Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1.337)	SGD	28. Jul. 22	26.952.333,08	767.806,84
Sale Euro-BTP Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1.312)	EUR	8. Sep. 22	115.621.572,23	775.172,08
Sale E-mini Russell 2000 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(184)	USD	16. Sep. 22	15.713.600,00	869.850,00
Purchase U.S. Dollar Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	399	USD	19. Sep. 22	41.681.136,00	881.555,00
Sale FTSE Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(556)	USD	28. Jul. 22	28.200.320,00	1.037.758,68
Sale Euro-Bund Future	JP Morgan Chase Bank NA	(479)	EUR	8. Sep. 22	44.882.557,30	1.455.036,41
Sale Euro-OAT Future	JP Morgan Chase Bank NA	(583)	EUR	8. Sep. 22	60.220.769,74	1.574.875,12
Sale Euro-BUXL 30 Year Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(223)	EUR	8. Sep. 22	21.652.443,32	1.757.268,46
Sale 10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	JP Morgan Chase Bank NA	(1.284)	CAD	20. Sep. 22	79.728.541,42	2.262.307,66
Sale Long Gilt Future	JP Morgan Chase Bank NA	(940)	GBP	28. Sep. 22	135.852.944,68	3.210.299,15
Sale KOSPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(758)	KRW	8. Sep. 22	44.872.053,87	4.590.811,93
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						25.351.927,23

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Sale 10 Year Korean Treasury Bond Future (KRX)	JP Morgan Chase Bank NA	(999)	KRW	20. Sep. 22	85.242.913,97	(1.212.864,06)
Sale Nikkei 225 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(185)	JPY	8. Sep. 22	17.906.961,87	(312.810,67)
Sale Australian Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1.467)	AUD	15. Sep. 22	119.939.164,73	(311.466,96)
Sale Topix Index Future (TSE)	JP Morgan Chase Bank NA	(92)	JPY	8. Sep. 22	12.666.889,08	(277.372,87)
Sale Amsterdam Index Future (AEX)	JP Morgan Chase Bank NA	(91)	EUR	15. Jul. 22	12.538.346,06	(196.590,79)
Purchase Hang Seng China Enterprises Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	142	HKD	28. Jul. 22	6.866.601,60	(123.162,27)
Sale SPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(181)	AUD	15. Sep. 22	20.104.154,92	(108.524,56)
Sale 30 Year US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(376)	USD	21. Sep. 22	44.385.625,00	(91.837,50)
Purchase 10 Year Japanese Bond Future (TSE)	JP Morgan Chase Bank NA	92	JPY	12. Sep. 22	67.434.169,86	(60.195,19)
Purchase FTSE 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	53	GBP	16. Sep. 22	4.583.492,22	(48.706,87)
Purchase Hang Seng Index Future (HKG)	JP Morgan Chase Bank NA	13	HKD	28. Jul. 22	1.801.157,72	(34.704,36)
Sale CBOE Volatility Index Future (VIX)	JP Morgan Chase Bank NA	(38)	USD	20. Jul. 22	1.085.367,40	(34.217,40)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(82)	USD	18. Jun. 24	19.942.400,00	(32.250,00)
Sale Swiss Market Index Future (EUZ)	JP Morgan Chase Bank NA	(229)	CHF	16. Sep. 22	25.563.513,87	(30.928,70)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(46)	USD	17. Sep. 24	11.197.550,00	(23.900,00)
Sale CAC40 Index Future (FSE)	JP Morgan Chase Bank NA	(88)	EUR	15. Jul. 22	5.440.855,76	(13.177,76)
Sale FTSE/JSE Top40 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(39)	ZAR	15. Sep. 22	1.427.359,59	(11.576,05)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(24)	USD	17. Dez. 24	5.844.900,00	(8.125,00)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(19)	USD	17. Jun. 25	4.628.400,00	(7.787,50)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(20)	USD	18. März 25	4.871.250,00	(7.675,00)
Sale VSTOXX Future	Goldman Sachs	(29)	EUR	20. Jul. 22	88.680,29	(7.181,20)
Sale VSTOXX Future	Goldman Sachs	(16)	EUR	17. Aug. 22	48.843,42	(5.425,21)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(12)	USD	16. Sep. 25	2.922.750,00	(4.912,50)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 12 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	USD	16. Jun. 26	729.825,00	(1.087,50)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	USD	17. März 26	973.500,00	(462,50)
Sale 3 Month US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	15. Dez. 26	243.100,00	(37,50)
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	CAD	16. Sep. 24	186.993,68	(29,13)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(2.967.009,05)

Man AHL Alpha Core Alternative

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	16. Dez. 25	243.487,50	87,50
Sale FTSE Bursa Malaysia Index Future (KLCI)	JP Morgan Chase Bank NA	(23)	MYR	29. Jul. 22	375.592,74	192,85
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	8. Jun. 23	680.950,64	400,79
Sale Mexican Bolsa Index Future	Goldman Sachs	(2)	MXN	15. Sep. 22	47.311,81	598,71
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	7. März 24	681.166,87	718,87
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	EUR	17. Jun. 24	1.025.743,16	720,74
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	8. Sep. 22	683.018,65	722,79
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	8. Dez. 22	681.633,03	753,38
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	16. Jun. 25	512.505,67	1.009,04
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(2)	CAD	17. Jun. 24	373.909,84	1.417,64
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	16. Sep. 24	769.346,57	1.664,26
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	7. Sep. 23	681.033,79	1.925,20
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	7. Dez. 23	681.116,96	3.086,30
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	15. Dez. 25	511.956,81	3.171,26
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(3)	CAD	18. März 24	560.719,41	3.388,75
Sale 90 days Australian Bank Bill Future (ASX)	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	AUD	9. März 23	681.050,42	3.405,91
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	16. März 26	511.617,04	3.433,35
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	EUR	15. Sep. 25	512.244,31	3.590,60
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(5)	CAD	18. Sep. 23	933.854,03	3.709,17
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	EUR	19. Jun. 23	1.027.154,52	4.245,82
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	EUR	18. Sep. 23	1.282.309,63	4.652,05
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	EUR	18. Dez. 23	1.281.917,59	4.835,51
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	EUR	19. Sep. 22	1.040.013,55	4.901,04
Sale SET50 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(57)	THB	29. Sep. 22	302.973,08	4.987,40
Sale Euro Stoxx 50 Future (EUX)	Goldman Sachs	(40)	EUR	16. Sep. 22	1.438.957,23	5.110,71
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	16. Dez. 24	769.268,16	5.412,11
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(4)	CAD	18. Dez. 23	747.315,79	5.651,15
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(6)	CAD	13. März 23	1.118.880,58	6.554,17

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 12 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Gewinn (in USD)
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	EUR	13. März 23	1.029.611,32	7.377,76
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(4)	EUR	19. Dez. 22	1.033.531,76	7.430,18
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(6)	CAD	19. Jun. 23	1.119.810,85	7.845,58
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(7)	USD	20. Dez. 22	1.698.287,50	8.950,00
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(6)	CAD	19. Dez. 22	1.118.648,01	10.069,14
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	EUR	17. März 25	769.072,14	10.357,70
Sale Bank Acceptance Future (BAX)	Merrill Lynch	(6)	CAD	19. Sep. 22	1.122.659,79	10.544,92
Sale Nifty Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(77)	USD	28. Jul. 22	2.421.265,00	10.574,05
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	USD	19. Dez. 23	3.152.987,50	11.637,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	USD	19. März 24	3.157.862,50	11.750,00
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	USD	20. Jun. 23	2.174.175,00	14.012,50
Sale 3 Month Euribor	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	EUR	18. März 24	1.281.982,93	14.401,71
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(11)	USD	19. Sep. 23	2.662.687,50	14.837,50
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	USD	14. März 23	2.175.075,00	23.050,00
Sale MSCI Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(9)	TWD	20. Jul. 22	885.301,86	26.058,07
Sale MSCI EAFE Future	Merrill Lynch	(24)	USD	16. Sep. 22	2.227.920,00	26.845,00
Sale E-mini S&P 500 Future (CME)	JP Morgan Chase Bank NA	(13)	USD	16. Sep. 22	2.463.175,00	31.337,50
Sale FTSE MIB Future	Goldman Sachs	(10)	EUR	16. Sep. 22	1.108.595,06	37.635,77
Sale MSCI Emerging Markets Index Future	Merrill Lynch	(98)	USD	16. Sep. 22	4.913.230,00	45.077,63
Purchase FTSE China A50 Index Future (SGX)	JP Morgan Chase Bank NA	153	USD	28. Jul. 22	2.277.099,00	46.374,47
Sale Stockholm 30 Index Future (OMX)	Goldman Sachs	(104)	SEK	15. Jul. 22	1.898.359,89	51.250,86
Sale S&P 60 Future (TSX)	Merrill Lynch	(11)	CAD	15. Sep. 22	1.948.525,14	63.482,39
Purchase E-mini Nasdaq 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(10)	USD	16. Sep. 22	2.305.900,00	66.102,00
Sale DAX Index Future (EUX)	Goldman Sachs	(6)	EUR	16. Sep. 22	2.002.716,08	74.996,34
Sale US Treasury Bond Future	Merrill Lynch	(102)	USD	21. Sep. 22	10.179.281,25	91.953,17
Sale Ultra US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(32)	USD	21. Sep. 22	3.053.500,00	94.683,19
Sale MSCI Singapore Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(178)	SGD	28. Jul. 22	3.588.268,73	101.111,24
Sale E-mini Russell 2000 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(24)	USD	16. Sep. 22	2.049.600,00	104.840,00
Purchase U.S. Dollar Index Future	Merrill Lynch	53	USD	19. Sep. 22	5.536.592,00	117.891,00
Sale Euro-BTP Future	Goldman Sachs	(174)	EUR	8. Sep. 22	15.333.958,51	119.637,70
Sale FTSE Taiwan Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(74)	USD	28. Jul. 22	3.753.280,00	137.858,64
Sale Euro-Bund Future	Goldman Sachs	(64)	EUR	8. Sep. 22	5.996.834,38	206.178,99
Sale Euro-BUXL 30 Year Bond Future	Goldman Sachs	(30)	EUR	8. Sep. 22	2.912.884,75	213.517,44
Sale Euro-OAT Future	Goldman Sachs	(78)	EUR	8. Sep. 22	8.056.981,20	214.233,82
Sale 10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	Merrill Lynch	(171)	CAD	20. Sep. 22	10.618.053,41	306.459,19
Sale Long Gilt Future	JP Morgan Chase Bank NA	(125)	GBP	28. Sep. 22	18.065.551,15	436.982,52
Sale KOSPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(101)	KRW	8. Sep. 22	5.978.993,99	607.078,98
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten						3.464.771,52

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Sale 10 Year Korean Treasury Bond Future (KRX)	JP Morgan Chase Bank NA	(133)	KRW	20. Sep. 22	11.348.656,21	(161.876,43)
Sale Nikkei 225 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(25)	JPY	8. Sep. 22	2.419.859,71	(42.358,81)
Sale Topix Index Future (TSE)	Goldman Sachs	(12)	JPY	8. Sep. 22	1.652.202,92	(37.128,42)
Sale Australian Treasury Bond Future	JP Morgan Chase Bank NA	(195)	AUD	15. Sep. 22	15.942.833,76	(34.541,26)
Sale Amsterdam Index Future (AEX)	Goldman Sachs	(12)	EUR	15. Jul. 22	1.653.408,27	(31.930,64)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 12 – Ausstehende Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative (Fortsetzung)

Beschreibung Kontrakte	Gegenpartei	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fälligkeits-termin	Verpflichtung (in USD)	Nicht realisierter Verlust (in USD)
Sale 30 Year US Treasury Bond Future (CBT)	Merrill Lynch	(50)	USD	21. Sep. 22	5.902.343,75	(15.312,50)
Sale SPI 200 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(24)	AUD	15. Sep. 22	2.665.744,30	(15.202,76)
Purchase Hang Seng China Enterprises Index Future	Goldman Sachs	19	HKD	28. Jul. 22	918.770,64	(15.194,04)
Purchase 10 Year Japanese Bond Future (TSE)	Goldman Sachs	12	JPY	12. Sep. 22	8.795.761,29	(10.616,04)
Sale Swiss Market Index Future (EUZ)	Goldman Sachs	(30)	CHF	16. Sep. 22	3.348.931,95	(7.245,32)
Purchase FTSE 100 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	7	GBP	16. Sep. 22	605.366,90	(6.889,90)
Sale CBOE Volatility Index Future (VIX)	Goldman Sachs	(5)	USD	20. Jul. 22	142.811,50	(4.461,50)
Purchase Hang Seng Index Future (HKG)	Goldman Sachs	2	HKD	28. Jul. 22	277.101,19	(4.422,48)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(6)	USD	17. Sep. 24	1.460.550,00	(4.362,50)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(11)	USD	18. Jun. 24	2.675.200,00	(2.550,00)
Sale CAC40 Index Future (FSE)	Goldman Sachs	(12)	EUR	15. Jul. 22	741.934,88	(2.274,92)
Sale FTSE/JSE Top40 Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(5)	ZAR	15. Sep. 22	182.994,82	(2.054,07)
Sale VSTOXX Future	Goldman Sachs	(4)	EUR	20. Jul. 22	12.231,76	(959,24)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	17. Jun. 25	487.200,00	(900,00)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(1)	USD	17. März 26	243.375,00	(737,50)
Sale VSTOXX Future	Goldman Sachs	(2)	EUR	17. Aug. 22	6.105,43	(681,43)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	USD	17. Dez. 24	730.612,50	(262,50)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(2)	USD	16. Sep. 25	487.125,00	(225,00)
Sale US SOFR Index Future	JP Morgan Chase Bank NA	(3)	USD	18. März 25	730.687,50	(150,00)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten						(402.337,26)

Erläuterung 13 – Ausstehende Swap-Kontrakte

Man Convertibles Europe

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Gegenpartei	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
TRS	14. Sep. 24	Electricite de France SA cvt 0.00 % 14/Sep/2024	Citigroup	EUR	62.000,00	(63.343,54)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten						(63.343,54)

Man Convertibles Global

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Gegenpartei	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Gewinn (in EUR)
TRS	2. Dez. 22	TotalEnergies SE	Citigroup	USD	2.400.000,00	573,92
TRS	2. März 24	America Movil BV	Citigroup	EUR	3.600.000,00	190.080,00
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten						190.653,92

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Gegenpartei	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
TRS	20. Nov. 31	Cellnex Telecom	Citigroup	EUR	4.100.000,00	(409.487,50)
TRS	4. Aug. 25	STMicroelectronics NV	Citigroup	USD	1.800.000,00	(367.007,51)
TRS	24. Apr. 27	Nexi Spa	Citigroup	EUR	2.200.000,00	(349.800,00)
TRS	15. Jun. 26	Schneider Electric SE	Citigroup	EUR	9.200,00	(345.966,00)
TRS	4. Aug. 27	STMicroelectronics NV	Citigroup	USD	1.600.000,00	(339.268,26)
TRS	15. Mai 27	Safran SA	Citigroup	EUR	23.895,00	(304.246,43)
TRS	3. Nov. 27	ams OSRAM AG	Citigroup	EUR	1.900.000,00	(303.477,50)
TRS	5. Jul. 28	Cellnex Telecom	Citigroup	EUR	1.200.000,00	(213.999,96)
TRS	24. Feb. 22	Nexi Spa	Citigroup	EUR	2.400.000,00	(204.400,08)
TRS	10. Nov. 23	Compagnie Générale des Établissements Michelin	Citigroup	USD	4.600.000,00	(203.720,89)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 13 – Ausstehende Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

Man Convertibles Global (Fortsetzung)

Beschreibung	Fälligkeits-termin	Basiswert	Gegenpartei	Währung	Nominalwert in Währung	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
TRS	30. Jun. 25	Deutsche Post AG	Citigroup	EUR	2.500.000,00	(152.375,00)
TRS	17. Jun. 26	RAG-Stiftung	Citigroup	EUR	1.600.000,00	(148.933,28)
TRS	9. Apr. 25	Amadeus IT Group SA	Citigroup	EUR	1.500.000,00	(131.400,00)
TRS	23. Jun. 25	Umicore SA	Citigroup	EUR	1.400.000,00	(120.225,00)
TRS	14. Sep. 24	Electricite de France SA	Citigroup	EUR	400.892,00	(116.928,17)
TRS	12. Sep. 23	Adidas AG	Citigroup	EUR	1.800.000,00	(104.635,44)
TRS	25. Jun. 25	Selena SAS	Citigroup	EUR	1.300.000,00	(64.057,50)
TRS	1. Sep. 25	LEG Immobilien SE	Citigroup	EUR	1.300.000,00	(56.566,25)
TRS	1. Jan. 25	Veolia Environnement SA	Citigroup	EUR	42.800,00	(47.579,48)
TRS	11. Nov. 22	Iberdrola International BV	Citigroup	EUR	1.200.000,00	(23.016,00)
TRS	23. Jan. 24	Delivery Hero	Citigroup	EUR	800.000,00	(21.306,64)
TRS	13. Sep. 23	Qiagen NV	Citigroup	USD	2.000.000,00	(20.947,92)
TRS	30. Sep. 22	Kering	Citigroup	EUR	400.000,00	(641,68)
Nicht realisierter Verlust aus Swap-Kontrakten						(4.049.986,49)

Erläuterung 14 – Ausstehende Optionskontrakte

Man Convertibles Global

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeits-termin	Marktwert (in EUR)	Nicht realisierter Verlust (in EUR)
Call on Seino Holdings Conv 0 % 31/Mar/2026 Strike Price JPY 55	Nomura	JPY	20.000.000	31. März 26	2.513,56	(8.282,76)
Marktwert und nicht realisierter Verlust aus Optionen					2.513,56	(8.282,76)

Erläuterung 15 – Gezahlte Dividende

Anteilsklasse	Stichtag	Datum des Dividenden-abschlags	Zahlungs-datum	Gezahlter Betrag (in EUR)	Betrag je Anteil	Währung
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	5. Mai 22	6. Mai 22	10. Mai 22	38.654,42	0,4071	EUR
				38.654,42		

Erläuterung 16 – Angaben zu Barsicherheiten

Die nachfolgende Tabelle enthält die Barsicherheitsalden der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2022. Diese Sicherheiten beziehen sich auf Devisentermin-, Future- und Swap-Kontrakte.

Portfolios	Art der Sicherheit	Gegenpartei	Währung	Barsicherheiten	
				Gezahlt	Erhalten
Man Convertibles Europe	Barmittel	Citigroup	EUR	159.955,68	–
Man Convertibles Global	Barmittel	Merrill Lynch	EUR	21.502,70	–
Man Convertibles Global	Barmittel	Nomura	EUR	81.546,08	–
Man Convertibles Global	Barmittel	Citigroup	EUR	13.911.590,02	3.441.479,14
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Goldman Sachs	USD	204.881,06	134.046,24
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Merrill Lynch	USD	3.025.531,41	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Royal Bank of Scotland	USD	19.601.556,55	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	HSBC	USD	25.090.000,00	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	Citigroup	USD	25.528.090,05	–
Man AHL Trend Alternative	Barmittel	JP Morgan	USD	35.969.473,98	4.836.606,50
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Merrill Lynch	USD	892.508,23	495.369,63
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Goldman Sachs	USD	2.343.250,15	412.690,56
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Royal Bank of Scotland	USD	2.595.332,26	0,01
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	HSBC	USD	2.610.000,00	–
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	JP Morgan	USD	2.932.882,27	795.906,80
Man AHL Alpha Core Alternative	Barmittel	Citigroup	USD	8.993.649,67	–

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Erläuterung 17 – Wesentliche Ereignisse im Verlauf des Berichtszeitraums

Die folgenden Anteilsklassen wurden im Berichtszeitraum aufgelegt:

Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc – am 28. April 2022 aufgelegt

Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc – am 1. März 2022 aufgelegt

Darüber hinaus sind sich der Verwaltungsrat und die Anlageverwalter der aktuellen Krise in der Ukraine und der damit verbundenen Sanktionen gegen Russland bewusst. Der Anlageverwalter hat die im Fonds gehaltenen Positionen auf ein etwaiges russisches und ukrainisches Engagement überprüft und kein Engagement festgestellt. Nichtsdestotrotz bleibt die Situation unter ständiger Beobachtung.

Seit dem Ende des Berichtszeitraums sind keine weiteren Ereignisse eingetreten, die sich wesentlich auf den Abschluss auswirken würden.

Erläuterung 18 – Käufe und Verkäufe

Eine detaillierte Auflistung aller während des von diesem Bericht abgedeckten Zeitraums erworbenen und veräußerten Kapitalanlagen ist auf Anfrage kostenlos am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, beim Facilities Agent sowie bei den Zahl- und Informationsstellen erhältlich und für schweizerische Anleger beim Vertreter für die Schweiz.

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten)
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022**

Vertreter

Der Repräsentant in der Schweiz ist Man Investments AG, Huobstrasse 3, 8808 Pfäffikon/SZ, Schweiz.

Zahlstelle

Die Zahlstelle in der Schweiz ist RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich.

Stelle, von der die entsprechenden Dokumente bezogen werden können

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung, Jahres- und Halbjahresberichte, eine Aufstellung aller Käufe bzw. Verkäufe während des von diesem Bericht abgedeckten Zeitraums und weitere Informationen sind kostenfrei bei der Vertretung in der Schweiz erhältlich.

Total Expense Ratio (TER)

Die bei der Verwaltung des Fonds angefallenen Provisionen und Kosten sind in der international unter dem Begriff „Total Expense Ratio (TER)“ bekannten Kennziffer offenzulegen. Diese Kennziffer drückt die Gesamtheit der Provisionen und Kosten aus, die laufend dem entsprechenden Teilfondsvermögen belastet werden (Aufwendungen), und als Prozentsatz des jeweiligen Teilfondsvermögens errechnet und ausgewiesen werden.

Die Nebenkosten, die dem Organismus für gemeinsame Anlagen beim Kauf und Verkauf der Anlagen entstehen, sind nicht in den Betriebskosten enthalten (außer bei „Pauschalgebühren“). Diese sind Bestandteil der Anlagen und fallen auf die realisierten Kapitalgewinne/-verluste beim Verkauf der Anlagen an.

Die nachstehenden Zahlen beinhalten eine Kostenobergrenze und erlassene Honorare der Verwaltungsratsmitglieder.

Anteilklassen, für die keine Erfolgsgebühr erhoben wird

	Man Convertibles Europe	Man Convertibles Global
Man Convertibles Europe D EUR Acc	2,51 %	-
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	2,53 %	-
Man Convertibles Europe I EUR Acc	1,74 %	-
Man Convertibles Global D EUR Acc	-	1,83 %
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-	1,83 %
Man Convertibles Global D H USD Acc	-	1,83 %
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-	1,10 %
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-	1,08 %
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-	1,09 %
Man Convertibles Global I EUR Acc	-	1,05 %
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-	1,06 %
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-	1,05 %
Man Convertibles Global I H USD Acc	-	1,05 %

Anteilklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird

Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,44 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,29 %
Erfolgsgebühr:	2,15 %
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,66 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,28 %
Erfolgsgebühr:	2,38 %
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	5,79 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,79 %
Erfolgsgebühr:	3,00 %

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten) (Fortsetzung)**
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Total Expense Ratio (TER) (Fortsetzung)

Anteilstklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird (Fortsetzung)

Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,12 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77 %
Erfolgsgebühr:	1,35 %
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	5,28 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,77 %
Erfolgsgebühr:	2,51 %
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	6,55 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,78 %
Erfolgsgebühr:	3,77 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,22 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,78 %
Erfolgsgebühr:	1,44 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	7,54 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,85 %
Erfolgsgebühr:	4,69 %
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,46 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,77 %
Erfolgsgebühr:	2,69 %
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	7,65 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,50 %
Erfolgsgebühr:	6,15 %
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,19 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,77 %
Erfolgsgebühr:	2,42 %
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,84 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,72 %
Erfolgsgebühr:	3,12 %
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,56 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,72 %
Erfolgsgebühr:	2,84 %
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,72 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,73 %
Erfolgsgebühr:	2,99 %
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,85 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,73 %
Erfolgsgebühr:	3,12 %
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,48 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,62 %
Erfolgsgebühr:	2,86 %
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	5,58 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,73 %
Erfolgsgebühr:	3,85 %

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten) (Fortsetzung)**
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Total Expense Ratio (TER) (Fortsetzung)

Anteilstklassen, für die eine Erfolgsgebühr erhoben wird (Fortsetzung)

Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,05 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	2,05 %
Erfolgsgebühr:	0,00 %
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,21 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,30 %
Erfolgsgebühr:	0,91 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc ⁽¹⁾	
TER mit Erfolgsgebühr:	3,44 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,25 %
Erfolgsgebühr:	2,19 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	1,49 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,25 %
Erfolgsgebühr:	0,24 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc ⁽²⁾	
TER mit Erfolgsgebühr:	6,36 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,26 %
Erfolgsgebühr:	5,10 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	2,28 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,26 %
Erfolgsgebühr:	1,02 %
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	
TER mit Erfolgsgebühr:	4,17 %
TER ohne Erfolgsgebühr:	1,16 %
Erfolgsgebühr:	3,01 %

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Performance

	2022	2021	2020
Man Convertibles Europe			
Man Convertibles Europe D EUR Acc	-15,19 %	0,49 %	5,91 %
Man Convertibles Europe D H CHF Acc	-15,18 %	0,25 %	5,50 %
Man Convertibles Europe I EUR Acc	-14,86 %	1,29 %	6,74 %
Refinitiv Global Convertible Europe Bond Index (BM MCE) (abgesichert gegen EUR)	-18,82 %	0,43 %	6,18 %
Refinitiv Global Convertible Europe Bond Index (BM MCE CHF) (abgesichert gegen CHF)	-18,77 %	0,28 %	6,11 %
Man Convertibles Global			
Man Convertibles Global D EUR Acc	-18,34 %	-1,62 %	16,37 %
Man Convertibles Global D H CHF Acc	-18,43 %	-1,88 %	15,99 %
Man Convertibles Global D H USD Acc	-17,62 %	-0,70 %	18,13 %
Man Convertibles Global DR EUR Acc	-18,04 %	-0,88 %	17,25 %
Man Convertibles Global DR H CHF Acc	-18,09 %	-1,15 %	16,75 %
Man Convertibles Global DR H USD Acc	-17,36 %	0,03 %	19,23 %
Man Convertibles Global I EUR Acc	-18,02 %	-0,84 %	17,29 %
Man Convertibles Global I EUR Inc G-Dist BA	-18,02 %	-0,84 %	17,28 %

**Informationen für die Anleger in der Schweiz
(TER und Performancedaten) (Fortsetzung)**
für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022

Performance (Fortsetzung)

	2022	2021	2020
Man Convertibles Global (Fortsetzung)			
Man Convertibles Global I H CHF Acc	-18,06 %	-1,10 %	16,84 %
Man Convertibles Global I H USD Acc	-17,34 %	0,07 %	19,24 %
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index (BM MCG) (abgesichert gegen EUR)	-18,44 %	-1,81 %	21,49 %
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index (BM MCG CHF-D) (abgesichert gegen CHF)	-18,41 %	-1,96 %	21,41 %
Refinitiv Global Focus Hedged Convertible Bond Index (USD)	-17,82 %	-1,11 %	22,84 %
Man AHL Trend Alternative			
Man AHL Trend Alternative DN H CHF Acc	12,00 %	-3,96 %	0,30 %
Man AHL Trend Alternative DN H EUR Acc	12,30 %	-3,90 %	0,76 %
Man AHL Trend Alternative DNY USD Acc	12,08 %	-3,68 %	0,87 %
Man AHL Trend Alternative DNY H CHF Acc	12,62 %	-4,40 %	-0,17 %
Man AHL Trend Alternative DNY H EUR Acc	11,78 %	-4,39 %	0,20 %
Man AHL Trend Alternative DNY H GBP Acc	11,89 %	-3,76 %	1,25 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SEK Acc	12,69 %	-4,13 %	1,05 %
Man AHL Trend Alternative DNY H SGD Acc	12,66 %	-3,37 %	1,33 %
Man AHL Trend Alternative DNR H EUR Acc	12,34 %	-3,78 %	-0,03 %
Man AHL Trend Alternative DNR H GBP Acc	11,84 %	-0,26 %	n. v.
Man AHL Trend Alternative DNK H EUR Acc	12,46 %	-3,26 %	1,21 %
Man AHL Trend Alternative IN USD Acc	12,43 %	-2,84 %	2,15 %
Man AHL Trend Alternative IN H CHF Acc	12,50 %	-3,42 %	0,86 %
Man AHL Trend Alternative IN H EUR Acc	12,19 %	-3,69 %	1,23 %
Man AHL Trend Alternative IN H GBP Acc	12,91 %	-3,54 %	1,43 %
Man AHL Trend Alternative IN H SEK Acc	12,55 %	-2,81 %	2,26 %
Man AHL Trend Alternative IN H SGD Acc	12,49 %	-7,16 %	n. v.
HFRX Investable Global Hedge Fund Index	-5,05 %	3,65 %	6,81 %
Man AHL Alpha Core Alternative			
Man AHL Alpha Core Alternative DN H GBP Acc	10,09 %	-7,36 %	0,44 %
Man AHL Alpha Core Alternative DNR H GBP Acc	10,01 %	-6,67 %	1,02 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN USD Acc ⁽¹⁾	2,80 %	n. v.	n. v.
Man AHL Alpha Core Alternative IN H EUR Acc	9,57 %	-7,16 %	0,18 %
Man AHL Alpha Core Alternative IN H GBP Acc ⁽²⁾	11,52 %	n. v.	n. v.
Man AHL Alpha Core Alternative IN H JPY Acc	9,76 %	-6,45 %	0,18 %
Man AHL Alpha Core Alternative INW H EUR Acc	8,18 %	-5,59 %	n. v.
HFRX Investable Global Hedge Fund Index	-5,05 %	3,65 %	6,81 %

⁽¹⁾ Die Anteilsklasse wurde am 28. April 2022 wieder aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

⁽²⁾ Die Anteilsklasse wurde am 1. März 2022 aufgelegt (siehe Erläuterung 18).

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.

Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Provisionen und Kosten unberücksichtigt.

Ergänzende Informationen

Informationen zur Vergütung

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik gemäß den geltenden Gesetzen und Verordnungen mit dem Ziel verabschiedet, sicherzustellen, dass die Vergütungsstruktur mit ihren Interessen und denen der von ihr verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen in Einklang steht und das Eingehen von Risiken vermieden wird, die mit den Risikoprofilen, den Vorschriften, der Satzung oder den Verwaltungsrichtlinien der von ihr verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen unvereinbar sind.

Einzelheiten zur Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft, darunter die Identität der für die Zuteilung der festen und variablen Vergütungen zuständigen Personen, eine Beschreibung der wichtigsten Vergütungselemente und ein Überblick darüber, wie die Vergütung festgelegt wird, sind auf der Website <https://www.waystone.com/waystone-policies> verfügbar.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (die Verwaltungsgesellschaft beschäftigte zu diesem Zeitpunkt 72 Mitarbeiter) belief sich die gesamte von der Verwaltungsgesellschaft an ihre Mitarbeiter gezahlte feste bzw. variable Vergütung auf 6.001.650 EUR bzw. 768.882 EUR. Die Gesamtvergütung, die von der Verwaltungsgesellschaft an die Geschäftsleitung und Mitglieder des Personals, deren Tätigkeiten wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der Organismen für gemeinsame Anlagen haben, gezahlt wurde, belief sich auf 3.383.679 EUR. Der Vergütungsausschuss der Verwaltungsgesellschaft hat die Umsetzung der Vergütungspolitik überprüft und diesbezüglich keine Mängel festgestellt. Darüber hinaus wurde die aktuelle Fassung der Vergütungspolitik im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 aktualisiert und vom Verwaltungsrat genehmigt, wobei die aktuelle Fassung aus dem Februar 2021 stammt.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte führt Berichtsanforderungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß Artikel 3(11) der Verordnung über Wertpapiergeschäfte definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufsgeschäft oder ein Verkaufs-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 30. Juni 2022 hielten die Teilfonds Man Convertibles Europe und Man Convertibles Global Total Return Swaps als Anlageform, die der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unterliegt.

Globale Daten

Betrag der Vermögenswerte/Verbindlichkeiten über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg zum 30. Juni 2022:

Man Convertibles Europe:

Art des Vermögenswerts/der Verbindlichkeit	Betrag (in EUR)	% des NIW
Total Return Swaps	(63.343,54)	(0,49) %

Man Convertibles Global

Art des Vermögenswerts/der Verbindlichkeit	Betrag (in EUR)	% des NIW
Total Return Swaps	(3.859.332,57)	(1,46) %

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2022 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2022 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Konzentrationsdaten

Zum 30. Juni 2022 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Zum 30. Juni 2022 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten

Zum 30. Juni 2022 wurden Sicherheiten für Total Return Swaps in folgender Höhe gestellt:

Man Convertibles Europe

Vermögenswert	Marktwert (in EUR)	% des NIW
Barmittel	0,00*	0,00 %

Man Convertibles Global

Vermögenswert	Marktwert (in EUR)	% des NIW
Barmittel	3.441.479,14*	1,30 %

* Dieser Sicherheitenbetrag kann sich auf andere Transaktionen als TRS beziehen, die nicht unter die Offenlegung gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte fallen.

Rendite/Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 gestalten sich die Daten zu den Renditen und Kosten in Bezug auf Total Return Swaps wie folgt:

Man Convertibles Europe

Renditen	Betrag (in EUR)	% der Gesamtrenditen*
An den Fonds	113.063,54	100 %

Man Convertibles Global

Renditen	Betrag (in EUR)	% der Gesamtrenditen*
An den Fonds	3.997.795,01	100 %

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebenen Renditen aus Total Return Swaps sind in der Veränderung des Nettovermögens in „Zinsen auf Swap-Kontrakte“, „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps“ und „Veränderung des unrealisierten Nettowertzuwachses/(Wertverlusts) aus Swaps“ enthalten.

Man Convertibles Europe

Kosten	Betrag (in EUR)	% der Gesamtkosten*
An den Fonds	198,65	100 %

Man Convertibles Global

Kosten	Betrag (in EUR)	% der Gesamtkosten*
An den Fonds	4.554,56	100 %

* Absolut ausgedrückt.

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

Aggregierte Transaktionsdaten

Das Laufzeitprofil der Total Return Swaps sieht zum 30. Juni 2022 wie folgt aus:

Man Convertibles Europe

Total Return Swaps

Fälligkeit	Betrag (in EUR)
Weniger als ein Tag	0,00
Ein Tag bis eine Woche	0,00
Eine Woche bis ein Monat	0,00
Ein bis drei Monate	0,00
Drei Monate bis ein Jahr	0,00
Mehr als ein Jahr	(63.343,54)
Offene Laufzeit	0,00

Man Convertibles Global

Total Return Swaps

Fälligkeit	Betrag (in EUR)
Weniger als ein Tag	0,00
Ein Tag bis eine Woche	0,00
Eine Woche bis ein Monat	0,00
Ein bis drei Monate	0,00
Drei Monate bis ein Jahr	(23.083,76)
Mehr als ein Jahr	(3.836.248,81)
Offene Laufzeit	0,00

Die Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Total Return Swaps sind zum 30. Juni 2022 wie folgt:

Man Convertibles Europe

Total Return Swaps

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag (in EUR)
Bilateral	(63.343,54)

Man Convertibles Global

Total Return Swaps

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag (in EUR)
Bilateral	(3.859.332,57)

Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen von Total Return Swaps gestellte Sicherheitspositionen (einschließlich von Barmitteln) sehen zum 30. Juni 2022 wie folgt aus:

Man Convertibles Global

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Nennwert	Währung der Sicherheiten	Land
Citibank NA	Barmittel	0,00*	EUR	USA

Man Convertibles Global

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Nennwert	Währung der Sicherheiten	Land
Citibank NA	Barmittel	3.441.479,14*	EUR	USA

* Dieser Sicherheitenbetrag kann sich auf andere Transaktionen als TRS beziehen, die nicht unter die Offenlegung gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte fallen.

Ergänzende Informationen (Fortsetzung)

Gesamtrisiko

Für die folgenden Teilfonds der Man Umbrella SICAV wurde das Gesamtrisiko unter Anwendung des Commitment-Ansatzes ermittelt:

Man Convertibles Europe
Man Convertibles Global

Für die restlichen nachstehend aufgeführten Teilfonds wurde der absolute Value-at-Risk (VaR)-Ansatz verwendet:

Man AHL Trend Alternative
Man AHL Alpha Core Alternative