



Man Funds plc
(Eine Investmentgesellschaft
mit variablem Kapital)

Bericht und Abschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Fonds und Anteilsklassen

ISIN

Man GLG Global Convertibles Klasse D USD	IE00BVRZB126
Man GLG Global Convertibles Klasse D H EUR	IE00BVRZB456
Man GLG Global Convertibles Klasse DL USD	IE00B01D8Z85
Man GLG Global Convertibles Klasse DL H EUR	IE00B01D9113
Man GLG Global Convertibles Klasse DL H GBP	IE00B7510G27
Man GLG Global Convertibles Klasse I USD	IE00BVRZBP67
Man GLG Global Convertibles Klasse I H EUR	IE00BVRZBS98
Man GLG Global Convertibles Klasse IL USD	IE00B29Z0B02
Man GLG Global Convertibles Klasse IL H EUR	IE00B29Z0C19
Man GLG Global Convertibles Klasse IM USD	IE00B4Q68161
Man GLG Global Convertibles Klasse IM H EUR	IE00B4Q68831
Man GLG Global Convertibles Klasse IM H GBP	IE00B4Q69243
Man GLG Global Convertibles Klasse IU H EUR	IE00BMWB3B24
Man GLG Global Convertibles Klasse I H GBP	IE00BVRZBT06
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse D EUR	IE00B01D9G61
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse D C EUR	IE00BYVDZ334
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse D C USD	IE00BYVDZ664
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse D H USD	IE00B01D9D31
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse I EUR	IE00B29Z0J87
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse I C EUR	IE00BYVDZ003
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse I C SEK	IE00B403VD68
Man GLG RI European Equity Leaders Klasse I H USD	IE00B29Z0H63
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D EUR	IE00BYVDZH74
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D EUR G Dist	IE00BZ7PF968
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D JPY	IE00B5649C52
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D USD	IE00BP4VM748
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D H CHF	IE00B46RNT22
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D H EUR	IE00B5648R31
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D H GBP	IE00B665M716
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse D H USD	IE00B56CKP98
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I EUR	IE00B45R5B91
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I EUR Dist	IE00BZ6S5189
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I GBP	IE00B62QF466
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I JPY	IE00B5649G90
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I JPY Dist	IE00BJ3VGN70
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I SEK	IE00B43JT264
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I USD	IE00B3QXQG18
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I USD Dist	IE00BJ3VGL56
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H CHF	IE00B464TQ22
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H EUR	IE00B578XK25
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H EUR Dist	IE00BD82R418
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H GBP	IE00B64XDT64
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H GBP Dist	IE00BJ3VGM63
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H USD*	IE00B5646799
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H USD Dist	IE00BJ3VGN70
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX JPY	IE00BF2S5G73
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX H EUR	IE00BF2S5F66
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX H EUR Dist	IE00BDFF1S55
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX H GBP Dist	IE00BDFF1T62
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX H CHF	IE000FRITS42
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX H USD Dist	IE00BDFF1V84
Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse IXX H USD	IE00BF2S5H80

*Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H USD ist an der Luxembourg Stock Exchange notiert.

Fonds und Anteilsklassen (Fortsetzung)

ISIN

Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse D CHF	IE00BTC1N376
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse D EUR	IE00BTC1N590
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse D USD	IE00BTC1N152
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse I EUR	IE00BTC1NK44
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse I JPY	IE00BTC1NQ06
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse I SEK	IE00BTC1NN74
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse I USD	IE00BTC1NF90
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse IMU USD	IE00BHJYB976
Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse I GBP	IE00BTC1NL50
Man Numeric Global RI Climate Klasse D EUR *	IE00BYYJYW02
Man Numeric Global RI Climate Klasse D USD	IE00BYYJYR58
Man Numeric Global RI Climate Klasse I EUR	IE00BYYJZ947
Man Numeric Global RI Climate Klasse I SEK	IE00BYYJZD87
Man Numeric Global RI Climate Klasse I USD	IE00BYYJZ509
Man Numeric Global RI Climate Klasse I H EUR	IE00BYYJZK54
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse D C EUR	IE00BYQP7726
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse D C USD	IE00BYQP7B68
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I C EUR	IE00BYQP7387
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I C GBP	IE00BYQP7494
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I C SEK	IE00BYQP7502
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I C USD	IE00BYQP7619
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I C USD Dist	IE00BGLSNP00
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I H EUR Dist	IE00BDHF1S36
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I H GBP	IE00BD0Q9H86
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse D C EUR	IE00BYQP7G14
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse D C USD	IE00BYQP7R29
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse I C EUR	IE00BYQP7C75
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse I C SEK	IE00BYQP7F07
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse I C USD	IE00BYQP7H21
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse I H EUR	IE00BD1MB807
Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse IF H EUR	IE00BDQZFF92
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse D C EUR	IE00BYVQ5H62
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse D C USD	IE00BYVQ5L09
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse DF C EUR	IE00BYVQ5M16
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse I C CHF	IE00BYVQ5326
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse I C EUR	IE00BYVQ5433
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse I C SEK	IE00BYVQ5763
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse I C USD	IE00BYVQ5870
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse IF C EUR	IE00BYVQ5B01
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse DV C USD	IE00BMG8TZ99
Man GLG Pan European Equity Growth Klasse IV C USD	IE00BMG8V088
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse D C EUR	IE00BYPK8977
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse I USD	IE00BYPK8530
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse I C EUR	IE00BYPK8Q48
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse I C GBP	IE00BYPK8S61
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse I C SEK	IE00BYPK8W08
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse IU FH NOK	IE00BMD7ZD95
Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse I H (BRL) USD	IE00BNXH7B80
Man Numeric Europe RI Climate Klasse D C EUR *	IE00BYXG3D65
Man Numeric Europe RI Climate Klasse I C EUR	IE00BYXG3479
Man Numeric Europe RI Climate Klasse I C SEK	IE00BYXG3818
Man Numeric Europe RI Climate Klasse I C USD	IE00BYXG3925
Man Numeric Europe RI Climate Klasse I H GBP	IE00BKY53C33
Man Numeric Europe RI Climate Klasse I C GBP	IE00BYXG3693

*Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

Fonds und Anteilsklassen (Fortsetzung)

ISIN

Man GLG RI Sustainable European Income Klasse D C EUR	IE00BF4RVX15
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse DF C EUR	IE00BF4RW051
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse I C EUR	IE00BF4RW382
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse I C EUR Dist	IE00BF4RW499
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse I C USD	IE00BF4RW838
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse IF C EUR	IE00BF4RWB69
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse IM C EUR	IE00BF4RWW72
Man GLG RI Sustainable European Income Klasse I C EUR Dist Q	IE00BMC79X81
Man Numeric China A Equity Klasse D C EUR	IE00BFMXM619
Man Numeric China A Equity Klasse D H EUR	IE00BMWBB894
Man Numeric China A Equity Klasse I USD	IE00BF5HMG00
Man Numeric China A Equity Klasse I C EUR	IE00BFMXM494
Man Numeric China A Equity Klasse I C GBP	IE00BJCWB252
Man Numeric China A Equity Klasse I C SEK	IE00BFMXM502
Man GLG Strategic Bond Klasse D GBP	IE00BGT6GQ84
Man GLG Strategic Bond Klasse D GBP Dist	IE00BGT6GW45
Man GLG Strategic Bond Klasse D H CHF	IE00BKBDPF78
Man GLG Strategic Bond Klasse D H EUR	IE00BKBDPD54
Man GLG Strategic Bond Klasse D H USD	IE00BKBDPH92
Man GLG Strategic Bond Klasse DV H USD	IE00BL6VL772
Man GLG Strategic Bond Klasse DY H EUR	IE00BKBDPJ17
Man GLG Strategic Bond Klasse I GBP	IE00BGT6GR91
Man GLG Strategic Bond Klasse I GBP Dist	IE00BGV1JX91
Man GLG Strategic Bond Klasse I H CHF	IE00BKBDPL39
Man GLG Strategic Bond Klasse I H EUR	IE00BDVJ9G50
Man GLG Strategic Bond Klasse I H EUR Dist	IE00BGV1JQ25
Man GLG Strategic Bond Klasse I H JPY	IE00BKBDPM46
Man GLG Strategic Bond Klasse I H USD	IE00BGT6GS09
Man GLG Strategic Bond Klasse I H USD Dist	IE00BGV1JY09
Man GLG Strategic Bond Klasse IV H USD	IE00BL6VL889
Man GLG Strategic Bond Klasse IXF GBP	IE00BGT6GT16
Man GLG Strategic Bond Klasse IXF GBP Dist	IE00BGV1JZ16
Man GLG Strategic Bond Klasse IXF H USD	IE00BGT6GV38
Man GLG Strategic Bond Klasse D H USD Dist A	IE00BKBDPP76
Man GLG Strategic Bond Klasse DY H USD	IE00BKBDPK22
Man GLG Strategic Bond Klasse I GBP Dist A	IE00BKBDPR90
Man GLG Strategic Bond Klasse I H EUR Dist A	IE00BKBDPQ83
Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse I USD	IE00BK810371
Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse I C CHF	IE00BK810603
Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse I C EUR	IE00BK810595
Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse I C GBP	IE00BK810488
Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse IF C EUR	IE00BMWBB563
Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse IF C GBP	IE000ED2SMQ8
Man Numeric US High Yield Klasse I USD	IE00BMDNRN13
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse IF H EUR	IE000FTP5ZV4
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse I H EUR	IE000VA5W9H0
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse I H GBP	IE0009XKM2Z8
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse I USD	IE000XOE1GE5
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse I H EUR Dist	IE000HUNJLV8
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse IF H GBP	IE0006C92Y45
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse IF H GBP Dist	IE000UFXFS11
Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse IF EUR Dist	IE000NP13I93

Fonds und Anteilsklassen (Fortsetzung)

ISIN

Man GLG China Equity Klasse I C EUR	IE000WMBYW65
Man GLG China Equity Klasse I C GBP	IE000VPJAJH9
Man GLG China Equity Klasse IF C EUR	IE000FUCUTW3
Man GLG China Equity Klasse IF USD	IE000U1R2633
Man GLG China Equity Klasse I USD	IE000J4K3DA2
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Klasse I C EUR	IE000N8O3582
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Klasse I C GBP	IE000JPQQ084
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Klasse I C USD	IE0007JLMJ61
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Klasse IF C EUR	IE000CLHE6F4
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Klasse IF C USD	IE0002YJBIJ7
Man GLG Sustainable Strategic Income Klasse IF H EUR	IE000ULCE9A2
Man GLG Sustainable Strategic Income Klasse IF USD	IE000B8VRZT6
Man GLG Sustainable Strategic Income Klasse I H EUR	IE000K7D8CA7
Man GLG Sustainable Strategic Income Klasse I H GBP	IE000AIARQE3
Man GLG Sustainable Strategic Income Klasse I USD	IE0007LQCP82
Man GLG Dynamic Income Klasse I USD	IE000NS7XVU2
Man GLG Dynamic Income Klasse IF H EUR	IE000230XXL4
Man GLG Dynamic Income Klasse IF USD	IE00068B59K2
Man GLG Dynamic Income Klasse I H EUR	IE000E4XZ7U3
Man GLG Dynamic Income Klasse I H GBP	IE000RA2ZI45

	Seite
Anschriftenverzeichnis	3
Bericht des Verwaltungsrats	40
Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber	50
Bilanz	52
Aufstellung der Entwicklung des Nettovermögens	60
Gesamtergebnisrechnung	64
Kapitalflussrechnung	72
Erläuterungen zum Abschluss	80
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers	210
Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022	215
Man GLG Global Convertibles	215
Man GLG RI European Equity Leaders	220
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	223
Man Numeric Emerging Markets Equity	227
Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)	231
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	234
Man GLG Global Emerging Markets Bond	238
Man GLG Pan-European Equity Growth	241
Man GLG RI Global Sustainable Growth	244
Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)	247
Man GLG RI Sustainable European Income	251
Man Numeric China A Equity	252
Man GLG Strategic Bond	256
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	259
Man Numeric US High Yield	262
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	264
Man GLG China Equity	269
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy	273
Man GLG Sustainable Strategic Income	274
Man GLG Dynamic Income	277
Man GLG Global Convertibles	281
Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)	281
Man GLG RI European Equity Leaders	282
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	283
Man Numeric Emerging Markets Equity	284
Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)	285
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	286
Man GLG Global Emerging Markets Bond	287
Man GLG Pan-European Equity Growth	288
Man GLG RI Global Sustainable Growth	289
Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)	290
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	291
Man Numeric China A Equity	292
Man GLG Strategic Bond	293
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	294
Man Numeric US High Yield	295
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	296
Man GLG China Equity	297
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy	298
Man GLG Sustainable Strategic Income	299
Man GLG Dynamic Income	300

	Seite
Anhang I (ungeprüft)	301
Ergänzende Informationen (ungeprüft)	302
Ungeprüfte Berichtsanhörungen gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	303
Ungeprüfte regelmäßige Angaben für die EU-Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“)	310
Informationen für Schweizer Anleger	445

Der vorliegende Jahresbericht und geprüfte Jahresabschluss („Bericht und Abschluss“) können in andere Sprachen übersetzt werden. Diese Übersetzungen müssen dieselben Informationen enthalten und dieselbe Bedeutung haben wie der englischsprachige Bericht und Abschluss. Sofern der englischsprachige Bericht und Abschluss und der Bericht und Abschluss in einer anderen Sprache an irgendeiner Stelle differieren, sind der englischsprachige Bericht und Abschluss maßgeblich. Ausnahmsweise (und nur in diesem Umfang) ist eine andere Sprache des Berichts und Abschlusses dann und insoweit maßgeblich, wie das Gesetz eines Hoheitsgebietes, in dem die Anteile vertrieben werden, dies für Klagen, die sich auf Veröffentlichungen in einem Bericht und Abschluss in einer anderen Sprache als Englisch beziehen, verlangt. Streitigkeiten in Bezug auf die Bedingungen von Bericht und Abschluss, ungeachtet der Sprache des Berichts und Abschlusses, unterliegen irischem Recht und sind nach diesem auszulegen.

Verwaltungsrat:

Ronan Daly (Brite, mit Wohnsitz in Irland)*
Samantha McConnell (Irin)*
John Morton (Brite, mit Wohnsitz in Irland)
Bronwyn Wright (Irin)**

Verwaltungsgesellschaft:

Man Asset Management (Ireland) Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Verwahrstelle:

The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin
Riverside Two
Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Administrator:

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company
One Dockland Central
Guild Street
IFSC
Dublin 1
Irland

Rechtsberater für irisches Recht:

Matheson
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Gesellschaftssekretär und Sitz:

Matsack Trust Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Anlageverwalter für die Man GLG Portfolios:

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

Anlageverwalter für die GLG LLC Portfolios:

GLG LLC
452 Fifth Avenue
27th Floor
New York
NY 10018
USA

Anlageverwalter für die Man Numeric Portfolios:

Numeric Investors LLC
200 Pier 4 Boulevard
5th Floor
Boston
MA 02210
USA

Vertriebsgesellschaft für die Portfolios:

Man Investments AG
Huobstrasse 3
8808 Pfäffikon SZ
Schweiz

Unabhängiger Abschlussprüfer:

Ernst & Young
Chartered Accountants
Ernst & Young Building
Harcourt Centre
Harcourt Street
Dublin 2
Irland

Vertreter in der Schweiz:

Man Investments AG
Huobstrasse 3
8808 Pfäffikon SZ
Schweiz

Zahlstelle in der Schweiz:

RBC Investor Services Bank S.A.
Esch-sur Alzette
Zweigniederlassung Zürich
Bleicherweg 7
8027 Zürich
Schweiz

Notierungsstelle:

The Bank of New York Mellon SA/NV,
Niederlassung Luxemburg
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

*Unabhängig, nicht geschäftsführend.

**Unabhängig, nicht geschäftsführend und Vorsitzende.

Eine detaillierte Liste der während des Geschäftsjahres ge- und verkauften Anlagen ist kostenlos auf Anfrage am Geschäftssitz des Fonds erhältlich.

Performance-Tabelle

Für jeden der Teilfonds, die Teil von Man Funds plc sind, sind die Details ihrer Renditen während des am 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahres nachfolgend tabellarisch aufgeführt.

Die einzelnen Anteilsklassen, für die wir die Kennzahlen auf dieser Seite ausgewiesen haben, wurden von den jeweiligen Anlageverwaltern ausgewählt, da ihre Kommentare als Anlageverwalter in diesem Abschnitt des Abschlusses die Wertentwicklung dieser bestimmten Anteilsklassen am besten wiedergeben.

Bis zu einem gewissen Grad enthalten die Berichte der Anlageverwalter auch ihre Ansichten und Analysen zu den anderen Anteilsklassen, die zu ihren Portfolios gehören. Die Rendite für diese anderen Anteilsklassen während des Geschäftsjahres kann jedoch von dem abweichen, was in diesem Unterabschnitt des Jahresabschlusses berichtet wird.

Weitere Einzelheiten zu den Renditen, die für alle anderen Anteilsklassen der verschiedenen Teilfonds von Man Funds plc erzielt wurden, finden Sie im Bericht des Verwaltungsrats.

Für alle Teilfonds, die im Laufe des Geschäftsjahres aufgelegt wurden, stellen die nachstehenden Informationen die Wertentwicklung ab Auflegung bis zum 31. Dezember 2022 dar.

Teilfonds	Anteilsklasse	Rendite der Anteilsklasse	Benchmark	Benchmarkrendite
Man GLG Global Convertibles	Man GLG Global Convertibles Klasse DL USD	(14,73 %)	Thomson Reuters Global Focus Convertible Bond Index	(16,00 %)
Man GLG RI European Equity Leaders	Man GLG RI European Equity Leaders Klasse I EUR	(13,55 %)	MSCI Europe Index	(9,77 %)
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I JPY	18,88 %	(1) TOPIX (JPY, GDTR) (2) Russell Nomura Large Cap Value Index (JPY, GDTR)"	(1) 2,45 % (2) 10,83 %
Man Numeric Emerging Markets Equity	Man Numeric Emerging Markets Equity Klasse D USD	(20,25 %)	MSCI EM Index	(20,09 %)
Man Numeric Global RI Climate	Man Numeric Global RI Climate Klasse D USD	(19,78 %)	MSCI World Index	(18,14 %)
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Klasse I C USD	(3,70 %)	JP Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged Index	(11,69 %)
Man GLG Global Emerging Markets Bond	Man GLG Global Emerging Markets Bond Klasse D C USD	(10,26 %)	.P. Morgan EMBI Global Composite	(16,45 %)
Man GLG Pan European Equity Growth	Man GLG Pan European Equity Growth Klasse I C EUR	(25,73 %)	MSCI Europe Index	(9,50 %)
Man GLG RI Global Sustainable Growth	Man GLG RI Global Sustainable Growth Klasse I USD	(26,78 %)	MSCI World Index	(18,00 %)
Man Numeric Europe RI Climate	Man Numeric Europe RI Climate Klasse D C EUR	(16,05 %)	MSCI Europe Index	(9,50 %)
Man GLG RI Sustainable European Income	Man GLG RI Sustainable European Income Klasse D C EUR	(10,40 %)	MSCI Europe Index	(9,50 %)
Man Numeric China A Equity	Man Numeric China A Equity Klasse D C EUR	(22,83 %)	MSCI China A (EUR, NDTR)	(21,05 %)
Man GLG Strategic Bond	Man GLG Strategic Bond Klasse I GBP	(7,59 %)	IA GBP Strategic Sector	(11,70 %)
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	Man GLG Asia (ex Japan) Equity Klasse I USD	(13,04 %)	MSCI Asia ex Japan (USD, NDTR)	(19,67 %)
Man Numeric US High Yield	Man Numeric US High Yield Klasse I USD	(11,09 %)	ICE BofA US High Yield Index	(11,22 %)
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Man GLG Global Investment Grade Opportunities Klasse I USD	(9,61 %)	ICE BofA Global Large Cap Corporate Index (USD, TR)	(14,08 %)
Man GLG China Equity	Man GLG China Equity Klasse I USD	(18,13 %)	MSCI China (USD, NDTR)	(21,93 %)
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy	Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Klasse I C EUR	(7,25 %)	MSCI World Net Dividend Total Return EUR	(13,65 %)
Man GLG Sustainable Strategic Income	n. z. *Gemäß den MIFID-II-Vorschriften kann die Wertentwicklung eines Fonds erst dann veröffentlicht werden, wenn der Fonds 12 Monate lang gehandelt wurde.			
Man GLG Dynamic Income	n. z. *Gemäß den MIFID-II-Vorschriften kann die Wertentwicklung eines Fonds erst dann veröffentlicht werden, wenn der Fonds 12 Monate lang gehandelt wurde.			

Die Performancedaten werden nach Abzug von Gebühren mit reinvestierten Erträgen angegeben. Sie berücksichtigen keine ggf. anfallenden Ausgabe- und Rücknahmegebühren. Die Renditen werden abzüglich der Verwaltungsgebühren und etwaiger erfolgsabhängiger Gebühren für die in der obigen Performance-Tabelle genannten Anteilsklassen berechnet. Für andere Anteilsklassen werden eventuell höhere Gebühren erhoben.

Weitere Einzelheiten zu den spezifischen Verwaltungs- und Performance-Gebührensätzen der einzelnen Teilfonds (und ihrer verschiedenen Anteilsklassen) finden Sie in Anmerkung 8 des Jahresabschlusses.

Zusammenfassung der Marktentwicklung

2022 war ein schwieriges Jahr für die globalen Märkte, auch wenn das vierte Quartal zumindest eine gewisse Entspannung brachte. Die Anleger konnten nur in wenigen Bereichen Zuflucht finden, da sowohl die Zinssätze stiegen als auch die Kreditspreads sich ausweiteten und viele Kreditbereiche einige der schlechtesten Renditen seit Ende der 1990er Jahre verzeichneten. Die globalen Wandelanleihen schnitten etwas besser ab und übertrafen auch die globalen Aktien, verzeichneten jedoch ihre schlechteste jährliche Rendite seit 2008. Energietitel verzeichneten 2022 eine überdurchschnittliche Wertentwicklung, allerdings führte ihre geringe Allokation nur zu wenig Zuwachs bei den Wandelanleihen. Die Technologie- und wachstumsstarken Segmente trugen hingegen zum Großteil der negativen Rendite der Anlageklasse bei, was insbesondere auf die Kehrtwende in der Zentralbankpolitik, den raschen Anstieg der Inflation und die höheren Renditen zurückzuführen ist, die sowohl die Aktien- als auch die AnleihekompONENTEN von Wandelanleihen beeinträchtigten¹.

Performance-Rückblick

Der Fonds schloss das Jahr (nach Abzug von Gebühren) mit einem Minus ab, entwickelte sich jedoch besser als die Benchmark², die um 16,00 % fiel. Die Titelauswahl, die regionale Allokation und die Marktallokation trugen jeweils erheblich zur positiven Wertentwicklung im Jahresverlauf bei, während die Sektorallokation ebenfalls leicht positiv war. Auf sektoraler und regionaler Basis kamen die Gewinne in erster Linie aus der Positionierung und Titelauswahl in den US-amerikanischen Sektoren Technologie, nichtzyklische Konsumgüter und Kommunikation sowie in den Sektoren Kommunikation und Technologie in der EMEA-Region. Die Positionierung und die Titelauswahl in den Sektoren Industrie und zyklische Konsumgüter in Asien (ohne Japan) wirkten sich hingegen negativ aus.

Auf relativer Basis waren die Spitzenreiter bei den Einzeltiteln Yandex, Delivery Hero und Microstrategy. Der Fonds erzielte Rendite mit einer Untergewichtung von Yandex – einem russischen Internetunternehmen – zu Beginn des Jahres. Außerdem machte er Gewinne mit einer taktischen Übergewichtung, nachdem die Anleihen aus der Benchmark genommen wurden und anschließend aufgrund von Umstrukturierungserwartungen stark anstiegen. Eine Übergewichtung von Delivery Hero und eine Untergewichtung von Microstrategy waren ebenfalls zuträglich. Eine Übergewichtung des deutschen Immobilienunternehmens Tag Immobilien beeinträchtigte die Rendite hingegen am stärksten, während die Übergewichtungen von Redfin und Hon Hai ebenfalls abträglich waren, wobei Letzteres am Ende des Jahres hauptsächlich durch den schwächelnden TWD gegenüber dem USD in Mitleidenschaft gezogen wurde.

Das Aktien-Delta des Fonds lag am Monatsende bei 40 % und damit im Einklang mit dem der Benchmark (40 %). Der durchschnittliche YTM/P am Monatsende lag bei 0,17 %, während der Referenzindex -0,03 % verzeichnete. Zwar belebte sich die Emissionstätigkeit im vierten Quartal, jedoch beliefen sich die globalen Emissionen von Wandelanleihen im Jahr 2022 auf knapp 40 Mrd. USD und lagen damit deutlich unter dem Niveau von 2021.

Ausblick

2022 stand die Anlageklasse der Wandelanleihen unter dem Einfluss ihrer Ausrichtung auf wachstumsstarke Titel, der anziehenden Inflation und dem Richtungswechsel der globalen Geldpolitik. Steigende Zinsen wirkten sich nicht nur auf den Wert der Anleihen, sondern auch auf die Bewertungen der zugrunde liegenden Aktien aus. Die Anleihenmärkte haben jedoch Unterstützung erhalten, da sich die Kreditspreads stabilisiert haben und die Konvexität sich deutlich verbessert hat, so dass sich in Zukunft attraktive Risiko-Ertrags-Chancen bieten.

Der Markt wird nun näher am jeweiligen Wert der Anleihen gehandelt und zeichnet sich durch Anleihen aus, die aus dem Geld sind und attraktive Renditen in einem Umfeld bieten, in dem die Bilanzen im Allgemeinen gesund bleiben. Nach wie vor gibt es zahlreiche Möglichkeiten, Anlagechancen bei Wachstumswerten, die stark nach unten korrigiert wurden, zu nutzen, während Fusionen und Übernahmen den Anlegern nach einem aktiven Jahr 2022 weitere Möglichkeiten bieten.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

¹ Quelle: Financial Times und Bloomberg

² Der Fonds wird aktiv verwaltet. Der Fonds beabsichtigt nicht, den Thomson Reuters Global Focus Convertible Bond Index nachzubilden und ist daher nicht durch diesen eingeschränkt. Die Benchmark wird vom Fonds für Risikomanagementzwecke verwendet, um sicherzustellen, dass der Fonds auf eine Art und Weise verwaltet wird, die mit seinem Anlageziel und seinem Risikoprofil vereinbar ist.

Zusammenfassung der Marktentwicklung¹

Das Jahr 2022, das von Krieg, steigenden Kosten und höheren Zinssätzen geprägt war, würden viele europäische Unternehmen – und Börsenanleger – am liebsten vergessen. Sorgfältig ausgearbeitete Anlagestrategien hatten keinen Bestand mehr, zunächst aufgrund des russischen Einmarsches in die Ukraine und der anschließenden Energiekrise, dann durch die steigenden Fremdkapitalkosten, die die Verzinsung 10-jähriger deutscher Anleihen – der europäischen Benchmark – auf den höchsten Stand seit mehr als einem Jahrzehnt ansteigen ließen.

Performance-Rückblick

Der Portfoliomanager verließ das Unternehmen Mitte November 2022, woraufhin der Fonds abgewickelt und der letzte verfügbare NIW am 12. Dezember 2022 veröffentlicht wurde. Bis zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds für 2022 eine negative Gesamtrendite erwirtschaftet, was die allgemeinen Einbußen der europäischen Aktienmärkte im Laufe des Jahres widerspiegelt. Die Benchmark des Fonds, der MSCI Europe Index¹, erzielte im gleichen Zeitraum ebenfalls eine negative Wertentwicklung.¹

Es überrascht nicht, dass der Fonds im ersten Quartal 2022 durch den russischen Einmarsch in die Ukraine beeinträchtigt wurde und in diesem Zeitraum eine negative Wertentwicklung erzielte, die vor allem auf Industrie- und Energietitel zurückzuführen war. Dennoch übertraf der Fonds die Benchmark geringfügig, was einer positiven Aktienauswahl im Gesundheitswesen und bei Finanzwerten zu verdanken war. Im zweiten Quartal entwickelte sich der Fonds sowohl auf absoluter als auch auf relativer Basis negativ, wobei die unterdurchschnittliche Wertentwicklung vor allem auf die Positionen des Portfolios in Industrierwerten und Kommunikationsdienstleistungen zurückzuführen war.

Der Fonds erholte sich nicht von der Underperformance im ersten Halbjahr und verzeichnete im dritten Quartal seine schlechteste relative Wertentwicklung für das Jahr 2022. Wenn man sich das Universum insgesamt anschaut, verzeichneten die Aktien der Eurozone im dritten Quartal angesichts der anhaltenden Energiekrise, der steigenden Inflation und der daraus resultierenden Befürchtungen hinsichtlich der Aussichten für das Wirtschaftswachstum einen weiteren starken Rückgang. Alle Sektoren verzeichneten negative Renditen, wobei die stärksten Rückgänge bei Kommunikationsdienstleistungen, Immobilien und im Gesundheitswesen zu verzeichnen waren. In diesem Zeitraum schnitt der Fonds schlechter ab als die Benchmark. Allerdings verzeichneten beide negative Renditen. Die Positionen im Gesundheitssektor trugen zur Underperformance im Berichtszeitraum bei, der wichtigste negative Faktor waren aber erneut die Industrierwerte.

Ausblick

k. A.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden. Die Gewichtungen können sich jederzeit ändern.

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

¹ Der MSCI Europe Net Total Return Index EUR Hedged ist eine offizielle Benchmark für den Fonds.

Zusammenfassung der Marktentwicklung¹

2022 war ein weiteres erfolgreiches Jahr für den Fonds, da sich Substanzwerte² in Japan weiterhin besser entwickelten als Wachstumswerte. Vor dem Hintergrund volatiler makroökonomischer Bedingungen zeigte der substanzorientierte Anlagestil eine beruhigende Widerstandsfähigkeit. Der Fonds entwickelte sich zu Jahresbeginn deutlich überdurchschnittlich, da die Inflationskräfte dem Energie- und Rohstoffsektor zugutekamen und Finanzwerte gut abschnitten, als die globalen Anleiherenditen deutlich anstiegen. Die Performance war im Januar bemerkenswert stark, und dies war der beste Monat für Substanzaktien im Verhältnis zum TOPIX² seit Mai 2000. Angesichts des inflationären Umfelds gerieten jedoch viele zyklische und defensive Bereiche des Marktes aufgrund steigender Inputkosten und zunehmender Bedenken hinsichtlich einer Kompression der Margen unter Druck.

2022 war ein Jahr, das von zunehmendem Inflationsdruck und entsprechenden Reaktionen der Zentralbanken geprägt war. Die Inflation stieg in den USA und in Europa deutlich an, woraufhin die Zentralbanken weltweit ihre Politik zu straffen versuchten. In Japan war dies den Großteil des Jahres über anders. Trotz der steigenden Inflation blieb Zentralbankchef Kuroda von der Bank of Japan konsequent und weigerte sich, die ultralockere japanische Geldpolitik zu ändern. Er hatte zwei Voraussetzungen für eine Änderung der Geldpolitik: ein nachhaltiges Lohnwachstum und eine dauerhafte Inflation von 2 %. Obwohl stark damit gerechnet wurde, dass die Löhne bei den Tarifverhandlungen (Shunto) im Frühjahr 2023 erhöht würden, hatten sie noch kein nachhaltiges Wachstumsniveau erreicht. Die Inflation (ohne Berücksichtigung der Auswirkungen von Verbrauchsteuererhöhungen) erreichte den höchsten Stand seit 1990, allerdings prognostizierte die Bank of Japan, dass sie 2023 wieder unter die entscheidende Marke von 2 % fallen würde. Aufgrund dieser zunehmenden geldpolitischen Divergenz zwischen der japanischen und anderen Zentralbanken kam es zu einer erheblichen Abwertung des Yen. Im September gab das Finanzministerium schätzungsweise 20 Mrd. USD aus, um den Yen zu stützen – die erste Intervention dieser Art seit 24 Jahren. Dennoch fiel der Yen im Oktober auf ein reales, handelsgewichtetes 51-Jahres-Tief und durchbrach die psychologisch wichtige Marke von 150 gegenüber dem US-Dollar.

Dies veranlasste das Finanzministerium zu einer zweiten Intervention, um den Yen zu schützen, bei der weitere geschätzte 42 Mrd. US-Dollar ausgegeben wurden. Ein schwacher Yen ist im Allgemeinen positiv für japanische Großunternehmen, aber angesichts der negativen Auswirkungen auf die Menschen in Japan und des daraus resultierenden Drucks auf die Popularität von Premierminister Kishida begann eine Änderung der Geldpolitik der Bank of Japan unvermeidlich zu werden. Mit dem bevorstehenden Ruhestand von Zentralbankchef Kuroda im April 2023 ging der Markt davon aus, dass zu diesem Zeitpunkt eine Änderung angekündigt werden würde. Am 20. Dezember schockte die Bank of Japan jedoch die Märkte, indem sie ihren Zielkorridor für die 10-jährige JGB-Rendite erweiterte und die Obergrenze von 0,25 % auf 0,5 % an hob. Diese Änderung wurde verkündet, obwohl die beiden von Kuroda genannten Voraussetzungen für eine Änderung der Geldpolitik nicht erfüllt waren. Daraus wurden zwei Schlussfolgerungen gezogen. Erstens, dass Zentralbankchef Kuroda es vorziehen würde, den Markt glauben zu lassen, es handle sich lediglich um eine Anpassung „zur Verbesserung der Marktfunktionen“ und „nicht um eine Zinserhöhung“ handle. Oder die Schlussfolgerung – der das japanische CoreAlpha-Investmentteam eher Glauben schenkt –, dass dies der Beginn der Normalisierung der Geldpolitik in Japan ist.

Performance-Rückblick³

Der Fonds hat im Geschäftsjahr eine positive Rendite erzielt. Die Aktivitäten innerhalb des Fonds hängen vom Anlageerfolg ab. Der normale Prozess umfasst die Rotation weg von Titeln, die gute Renditen erzielt haben, hin zu Titeln mit größerem Potenzial. In einem starken Jahr für den Fonds, wie 2022 eines war, ist es angesichts der anhaltenden Rotation hin zu Substanztiteln¹ keine Überraschung, dass die Umsätze hoch waren. Die Änderungen bei den Einzeltitelgewichtungen beliefen sich auf insgesamt über 41 % und lagen damit nur geringfügig unter dem Wert für 2021. Diese Änderungen umfassten achtzehn vollständige Veräußerungen und vierzehn neue Positionen.

In den ersten Monaten des Jahres 2022 wurde das Engagement des Fonds vor dem Hintergrund dieser Kursschwäche erhöht. Als jedoch die Volatilität und die weltweite Unsicherheit der Märkte im zweiten und dritten Quartal zunahm, entwickelten sich defensive Bereiche des Marktes (einschließlich Telekommunikation, Einzelhandel und Getränke) gut, was der Wertentwicklung des Fonds zugutekam. Zu Beginn des vierten Quartals schnitten zyklische Sektoren und Finanzwerte gut ab, da anhaltend gute Wirtschaftsdaten und die mögliche Wiedereröffnung Chinas die Stimmung an den Märkten beflügelten. Die Bank of Japan überraschte die Märkte im Dezember als sie die Politik zur Kontrolle der Renditekurve für 10-jährige Staatsanleihen ausweitete. In den letzten Wochen des Jahres wurde die Wertentwicklung daher vor allem von Finanztiteln angetrieben. Die im Fonds deutlich übergewichteten Finanzwerte trugen in diesem Jahr wesentlich zur Wertentwicklung bei. Die hoch bewerteten technologiebezogenen Sektoren entwickelten sich 2022 weiterhin unterdurchschnittlich, ein Marktbereich, in dem der Fonds nicht engagiert war, was ebenfalls wesentlich zur Wertentwicklung beitrug.

In einem Jahr mit einer solch starken Wertentwicklung gab es generell nur einige vereinzelte Verlustbringer. Da sich Japan in der zweiten Jahreshälfte erst mit einer gewissen Verzögerung nach der Corona-Pandemie wieder öffnete, leisteten untergewichtete Positionen in inländischen Marktsegmenten wie Eisenbahn und Einzelhandel einen negativen Beitrag. Bei den Aktien enttäuschte die Entwicklung von Nissan Motor und Panasonic im Jahresverlauf. Insgesamt waren die Bedingungen weiterhin günstig für den substanzorientierten Stil¹. In diesem Umfeld führten eine vorteilhafte Titelauswahl und ein konzentriertes Sektorengagement dazu, dass der Fonds auch im Vergleich zum Russell/Nomura Large Cap Value Index ein erhebliches zusätzliches Alpha erzielte.

¹ Quelle: Man GLG, Refinitiv Datastream und Nomura.

² Die an der Börse Tokio notierten Unternehmen sind nach Größe in zwei Gruppen unterteilt: groß und klein, wobei die Gruppe der großen Unternehmen weiter nach Spitze (die größten Unternehmen) und Mitte (mittelgroße Unternehmen) unterteilt ist. Die japanischen börsennotierten Unternehmen werden auch nach Bewertung in zwei Gruppen unterteilt – woran sich zeigt, wie hoch die Preise sind, die die Anleger bereit sind, für ihre Aktien zu zahlen. Als Kennzahl wird das Kurs-Buchwert-Verhältnis (KBV) verwendet, das den Aktienkurs eines Unternehmens mit dem Buchwert seiner Anlagen vergleicht. Unternehmen mit einem niedrigen KBV werden als Substanzanlagen (billig) eingestuft, während solche mit einem hohen KBV als Wachstumsanlagen (teuer) bezeichnet werden. Der Japan CoreAlpha setzt auf Aktien aus den Segmenten der großen und der Substanzaktien. Die Aktienkursentwicklung der Unternehmen in diesen beiden Gruppen ist daher wesentlich für die Wertentwicklung des Fonds.

³ Die Bezeichnungen Top, Large, Mid, Small, Growth und Value beziehen sich alle auf Russell/Nomura-Indizes. Substanztitel haben im Allgemeinen ein niedrigeres KBV als der Markt, während Wachstumstitel ein höheres KBV als der Markt haben. Der TOPIX und der Russell/Nomura Large Cap Value Index sind offizielle Benchmarks für diesen Fonds. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Prospekt oder den wesentlichen Anlegerinformationen. Bestimmte auf dieser Seite genannte Indizes/Kennzahlen wurden nur zu Informationszwecken angegeben. Sie sollen Vergleichspunkte für bestimmte Anlagenklassen, Anlage-sektoren oder Finanzmärkte im Allgemeinen bieten („Markthintergrund“). Soweit nicht anders angegeben, ist der Anlageprozess des Fonds unabhängig von diesen Indizes/Kennzahlen.

Man GLG Japan CoreAlpha Equity – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

Angesichts des volatilen makroökonomischen Umfelds im Jahr 2022 wurde die Positionierung innerhalb des Portfolios in Reaktion auf die themenbezogene Wertentwicklung aktiv gesteuert. In der ersten Jahreshälfte 2022 wurden die Positionen in Finanzwerten und Rohstoffen aufgrund des Anstiegs der Rohstoffpreise und der globalen Renditen reduziert, um sie zu stärken. Die Gewinne wurden sowohl in zyklische als auch in defensive Werte umgeschichtet, deren Aktienkurse aufgrund gestiegener Inputkosten unter Druck geraten waren. Im dritten Quartal erzielten diese defensiven Titel die besten Ergebnisse innerhalb des Portfolios, als die ersten Preiserhöhungen umgesetzt wurden und die zunehmenden Rezessionsängste die relative Wertentwicklung weiter unterstützten. Gute Beispiele hierfür sind Telekommunikationstitel (NTT und KDDI), der Convenience-Store-Betreiber Seven & i, der Konsumgüterhersteller Kao Corp und der Brauereikonzern Kirin[†]. Vor dem Hintergrund des tragischen Todes des ehemaligen Premierministers Abe, des bevorstehenden Ruhestands von Zentralbankchef Kuroda und der zunehmenden Verdrossenheit der Öffentlichkeit angesichts der Reaktion der Regierung auf die steigende Inflation in Japan erschien ein Wechsel in der Geldpolitik sehr wahrscheinlich. Infolgedessen wurde die Position des Portfolios in Finanzwerten, vor allem in Banken, aber auch in Lebensversicherungsgesellschaften, im Vorfeld der Ankündigung im Dezember erhöht.

Die Position des Fonds in der Automobilbranche wurde nach einer starken Performance aufgrund des schwachen Yen und einer Überzeugungsänderung im Zuge der zunehmend unsicheren Elektrifizierungsaussichten der Branche erheblich reduziert.

Ausblick

Das Portfolio bleibt diversifizierter im Substanz-Spektrum. Dabei wurden im Vergleich zu der Positionierung des Fonds während der Corona-Pandemie die Anzahl der Positionen erhöht und der Anteil der Investitionen in den zehn größten Positionen reduziert. Infolgedessen wurde der Tracking Error reduziert. Zum Jahresende waren die drei größten übergewichteten Positionen des Fonds im Vergleich zum TOPIX zyklische Unternehmen aus der Industrie und dem verarbeitenden Gewerbe sowie Banken und Immobilien. Die technologiebezogenen Sektoren sind nach wie vor am stärksten untergewichtet.

Das Anlageteam ist optimistisch, was den japanischen Markt im Jahr 2023 betrifft, da die Bewertungen weiterhin niedrig sind, insbesondere im Vergleich zum US-Markt. Die japanische Wirtschaft erholt sich weiter von der Corona-Pandemie, und für Japan wird im Jahr 2023 die höchste BIP-Wachstumsrate der G7-Länder prognostiziert. Die laufenden Verbesserungen bei der Corporate Governance sind ebenfalls sehr positiv zu bewerten. Trotz der starken Jahre 2021 und 2022 ist der Substanzbereich im Vergleich zum Gesamtmarkt nach wie vor gedämpft, und es besteht immer noch eine große Chance in Bezug auf die Rückkehr zum Mittelwert. Angesichts der Anzeichen für eine Normalisierung der Geldpolitik in Japan scheint die Ära der weltweiten Negativzinsen hinter uns zu liegen. In diesem Umfeld hat der substanzorientierte Anlagestil das Potenzial, sich auch in Zukunft gut zu entwickeln.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden. Die Gewichtungen können sich jederzeit ändern.

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Nach einer lang anhaltenden Rallye seit dem Tiefpunkt der Covid-19-Krise im März 2020 legten die Märkte schließlich eine Verschnaufpause ein: Der MSCI World Index fiel im ersten Quartal 2022 um 5,2 %. Das Jahr begann mit guten Ergebnissen im vierten Quartal, guten Beschäftigungszahlen und einer Abnahme der Zahl der Covid-19-Fälle optimistisch. Die Wirtschaft war jedoch nicht in der Lage, die hohe Inflation abzufedern, und da die Fed aggressive Maßnahmen andeutete, drehten die Märkte, und der MSCI World Index beendete den Monat Januar mit -5,3 %.

Im Februar setzten die Märkte ihre Talfahrt nach dem Einmarsch Russlands in die Ukraine fort und wurden durch die Unsicherheit über die geopolitische Positionierung Chinas und die Angst vor Offshore-Delistings weiter verschärft. Im März schüttelten die Märkte diese Sorgen schließlich mit einer Erholung des MSCI World Index um 2,7 % ab, nachdem sich die chinesischen Behörden marktfreundlich geäußert hatten. Aus Sicht der Performance von ESG-Faktoren war das erste Quartal 2022 für ESG-orientierte Strategien der perfekte Sturm. Nach einer starken relativen Rendite im Jahr 2021 blieben die ESG-Indizes im ersten Quartal hinter Fonds mit Standard-Strategien zurück.

Die Gefahr einer anhaltenden Inflation ist im zweiten Quartal 2022 real geworden. Die Märkte reagierten, wie es zu erwarten war, und die Anleger verkauften alles, was ihnen riskant erschien. Der MSCI World Index fiel um 16,2 % und tendierte über weite Strecken des Quartals abwärts. Ungeachtet kurzer Mini-Erholungen Mitte Mai und Mitte Juni beendeten die Märkte das Quartal nahe neuen Jahrestiefständen. Angesichts des düsteren makroökonomischen Umfelds, der ausufernden Inflation und einer drohenden Rezession war dies für die Anleger sicherlich keine einfache Zeit. Aus Sicht der Faktor-Performance war es vor dem Hintergrund steigender Zinsen nicht überraschend, dass die Wertentwicklung im Substanzbereich weiterhin positiv war. Die Faktor-Ergebnisse in der ersten Jahreshälfte entsprechen fast genau dem, was man erwarten konnte. Nach einem schwachen ersten Quartal erholte sich der MSCI US ESG Index im Vergleich zu seinem Standard-Pendant wieder. Außerhalb der USA (EAFE und EM) entwickelten sich die MSCI ESG-Indizes jedoch weiterhin unterdurchschnittlich.

Das dritte Quartal 2022 begann recht optimistisch mit einem Anstieg der Märkte, nachdem diese im Vorquartal aufgrund von Unternehmensgewinnen, die höher als erwartet ausfielen, nachgegeben hatten. Gegen Ende Juli ließen die Wirtschaftsindikatoren jedoch Besorgnis erkennen, so dass sich der Ausblick der Anleger eintrübte und der Markt im Quartal in den negativen Bereich rutschte.

Auch im vierten Quartal blieben alle Augen auf die Politik der US-Notenbank (Fed) gerichtet, und die Anleger, die sichtlich verzweifelt darauf warteten, dass der Markt die Talsohle erreichte, gingen bei den geringsten Anzeichen einer Verlangsamung der US-Wirtschaft auf Kauftour. Vor allem die unter den Erwartungen liegenden Inflationszahlen vom 10. November lösten eine extreme Zunahme der Risikobereitschaft aus. Trotz einer geringeren Zinsanhebung im Dezember hat die Fed aber noch keine deutliche Verlangsamung ihrer aggressiven geldpolitischen Straffung signalisiert, was ein anhaltend instabiles Umfeld schafft. In den Schwellenländern wurde die Marktvolatilität durch die Erwartung verstärkt, dass China seine Corona-Beschränkungen lockern würde, was am 5. Dezember erneut als Katalysator für eine starke Risikorally wirkte.

Im Gesamtzeitraum seit Jahresanfang ist der MSCI World Index in den Industrieländern um 18,1 % gefallen, während der S&P 500 Index seit Jahresanfang ebenfalls 18,1 % eingebüßt hat. In den Industrieländern ist ansonsten der MSCI Japan Index um 4,5 % gefallen und der MSCI Europe Index hat im Berichtszeitraum in EUR 9,5 % eingebüßt. Im Schwellenmarktbereich fiel der MSCI Emerging Markets Index in USD um 20,1 %. Der MSCI China A Index ist seit Jahresbeginn um 25,9 % in USD gefallen.

Performance-Rückblick

Im Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 erzielte der Numeric Emerging Markets Equity Fund eine negative Rendite (nach Abzug von Gebühren).

Performance der Modelle: Der Man Numeric strebt eine Wertschöpfung über einen auf Fundamentaldaten basierenden, quantitativen, Bottom-up-Titelauswahlprozess an. Aktien werden auf der Grundlage der Ergebnisse unserer quantitativen Investmentmodelle ausgewählt. Der Fonds wies im bisherigen Jahresverlauf eine insgesamt positive Modellperformance auf, wobei alle Modelle positiv abschnitten. Das Value-Modell erzielte die positivsten Renditen, gefolgt von den Modellen Factor Selection, Informed Investor und Momentum.

Aufschlüsselung der Performancebeiträge: Die Titelauswahl war positiv, allen voran eine erfolgreiche Titelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienstleistungen, Energie und Gesundheitswesen. Die Sektorallokation war im Berichtszeitraum negativ. Eine Übergewichtung des Informationstechnologiesektors belastete das Ergebnis, während eine Übergewichtung des Industriesektors einen positiven Beitrag leistete.

Die Titelauswahl in den Ländern trug zur Performance bei. Die Titelauswahl war in China, Mexiko und Südkorea erfolgreich, während die Anlagen in Taiwan und Indien die Performance belasteten. Die Länderallokation des Fonds belastete die Performance. Eine Übergewichtung von Brasilien erwies sich als vorteilhaft für die Performance, während eine Untergewichtung von Südafrika abträglich war.

Auf der Einzeltitelebene stammten die drei größten Beiträge des Fonds von einem brasilianischen Energieunternehmen, einem indischen Industrieunternehmen und einem chinesischen IT-Unternehmen. Die drei größten Verlustbringer des Fonds waren ein russischer Finanzdienstleister, ein indisches Energieunternehmen und eine russische Energiegesellschaft.

Ausblick

Auch wenn wir nicht wissen, was das Jahr 2023 bringen wird, sind wir der Meinung, dass die jüngsten Verbesserungen des Prozesses unser Portfolio in die Lage versetzen, sich in dem unsicheren makroökonomischen Umfeld besser zu behaupten. Wir werden auch weiterhin alles daran setzen, unsere Prozesse und Strategien zu verbessern, um die Herausforderungen im Zusammenhang mit makroökonomischen Unsicherheiten und künftigen Marktschwankungen besser zu bewältigen. Es gibt keinen offensichtlichen Grund für die Annahme, dass sich das Umfeld in absehbarer Zeit ändern wird. Die Anleger schwanken 2023 zwischen der Hoffnung auf eine weiche Landung und der Angst vor einer Rezession in den USA.

Die Volatilität wird aller Wahrscheinlichkeit nach hoch bleiben, was die Bedeutung des Risikomanagements und insbesondere der Frage, wie wir unser Risiko gegenüber Marktschwankungen am besten steuern können, unterstreicht. Dies ist ein Research-Bereich, in dem wir uns entschieden engagieren werden. Wir konzentrieren uns auf die Bottom-up-Titelauswahl und versuchen nicht, Zinssätze, Sektoren, Länder, Laufzeiten oder andere allgemeine Faktoren zu timen oder in größerem Ausmaß von der Benchmark in Bezug auf einen dieser Faktoren abzuweichen.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kaufempfehlung ausgelegt werden

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Nach einer lang anhaltenden Rallye seit dem Tiefpunkt der Covid-19-Krise im März 2020 legten die Märkte schließlich eine Verschnaufpause ein: Der MSCI World Index fiel im ersten Quartal 2022 um 5,2 %. Das Jahr begann mit guten Ergebnissen im vierten Quartal, guten Beschäftigungszahlen und einer Abnahme der Zahl der Covid-19-Fälle optimistisch. Die Wirtschaft war jedoch nicht in der Lage, die hohe Inflation abzufedern, und da die Fed aggressive Maßnahmen andeutete, drehten die Märkte, und der MSCI World Index beendete den Monat Januar mit -5,3 %.

Im Februar setzten die Märkte ihre Talfahrt nach dem Einmarsch Russlands in die Ukraine fort und wurden durch die Unsicherheit über die geopolitische Positionierung Chinas und die Angst vor Offshore-Delistings weiter verschärft. Im März schüttelten die Märkte diese Sorgen schließlich mit einer Erholung des MSCI World Index um 2,7 % ab, nachdem sich die chinesischen Behörden marktfreundlich geäußert hatten. Aus Sicht der Performance von ESG-Faktoren war das erste Quartal 2022 für ESG-orientierte Strategien der perfekte Sturm. Nach einer starken relativen Rendite im Jahr 2021 blieben die ESG-Indizes im ersten Quartal hinter Fonds mit Standard-Strategien zurück.

Die Gefahr einer anhaltenden Inflation ist im zweiten Quartal 2022 real geworden. Die Märkte reagierten, wie es zu erwarten war, und die Anleger verkauften alles, was ihnen riskant erschien. Der MSCI World Index fiel um 16,2 % und tendierte über weite Strecken des Quartals abwärts. Ungeachtet kurzer Mini-Erholungen Mitte Mai und Mitte Juni beendeten die Märkte das Quartal nahe neuen Jahrestiefständen. Angesichts des düsteren makroökonomischen Umfelds, der ausufernden Inflation und einer drohenden Rezession war dies für die Anleger sicherlich keine einfache Zeit. Aus Sicht der Faktor-Performance war es vor dem Hintergrund steigender Zinsen nicht überraschend, dass die Wertentwicklung im Substanzbereich weiterhin positiv war. Die Faktor-Ergebnisse in der ersten Jahreshälfte entsprechen fast genau dem, was man erwarten konnte. Nach einem schwachen ersten Quartal erholte sich der MSCI US ESG Index im Vergleich zu seinem Standard-Pendant wieder. Außerhalb der USA (EAFE und EM) entwickelten sich die MSCI ESG-Indizes jedoch weiterhin unterdurchschnittlich.

Das dritte Quartal 2022 begann recht optimistisch mit einem Anstieg der Märkte, nachdem diese im Vorquartal aufgrund von Unternehmensgewinnen, die höher als erwartet ausfielen, nachgegeben hatten. Gegen Ende Juli ließen die Wirtschaftsindikatoren jedoch Besorgnis erkennen, so dass sich der Ausblick der Anleger eintrübte und der Markt im Quartal in den negativen Bereich rutschte.

Auch im vierten Quartal blieben alle Augen auf die Politik der US-Notenbank (Fed) gerichtet, und die Anleger, die sichtlich verzweifelt darauf warteten, dass der Markt die Talsohle erreichte, gingen bei den geringsten Anzeichen einer Verlangsamung der US-Wirtschaft auf Kauftour. Vor allem die unter den Erwartungen liegenden Inflationszahlen vom 10. November lösten eine extreme Zunahme der Risikobereitschaft aus. Trotz einer geringeren Zinsanhebung im Dezember hat die Fed aber noch keine deutliche Verlangsamung ihrer aggressiven geldpolitischen Straffung signalisiert, was ein anhaltend instabiles Umfeld schafft. In den Schwellenländern wurde die Marktvolatilität durch die Erwartung verstärkt, dass China seine Corona-Beschränkungen lockern würde, was am 5. Dezember erneut als Katalysator für eine starke Risikorally wirkte.

Im Gesamtzeitraum seit Jahresanfang ist der MSCI World Index in den Industrieländern um 18,1 % gefallen, während der S&P 500 Index seit Jahresanfang ebenfalls 18,1 % eingebüßt hat. In den Industrieländern ist ansonsten der MSCI Japan Index um 4,5 % gefallen und der MSCI Europe Index hat im Berichtszeitraum in EUR 9,5 % eingebüßt. Im Schwellenmarktbereich fiel der MSCI Emerging Markets Index in USD um 20,1 %. Der MSCI China A Index ist seit Jahresbeginn um 25,9 % in USD gefallen.

Performance-Rückblick

Im Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 erzielte der Man Numeric Global RI Climate Fund (der „Fonds“) eine negative Rendite (nach Abzug von Gebühren) und blieb hinter seiner Benchmark zurück.

Im Februar 2022 ging der Fonds von Man Numeric RI Global Equity in den Man Numeric Global RI Climate über. Ziel dieser und anderer Klimastrategien von Man Numeric ist es, sich gegen die Risiken des Klimawandels abzusichern, die Alpha-Chancen des Übergangs zu sauberer Energie zu nutzen und ein positives Engagement in ESG- und fundamentalen Anlagekonzepten über einen vollständig systematischen Prozess aufrechtzuerhalten. Der Fonds umfasst eine Reihe komplementärer Alpha-Modelle, die an Climate, ESG und Fundamental Investment Themes gebunden sind, um ein Portfolio aufzubauen, das eine ganzheitliche Sicht der Welt umfasst. Das vielschichtige Climate-Alpha-Modell wurde bei der Umstellung im Februar 2022 neu in die Strategie aufgenommen. Damit wurde die Strategie auf das 2-Grad-Ziel des Abkommens von Paris ausgerichtet und die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen des Portfolios auf 50 % der Emissionen der Benchmark erhöht. Das ESG-Alpha-Modell ist dasselbe wie vor der Umstellung, nur mit einer höheren Gewichtung. Zum Zeitpunkt der Umstellung wurde das Fundamental Investment Themes-Modell von dem früheren Alpha-Modell auf ein Modell umgestellt, das sich stärker auf langfristige (fünf Jahre oder mehr) Signale konzentriert, die dem Zeithorizont des Climate-Modells besser entsprechen.

Performance der Modelle: Nach der Umstellung auf einen Klimafokus im Februar bis Ende Dezember war die Gesamtperformance des Modells negativ. Das Fundamental Themes-Modell erzielte durch das Signal „Ertragsqualität“ positive Renditen. Das Climate-Modell erzielte negative Renditen, wobei sich das Signal „Temperaturanstieg“ am schlechtesten entwickelte. Das ESG-Modell erzielte leicht negative Renditen, wobei sich das Signal „Umwelt“ im Berichtszeitraum am schlechtesten entwickelte.

Aufschlüsselung der Performancebeiträge: Die Titelauswahl beeinträchtigte die Performance im bisherigen Jahresverlauf, wobei die Sektoren Energie, Grundstoffe und Informationstechnologie am stärksten betroffen waren. Das Portfolio verzeichnete eine positive Titelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienstleistungen und Nichtbasiskonsumgüter. Die Sektorallokation war im Berichtszeitraum positiv. Eine Übergewichtung im Sektor Gesundheitswesen leistete einen positiven Beitrag zur Performance, während eine Übergewichtung im Sektor Informationstechnologie die Performance belastete.

Aus der Länderperspektive war die Titelauswahl negativ, wobei die Auswahl im Vereinigten Königreich der Performance abträglich war und die Auswahl in den USA zur Performance beitrug. Die Länderallokation des Fonds war ebenso negativ, wobei eine Übergewichtung der Niederlande das Ergebnis belastete.

Aus Einzeltitelperspektive leisteten die untergewichteten Positionen des Fonds in einem US-amerikanischen Nichtbasiskonsumgüter-Unternehmen, einem US-amerikanischen Kommunikationsdienstleistungsunternehmen und einem US-amerikanischen Nichtbasiskonsumgüter-Unternehmen die größten Beiträge. Die Übergewichtungen des Fonds in einem niederländischen Unternehmen aus dem Pflegebereich, einem norwegischen Energieunternehmen und einem deutschen Industrieunternehmen belasteten das Ergebnis.

Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity) – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

Ausblick

Auch wenn wir nicht wissen, was das Jahr 2023 bringen wird, sind wir der Meinung, dass die jüngsten Verbesserungen des Prozesses unser Portfolio in die Lage versetzen, sich in dem unsicheren makroökonomischen Umfeld besser zu behaupten. Wir werden auch weiterhin alles daran setzen, unsere Prozesse und Strategien zu verbessern, um die Herausforderungen im Zusammenhang mit makroökonomischen Unsicherheiten und künftigen Marktschwankungen besser zu bewältigen. Es gibt keinen offensichtlichen Grund für die Annahme, dass sich das Umfeld in absehbarer Zeit ändern wird. Die Anleger schwanken 2023 zwischen der Hoffnung auf eine weiche Landung und der Angst vor einer Rezession in den USA.

Die Volatilität wird aller Wahrscheinlichkeit nach hoch bleiben, was die Bedeutung des Risikomanagements und insbesondere der Frage, wie wir unser Risiko gegenüber Marktschwankungen am besten steuern können, unterstreicht. Dies ist ein Research-Bereich, in dem wir uns entschieden engagieren werden. Wir konzentrieren uns auf die Bottom-up-Titelauswahl und versuchen nicht, Zinssätze, Sektoren, Länder, Laufzeiten oder andere allgemeine Faktoren zu timen oder in größerem Ausmaß von der Benchmark in Bezug auf einen dieser Faktoren abzuweichen.

Vom MSCI World Index abgesehen werden die abgebildeten Indizes vom Anlageverwalter ausschließlich zu Anschauungs- und Vergleichszwecken ausgewählt. Sie stellen keine formelle Benchmark dar und sind nicht Teil der Anlageziele oder der Anlagepolitik des Fonds.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kaufempfehlung ausgelegt werden

Numeric Investors LLC
200 Pier 4 Boulevard
5th Floor
Boston
MA 02210
USA

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Im Jahr 2022 hielt der starke Inflationsdruck in den meisten Ländern an, während die globalen Wachstumserwartungen allmählich nach unten korrigiert wurden. Der russische Einmarsch in die Ukraine trieb die Energiekosten in die Höhe und Chinas Null-Covid-Politik verzögerte die Normalisierung der Lieferkettenstörungen. Darüber hinaus führte die angespannte Lage auf dem Arbeitsmarkt dazu, dass die Lohnkosten hoch blieben und die Märkte eine stärkere Anhebung der Leitzinssätze einpreisten. Unter dem Einfluss des Krieges in der Ukraine schnellten die Rohstoffpreise in die Höhe, wenngleich der Preisanstieg im zweiten Halbjahr durch die schwächere Nachfrage gedämpft wurde, wobei sich die Energiepreise am stärksten auswirkten. Die Industrieländer und die Schwellenländer setzten den Straffungszyklus fort, und die Finanzmärkte fanden sich mit der Tatsache ab, dass eine geringere Wirtschaftstätigkeit eventuell kein Katalysator für moderate Änderungen der Geldpolitik mehr ist, da die geldpolitischen Entscheidungsträger das Risiko einer Rezession in Kauf nehmen, um die Inflation unter Kontrolle zu bringen. Die Renditen der US-Staatsanleihen stiegen und die US-Renditekurve flachte ab, während der USD gegenüber den meisten Währungen der Industrie- und Schwellenländer zulegte. Die Volatilität blieb im historischen Vergleich hoch.

Performance-Rückblick

Im Jahr 2022 verbuchte der Fonds eine negative Performance (nach Abzug von Gebühren), er konnte aber seine Benchmark übertreffen. Die relative Bruttooutperformance lag bei 8,75 %, wobei der größte Beitrag zur relativen Wertentwicklung von Engagements in lokalen Zinssätzen stammten, gefolgt von der Währungspositionierung. Der hohe Beitrag von lokalen Zinssätzen im Vergleich zu Währungen spiegelt die defensive Positionierung des Portfolios und die dynamische Anpassung der Engagements wider, wodurch von der höheren Marktvolatilität in einem Zeitraum profitiert werden sollte, in dem der Anstieg der Schwellenländerrenditen zu einem Verlust von 11,0 % im Index führte, während die Abwertung der Schwellenländerwährungen zu einem vergleichsweise geringeren Verlust von 6,1 % führte.

Die Länderauswahl war auch entscheidend für die Generierung von Alpha. Das Nullengagement des Fonds in Russland zum Zeitpunkt des Einmarsches in die Ukraine und seines Ausschlusses aus dem Index, trug am meisten zur Wertentwicklung bei. In ähnlicher Weise führte das Nullengagement in Ägypten (die zweitschlechteste Komponente im Index), zum zweitgrößten relativen Performancebeitrag, obwohl das Land im Index nur eine geringe Gewichtung hat. Auch die anfängliche Untergewichtung von Polen und Ungarn und die anschließende rechtzeitige Übergewichtung von HUF und PLN, nachdem sich die Bewertungen angepasst hatten, katapultierten diese Länder im Berichtszeitraum auf Platz 3 und 4 der Alpha-Quellen.

Auf der anderen Seite beeinträchtigten das Nullengagement in der Türkei und Kolumbien sowie die Untergewichtung von Chile die Wertentwicklung am stärksten. Trotz des starken Anstiegs bei diesen Anlagen, insbesondere gegen Ende des Jahres, behielten wir die Untergewichtung bei, da wir nicht der Meinung sind, dass das Risiko-Ertrags-Profil eine Erhöhung des Engagements rechtfertigt.

Der GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates Fund (der „Fonds“) begann das Jahr mit einer defensiven Positionierung, da wir der Ansicht waren, dass die wichtigsten Anlagethemen, die 2021 vorherrschend waren – die geld- und fiskalpolitische Normalisierung in den USA, das Risiko einer länger anhaltenden höheren Inflation und die erhöhte globale wirtschaftliche Ungewissheit aufgrund der Corona-Pandemie sowie die Herausforderungen, mit denen die chinesische Wirtschaft konfrontiert ist –, auch im Jahr 2022 eine Rolle spielen würden. Diese Faktoren kamen zu schwellenländerspezifischen Anfälligkeiten, wie der Schuldenüberhang in vielen Ländern, geopolitischen Unsicherheiten (Russland gegen den Westen/die Ukraine sowie Spannungen zwischen den USA und China), politischen Risiken aufgrund eines vollen Wahlkalenders und überlaufenen Märkten hinzu.

2022, als die Renditen stiegen, die Währungen der Schwellenländer fielen und die Marktpositionierung in den ausgewählten Anlagen sich verbesserte, nahmen wir Gewinne mit und reduzierten nach und nach die Untergewichtungen des Portfolios. Der größte Teil der Reduzierung erfolgte im März (als die Bewertungen der lokalen Zinssätze begannen, sich auf die Entwicklungen im Russland-Ukraine-Krieg und auf die Tatsache, dass die Reaktion der Zentralbanken auf den Konflikt eher in Richtung eines erhöhten Inflationsdrucks als in Richtung eines negativen Wachstumsschocks ging, einzustellen), im Juni (unter Berücksichtigung der starken USD-Bewegung und der negativen Positionierung in Bezug auf EMFX) und im Oktober (nach dem erheblichen Abverkauf von Schwellenländerwährungen im Vorfeld und im Anschluss an die September-Sitzung des Offenmarktausschusses). Im Juli und November, als der Anstieg der Bewertungen bestimmter Währungen oder lokaler Kurven über das hinaus ging, was unserer Meinung nach durch die Fundamentaldaten gerechtfertigt war, gewichteten wir das Portfolio neu bzw. reduzierten sein Engagement.

Zum 31. Dezember 2022 lag die Untergewichtung des durationsgewichteten Engagements (DWE) des Fonds bei -1,7 Jahren, nachdem die Untergewichtung Ende 2021 bei einem Tiefstand von -2,0 Jahren und im Mai bei einem Höchststand von -0,9 Jahren gelegen hatte. Die wichtigsten DWE-Engagements des Fonds waren eine Übergewichtung in Mexiko und Untergewichtungen in den ertragsschwachen Ländern China und Thailand, sowie in Südafrika, Malaysia und Kolumbien.

Bei den Währungen lag die Untergewichtung in den Schwellenländern zum 31. Dezember 2022 bei -12 %, wobei mit einer Untergewichtung von -18 % im Januar ein Tiefstand und im Juni, September und Oktober ein Stand von -9 % erreicht wurde. Die wichtigsten FX-Engagements des Fonds waren ein nicht in der Benchmark enthaltenes Engagement im SGD, eine Übergewichtung im PEN und Untergewichtungen in COP, MXN, CLP, MYR, BRL, EGP und TRY. Auch die Zusammensetzung der Über- und Untergewichtungen änderte sich im Laufe des Jahres erheblich, da das Team das Portfolio aufgrund von Änderungen bei den Bewertungen, den Fundamentaldaten und der Marktposition in bestimmten Währungen neu gewichtete.

Nach Ländern betrachtet ist hervorzuheben, dass der Fonds zum Zeitpunkt des Ausschlusses des Landes aus der Benchmark nicht in Russland engagiert war. Der Fonds war seit Anfang Dezember 2021 nicht mehr in Russland engagiert, da die Risiken militärischer Aktionen und von Sanktionen unseres Erachtens nicht angemessen eingepreist waren. Wir behielten das Nullengagement über die folgenden Monate bei, wobei die Bewertungen erst nach dem Einmarsch in die Ukraine korrigiert wurden. Die Gräueltaten im Kriegsgebiet, die damit verbundenen Sanktionen und die Erkenntnis, dass ein langer Krieg bevorstehen könnte, machten das Land unserer Meinung nach auf absehbare Zeit für Anlagen uninteressant. Angesichts des teuren realen effektiven Wechselkurses, der sich unseres Erachtens in einem Umfeld steigender globaler Zinssätze nicht halten konnte, hatte das Portfolio während des gesamten Jahres 2022 kein Engagement in

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

Ägypten. Bis jetzt wertete das Land seine Währung zweimal – im vierten Quartal 2022 – ab (und erhöhte die Zinssätze 2022 um 800 Bp auf 17,25 %). Dies trug schließlich dazu bei, dass es eine Fazilität des IWF in Höhe von 3 Mrd. USD erhielt, was zum Teil auf die im Oktober gegebene Zusage, ein flexibles Wechselkursystem einzurichten, zurückzuführen war. Der Fonds hat eine Nullgewichtung in der Türkei, da die Regierung eine Mischung aus unorthodoxer Geld-, Fiskal- und öffentlicher Bankenpolitik betreibt, die unserer Ansicht nach nicht nachhaltig ist. Im Oktober änderten wir die Marktgewichtung in Kolumbien in eine Nullgewichtung, nachdem Präsident Petro Kapitalverkehrskontrollen erwähnt hatte. Daneben haben wir auch Bedenken in Bezug auf die Fiskalregel.

Ausblick

Unserer Ansicht nach sind die Schwellenmarktschuldttitel immer noch mit Herausforderungen konfrontiert. Dabei sind die hohe Verschuldung, der geldpolitische Druck der Industrieländer, die strukturelle Verlangsamung Chinas und die immer noch ausgedehnte Marktpositionierung zu nennen. Darüber hinaus besteht das Risiko einer durch eine restriktivere Politik ausgelösten Rezession in den USA, während das Wachstum in Europa zu Beginn des Winters auf der Nordhalbkugel durch höhere Energiekosten sowie die negativen Auswirkungen der Eskalation des Krieges in der Ukraine beeinträchtigt wird.

Dennoch begannen ausgewählte Währungen und lokale Renditekurven, einen Mehrwert zu bieten. Die Bewertungsspannen sind im Vergleich zu den Zeiten der quantitativen Lockerung, als die leicht zugängliche Liquidität die Volatilität unterdrückte und die Korrelationen gegen eins konvergierten, viel breiter gestreut. Auf makroökonomischer Ebene sind ebenfalls erhebliche Unterschiede in den Wirtschaftsaussichten der Länder nach der Pandemie zu beobachten. Und schließlich wird die hohe Volatilität wahrscheinlich weiterhin zu Verwerfungen in der Kursfestsetzung führen und Anlagemöglichkeiten schaffen.

Wenn man all dies berücksichtigt, sind die Aussichten für Schwellenländeranleihen unserer Ansicht nach weit weniger einseitig als in den letzten Jahren. Daher sind wir überzeugt, dass ausgewogenere Portfolios mit Kombinationen aus Über- und Untergewichtungen, die versuchen, Alpha zu generieren, indem sie die Gewinner auswählen und die Verlierer meiden, erforderlich sein werden, um in diesem Umfeld zu bestehen. Der Anlageprozess des Teams ist so konzipiert, dass er das Beta-Risiko in Zeiten höherer Volatilität, z. B. an Wendepunkten des Marktzyklus, übertrifft, was nach Einschätzung des Teams auch in den kommenden Monaten der Fall sein wird.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

GLG LLC
452 Fifth Avenue
27th Floor
New York
NY 10018
USA

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Im Jahr 2022 hielt der starke Inflationsdruck in den meisten Ländern an, während die globalen Wachstumserwartungen allmählich nach unten korrigiert wurden. Der russische Einmarsch in die Ukraine trieb die Energiekosten in die Höhe und Chinas Null-Covid-Politik verzögerte die Normalisierung der Lieferkettenstörungen. Darüber hinaus führte die angespannte Lage auf dem Arbeitsmarkt dazu, dass die Lohnkosten hoch blieben und die Märkte eine stärkere Anhebung der Leitzinssätze einpreisten. Unter dem Einfluss des Krieges in der Ukraine schnellten die Rohstoffpreise in die Höhe, wenngleich der Preisanstieg im zweiten Halbjahr durch die schwächere Nachfrage gedämpft wurde, wobei sich die Energiepreise am stärksten auswirkten. Die Industrieländer und die Schwellenländer setzten den Straffungszyklus fort, und die Finanzmärkte fanden sich mit der Tatsache ab, dass eine geringere Wirtschaftstätigkeit eventuell kein Katalysator für moderate Änderungen der Geldpolitik mehr ist, da die geldpolitischen Entscheidungsträger das Risiko einer Rezession in Kauf nehmen, um die Inflation unter Kontrolle zu bringen. Die Renditen der US-Staatsanleihen stiegen und die US-Renditekurve flachte ab, während der USD gegenüber den meisten Währungen der Industrie- und Schwellenländer zulegte. Die Volatilität blieb im historischen Vergleich hoch.

Die Hartwährungsanleihen staatlicher und staatsnaher Stellen aus Schwellenländern verzeichneten einen Verlust. Die negative Performance war auf den Anstieg der Kernsätze in den Industrieländern zurückzuführen, wo die durchschnittliche Hartwährungsrendite um 2,84 % auf 7,77 % anstieg (-14,3 % US-Staatsanleihen-Rendite). Hinzu kam, dass sich die Spreads in den Schwellenländern um 0,44 % auf 3,74 % ausweiteten (-2,5 % Spread-Rendite). Der Investment-Grade-Sektor (IG) mit seiner längeren Duration entwickelte sich unterdurchschnittlich, obwohl der Hochzinssektor (HY) ebenfalls erhebliche Verluste (-18,4 % bzw. -13,5 %) verzeichnete, wobei die Rückzahlungsfähigkeit der Schwellenländer angesichts des hohen Verschuldungsgrads einiger dieser Länder und der immer schwieriger werdenden Refinanzierungsbedingungen im Vordergrund stand. Sri Lanka geriet im Mai mit seinen Auslandsschulden in Verzug. Im Juni konnte Russland und im Juli konnte Belarus die jeweiligen Auslandsschulden nicht mehr bedienen, da beide Länder durch die Sanktionen von den internationalen Finanzmärkten abgeschnitten sind. Ghana kündigte im Dezember die Aussetzung der Zahlungen für den Großteil seiner Auslandsschulden an.

Performance-Rückblick

Der GLG Global Emerging Bond Fund (der „Fonds“) begann das Jahr mit einer defensiven Positionierung, was durch ein durationsgewichtetes Engagement (DWE) und Untergewichtungen des Kreditspread-DWE (Spread-DWE) von -2,0 Jahren bzw. -2,2 Jahren zum Ausdruck kam, da wir der Ansicht waren, dass die wichtigsten Anlagethemen, die 2021 vorherrschend waren – die geld- und fiskalpolitische Normalisierung in den USA, das Risiko einer länger anhaltenden höheren Inflation und die erhöhte globale wirtschaftliche Ungewissheit aufgrund der Corona-Pandemie sowie die Turbulenzen, mit denen die chinesische Wirtschaft konfrontiert ist –, auch im Jahr 2022 eine Rolle spielen würden. Diese Faktoren kamen zu schwellenländerspezifischen Anfälligkeiten, wie der Schuldenüberhang in vielen Ländern, geopolitischen Unsicherheiten (Russland gegen den Westen/die Ukraine sowie Spannungen zwischen den USA und China), politischen Risiken aufgrund eines vollen Wahlkalenders und überlaufenen Märkten hinzu. Das Risikoengagement war eher auf das Hochzinssegment ausgerichtet.

Der Fonds war zum Zeitpunkt des Ausschlusses dieser Länder aus der Benchmark nicht in Russland und Belarus engagiert. Der Fonds hatte seit Anfang Dezember 2021 kein Engagement mehr in Russland, da wir der Ansicht waren, dass die Risiken militärischer Aktionen und von Sanktionen nicht angemessen eingepreist waren. Am 9. Februar setzten wir die Gewichtung der Ukraine auf null, um vom Anstieg des Schwellenmarktrisikos zu profitieren.

In Anbetracht des Anstiegs der Renditen der Industrieländer und der Ausweitung der Spreads der Schwellenländeranleihen während der ersten neun Monate des Jahres 2022, reduzierten wir diese Untergewichtungen bis September schrittweise von 1,2 Jahren bzw. 0,7 Jahren auf -0,8 Jahre bzw. -1,7 Jahre. Der größte Teil der Reduzierung der Kreditspread-Untergewichtungen erfolgte im März, als die Bewertungen begannen, sich auf die Entwicklungen im Russland-Ukraine-Krieg und auf die Tatsache, dass die Reaktion der Zentralbanken auf den Konflikt eher in Richtung eines erhöhten Inflationsdrucks als in Richtung eines negativen Wachstumsschocks ging, einzustellen, sowie im September. Das Engagement wurde insbesondere bei ausgewählten Titeln des Hochzinssegments, von Emittenten, die bereits unter Druck geraten waren, erhöht (Türkei, Südafrika, Ecuador, Argentinien, Angola, Pemex, Sri Lanka und Ukraine). Ebenso wurde die DWE-Untergewichtung im März und September am stärksten reduziert, als die Kernrenditen höher bewertet wurden.

Im vierten Quartal erhöhten wir die DWE-Untergewichtung hingegen um -1,1 Jahre, als wir die UST-Position des Fonds schrittweise abbauten, da wir die UST-Rallye im Berichtszeitraum als exzessiv ansahen. Darüber hinaus erhöhten wir die Kreditspread-DWE-Untergewichtung des Fonds um -0,6 Jahre, da wir die Rallye der EM-Spreads im Berichtszeitraum nicht für nachhaltig und mit den Fundamentaldaten vereinbar hielten. So reduzierten wir das Engagement in Ländern, die sich deutlich besser entwickelt hatten, wie Ecuador, Rumänien, die Dominikanische Republik, Angola und Mexiko. Auch in Kolumbien änderten wir im Oktober die Übergewichtung zu einer Nullgewichtung, da sich die unorthodoxen Äußerungen von Präsident Petro häuften, die auf Kapitalverkehrskontrollen hindeuteten und die politischen Risiken unter der neuen Regierung (einschließlich der Beibehaltung der Fiskalregel) in Verbindung mit einem hohen Leistungsbilanzdefizit verschärften. Wir hatten Ägypten im Mai aufgrund unserer negativen Einschätzung der Fundamentaldaten des Landes aus dem Portfolio gestrichen, erhöhten das Engagement im Oktober aber auf Marktgewichtung, nachdem das Land eine Abwertung seiner Währung zuließ und damit die Verhandlungen über ein IWF-Abkommen vorantrieb. In ähnlicher Weise änderten wir Ghana von Nullgewichtung in Marktgewichtung, da die Ausfallrisiken in die Bewertungen eingepreist wurden.

Zum 31. Dezember 2022 wies der Fonds ein durationsgewichtetes Engagement (DWE) und eine Untergewichtung des Kreditspread-DWE (Spread-DWE) von -1,9 Jahren bzw. -2,1 Jahren auf. Der größte Teil der Untergewichtung der Spreadduration entfiel auf den IG-Bereich (-1,3 Jahre), wobei die größten Untergewichtungen in China (-0,4 Jahre) und der GCC-Region (-0,7 Jahre) zu verzeichnen waren. Die Untergewichtung von HY lag bei -13,8 % (gegenüber -8,9 % im September), was auf die Untergewichtung (kein Engagement) in der Türkei¹ (-6,9 %) zurückzuführen war, wo wir hohe idiosynkratische Risiken sehen.

2022 erzielte der Fonds nach Abzug von Gebühren eine Rendite von -9,78 % und übertraf damit seine Benchmark² um +6,68 %, wobei der Fonds in jedem Quartal mit Ausnahme des vierten Quartals 2022 ein positives Alpha generierte. Die relative Bruttoperformance lag bei +7,31 %. Mit Ausnahme des vierten Quartals 2022, als sich die Hartwährungsanleihen aus Schwellenländern erholten, unterstützte sowohl die Untergewichtung des Spread-DWE als auch des DWE die relative Wertentwicklung. Nach Ländern betrachtet war das Nullengagement

¹ Aufgrund unserer negativen Einschätzung der Fundamentaldaten des Landes stiegen wir im Juni aus der Türkei aus.

² J.P. Morgan EMBI Global Composite (Bloomberg-Ticker: JPEGCOMP Index)

Man GLG Global Emerging Markets Bond – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

in Russland die größte einzelne Alpha-Quelle. Darüber hinaus waren die Nullgewichtung der Ukraine (drittschlechtesten Performer im GJ 2022 nach Russland und Belarus) und von Belarus zu Beginn des Krieges, die Titelauswahl in Indonesien, Mexiko, Chile und den Vereinigten Arabischen Emiraten sowie die Untergewichtung in Ägypten und Ghana zu dem Zeitpunkt, als die Anleihen am stärksten unter Druck standen, ebenfalls wichtige Alpha-Quellen. Dagegen waren die Untergewichtung in der Türkei, Bahrain, China und Brasilien, die eine Outperformance erzielten, sowie die Titelauswahl und die Übergewichtung in Ecuador im dritten Quartal 2022 die größten Belastungsfaktoren.

Ausblick

Unserer Ansicht nach sind die Schwellenmarktschuldttitel immer noch mit Herausforderungen konfrontiert. Dabei sind die hohe Verschuldung, der geldpolitische Druck der Industrieländer, die strukturelle Verlangsamung Chinas und die immer noch ausgedehnte Marktpositionierung zu nennen. Darüber hinaus besteht das Risiko einer durch eine restriktivere Politik ausgelösten Rezession in den USA, während das Wachstum in Europa zu Beginn des Winters auf der Nordhalbkugel durch höhere Energiekosten sowie die negativen Auswirkungen der Eskalation des Krieges in der Ukraine beeinträchtigt wird.

Allerdings haben mehrere staatliche HY-Emittenten aus den Schwellenländern begonnen, einen Mehrwert zu bieten, während die Bewertungsspannen in der EMD-Anlageklasse im Vergleich zur Phase der quantitativen Lockerung, als die leicht zugängliche Liquidität die Volatilität unterdrückte und die Korrelationen gegen eins konvergierten, viel breiter gestreut waren. Auf makroökonomischer Ebene sind ebenfalls erhebliche Unterschiede in den Wirtschaftsaussichten der Länder nach der Pandemie zu beobachten. Und schließlich wird die hohe Volatilität wahrscheinlich weiterhin zu Verwerfungen in der Kursfestsetzung führen und Anlagemöglichkeiten schaffen. Wenn man all dies berücksichtigt, sind die Aussichten für Schwellenländeranleihen unserer Ansicht nach weit weniger einseitig als in den letzten Jahren. Daher sind wir überzeugt, dass ausgewogenere Portfolios mit Kombinationen aus Long-/Short-Engagements, die versuchen, Alpha zu generieren, indem sie die Gewinner auswählen und die Verlierer meiden, erforderlich sein werden, um in diesem Umfeld zu bestehen.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

GLG LLC
452 Fifth Avenue
27th Floor
New York
NY 10018
USA

Man GLG Pan European Equity Growth – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Die Inflation und die Renditen der Staatsanleihen stiegen deutlich stärker, als wir zu Beginn des Jahres erwartet hatten. Wir unterschätzten daher das Ausmaß, in dem das Portfolio im Jahr 2022 einer Multiplikatorenkompression unterworfen sein würde – eine Bewertungsrücknahme, die heftiger ausfiel, als wir erwartet hatten. Das Portfolio wurde im Kalenderjahr 2022 erheblich durch Auswirkungen eines höheren risikofreien Renditesatzes in Mitleidenschaft gezogen. Die Renditen zehnjähriger US-Staatsanleihen stiegen um 2,4 Prozentpunkte, wodurch der risikofreie Renditesatz und damit auch der Abzinsungssatz, der zur Berechnung des Werts der zukünftigen freien Cashflows in heutigem Geld verwendet wird, anstiegen, was zu einem Abwärtsdruck auf den Barwert führte.

Performance-Rückblick

2022 war ein besonders schwieriges Jahr für den Fonds. Der Anteilspreis fiel im Laufe des Jahres und verzeichnete somit einen überdurchschnittlichen Rückgang im Vergleich zum Referenzindex¹.

Zwanzig der heute siebenundzwanzig Aktienportfolios verbuchten im Jahr 2022 einen stärkeren Kursrückgang als der Referenzindex. Da sie mehr als zwei Drittel des Portfolios ausmachten, überwogen ihre negativen Auswirkungen den positiven Beitrag der sieben Positionen, die die Benchmark übertrafen, darunter Novo Nordisk und AstraZeneca, die absolute Gewinne von 28 bzw. 29 Prozent erzielten. Die fünf größten Verlustbringer im Zuge der negativen Wertentwicklung des vergangenen Jahres waren Vitrolife, Puma, Delivery Hero, Dr. Martens und Adyen, die erhebliche Kursrückgänge von 67 %, 47 %, 54 %, 55 % bzw. 44 % verzeichneten.

Die Wertentwicklung des Fonds im Jahr 2022 wurde auch durch das Regionen- und Sektorenprofil des Portfolios beeinträchtigt. Das geringe Engagement im Vereinigten Königreich im Vergleich zur Benchmark stellte ein Gegenwind für die relativen Renditen dar. Das Nullengagement im Energie- und im Bankensektor beeinträchtigte die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zur Benchmark ebenfalls.

Die negative Wertentwicklung des letzten Jahres wurde durch die starke Performance einiger der größten Beteiligungen des Fonds gemildert, wobei Novo Nordisk, LVMH und Chr. Hansen sich 2022 jeweils einer robusten relativen Wertentwicklung erfreuen konnten. Die seit langem gehaltene Position in Chr. Hansen wurde im Dezember durch ein Aufschlagsangebot für alle Aktien des benachbarten Unternehmens Novozymes beflügelt.

Der Zeitpunkt der Aufnahme der neuen Positionen Hermès und Assa Abloy ermöglichte, dass auch diese einen positiven relativen Beitrag zur Wertentwicklung leisten konnten. Die Entscheidung, in den letzten vier Monaten des Jahres 2021 eine Reihe von Emerging-Winner-Positionen des Portfolios zu veräußern, trug ebenfalls dazu bei, weitere Einbußen des Fonds im Jahr 2022 zu vermeiden. Tatsächlich blieb das Engagement in dieser Kategorie im Jahr 2022 im historischen Vergleich gering und machte am Jahresende sieben Prozent des Fonds aus, was dem niedrigsten Stand aller Zeiten entspricht.

Die Portfoliotätigkeit wurde 2022 durch die Priorität bestimmt, die wir den Positionen des Fonds mit dem höchsten Überzeugungsgrad einräumten. Die Volatilität des vergangenen Jahres bot gute Gelegenheiten, diese Bestände zu attraktiveren Preisen aufzustoßen. Die Gewichtungen von Novo Nordisk, LVMH, L'Oréal, Nestlé und Abcam wurden 2022 erhöht und Teil der zehn größten Positionen, auf die zum Jahresende 58 Prozent des Fonds entfielen, im Vergleich zu 55 Prozent zu Beginn des Jahres. Im vergangenen Jahr wurden fünf relativ unbedeutende Positionen verkauft, während nur zwei neue Positionen (Hermès und Assa Abloy) in das Portfolio aufgenommen wurden, so dass die Zahl der Positionen von 30 auf 27 zurückging.

Wir haben die Unternehmen mit der stärksten Wettbewerbsposition, der besten Erfolgsbilanz und der solidesten Finanzlage priorisiert, was zu dem bisher höchsten Engagement in der Kategorie „Established Leader“ geführt hat. Trotz oder gerade wegen der gegenwärtigen geopolitischen und wirtschaftlichen Turbulenzen ist unsere Ansicht bezüglich der Aufnahme dieser Unternehmen ins Portfolio positiver, was durch die Beständigkeit ihrer jüngsten Ergebnisse unterstützt wird.

Ausblick

Dieser Bericht dürfte deutlich gemacht haben, dass wir mit gestärkter Zuversicht bezüglich der grundlegenden Vorzüge des Portfolios in das Jahr 2023 gehen. Die enttäuschende Wertentwicklung des letzten Jahres war fast ausschließlich auf die Multiplikatorenkompression zurückzuführen und nicht auf eine Verschlechterung der zugrunde liegenden Geschäftsbereiche der im Fonds enthaltenen Unternehmen. Dies spiegelt sich sowohl in dem geringen Portfolioumschlag als auch darin wider, dass die Ergebnisse der Portfoliounternehmen uns in der Regel dazu veranlassen, unsere Zahlen für das GJ22 nach oben zu korrigieren. Wir sind beeindruckt von ihren Marktanteilsgewinnen, ihrer Preissetzungsmacht, ihrer breiten regionalen Aufstellung, ihren neuen Produkten, ihrer Margenbeständigkeit und ihrer Bilanzstärke. Diese Eigenschaften werden 2023 aller Wahrscheinlichkeit nach von entscheidender Bedeutung sein.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

¹ Der MSCI Europe NDTR Index ist eine offizielle Benchmark für diesen Fonds.

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Die Wertentwicklung während des Jahres war sowohl absolut als auch relativ gesehen enttäuschend. Die Inflation hatte sich bereits beschleunigt und wurde durch den Ausbruch des Krieges zwischen Russland und der Ukraine noch verschärft. Auch die Null-Covid-Politik in China belastete die Märkte. Die steigende Inflation veranlasste die Zentralbanken in der ganzen Welt, die Zinssätze im Laufe des Jahres anzuheben. Die US-Notenbank (Fed) z. B. hob die Zinssätze von nahe null auf die heutige Spanne von 4,25-4,5 % an. Dies wirkte sich im vergangenen Jahr negativ auf die Aktienbewertungen aus. Eine höhere risikofreie Rendite und folglich ein höherer Abzinsungssatz, mit dem der Markt den heutigen Wert künftiger Cashflows beurteilt, führten zu einer starken Korrektur der Bewertungen.

Performance-Rückblick

Der Fonds beendete das Geschäftsjahr mit einem Rückgang und blieb somit hinter seiner Benchmark¹ zurück. Wir waren von der Geschwindigkeit und dem Umfang dieser Korrektur überrascht. Wir waren davon ausgegangen, dass sich diese Entwicklung über einen viel längeren Zeitraum erstrecken und durch das Gewinnwachstum unserer Beteiligungen leichter aufgefangen werden würde. Als langfristige Investoren setzen wir mit unserer Strategie auf Unternehmen, die in den kommenden Jahren ein erhebliches Ertragswachstumspotenzial haben. Die Bewertungen dieser Erträge und Cashflows unterliegen nun höheren Abzinsungssätzen. Nicht rentable Unternehmen, deren Bewertungen vollständig von potenziellen künftigen Cashflows abhängen, wurden am stärksten in Mitleidenschaft gezogen.

Obwohl wir unser Engagement in Unternehmen, die noch nicht rentabel geworden waren, bereits im letzten Jahr reduziert hatten, hätte unsere Vorgehensweise aggressiver sein müssen. Aufgrund ihrer starken Wettbewerbspositionen, der zuvor starken Aktienkurse und der erstklassigen Bewertungen litten auch andere Beteiligungen des Portfolios überproportional unter dem mehrfachen Reset, dem die Aktien im letzten Jahr ausgesetzt waren. In mehreren Fällen, in denen wir der Meinung waren, dass der Markt zu weit gegangen war, nutzten wir die attraktiven Preise, um diese Positionen aufzustoocken. Wir begannen das letzte Jahr mit 32 Beteiligungen und beendeten es mit 28. Auch wenn die schlechte Performance des Fonds größtenteils auf den Reset der Bewertungen zurückzuführen ist und nicht auf eine mangelhafte Wertpapierauswahl oder fundamentale Probleme bei unseren Titeln, haben wir im Laufe des Jahres dennoch einige Anpassungen vorgenommen.

Erstens stockten wir die Bestände an Titeln auf, bei denen wir am meisten davon überzeugt sind, dass sie das Ertragswachstum auch in einem Inflations- und möglicherweise Rezessionsumfeld unterstützen können. Dementsprechend stockten wir unter anderem die Bestände in Novo Nordisk, Visa, L'Oréal und SAP auf. Wir nahmen auch neue Titel in das Portfolio auf, die unserer Meinung nach auch in einem schwierigen makroökonomischen Umfeld eine hohe Widerstandsfähigkeit in Kombination mit Wachstumschancen bieten. Dazu gehören Cooper Companies, Thermo Fisher Scientific und Schneider Electric. Wir finanzierten diese Anlagen, indem wir aus Positionen ausstiegen, bei denen wir von einem anfälligeren Ertragswachstum ausgingen, wie Dr. Martens, MYT Netherlands, Ocado, Progyny, Qualtrics, Illumina und Logitech. Zweitens hat sich das Sektorprofil des Fonds teilweise als Folge der oben genannten Portfolioaktivität geändert.

Die Übergewichtung des Fonds im Gesundheitswesen ist viel ausgeprägter und ging zu Lasten von Informationstechnologie und zyklischen Konsumgütern. Drittens machte die Kategorie, die wir als Tier 2 bezeichnen, Ende Dezember 22 % des verwalteten Vermögens (AUM) aus, im Vergleich zu 24 % zu Beginn des Jahres 2022. Tier 2 umfasst Unternehmen, die entweder noch nicht rentabel sind (Delivery Hero bleibt die einzige nicht rentable Beteiligung des Fonds) oder Verbesserungspotenzial in Bezug auf ESG-Kennzahlen oder Angaben zu den Treibhausgasemissionen („THG“) haben. Um das Risiko zu steuern, ist das Engagement des Fonds in dieser Kategorie strikt auf 40 % seines verwalteten Vermögens begrenzt, während die Kernkategorie immer mindestens 60 % entsprechen muss. Tier 2 ist auch die Kategorie, auf die wir unsere Mitwirkungsaktivitäten konzentrieren. Diese Bemühungen zielen vor allem darauf ab, die Angaben zu den Treibhausgasemissionen in allen drei Bereichen zu verbessern, da wir dies als ersten Schritt zur Rechenschaftspflicht betrachten, die letztendlich zu Reduktionszielen führen sollte. Wir freuen uns, berichten zu können, dass die gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität des Fonds von 20,4 Tonnen CO₂-Äquivalent pro Million USD Einnahmen im Vergleich zum Benchmark-Wert von 160,5 Tonnen CO₂-Äquivalent pro Million USD sehr positiv ist.

Ausblick

Zwar glauben wir, dass wir bei den Bewertungskorrekturen das Schlimmste hinter uns gelassen haben, wir bleiben dennoch zurückhaltend. Die Inflation mag ihren Höhepunkt überschritten haben, doch der Weg zum Inflationsziel von 2 % der Fed ist noch lang. Es wird signalisiert, dass der Höchststand der Leitzinssätze noch vor uns liegt, was bedeutet, dass der mechanische Druck auf die Bewertungen anhalten könnte. In unseren dreijährigen Kurszielen ist weiterhin Gegenwind für die Bewertungen berücksichtigt. Daher muss die Wertentwicklung von nun an von der zugrunde liegenden Ertragskraft unserer Bestände getragen werden, was bedeutet, dass eine präzise Titelauswahl im Jahr 2023 entscheidend ist. Wir sind der Ansicht, dass die Portfoliounternehmen über die Preisgestaltungsmacht, die Kaufkraft und die Bilanzstärke verfügen, um ein Umfeld zu meistern, das durch anhaltende Inflation und hohe Zinsen gekennzeichnet ist. Darüber hinaus dürften viele der von uns gehaltenen Titel von der Widerstandsfähigkeit der Umsätze in einem Rezessionsumfeld profitieren. Nach einem schwierigen Jahr 2022 gehen wir mit vorsichtiger Zuversicht in das Jahr 2023, wobei wir uns auf unser Verständnis der Vorzüge der zugrunde liegenden Portfoliounternehmen stützen.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden. Die Gewichtungen können sich jederzeit ändern.

¹ Der MSCI World NDTR Index ist eine offizielle Benchmark für diesen Fonds. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Prospekt und den wesentlichen Anlegerinformationen.

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Nach einer lang anhaltenden Rallye seit dem Tiefpunkt der Covid-19-Krise im März 2020 legten die Märkte schließlich eine Verschnaufpause ein: Der MSCI World Index fiel im ersten Quartal 2022 um 5,2 %. Das Jahr begann mit guten Ergebnissen im vierten Quartal, guten Beschäftigungszahlen und einer Abnahme der Zahl der Covid-19-Fälle optimistisch. Die Wirtschaft war jedoch nicht in der Lage, die hohe Inflation abzufedern, und da die Fed aggressive Maßnahmen andeutete, drehten die Märkte, und der MSCI World Index beendete den Monat Januar mit -5,3 %.

Im Februar setzten die Märkte ihre Talfahrt nach dem Einmarsch Russlands in die Ukraine fort und wurden durch die Unsicherheit über die geopolitische Positionierung Chinas und die Angst vor Offshore-Delistings weiter verschärft. Im März schüttelten die Märkte diese Sorgen schließlich mit einer Erholung des MSCI World Index um 2,7 % ab, nachdem sich die chinesischen Behörden marktfreundlich geäußert hatten. Aus Sicht der Performance von ESG-Faktoren war das erste Quartal 2022 für ESG-orientierte Strategien der perfekte Sturm. Nach einer starken relativen Rendite im Jahr 2021 blieben die ESG-Indizes im ersten Quartal hinter Fonds mit Standard-Strategien zurück.

Die Gefahr einer anhaltenden Inflation ist im zweiten Quartal 2022 real geworden. Die Märkte reagierten, wie es zu erwarten war, und die Anleger verkauften alles, was ihnen riskant erschien. Der MSCI World Index fiel um 16,2 % und tendierte über weite Strecken des Quartals abwärts. Ungeachtet kurzer Mini-Erholungen Mitte Mai und Mitte Juni beendeten die Märkte das Quartal nahe neuen Jahrestiefständen. Angesichts des düsteren makroökonomischen Umfelds, der ausufernden Inflation und einer drohenden Rezession war dies für die Anleger sicherlich keine einfache Zeit. Aus Sicht der Faktor-Performance war es vor dem Hintergrund steigender Zinsen nicht überraschend, dass die Wertentwicklung im Substanzbereich weiterhin positiv war. Die Faktor-Ergebnisse in der ersten Jahreshälfte entsprechen fast genau dem, was man erwarten konnte. Nach einem schwachen ersten Quartal erholte sich der MSCI US ESG Index im Vergleich zu seinem Standard-Pendant wieder. Außerhalb der USA (EAFE und EM) entwickelten sich die MSCI ESG-Indizes jedoch weiterhin unterdurchschnittlich.

Das dritte Quartal 2022 begann recht optimistisch mit einem Anstieg der Märkte, nachdem diese im Vorquartal aufgrund von Unternehmensgewinnen, die höher als erwartet ausfielen, nachgegeben hatten. Gegen Ende Juli ließen die Wirtschaftsindikatoren jedoch Besorgnis erkennen, so dass sich der Ausblick der Anleger eintrübte und der Markt im Quartal in den negativen Bereich rutschte.

Auch im vierten Quartal blieben alle Augen auf die Politik der US-Notenbank (Fed) gerichtet, und die Anleger, die sichtlich verzweifelt darauf warteten, dass der Markt die Talsohle erreichte, gingen bei den geringsten Anzeichen einer Verlangsamung der US-Wirtschaft auf Kaufout. Vor allem die unter den Erwartungen liegenden Inflationszahlen vom 10. November lösten eine extreme Zunahme der Risikobereitschaft aus. Trotz einer geringeren Zinsanhebung im Dezember hat die Fed aber noch keine deutliche Verlangsamung ihrer aggressiven geldpolitischen Straftung signalisiert, was ein anhaltend instabiles Umfeld schafft. In den Schwellenländern wurde die Marktvolatilität durch die Erwartung verstärkt, dass China seine Corona-Beschränkungen lockern würde, was am 5. Dezember erneut als Katalysator für eine starke Risikorally wirkte.

Im Gesamtzeitraum seit Jahresanfang ist der MSCI World Index in den Industrieländern um 18,1 % gefallen, während der S&P 500 Index seit Jahresanfang ebenfalls 18,1 % eingebüßt hat. In den Industrieländern ist ansonsten der MSCI Japan Index um 4,5 % gefallen und der MSCI Europe Index hat im Berichtszeitraum in EUR 9,5 % eingebüßt. Im Schwellenmarktbereich fiel der MSCI Emerging Markets Index in USD um 20,1 %. Der MSCI China A Index ist seit Jahresbeginn um 25,9 % in USD gefallen.

Performance-Rückblick

Im Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 erzielte der Man Numeric Europe RI Climate Fund eine negative Rendite (nach Abzug von Gebühren) und blieb damit hinter seiner Benchmark zurück.

Im Februar 2022 wurde der Fonds von Man Numeric RI European Equity auf Man Numeric Europe RI Climate umgestellt. Ziel dieser und anderer Klimastrategien von Man Numeric ist es, sich gegen die Risiken des Klimawandels abzusichern, die Alpha-Chancen des Übergangs zu sauberer Energie zu nutzen und ein positives Engagement in ESG- und fundamentalen Anlagekonzepten über einen vollständig systematischen Prozess aufrechtzuerhalten. Der Fonds umfasst eine Reihe komplementärer Alpha-Modelle, die an Klima, ESG und fundamentale Anlagethemen gebunden sind, um ein Portfolio aufzubauen, das eine ganzheitliche Sicht der Welt umfasst. Das vielschichtige Climate-Alpha-Modell wurde bei der Umstellung im Februar 2022 neu in die Strategie aufgenommen. Damit wurde die Strategie auf das 2-Grad-Ziel des Abkommens von Paris ausgerichtet und die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen des Portfolios auf 50 % der Emissionen der Benchmark erhöht. Das ESG-Alpha-Modell ist dasselbe wie vor der Umstellung, nur mit einer höheren Gewichtung. Zum Zeitpunkt der Umstellung wurde das Fundamental Investment Themes-Modell von dem früheren Alpha-Modell auf ein Modell umgestellt, das sich stärker auf langfristige (fünf Jahre oder mehr) Signale konzentriert, die dem Zeithorizont des Climate-Modells besser entsprechen.

Performance der Modelle: Nach der Umstellung auf einen Klimafokus im Februar bis Ende Dezember war die Gesamtperformance des Modells negativ. Das Modell „Fundamental Themes“ erzielte negative Renditen, die durch das Signal „Langfristiger Fokus“ verursacht wurden. Das Climate-Modell erzielte negative Renditen, wobei sich das Signal „Temperaturanstieg“ am schlechtesten entwickelte. Das ESG-Modell erzielte positive Renditen, wobei sich das Signal „Soziales“ im Berichtszeitraum am besten entwickelte.

Aufschlüsselung der Performancebeiträge: In Bezug auf die Sektoren war die Titelauswahl negativ und die Sektorauswahl leicht negativ. Die Titelauswahl in den Bereichen Gesundheit und Energie belastete das Ergebnis am meisten. Innerhalb der Sektorallokation wirkte sich eine Untergewichtung des Finanzsektors negativ aus, während eine Übergewichtung des Immobiliensektors positiv zur Performance beitrug.

Aus der Länderperspektive betrachtet belastete eine negative Titelauswahl das Ergebnis. Den größten Verlust verursachte die nachteilige Titelauswahl im Vereinigten Königreich. Auf Länderebene war das Ergebnis der Gewichtungen ebenfalls negativ, wobei eine Übergewichtung im Vereinigten Königreich die Performance beeinträchtigte und eine Übergewichtung in Norwegen zur Performance beitrug.

Bei den Einzeltiteln beeinträchtigten die Übergewichtung eines niederländischen und eines schwedischen Unternehmens aus dem Pflegebereich sowie eines britischen Nichtbasiskonsumgüter-Unternehmens die Wertentwicklung des Fonds am meisten. Die drei Titel, die am meisten zur Performance beitrugen, waren eine Übergewichtung in einem schwedischen und in einem niederländischen Industrieunternehmen sowie in einem britischen Nichtbasiskonsumgüter-Unternehmen.

Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity) – Kommentar zum Jahresbericht
(Fortsetzung)

Ausblick

Auch wenn wir nicht wissen, was das Jahr 2023 bringen wird, sind wir der Meinung, dass die jüngsten Verbesserungen des Prozesses unser Portfolio in die Lage versetzen, sich in dem unsicheren makroökonomischen Umfeld besser zu behaupten. Wir werden auch weiterhin alles daran setzen, unsere Prozesse und Strategien zu verbessern, um die Herausforderungen im Zusammenhang mit makroökonomischen Unsicherheiten und künftigen Marktschwankungen besser zu bewältigen. Es gibt keinen offensichtlichen Grund für die Annahme, dass sich das Umfeld in absehbarer Zeit ändern wird. Die Anleger schwanken 2023 zwischen der Hoffnung auf eine weiche Landung und der Angst vor einer Rezession in den USA.

Die Volatilität wird aller Wahrscheinlichkeit nach hoch bleiben, was die Bedeutung des Risikomanagements und insbesondere der Frage, wie wir unser Risiko gegenüber Marktschwankungen am besten steuern können, unterstreicht. Dies ist ein Research-Bereich, in dem wir uns entschieden engagieren werden. Wir konzentrieren uns auf die Bottom-up-Titelauswahl und versuchen nicht, Zinssätze, Sektoren, Länder, Laufzeiten oder andere allgemeine Faktoren zu timen oder in größerem Ausmaß von der Benchmark in Bezug auf einen dieser Faktoren abzuweichen.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kaufempfehlung ausgelegt werden

Numeric Investors LLC
200 Pier 4 Boulevard
5th Floor
Boston
MA 02210
USA

Zusammenfassung der Marktentwicklung

2022 spielten makroökonomische Ereignisse auf den europäischen Märkten eine maßgebliche Rolle. Die straffe Geldpolitik der US-Notenbank zur Senkung der Inflation bei gleichzeitiger Aufrechterhaltung des Aufschwungs nach Corona veranlasste die Anleger dazu, Substanz- gegenüber Wachstumsaktien zu bevorzugen, was zu einer der größten Faktorrotationen der letzten zehn Jahre führte. Seit Ende Februar wird die europäische Wirtschaft durch den Krieg zwischen Russland und der Ukraine beeinträchtigt, dessen endgültige Lösung noch in weiter Ferne zu liegen scheint. Der Anstieg der Energiepreise, unerwartet hohe Inflationszahlen und weitere Zinserhöhungen durch die Zentralbanken führten im zweiten und dritten Quartal zu einem starken Abverkauf an den Märkten, höheren Renditen und Volatilität.

Der Markt begann sich im vierten Quartal zu erholen, als die Inflation allmählich zurückging, der Druck aus dem Energie- und Frachtbereich nachließ und die Erwartungen einer gemäßigeren Geldpolitik zunahm. Es gibt jedoch offensichtliche Anzeichen für eine Konjunkturabschwächung, wie etwa drohende Korrekturen der Gewinnprognosen und steigende Arbeitslosenzahlen, die ein bedachtes Vorgehen erfordern.

Performance-Rückblick

Vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 verbuchte der Teilfonds eine negative Performance, wobei er sich größtenteils parallel zu seinem Referenzindex (MSCI Europe) entwickelte. Der Teilfonds hat seine Geschäftstätigkeit am 20. Januar 2023 eingestellt.

Den größten positiven Beitrag zur Performance leistete ein nordeuropäisches Energieunternehmen (das „Unternehmen“). Nach der Intervention des deutschen Staates in einen privaten deutschen Energiekonzern, der seine Rolle als wichtiger Anbieter von Versorgungssicherheit nicht mehr erfüllen konnte, legten die Aktien des oben genannten Unternehmens im September um 34 % zu. Angesichts höherer Gaspreise, die einen Liquiditätssengpass auslösten, zeichnete der deutsche Staat eine Kapitalerhöhung des deutschen Energiekonzerns in Höhe von 8 Mrd. EUR und erklärte sich bereit, den gesamten Aktienbesitz des Unternehmens an dem deutschen Energiekonzern zum Preis von 0,5 Mrd. EUR zu übernehmen. Im Rahmen der Vereinbarung sollte das 4-Milliarden-Euro-Darlehen des Unternehmens an den deutschen Energiekonzern zurückgezahlt und die Bürgschaft der Muttergesellschaft des Unternehmens freigegeben werden.

Durch diese Entwicklung wurde das Investitionsrisiko für das Unternehmen erheblich gesenkt, da der Gesamtverlust der Investition des deutschen Energiekonzerns begrenzt wurde und das Unternehmen sich wieder auf sein Kerngeschäft, die Erzeugung von sauberer Energie in Nordeuropa, konzentrieren konnte. Das Unternehmen hat auch bestätigt, dass sein Eigenkapital weiterhin ausreichend ist und dass es keine zusätzlichen Kapitalzuführungen benötigt.

Unterdessen beeinträchtigte eine britische Fluggesellschaft (das „Unternehmen“) die Wertentwicklung am meisten. Die Aktien entwickelten sich deutlich unterdurchschnittlich, da die Beteiligung am „Wiedereröffnungs“-Handel schlechter ausfiel als bei anderen Unternehmen und sich die Kapazitäten langsamer als erwartet erholten. Das Unternehmen hatte höhere Kosten, wobei die Inflation der Betriebsausgaben die höheren Treibstoffpreise und Flughafengebühren widerspiegelte. Während die Preisgestaltung weiterhin stark blieb, führten die insgesamt negativen Auswirkungen zu Korrekturen der Gewinnprognosen.

Dennoch ist das Team davon überzeugt, dass die von der Geschäftsleitung eingeleiteten Umstellungsmaßnahmen erfolgreich sein werden. Insbesondere hat das Unternehmen mit der Optimierung des Netzes begonnen, wobei die Sitzplätze auf stärkere und profitablere Märkte und Slots umverteilt wurden. Außerdem änderte es seinen Ansatz für das Management von Zusatzleistungen, indem es die Richtlinien für Handgepäck und aufgegebenes Gepäck überarbeitete, was dazu führte, dass der Anteil der Zusatzleistungen an den Einnahmen von bisher rund 20 % auf rund 30 % anstieg. Schließlich bewertet es die Lohnkosten jetzt produktivitäts- und saisonabhängig, was zu erheblichen Einsparungen führen kann.

Ausblick

Angesichts der nun anhaltenden Anzeichen von Inflation ist das Team der Ansicht, dass eine Rezession eintreten könnte. Wir sind der Meinung, dass sich die Anleger auf einen Zeitraum mit niedrigeren Renditen – insbesondere niedrigeren Realrenditen (d. h. inflationsbereinigt) – und höherer Volatilität im Vergleich zum vorherigen Zyklus einstellen sollten. Unser Ziel ist es, dass der Fonds über einen Konjunkturzyklus hinweg weiterhin eine bessere Performance als der Markt erzielt.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

Man Numeric China A Equity – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Nach einer lang anhaltenden Rallye seit dem Tiefpunkt der Covid-19-Krise im März 2020 legten die Märkte schließlich eine Verschnaufpause ein: Der MSCI World Index fiel im ersten Quartal 2022 um 5,2 %. Das Jahr begann mit guten Ergebnissen im vierten Quartal, guten Beschäftigungszahlen und einer Abnahme der Zahl der Covid-19-Fälle optimistisch. Die Wirtschaft war jedoch nicht in der Lage, die hohe Inflation abzufedern, und da die Fed aggressive Maßnahmen andeutete, drehten die Märkte, und der MSCI World Index beendete den Monat Januar mit -5,3 %.

Im Februar setzten die Märkte ihre Talfahrt nach dem Einmarsch Russlands in die Ukraine fort und wurden durch die Unsicherheit über die geopolitische Positionierung Chinas und die Angst vor Offshore-Delistings weiter verschärft. Im März schüttelten die Märkte diese Sorgen schließlich mit einer Erholung des MSCI World Index um 2,7 % ab, nachdem sich die chinesischen Behörden marktfreundlich geäußert hatten. Aus Sicht der Performance von ESG-Faktoren war das erste Quartal 2022 für ESG-orientierte Strategien der perfekte Sturm. Nach einer starken relativen Rendite im Jahr 2021 blieben die ESG-Indizes im ersten Quartal hinter Fonds mit Standard-Strategien zurück.

Die Gefahr einer anhaltenden Inflation ist im zweiten Quartal 2022 real geworden. Die Märkte reagierten, wie es zu erwarten war, und die Anleger verkauften alles, was ihnen riskant erschien. Der MSCI World Index fiel um 16,2 % und tendierte über weite Strecken des Quartals abwärts. Ungeachtet kurzer Mini-Erholungen Mitte Mai und Mitte Juni beendeten die Märkte das Quartal nahe neuen Jahrestiefständen. Angesichts des düsteren makroökonomischen Umfelds, der ausufernden Inflation und einer drohenden Rezession war dies für die Anleger sicherlich keine einfache Zeit. Aus Sicht der Faktor-Performance war es vor dem Hintergrund steigender Zinsen nicht überraschend, dass die Wertentwicklung im Substanzbereich weiterhin positiv war. Die Faktor-Ergebnisse in der ersten Jahreshälfte entsprechen fast genau dem, was man erwarten konnte. Nach einem schwachen ersten Quartal erholte sich der MSCI US ESG Index im Vergleich zu seinem Standard-Pendant wieder. Außerhalb der USA (EAFE und EM) entwickelten sich die MSCI ESG-Indizes jedoch weiterhin unterdurchschnittlich.

Das dritte Quartal 2022 begann recht optimistisch mit einem Anstieg der Märkte, nachdem diese im Vorquartal aufgrund von Unternehmensgewinnen, die höher als erwartet ausfielen, nachgegeben hatten. Gegen Ende Juli ließen die Wirtschaftsindikatoren jedoch Besorgnis erkennen, so dass sich der Ausblick der Anleger eintrübte und der Markt im Quartal in den negativen Bereich rutschte.

Auch im vierten Quartal blieben alle Augen auf die Politik der US-Notenbank (Fed) gerichtet, und die Anleger, die sichtlich verzweifelt darauf warteten, dass der Markt die Talsohle erreichte, gingen bei den geringsten Anzeichen einer Verlangsamung der US-Wirtschaft auf Kauffour. Vor allem die unter den Erwartungen liegenden Inflationszahlen vom 10. November lösten eine extreme Zunahme der Risikobereitschaft aus. Trotz einer geringeren Zinsanhebung im Dezember hat die Fed aber noch keine deutliche Verlangsamung ihrer aggressiven geldpolitischen Straffung signalisiert, was ein anhaltend instabiles Umfeld schafft. In den Schwellenländern wurde die Marktvolatilität durch die Erwartung verstärkt, dass China seine Corona-Beschränkungen lockern würde, was am 5. Dezember erneut als Katalysator für eine starke Risikorally wirkte.

Im Gesamtzeitraum seit Jahresanfang ist der MSCI World Index in den Industrieländern um 18,1 % gefallen, während der S&P 500 Index seit Jahresanfang ebenfalls 18,1 % eingebüßt hat. In den Industrieländern ist ansonsten der MSCI Japan Index um 4,5 % gefallen und der MSCI Europe Index hat im Berichtszeitraum in EUR 9,5 % eingebüßt. Im Schwellenmarktbereich fiel der MSCI Emerging Markets Index in USD um 20,1 %. Der MSCI China A Index ist seit Jahresbeginn um 25,9 % in USD gefallen.

Performance-Rückblick

Im Zwölfmonatszeitraum zum 31. Dezember 2022 erzielte der Man Numeric China A Fund eine negative Wertentwicklung (nach Abzug von Gebühren) und blieb damit hinter seiner Benchmark zurück.

Performance der Modelle: Der Man Numeric strebt eine Wertschöpfung über einen auf Fundamentaldaten basierenden, quantitativen, Bottom-up-Titelauswahlprozess an. Aktien werden auf der Grundlage der Ergebnisse unserer quantitativen Investmentmodelle ausgewählt. Der Fonds erzielte im bisherigen Jahresverlauf insgesamt eine positive Modellperformance. Das Value-Modell erzielte die beste Performance, gefolgt vom Informed-Investor-Modell. Das Momentum-Modell entwickelte sich während des Berichtsjahres am schlechtesten, gefolgt vom Factor Selection- und vom Quality-Modell.

Aufschlüsselung der Performancebeiträge: Die Titelauswahl war positiv, vor allem in den Sektoren Informationstechnologie, Gesundheitswesen und Energie. Die Sektorallokation verzeichnete im Berichtszeitraum eine Seitwärtsentwicklung. Eine Übergewichtung des Energiesektors trug zur Performance bei, während eine Untergewichtung des Gesundheitssektors die Performance beeinträchtigte.

Auf Einzeltitelebene kamen die drei größten Beiträge des Fonds aus dem Industrie- und dem Grundstoffsektor. Die drei größten Verlustbringer waren Industrie-, Grundstoff- und Energieunternehmen.

Ausblick

Auch wenn wir nicht wissen, was das Jahr 2023 bringen wird, sind wir der Meinung, dass die jüngsten Verbesserungen des Prozesses unser Portfolio in die Lage versetzen, sich in dem unsicheren makroökonomischen Umfeld besser zu behaupten. Wir werden auch weiterhin alles daran setzen, unsere Prozesse und Strategien zu verbessern, um die Herausforderungen im Zusammenhang mit makroökonomischen Unsicherheiten und künftigen Marktschwankungen besser zu bewältigen. Es gibt keinen offensichtlichen Grund für die Annahme, dass sich das Umfeld in absehbarer Zeit ändern wird. Die Anleger schwanken 2023 zwischen der Hoffnung auf eine weiche Landung und der Angst vor einer Rezession in den USA.

Die Volatilität wird aller Wahrscheinlichkeit nach hoch bleiben, was die Bedeutung des Risikomanagements und insbesondere der Frage, wie wir unser Risiko gegenüber Marktschwankungen am besten steuern können, unterstreicht. Dies ist ein Research-Bereich, in dem wir uns entschieden engagieren werden. Wir konzentrieren uns auf die Bottom-up-Titelauswahl und versuchen nicht, Zinssätze, Sektoren, Länder, Laufzeiten oder andere allgemeine Faktoren zu timen oder in größerem Ausmaß von der Benchmark in Bezug auf einen dieser Faktoren abzuweichen.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kaufempfehlung ausgelegt werden

Numeric Investors LLC
200 Pier 4 Boulevard
5th Floor
Boston
MA 02210
USA

Man GLG Strategic Bond – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Im historischen Vergleich war 2022 ein schwieriges Jahr für die Rentenmärkte. Die höhere Inflation und der daraus resultierende Übergang der großen Zentralbanken zu einer restriktiven Haltung trieben die Zinssätze weiter in die Höhe, so dass die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen Ende des Jahres bei 3,87 % lag und damit 2,5 Mal so hoch war wie zu Jahresbeginn. Die Anleger mussten 2022 einiges an Sorgen ertragen, als die Wiedereröffnung der Weltwirtschaft nach einer beispiellosen geldpolitischen Lockerung die Inflation anheizte.

Dies wurde durch Lieferkettenengpässe noch verschärft und zwang die Zentralbanken zum Handeln. Der Berichtszeitraum war nicht nur von der Besorgnis über die Auswirkungen der strikteren Finanzbedingungen auf das Wachstum geprägt, sondern auch durch den Krieg zwischen Russland und der Ukraine, der die Öl- und anderen Rohstoffpreise Ende Februar und im März in die Höhe schnellen ließ und die inflationären Bedingungen, insbesondere in Europa, verschärfte. Dies verursachte eine Ausweitung der Kreditspreads und eine Dekompression, d. h. eine schlechtere Performance von Anleihen geringerer Qualität im Vergleich zu Anleihen höherer Qualität.

Ende 2022 waren die Leitzinsen der wichtigsten Zentralbanken weit von ihrem Stand zu Beginn des Jahres entfernt, nachdem einige der steilsten Zinsanhebungszyklen der jüngeren Geschichte stattgefunden hatten. Die US-Notenbank beendete das Jahr 2022 mit einer Zielspanne von 4,25-4,50 %, die EZB mit 2,5 % und die Bank of England mit 3,5 %. Selbst die stets gemäßigte Bank of Japan weitete im Dezember ihr Kontrollband für die Renditekurve 10-jähriger Staatsanleihen von +/-25 Basispunkten auf +/-50 Bp aus, was die Spekulationen über eine Politikänderung in Japan ebenfalls anheizte.

Performance-Rückblick

Der Man GLG Strategic Bond („Fonds“) erzielte 2022 eine Rendite von -7,42 %¹ im Vergleich zum strategischen IA £-Sektor, der eine Rendite von -11,70 % erzielte. Die Investment-Grade-Anleihen des Fonds beeinträchtigten die Wertentwicklung, während die Hochzinsanleihen die Wertentwicklung nur geringfügig schmälerten. Die Auswirkungen von Baranleihen auf die Performance wurden durch einen positiven Performancebeitrag von CDS-Index-Absicherungen etwas abgeschwächt.

Der Fonds war bis Oktober dieses Jahres in der Lage, weniger Verluste als die Rentenindizes zu realisieren. Daher war die Realisierung einer stärkeren Aufwärtsbewegung als bei den Indizes ebenfalls ein wichtiger positiver Faktor bei der Markterholung im November. Das Portfolio konnte dies durch signifikante Katalysator-Realisierungen und eine Erholung einiger seit langem im Portfolio gehaltener Positionen mit hohem Überzeugungsgrad erreichen.

In Anbetracht der Marktbewegungen waren Kredite, die eine überdurchschnittlich hohe Duration und vergleichsweise hohe Spreads aufwiesen, den schwachen Bedingungen am Anleihemarkt im Jahr 2022 am stärksten ausgesetzt. Im Fonds waren u. a. Positionen in Aviva und Nationwide davon betroffen, die beide zusammengenommen die Rendite beeinträchtigten.

Der Verzicht auf ein erhebliches Engagement in REITS und im Immobiliensektor im Allgemeinen war dabei entscheidend, da die steigenden Zinsen diesen Sektor stark unter Druck setzten. Leider hielt der Fonds Canary Wharf & Vivion in beträchtlichem Umfang, was die Rendite beeinträchtigte.

In einem Jahr, in dem die Gesamrenditen besonders negativ ausfielen, gab es auch herausragende Performer für den Fonds, die erhebliche positive Beiträge leisteten. Als sich abzeichnete, dass der Druck auf den Erdgasmarkt in Europa nach dem russischen Einmarsch in die Ukraine nachlassen würde, investierte der Fonds in europäische Versorgungsunternehmen, die wenig oder gar nicht von den Erdgaspreisen abhängig sind und zu diesem Zeitpunkt insgesamt äußerst attraktiv bewertet waren. Enel war das beste Beispiel für dieses Thema und trug zur Wertentwicklung bei. Der Fonds erhöhte im vierten Quartal auch sein Engagement in Tier-2-Finanzinstrumenten, da die hohen Kreditspreads dazu führten, dass die Anlegergelder allmählich wieder in Kredite flossen, während die Spreads durch umfangreiche Emissionen von Tier-2-Schuldtiteln auf einem attraktiven Niveau gehalten werden konnten. Anlagen in BNP, HSBC, Standard Chartered, CaixaBank und Bank of Ireland trugen zusammen 0,32 % zur Rendite bei.

Der taktische Makro-Overlay-Prozess des Fonds lieferte im Jahr 2022 hervorragende Ergebnisse, wobei alle Komponenten positive Renditen erzielten und gemeinsam zur Wertentwicklung des Fonds beitrugen. Die rechtzeitige Absicherung von Krediten in einem sich verschlechternden Umfeld für Spreads war ein entscheidender Faktor für die Renditen, während die Positionierung in Staatsanleihen und Währungen im Laufe des Jahres ebenfalls zur Wertentwicklung des Fonds beitrug.

Der Fonds vertrat 2022 in der Regel eine vorsichtige Haltung in Bezug auf die Duration und hielt eine negative taktische Duration durch Short-Positionen in Anleihefutures in den Kernmärkten für Staatsanleihen, die sich vor dem Hintergrund steigender Zinsen gut entwickelten. Allerdings wurde die Positionierung aktiv gesteuert und so profitierte der Fonds auch davon, dass er seine Duration bis Ende Februar deutlich verlängerte, da der russische Einmarsch in die Ukraine als potenzieller großer Schock für die Märkte angesehen wurde und Staatsanleihen auf die Unsicherheit und die Abwärtsrisiken für das Wachstum als sicherer Hafen reagieren konnten. Die taktische Durationspositionierung wurde in der zweiten Jahreshälfte zunehmend ausgewogener, da sich die Zinsanhebungen erwartungsgemäß verlangsamten und hohe Renditeniveaus für langfristige Anleger attraktiv wurden.

Bei den Währungen hatte das Portfolio während des gesamten Jahres 2022 in der Regel Long-Positionen im US-Dollar, um von den höheren Zinserwartungen gegenüber einer aggressiven US-Notenbank zu profitieren. Es wurde aber auch aktiv im Verhältnis zu einer Reihe von Währungspaaren verwaltet. Die Long-USD-Positionierung hat sich im zweiten und dritten Quartal besonders bewährt, da die Zinserwartungen deutlich stiegen. Als die Fed eine Verlangsamung der Zinsanhebungen signalisierte, brach der stark tendierende US-Dollar im vierten Quartal ein, so dass sich die Währungspositionierung des Fonds gegen Ende des Jahres allmählich in Richtung einer Short-Position im US-Dollar bewegte.

¹ Die Daten beziehen sich auf den 31. Dezember 2022 und basieren auf der Performance der Anteilsklasse I GBP des Man GLG Strategic Bond. Die Performance Daten werden nach Abzug von Gebühren mit reinvestierten Erträgen angegeben. Sie berücksichtigen keine ggf. anfallenden Ausgabe- und Rücknahmegebühren. Renditen werden nach Abzug einer Managementgebühr von 0,39 % berechnet. Für andere Anteilsklassen werden eventuell höhere Gebühren erhoben.

Man GLG Strategic Bond – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

Ein CDS-Indexschutz wurde 2022 dreimal in Anspruch genommen. Zunächst im Februar aufgrund der aggressiven Haltung der EZB und der Kreditabflüsse, die dann im weiteren Verlauf des Monats im Zuge des russischen Einmarschs in die Ukraine noch verstärkt wurden. Mitte März wurden aus dieser Position Gewinne mitgenommen, aber im April wurden die Absicherungen aufgrund der negativen Dynamik und der üblichen saisonalen Schwäche im zweiten Quartal wieder aufgebaut und nach einem sprunghaften Anstieg der Spreads im Juni wieder beendet. Als die Zuflüsse zu Unternehmensanleihen im August nachließen, wurden zum dritten Mal Kreditabsicherungen vorgenommen. Die Spreads weiteten sich aus, übertrafen ihre Höchststände vom Juni und gingen in den letzten Septembertagen aufgrund deutlich verbesserter Bewertungsniveaus wieder zurück. Alle drei durchgeführten Absicherungen erbrachten positive Renditen.

Ausblick

Zu Beginn des Jahres 2023 ist die Unsicherheit nach wie vor groß in Bezug auf den Endzinssatz, der in den wichtigsten Volkswirtschaften der Welt erreicht werden wird, um die Inflation einzudämmen. Zum Jahresende deuten die marktimplizierten Erwartungen für die Zinssätze darauf hin, dass die Fed ihre Schritte größtenteils abgeschlossen haben könnte und der Höchststand bei 5 % erreicht ist. Die EZB, die sich auf ihrer letzten Sitzung des Jahres im Dezember bemerkenswert restriktiv zeigte, hat möglicherweise jedoch noch einen weiten Weg vor sich. Die Bank of England steht weiterhin vor der Möglichkeit einer Stagflation, was unseres Erachtens eine baldige Zinserhöhung verhindern könnte. 2023 werden wir uns nicht allein mit den Höchstständen bei den Zinsen befassen müssen, sondern auch mit den anschließenden Auswirkungen, die straffere finanzielle Bedingungen auf das globale makroökonomische Umfeld haben werden.

Die wichtigsten Zentralbanken und Anleihemärkte werden wahrscheinlich zunehmend datenabhängig werden. Das Hauptaugenmerk liegt auf der Inflation, die zu höheren kurzfristigen Zinssätzen führt, aber die geringeren Wachstumsrisiken werden bestimmen, wie weit die Zinssätze noch steigen und wie lange sie unverändert bleiben können.

Wir machen uns nach wie vor Sorgen, dass es den Zentralbanken angesichts der höheren Kreditzinsen für private Haushalte und Unternehmen nicht gelingen wird, eine sanfte Landung für ihre jeweiligen Volkswirtschaften zu erreichen, und gehen davon aus, dass eine erhebliche Abschwächung des globalen Wachstums in Zukunft sehr wahrscheinlich ist. China könnte jedoch unterstützen, wenn es im Laufe des Jahres aus seiner selbst auferlegten coronabedingten Konjunkturlaute herauskommt.

In einem solchen Umfeld, insbesondere angesichts des starken Anstiegs der Renditen, sind Kern-Staatsanleihen in diesem Jahr in einer besseren Position, um ihren Status als sicherer Hafen wiederzuerlangen. Unternehmensanleihen mit höherer Bonität können auch in Zukunft im Vergleich zu risikoreicheren Kreditanlagen noch gut abschneiden. Ein gedämpftes wirtschaftliches Umfeld hat zwar weitreichende Auswirkungen auf die Kreditmärkte und führt in der Regel zu höheren Spreads und zu einer höheren Streuung der Kreditqualität, es bietet aber auch erhebliche Möglichkeiten, Preisverwerfungen und idiosynkratische Katalysatoren für Fonds mit flexiblem Mandat zu erkennen.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

Man GLG Asia (ex Japan) Equity – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

2022 war ein schwieriges Jahr für Risikoanlagen. Es war von der größten Veränderung der Inflationsentwicklung seit mehreren Jahrzehnten, dem schnellsten Anstieg der US-Zinsen seit Anfang der 1980er Jahre und den Auswirkungen der chinesischen Null-Covid-Politik geprägt. Dies führte während des größten Teils des Jahres zu erheblichem Druck auf die Bewertung und die Korrekturen des Gewinns je Aktie, wobei die Gewinnerwartungen in Asien von Anfang Januar bis Ende Oktober um mehr als 15 % nach unten korrigiert wurden.

Anfang November hatten die Schätzungen des Gewinns je Aktie für 2022 und 2023 in Bezug auf Asien (ohne Japan) jedoch ihren Tiefpunkt erreicht, wobei die große Trendwende durch den Optimismus im Zusammenhang mit der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft und den Höchststand des USD unterstützt wurde. Dies erzeugte in den letzten beiden Monaten des Jahres einen starken Rückenwind für den Markt und trug dazu bei, einen Teil der Verluste von fast 30 % auszugleichen, die der Index vor der Lockerung der Einreise- und Quarantänebestimmungen sowie der Richtlinien zur Durchführung von Coronatests erlitten hatte. Zum Jahresende lag der MSCI Asia ex Japan in USD gemessen um 19,7 % im Minus.

Performance-Rückblick

Der Man GLG Asia ex Japan Equity erzielte 2022 eine negative Nettorendite, konnte seine Benchmark aber übertreffen¹. Trotz eines schwierigen Marktumfelds, in dem die Schätzungen des Gewinns je Aktie in der gesamten Region deutlich nach unten revidiert wurden, war das Team sehr erfolgreich bei der Identifizierung idiosynkratischer Chancen, die von überdurchschnittlichen relativen Korrekturen profitierten und zur Outperformance beitrugen.

Leader Harmonious Drive, eine Aktie aus dem Bereich der Fertigungsautomatisierung, die auf die Automobilzulieferkette ausgerichtet ist, trug über das Jahr gesehen am meisten zur Wertentwicklung bei. Wir betrachteten das Unternehmen als strukturellen Gewinner in einem Nischenbereich des Robotikmarktes und richteten die Position im März aufgrund der aggressiven Kapazitätserweiterung, die unserer Meinung nach vom Konsens unterschätzt wurde, ein. Die meisten Zuwächse gab es im zweiten und zu Beginn des dritten Quartals, als die Aktie aufgrund des wachsenden Trends zu einer stärkeren Automatisierung in der chinesischen Fertigung und einer verstärkten inländischen Beschaffung in der Branche um fast 280 % zulegte. Angesichts dieser extremen Kursschwankungen begannen wir im Juli mit dem Abbau unserer Position, um die Gewinne aus einem erfolgreichen Handel mitzunehmen, bevor wir im Oktober aufgrund von Bedenken, ob die Aktie die Gewinnerwartungen im nächsten Jahr erfüllen wird, schließlich ausstiegen.

Vor dem Hintergrund sich verbessernder makroökonomischer Fundamentaldaten für die südostasiatischen Volkswirtschaften war Bank Mandiri ein weiterer wesentlicher Gewinner in der zweiten Jahreshälfte. Die indonesische Bank stieg von ihren anfänglichen Tiefständen im Juli um mehr als 38 %, nachdem sie von steigenden Referenzzinssätzen in Indonesien und starken Ergebnissen im dritten Quartal Unterstützung erhielt. Die Bank hat einen Aufwärtstrend bei der Rentabilität verzeichnet, der auf eine höhere Nettozinsspanne und eine verbesserte Qualität der Aktiva zurückzuführen ist. Ihr starkes Transaktionsgeschäft dürfte die Erweiterung der Nettozinsspanne und die Ertragsverbesserungen zusätzlich unterstützen – insbesondere aufgrund der Aussicht auf eine geldpolitische Kehrtwende der US-Notenbank und des hinter uns liegenden USD-Höchststandes. In ähnlicher Weise haben wir unsere Position in der E-Commerce-Plattform Pinduoduo zu Beginn des zweiten Halbjahres initiiert, da wir der Ansicht waren, dass das Unternehmen aufgrund seiner differenzierten Produktkategorie (geringeres Sortiment an Alltagsprodukten und Lebensmitteln) und seiner geografischen Streuung (geringerer Umsatzbeitrag aus Tier-1-Städten, in denen es zu den strengsten Lockdowns kam) gut positioniert war, um Marktanteile gegenüber seinen Mitbewerbern zu gewinnen. Im November gab das Unternehmen einen deutlichen Gewinnanstieg bekannt, der auf eine über den Erwartungen liegende Erhöhung der Take-Rate zurückzuführen war. Dies führte zu einer Anhebung der Gewinnsschätzungen um mehr als 20 % für das GJ 2023 und zu einer annähernden Verdoppelung des Aktienkurses – ein Anzeichen dafür, dass der Konsens die Verbesserung der inländischen Gewinnspanne des Unternehmens endlich berücksichtigt.

Der Chiphersteller SK Hynix, der aufgrund von Bedenken hinsichtlich einer geringeren weltweiten Smartphone-Nachfrage und einer länger anhaltenden Preiskorrektur im DRAM-Segment fiel, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung am meisten. Die Abschwächung der Weltwirtschaft, der Aufbau von Lagerbeständen und anhaltende Lieferprobleme haben die Chipnachfrage belastet. Die drastischen Kürzungen der Investitionsausgaben von Hynix dürften jedoch den Abbau von Lagerbeständen im Jahr 2023 unterstützen, und wir sind weiterhin optimistisch, was das künftige Potenzial für Gewinnkorrekturen des Unternehmens angeht. Die Automobilhersteller Nio und Great Wall Automobile waren im ersten Quartal wesentliche Verlustbringer, da sich der Anstieg der Rohstoffkosten auf die Margen auswirkte und es Bedenken hinsichtlich der Endnachfrage nach den erneut verhängten Lockdowns in China gab. Diese Aktien erholten sich teilweise, nachdem positive Nachrichten über Konjunkturmaßnahmen und mehr Klarheit über die Einhaltung der Lieferziele bei Elektrofahrzeugen im Juni verkündet wurden, was uns veranlasste, unser Engagement in Nio zu konsolidieren. Während Nio in der zweiten Jahreshälfte aufgrund enttäuschender Auslieferungszahlen für das dritte Quartal nachgab, erholte sich der Kurs teilweise, da sich die E-Fahrzeugsparte angesichts der Wiedereröffnung deutlich nach oben bewegte.

Ausblick

Die Aussicht auf eine Wiedereröffnung Chinas, die politische Flexibilität in der Region und die Anzeichen einer möglichen Kehrtwende der US-Notenbank haben dazu geführt, dass wir die Aussichten für asiatische Aktien nun wesentlich konstruktiver einschätzen. In China deuten die von den politischen Entscheidungsträgern gegen Ende 2022 unternommenen Schritte auf die Überzeugung der Regierung hin, dass das Virus keine Gefahr mehr für das Gesundheitssystem darstellt, woraufhin eine vollständige Wiedereröffnung wahrscheinlich schneller als erwartet erfolgen wird. Dies dürfte die Aussichten in der Region für die Unternehmensgewinne im Jahr 2023 deutlich verbessern. Allerdings rechnen wir in den ersten Monaten des neuen Jahres noch mit einigen coronabedingten Störungen, insbesondere da die Weihnachtsfeiertage und das Chinesische Neujahrsfest nahe beieinander liegen. Insgesamt sind die Voraussetzungen für absolute Aktiengewinne in Asien im Jahr 2023 gut, und die Änderung der Politik dürfte eine klare Chance für Alpha aus der Titelauswahl schaffen. Zum ersten Mal seit unserer Tätigkeit für Man GLG gehen wir aktiv von steigenden Kursen aus.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

¹ Der MSCI Asia ex Japan (USD, NDTR) ist eine offizielle Benchmark für den Fonds. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Prospekt oder den wesentlichen Anlegerinformationen.

Man Numeric US High Yield – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Nach einer lang anhaltenden Rallye seit dem Tiefpunkt der Covid-19-Krise im März 2020 legten die Märkte schließlich eine Verschnaufpause ein: Der MSCI World Index fiel im ersten Quartal 2022 um 5,2 %. Das Jahr begann mit guten Ergebnissen im vierten Quartal, guten Beschäftigungszahlen und einer Abnahme der Zahl der Covid-19-Fälle optimistisch. Die Wirtschaft war jedoch nicht in der Lage, die hohe Inflation abzufedern, und da die Fed aggressive Maßnahmen andeutete, drehten die Märkte, und der MSCI World Index beendete den Monat Januar mit -5,3 %.

Im Februar setzten die Märkte ihre Talfahrt nach dem Einmarsch Russlands in die Ukraine fort und wurden durch die Unsicherheit über die geopolitische Positionierung Chinas und die Angst vor Offshore-Delistings weiter verschärft. Im März schüttelten die Märkte diese Sorgen schließlich mit einer Erholung des MSCI World Index um 2,7 % ab, nachdem sich die chinesischen Behörden marktfreundlich geäußert hatten. Aus Sicht der Performance von ESG-Faktoren war das erste Quartal 2022 für ESG-orientierte Strategien der perfekte Sturm. Nach einer starken relativen Rendite im Jahr 2021 blieben die ESG-Indizes im ersten Quartal hinter Fonds mit Standard-Strategien zurück.

Die Gefahr einer anhaltenden Inflation ist im zweiten Quartal 2022 real geworden. Die Märkte reagierten, wie es zu erwarten war, und die Anleger verkauften alles, was ihnen riskant erschien. Der MSCI World Index fiel um 16,2 % und tendierte über weite Strecken des Quartals abwärts. Ungeachtet kurzer Mini-Erholungen Mitte Mai und Mitte Juni beendeten die Märkte das Quartal nahe neuen Jahrestiefständen. Angesichts des düsteren makroökonomischen Umfelds, der ausufernden Inflation und einer drohenden Rezession war dies für die Anleger sicherlich keine einfache Zeit. Aus Sicht der Faktor-Performance war es vor dem Hintergrund steigender Zinsen nicht überraschend, dass die Wertentwicklung im Substanzbereich weiterhin positiv war. Die Faktor-Ergebnisse in der ersten Jahreshälfte entsprechen fast genau dem, was man erwarten konnte. Nach einem schwachen ersten Quartal erholte sich der MSCI US ESG Index im Vergleich zu seinem Standard-Pendant wieder. Außerhalb der USA (EAFE und EM) entwickelten sich die MSCI ESG-Indizes jedoch weiterhin unterdurchschnittlich.

Das dritte Quartal 2022 begann recht optimistisch mit einem Anstieg der Märkte, nachdem diese im Vorquartal aufgrund von Unternehmensgewinnen, die höher als erwartet ausfielen, nachgegeben hatten. Gegen Ende Juli ließen die Wirtschaftsindikatoren jedoch Besorgnis erkennen, so dass sich der Ausblick der Anleger eintrübte und der Markt im Quartal in den negativen Bereich rutschte.

Auch im vierten Quartal blieben alle Augen auf die Politik der US-Notenbank (Fed) gerichtet, und die Anleger, die sichtlich verzweifelt darauf warteten, dass der Markt die Talsohle erreichte, gingen bei den geringsten Anzeichen einer Verlangsamung der US-Wirtschaft auf Kauftour. Vor allem die unter den Erwartungen liegenden Inflationszahlen vom 10. November lösten eine extreme Zunahme der Risikobereitschaft aus. Trotz einer geringeren Zinsanhebung im Dezember hat die Fed aber noch keine deutliche Verlangsamung ihrer aggressiven geldpolitischen Straffung signalisiert, was ein anhaltend instabiles Umfeld schafft. In den Schwellenländern wurde die Marktvolatilität durch die Erwartung verstärkt, dass China seine Corona-Beschränkungen lockern würde, was am 5. Dezember erneut als Katalysator für eine starke Risikorally wirkte.

Im Gesamtzeitraum seit Jahresanfang ist der MSCI World Index in den Industrieländern um 18,1 % gefallen, während der S&P 500 Index seit Jahresanfang ebenfalls 18,1 % eingebüßt hat. In den Industrieländern ist ansonsten der MSCI Japan Index um 4,5 % gefallen und der MSCI Europe Index hat im Berichtszeitraum in EUR 9,5 % eingebüßt. Im Schwellenmarktbereich fiel der MSCI Emerging Markets Index in USD um 20,1 %. Der MSCI China A Index ist seit Jahresbeginn um 25,9 % in USD gefallen.

Performance-Rückblick

Im Geschäftsjahr zum 21. Dezember 2022 erzielte der Man Numeric US High Yield Fund (der „Fonds“) eine negative Rendite, übertraf aber seine Benchmark, den ICE BofA US HY Index. Im Folgenden finden Sie eine Zusammenfassung der wichtigsten Beitragszahler im Jahr 2022.

	Q1-22	Q2-22	Q3-22	Okt. 22	Nov. 22	Dez. 22	Q4-22	FY 2022
S&P500	-4,60 %	-16,10 %	-4,88 %	8,10 %	5,59 %	-5,76 %	7,56 %	-18,11 %
7-10-jährige Staatsanleihen	-6,43 %	-4,26 %	-5,56 %	-1,41 %	3,53 %	-1,31 %	0,73 %	-14,78 %
Gehebelte Darlehen	-0,10 %	-4,35 %	1,19 %	0,85 %	1,11 %	0,36 %	2,33 %	-1,06 %
Investment Grade (COA0)	-7,74 %	-6,71 %	-5,11 %	-1,11 %	4,92 %	-0,21 %	3,53 %	-15,44 %
High Yield (HOA0)	-4,51 %	-9,97 %	-0,68 %	2,85 %	1,87 %	-0,75 %	3,98 %	-11,22 %
BB/B Index (LBBATRUU)	-4,96 %	-9,40 %	-0,69 %	2,75 %	2,39 %	-0,61 %	4,56 %	-10,59 %
BB/B 2% Issuer Constrained (LBICTRUU)	-4,93 %	-9,41 %	-0,68 %	2,74 %	2,37 %	-0,59 %	4,56 %	-10,57 %
BB (HOA1)	-5,37 %	-8,62 %	-0,88 %	2,68 %	2,14 %	-0,53 %	4,33 %	-10,57 %
B (HOA2)	-3,46 %	-10,70 %	-0,59 %	3,41 %	2,00 %	-1,09 %	4,33 %	-10,58 %
CCC und darunter (HOA3)	-3,72 %	-13,91 %	-0,17 %	1,73 %	0,09 %	-0,68 %	1,12 %	-16,32 %

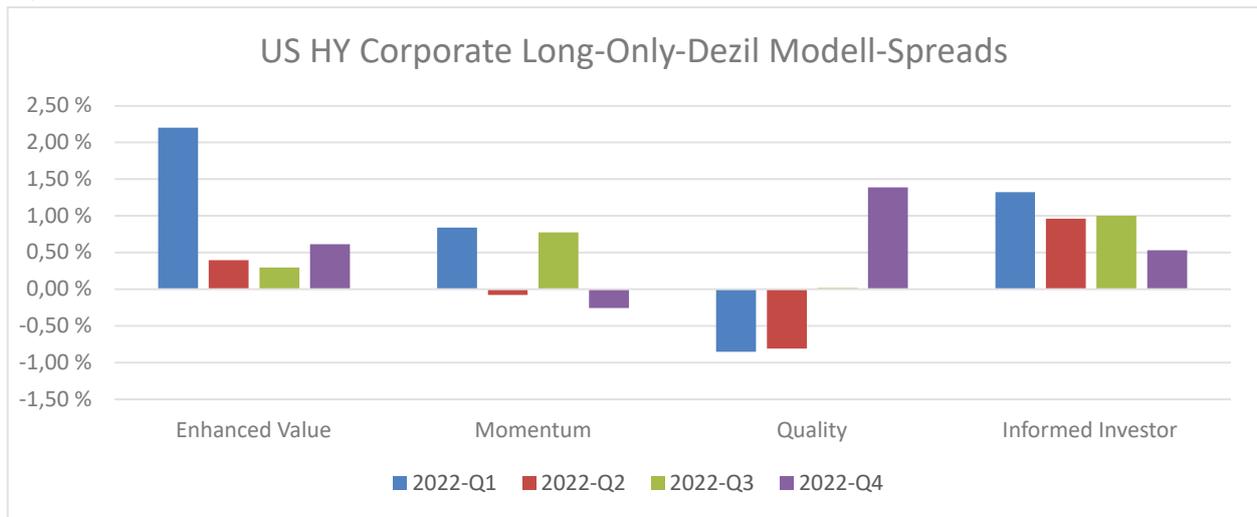
Performance der Modelle: Der Man Numeric strebt eine Wertschöpfung über einen auf Fundamentaldaten basierenden, quantitativen, Bottom-up-Auswahlprozess von festverzinslichen Anleihen an. Die Anleihen werden auf der Grundlage der Ergebnisse unserer quantitativen Investmentmodelle ausgewählt. Der Fonds erzielte im GJ 2022 in drei der vier Säulen – Value, Informed Investor und Momentum – eine positive Gesamtperformance, während Quality unterdurchschnittlich abschnitt, aber nahezu neutral war.

Man Numeric US High Yield – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

Informed Investor, das die Stimmung der Anleger anhand des Bestands an Leerverkaufspositionen umfasst, zeichnete sich 2022 durch die größten Säulenspreads aus. In jedem Quartal des Jahres wurde eine positive Performance innerhalb der Säule erzielt, die sich sowohl auf anleihen- als auch auf aktienbasierte Mischungen bezog. Value, zu dem Relative-Value- und verwandte Modelle gehören, entwickelte sich 2022 ebenfalls überdurchschnittlich. Alle Signale dieser Säule wiesen im ersten Quartal positive Spreads auf, und alle bis auf ein Modell entwickelten sich in den letzten drei Quartalen des Jahrs positiv.

Die Spreads des Momentum-Modells erzielten sowohl in der ersten als auch in der zweiten Jahreshälfte ein positives Nettoergebnis. Insgesamt erzielten die anleihenbasierten Momentum-Signale im ersten und zweiten Quartal eine überdurchschnittliche Performance, im dritten und vierten Quartal entwickelten sie sich jedoch unterdurchschnittlich. Diejenigen Modelle, die auf Aktien-Anlagenklassen basieren, erzielten im ersten, dritten und vierten Quartal hauptsächlich eine Outperformance, während sie sich im zweiten Quartal enttäuschend entwickelten.

Quality erzielte eine Underperformance im ersten und zweiten Quartal und eine Outperformance im dritten und vierten Quartal. Über die Quartale hinweg war die Performance unterschiedlich, wobei die Signale sich in der ersten Hälfte auf die Tragfähigkeit der Verschuldung und die Ausfallwahrscheinlichkeit bezogen, was letztlich trotz eines positiven vierten Quartals über das Jahr gesehen zu einem neutralen Ergebnis für die Säule führte.



Aufschlüsselung der Performancebeiträge: Die Betrachtung der Renditebeiträge nach Sektoren und Ratings hilft, die wichtigsten thematischen Treiber für die positive und negative Performance zu identifizieren. Auf Sektorebene trugen Energie und Medien am stärksten zu den aktiven Fondsrenditen bei. Das Alpha in beiden Sektoren ist auf positive Titelauswahl- und Allokationseffekte zurückzuführen. Andererseits beeinträchtigte der Gesundheitssektor die aktiven Renditen am stärksten, wobei die negative Performance auf negative Titelauswahl- und Allokationseffekte zurückzuführen war. Bei den Kreditratings trug die robuste Auswahl in den Kategorien BB, B und CCC und darunter zur Outperformance der Strategie bei. Andererseits wirkte sich ein geringes Engagement in Rising Stars mit BBB-Rating negativ auf die aktive Rendite aus.

Ausblick

Auch wenn wir nicht wissen, was das Jahr 2023 bringen wird, sind wir der Meinung, dass die jüngsten Verbesserungen des Prozesses unser Portfolio in die Lage versetzen, sich in dem unsicheren makroökonomischen Umfeld besser zu behaupten. Wir werden auch weiterhin alles daran setzen, unsere Prozesse und Strategien zu verbessern, um die Herausforderungen im Zusammenhang mit makroökonomischen Unsicherheiten und künftigen Marktschwankungen besser zu bewältigen. Es gibt keinen offensichtlichen Grund für die Annahme, dass sich das Umfeld in absehbarer Zeit ändern wird. Die Anleger schwanken 2023 zwischen der Hoffnung auf eine weiche Landung und der Angst vor einer Rezession in den USA.

Die Volatilität wird aller Wahrscheinlichkeit nach hoch bleiben, was die Bedeutung des Risikomanagements und insbesondere der Frage, wie wir unser Risiko gegenüber Marktschwankungen am besten steuern können, unterstreicht. Dies ist ein Research-Bereich, in dem wir uns entschieden engagieren werden. Wir konzentrieren uns auf die Bottom-up-Titelauswahl und versuchen nicht, Zinssätze, Sektoren, Länder, Laufzeiten oder andere allgemeine Faktoren zu timen oder in größerem Ausmaß von der Benchmark in Bezug auf einen dieser Faktoren abzuweichen.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kaufempfehlung ausgelegt werden

Numeric Investors LLC
200 Pier 4 Boulevard
5th Floor
Boston
MA 02210
USA

Zusammenfassung der Marktentwicklung

2022 war ein schwieriges Jahr für Investment-Grade-Anleger, da der Markt die schlechteste jährliche Gesamttrendite seit 1997 erzielte¹. Während die Zentralbanken weltweit versuchten, die galoppierende Inflation in den Griff zu bekommen, waren Rentenanleger gezwungen, sich mit einem raschen Anstieg der Zinssätze auseinanderzusetzen. Die Renditen 2-jähriger US-Staatsanleihen begannen das Jahr bei 0,7 % und beendeten es bei 4,4 %. Die kurzfristige Auswirkung dieses Umfelds war eine negative Gesamttrendite in den meisten Festzins-Bereichen. Optimistischer betrachtet bedeuten die Einbußen der Anleger im Jahr 2022, dass das Ausgangsniveau der Renditen und die potenziellen Gesamttrenditen der Rentenmärkte auf dem höchsten Stand seit über einem Jahrzehnt bleiben. Es war richtig anzunehmen, dass zinsempfindlichere Märkte wie Staatsanleihen und Investment-Grade-Anleihen in diesem Umfeld unterdurchschnittlich abschneiden würden.

Insgesamt lagen die Kreditspreads zum Jahresende bei 147 Bp bzw. hatten sich im Jahresverlauf um 48 Bp ausgeweitet. Europa und das Vereinigte Königreich blieben hinter den USA zurück und verzeichneten einen Anstieg um 69 Bp bzw. 81 Bp gegenüber +40 Bp in den USA. Auf Sektorbasis schnitten Verbraucherdienstleistungen, Einzelhandel, Freizeit und Technologie besser ab als der Gesamtmarkt, während die Immobilien, Grundstoffindustrie, Medien und Versicherungen unterdurchschnittlich abschnitten.

Performance-Rückblick

Der Man GLG Global Investment Grade Opportunities erzielte eine negative Rendite (nach Abzug von Gebühren), übertraf jedoch die Rendite der Benchmark. Der Fonds war in der Lage, Renditen über eine breite Palette von Marktbedingungen hinweg zu erzielen, was unserem Ansatz entspricht, über den Zyklus hinweg starke Überschussrenditen zu erwirtschaften. Die Titelauswahl war im Jahresverlauf die treibende Kraft hinter den Renditen, die vor allem auf eine Reihe von Emittenten aus den Bereichen nicht zyklische Konsumgüter, Banken, Energie und Glücksspiel zurückzuführen sind. Die Sektorallokation schmälerte die Renditen aufgrund der Entscheidung, in den Immobilienbereich zu investieren.

Die wichtigsten positiven Beiträge kamen von den folgenden Positionen:

- **Rohstoffhändler:** Zwei der weltweit größten Öl- und Gashändler, Trafigura und Gunvor, sowie der Agrarrohstoffhändler Louis Dreyfus schnitten auf dem Anleihemarkt sehr schlecht ab, wobei Aufforderungen zur Erbringung von Sicherheitsleistungen (Margin Calls) Anlass zur Sorge gaben. Wir waren der Meinung, dass der Markt die Risiken und Chancen dieser Unternehmen falsch einschätzte. Die Händler profitieren von der Volatilität, was bedeutet, dass 2022 eigentlich ein Rekordjahr für die Rentabilität war. Darüber hinaus haben die Wirtschaftsgüter der Rohstoffhändler eine kurze Laufzeit, was die Flexibilität verleiht, schnell Liquidität zu beschaffen, so dass die Liquiditätssorgen der Märkte übertrieben sind.
- **Inflationsgewinner mit Schwerpunkt auf dem Öl- und Gassektor:** Nach einer starken Performance hat die Strategie alle ihre Ölproduzenten veräußert.
- **Europäische Finanzwerte wie die Raiffeisen Bank,** die aufgrund des russischen Einmarsches in die Ukraine überproportional abverkauft wurden.
- **Ausgewählte Gelegenheiten in Asien,** wie das internationale Glücksspielunternehmen Genting Malaysia, nach einem wahllosen Abverkauf im vierten Quartal des Jahres.

Die größten Verluste kamen von den folgenden Positionen:

- **Immobilien Sektor,** die Strategie wurde durch das zu frühe Investieren in den Sektor beeinträchtigt.
- **Ausgewählte Finanzwerte,** wie der alternative Vermögensverwalter Intermediate Capital Group, der trotz guter finanzieller Ergebnisse schlecht abschnitt. Interessanterweise wurde das Kreditrating des Unternehmens im Laufe des Jahres von BBB- auf BBB heraufgestuft, und wir sind zuversichtlich, dass sich die Anleihe letztlich erholen und die Fundamentaldaten des Unternehmens widerspiegeln wird.

Ausblick

Angesichts von Renditen, die nahezu den Höchststand des letzten Jahrzehnts erreicht haben, sind wir der Meinung, dass Anleger weiterhin von einer Allokation in Investment-Grade-Anleihen profitieren können. Es ist in der Tat selten, dass sowohl die Zinssatz- als auch die Spread-Komponente gleichzeitig einen Mehrwert bieten. Die Weltwirtschaft verlangsamt sich zusehends, wobei die Auswirkungen einer strafferen Geldpolitik spürbar werden. Unserer Ansicht nach wird sich die Inflation im nächsten Jahr rasch abschwächen, da die Inputpreise stark zurückgegangen sind.

Eine Kombination aus günstigen Fundamentaldaten für erstklassige Anleihen, insbesondere Verlangsamung des Wachstums und Inflation, und attraktiveren Renditen lässt uns konstruktiv nach vorne blicken. Unseres Erachtens ist bei der Titelauswahl ein differenzierterer Ansatz angebracht. Wir sind der Meinung, dass in bestimmten Bereichen des Marktes, vor allem in Europa, mit Schwerpunkt auf Immobilien, und bei Finanztiteln ein echter Mehrwert zu finden ist.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

¹ ICE BofA Global Large Cap Corporate Index (USD, TR) Hedged.

Man GLG China Equity – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

2022 war ein schwieriges Jahr für Risikoanlagen. Es war von der größten Veränderung der Inflationsentwicklung seit mehreren Jahrzehnten, dem schnellsten Anstieg der US-Zinsen seit Anfang der 1980er Jahre und den Auswirkungen der chinesischen Null-Covid-Politik geprägt. Dies führte während des größten Teils des Jahres zu erheblichem Druck auf die Bewertung und die Korrekturen des Gewinns je Aktie, wobei die Gewinnerwartungen bei chinesischen Aktien von Anfang Januar bis Ende Oktober um mehr als 15 % nach unten korrigiert wurden.

Anfang November hatten die Schätzungen des Gewinns je Aktie für 2022 und 2023 in Bezug auf den Markt jedoch ihren Tiefpunkt erreicht, wobei die große Trendwende durch den Optimismus im Zusammenhang mit der Wiedereröffnung der Wirtschaft und den Höchststand des USD unterstützt wurde. Dies erzeugte in den letzten beiden Monaten des Jahres einen starken Rückenwind für den Markt und trug dazu bei, einen Teil der Verluste von fast 44 % auszugleichen, die der Index vor der Lockerung der Einreise- und Quarantänebestimmungen sowie der Richtlinien zur Durchführung von Coronatests erlitten hatte. Zum Jahresende lag der MSCI China in USD gemessen deutlich im Minus.

Performance-Rückblick¹

Im Jahr 2022 verbuchte der Fonds eine negative Performance (nach Abzug von Gebühren), obwohl er seine Benchmark² im selben Zeitraum übertreffen konnte. Die positive relative Wertentwicklung, insbesondere in der zweiten Jahreshälfte, war darauf zurückzuführen, dass das Portfolio in äußerst präsenten Ertragsbringern mit langer Duration und in Titeln mit geldpolitischem Rückenwind übergewichtet war, während Teile des Marktes, von denen das Anlageteam nicht erwartete, dass sie sich wie angenommen erholen würden (d. h. Ausgaben für Nichtbasiskonsumgüter), untergewichtet waren. Der Top-Performer des Fonds war 2022 Leader Harmonious Drive, eine Aktie aus dem Bereich der Fertigungsautomatisierung, die auf die Automobilzulieferkette ausgerichtet ist. Wir betrachteten das Unternehmen als strukturellen Gewinner in einem Nischenbereich des Robotikmarktes und richteten die Position im März aufgrund der aggressiven Kapazitätserweiterung, die unserer Meinung nach vom Konsens unterschätzt wurde, ein.

Die meisten Zuwächse gab es im zweiten und zu Beginn des dritten Quartals, als die Aktie aufgrund des wachsenden Trends zu einer stärkeren Automatisierung in der chinesischen Fertigung und einer verstärkten inländischen Beschaffung in der Branche um fast 280 % zulegte. Angesichts dieser extremen Kursschwankungen begannen wir im Juli mit dem Abbau unserer Position, um die Gewinne aus einem erfolgreichen Handel mitzunehmen, bevor wir im Oktober aufgrund von Bedenken, ob die Aktie die Gewinnerwartungen im nächsten Jahr erfüllen wird, schließlich ausstieg. Weitere Top-Beiträge stammten vom eCommerce-Anbieter Pinduoduo und vom Casinobetreiber Sands China. Pinduoduo wurde zu Beginn des zweiten Halbjahres initiiert, da wir der Ansicht waren, dass das Unternehmen aufgrund seiner differenzierten Produktkategorie (geringeres Sortiment an Alltagsprodukten und Lebensmitteln) und seiner geografischen Streuung (geringerer Umsatzbeitrag aus Tier-1-Städten, in denen es zu den strengsten Lockdowns kam) gut positioniert war, um Marktanteile gegenüber seinen Mitbewerbern zu gewinnen.

Im November gab das Unternehmen einen deutlichen Gewinnanstieg bekannt, der auf eine über den Erwartungen liegende Erhöhung der Take-Rate zurückzuführen war. Dies führte zu einer Anhebung der Gewinnschätzungen um mehr als 20 % für das GJ 2023 und zu einer annähernden Verdoppelung des Aktienkurses – ein Anzeichen dafür, dass der Konsens die Verbesserung der inländischen Gewinnspanne des Unternehmens endlich berücksichtigt. Im Dezember profitierte Sands China von der Lockerung der Beschränkungen sowohl auf dem Festland als auch in Macau im Dezember begünstigt und erholte sich von seinen Tiefständen im Oktober. Das Anlageteam eröffnete die Position Anfang Oktober, wobei der Marktkonsens die Gewinnerwartungen für die Glücksspielbranche in Macau im GJ 2023 nach wie deutlich unter dem Niveau von vor der Corona-Krise sieht.

Die Automobilhersteller Nio und Great Wall Automobile waren im ersten Quartal wesentliche Verlustbringer, da sich der Anstieg der Rohstoffkosten auf die Margen auswirkte und es Bedenken hinsichtlich der Endnachfrage nach den erneut verhängten Lockdowns in China gab. Diese Aktien erholten sich teilweise, nachdem positive Nachrichten über Konjunkturmaßnahmen und mehr Klarheit über die Einhaltung der Lieferziele bei Elektrofahrzeugen im Juni verkündet wurden, was uns veranlasste, unser Engagement in Nio zu konsolidieren. Während Nio in der zweiten Jahreshälfte aufgrund enttäuschender Auslieferungszahlen für das dritte Quartal nachgab, erholte sich der Kurs teilweise, da sich die E-Fahrzeugsparte angesichts der Wiedereröffnung deutlich nach oben bewegte. Eine große Position im Gesundheitssektor, Wuxi Biologics, zog den Fonds zu Beginn des Jahres ebenfalls in Mitleidenschaft, als die Position um 30 % fiel, nachdem bekannt wurde, dass das Unternehmen auf die sogenannte „Unverified List“ der USA gesetzt worden war. WuxiBio verwendet Ausrüstungen von US-Lieferanten, die der Exportkontrolle unterliegen und von der US-Regierung geprüft werden müssen, um sicherzustellen, dass die Ausrüstungen bestimmungsgemäß verwendet werden. Diese Prüfung hatte sich coronabedingt einige Male verzögert, was schließlich dazu führte, dass die Aktie auf die Liste gesetzt wurde.

Ausblick

Die vor Kurzem stattgefundenen Lockerung der Mobilitätsbeschränkungen in China hat zum größten Sprung bei den Gewinnkorrekturen für Asien (ohne Japan) seit über einem Jahr geführt und ist ein Zeichen für erheblich bessere Aussichten für die Unternehmensgewinne im Jahr 2023. Während das Anlageteam ursprünglich davon ausging, dass der Weg aus der Pandemie in Form einer über längere Zeit andauernden, schrittweisen Lockerung erfolgen würde, deuten die gegen Ende des Jahres unternommenen Schritte auf die Überzeugung der Regierung hin, dass das Virus keine Gefahr mehr für das Gesundheitssystem darstellt, woraufhin eine vollständige Wiedereröffnung wahrscheinlich schneller als erwartet (und ohne Massenimpfkampagne) erfolgen wird. Allerdings rechnet das Anlageteam in den ersten Monaten des Jahres 2023 noch mit einigen coronabedingten Störungen, insbesondere da die Weihnachtsfeiertage und das Chinesische Neujahrsfest nahe beieinander liegen.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

¹ Quelle: Datenbank von Man Group, MSCI und Bloomberg.

² Der MSCI China (USD, NDTR) ist eine offizielle Benchmark für den Fonds. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Prospekt oder den wesentlichen Anlegerinformationen.

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy (der „Fonds“) wurde am 10. Februar 2022 aufgelegt. Es handelt sich um einen aktiv verwalteten Long-only-Aktienfonds mit einem starken Schwerpunkt auf Nachhaltigkeit. Der Fonds ist darauf ausgerichtet, Renditen zu erwirtschaften und gleichzeitig eine positive Auswirkung auf die Umwelt zu erzielen. Er investiert ausschließlich in Unternehmen, die Lösungen und Technologien im Zusammenhang mit der Bekämpfung von Wasserknappheit anbieten, die die Versorgung und Aufbereitung von hochwertigem Wasser verbessern und/oder die Herausforderungen der Kreislaufwirtschaft angehen.

2022 erwies sich als schwieriges und volatiles Jahr für die Aktienmärkte. Die ersten Monate nach Auflegung des Fonds waren für die Aktienmärkte eine volatile Phase. Der Einmarsch Russlands in die Ukraine im Februar löste eine Energiekrise in Europa aus, die eine Verlangsamung des weltweiten Wachstums und die Angst vor einer Rezession zur Folge haben könnte. Der Juni war eine schwierige Zeit – vor allem in der zweiten Woche des Monats, als die Aktienmärkte nach einer hohen Inflationsrate in den USA einbrachen.

In diesem Monat wurden auch schwache Daten zum US-Wohnungsbau und Befürchtungen hinsichtlich der Gasversorgung in Europa veröffentlicht, die sich stark auf wichtige Segmente des Fonds auswirkten. Im Juli erholten sich die Märkte, als die Angst vor Zinsanhebungen nachließ, bevor sie im August und September wieder nachgaben. Im letzten Quartal des Jahres stiegen die Märkte erneut, als es im Oktober und November Anzeichen dafür gab, dass die Inflation ihren Höhepunkt erreicht hatte und die Zentralbank möglicherweise eine Kehrtwende vollziehen würde. Der Dezember erwies sich jedoch als enttäuschendes Ende eines schwierigen Jahres, da die Zentralbanken weiterhin eine aggressive Haltung einnahmen.

Performance-Rückblick

Der Fonds erzielte eine negative absolute Rendite (nach Abzug der Gebühren), übertraf jedoch seit seiner Auflegung am 10. Februar 2022 die Benchmark.

Auf Sektorebene trugen alle US-Industrietitel seit der Auflegung am meisten zur Wertentwicklung des Fonds bei. Die Zuwächse sind insbesondere auf Clean Harbors Inc. zurückzuführen, ein Unternehmen, das Industrieabfallbehandlungsdienste anbietet und gebrauchtes Motoröl recycelt. Es profitierte von günstigen regulatorischen Trends in seinen beiden Segmenten und hatte zudem den Vorteil, dass es in Europa und China nicht engagiert war. Die Aktie entwickelte sich in der zweiten Jahreshälfte gut, da die Schätzungen übertriften wurden und der Gewinn je Aktie korrigiert wurde. Weitere Top-Performer waren rezessionssichere Titel mit einem starken Inflationsschutz wie Republic Services, ein US-amerikanischer Entsorgungsdienstleister für feste Abfälle, der von automatischen Preisindexierungen profitierte, und Waste Connections, ein nordamerikanischer Anbieter von Abfalldienstleistungen.

Dagegen wurde der Fonds durch den Russland-Ukraine-Krieg negativ beeinflusst. Der größte Verlustbringer des Jahres war Veolia Environment, das über ein erhebliches Engagement an den europäischen Industriemärkten verfügt. Erwähnenswert ist, dass der Titel nach mehreren Monaten unterdurchschnittlicher Performance im Oktober im Anschluss an starke Gewinnmeldungen wieder zu steigen begann und im letzten Quartal den größten Beitrag zu den Fondsrenditen leistete. Das Anlageteam hat sein Engagement in Veolia erhöht, da es der Ansicht ist, dass das Unternehmen 2023 eine gute Performance erzielen wird. Zu den weiteren Verlustbringern gehörte Advanced Drainage, das bis Oktober noch zu den Top-Performern gehört hatte. Das Unternehmen profitierte nicht so stark wie erwartet von den niedrigeren Harzkosten und sah sich mit einem beschleunigten Abbau der Lagerbestände bei wichtigen Händlern konfrontiert. Zudem wurde es durch die schwachen Wohnungsbauzahlen in den USA in Mitleidenschaft gezogen. Das Anlageteam reduzierte die Position deutlich, die im Vergleich zu ähnlichen Unternehmen nun untergewichtet ist. Avantor schließlich leistete einen weiteren negativen Beitrag, nachdem das Unternehmen seine Ergebnisse für das zweite Quartal leicht verfehlt hatte und nicht mit den starken Ergebnissen der Konkurrenz mithalten konnte.

Ausblick

Obwohl wir für 2023 einen weiteren Konjunkturrückgang erwarten, glauben wir, dass Unternehmen der Wasser- und Kreislaufwirtschaft widerstandsfähiger sein könnten, da sie weniger von den Hauptfaktoren des Abschwungs betroffen sind, beispielsweise von dem Druck der hohen Inflation auf die Verbraucher. Der Fonds ist nur in sehr geringem Maße in zyklischen Konsumgütern, Banken und Kommunikationsdienstleistungen engagiert, und seine Industriewerte profitieren in der Regel von strukturellen Trends. Das Gesamtrisikoniveau bleibt unverändert und liegt leicht unter dem des Gesamtmarktes.

Bitte beachten Sie, dass die bisherige Wertentwicklung nicht auf die zukünftige Wertentwicklung schließen lässt. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

Man GLG Sustainable Strategic Income – Kommentar zum Jahresbericht

Einleitung

Der Sustainable Strategic Income Fund¹ wurde offiziell am 23. März 2022 aufgelegt. Er verfolgt eine globale, auf nachhaltige Erträge ausgerichtete Strategie. Der Kern des Portfolios wird aus Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating bestehen, mit einer kleineren Allokation in Hochzins- und Staatsanleihen. Die Strategie zielt darauf ab, den globalen Übergang zu einer nachhaltigen Wirtschaft zu unterstützen, was durch ein nachhaltiges Portfolio erreicht werden soll, das aus folgenden Elementen besteht:

- Investition von mindestens 75 % des Portfolios in nachhaltigen Investitionen

Zusammenfassung der Marktentwicklung

Im historischen Vergleich war 2022 ein schwieriges Jahr für die Rentenmärkte. Die höhere Inflation und der daraus resultierende Übergang der großen Zentralbanken zu einer restriktiven Haltung trieben die Zinssätze weiter in die Höhe, so dass die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen Ende des Jahres bei 3,87 % lag und damit 2,5 Mal so hoch war wie zu Jahresbeginn. Die Anleger mussten 2022 einiges an Sorgen ertragen, als die Wiederöffnung der Weltwirtschaft nach einer beispiellosen geldpolitischen Lockerung die Inflation anheizte. Dies wurde durch Lieferkettenengpässe noch verschärft und zwang die Zentralbanken zum Handeln. Der Berichtszeitraum war nicht nur von der Besorgnis über die Auswirkungen der strikteren Finanzbedingungen auf das Wachstum geprägt, sondern auch durch den Krieg zwischen Russland und der Ukraine, der die Öl- und anderen Rohstoffpreise Ende Februar und im März in die Höhe schnellen ließ und die inflationären Bedingungen, insbesondere in Europa, verschärfte. Dies verursachte eine Ausweitung der Kreditspreads und eine Dekompression, d. h. eine schlechtere Performance von Anleihen geringerer Qualität im Vergleich zu Anleihen höherer Qualität.

Ende 2022 waren die Leitzinsen der wichtigsten Zentralbanken weit von ihrem Stand zu Beginn des Jahres entfernt, nachdem einige der steilsten Zinsanhebungszyklen der jüngeren Geschichte stattgefunden hatten. Die US-Notenbank beendete das Jahr 2022 mit einer Zielspanne von 4,25-4,50 %, die EZB mit 2,5 % und die Bank of England mit 3,5 %. Selbst die stets gemäßigte Bank of Japan weitete im Dezember ihr Kontrollband für die Renditekurve 10-jähriger Staatsanleihen von +/-25 Basispunkten auf +/-50 Bp aus, was die Spekulationen über eine Politikänderung in Japan ebenfalls anheizte.

Performance-Rückblick

Der Man GLG Sustainable Strategic Income („Fonds“) wurde im März 2022 aufgelegt und erzielte 2022 eine Rendite von -8,2 %².

Der Bloomberg Barclays Global Corporate Index verzeichnete eine der schwierigsten Perioden seit der Auflegung des Fonds mit einer Rendite von -7,6 %. Der Bloomberg Barclays Global High Yield Index schnitt aufgrund seiner geringeren Duration etwas besser ab und verzeichnete eine negative Gesamterrendite von -5,18 %.

Die Investment-Grade-Anleihen des Fonds beeinträchtigten die Wertentwicklung, ebenso wie die Hochzinsanleihen. Die Auswirkungen von Baranleihen auf die Performance wurden durch einen positiven Performancebeitrag von CDS-Index-Absicherungen etwas abgeschwächt.

In Anbetracht der Marktbewegungen waren Kredite, die eine überdurchschnittlich hohe Duration aufwiesen, den schwachen Bedingungen am Anleihemarkt im Jahr 2022 am stärksten ausgesetzt. Im Fonds waren u. a. Positionen in Berkshire Hathaway Energy und Munich Re davon betroffen, die beide zusammengenommen die Rendite beeinträchtigten.

In einem Jahr, in dem die Gesamterrenditen besonders negativ ausfielen, gab es auch herausragende Performer für den Fonds, die erhebliche positive Beiträge leisteten. Als sich abzeichnete, dass der Druck auf den Erdgasmarkt in Europa nach dem russischen Einmarsch in die Ukraine nachlassen würde, investierte der Fonds in europäische Versorgungsunternehmen, die wenig oder gar nicht von den Erdgaspreisen abhängig sind und zu diesem Zeitpunkt insgesamt äußerst attraktiv bewertet waren. Der Fonds erhöhte im vierten Quartal auch sein Engagement in Tier-2-Finanzinstrumenten, da die hohen Kreditspreads dazu führten, dass die Anlegergelder allmählich wieder in Kredite flossen, während die Spreads durch umfangreiche Emissionen von Tier-2-Schuldtiteln auf einem attraktiven Niveau gehalten werden konnten.

Der taktische Makro-Overlay-Prozess des Fonds erzielte 2022 eine negative Rendite. Die Positionierung in Staatsanleihen war nachteilig, während die Währungspositionierung im Jahresverlauf keine Veränderung brachte. Da der Fonds 2022 in der Regel eine vorsichtige Haltung gegenüber Zins- und Kreditrisiken einnahm, wurde ein angemessener Anteil der Duration in langlaufenden grünen Staatsanleihen gehalten, vor allem in britischen Gilts sowie Staatsanleihen aus Spanien und Italien, um die untergewichtete Duration von Unternehmensanleihen auszugleichen. Da die Verzinsungen im Laufe des Jahres deutlich anstiegen, entwickelten sich diese Bestände negativ und schmälerten die Rendite. Eine negative taktische Duration, die durch Short-Positionen in Futures auf US-Anleihen umgesetzt wurde, glich dies etwas aus und trug positiv zur Performance bei.

Ausblick

Zu Beginn des Jahres 2023 ist die Unsicherheit nach wie vor groß in Bezug auf den Endzinssatz, der in den wichtigsten Volkswirtschaften der Welt erreicht werden wird, um die Inflation einzudämmen. Zum Jahresende deuten die marktimplizierten Erwartungen für die Zinssätze darauf hin, dass die Fed ihre Schritte größtenteils abgeschlossen haben könnte und der Höchststand bei 5 % erreicht ist. Die EZB, die sich auf ihrer letzten Sitzung des Jahres im Dezember bemerkenswert restriktiv zeigte, hat möglicherweise jedoch noch einen weiten Weg vor sich. Die Bank of England steht weiterhin vor der Möglichkeit einer Stagflation, was unseres Erachtens eine baldige Zinserhöhung verhindern könnte. 2023 werden wir uns nicht allein mit den Höchstständen bei den Zinsen befassen müssen, sondern auch mit den anschließenden Auswirkungen, die straffere finanzielle Bedingungen auf das globale makroökonomische Umfeld haben werden.

Die wichtigsten Zentralbanken und Anleihemärkte werden wahrscheinlich zunehmend datenabhängig werden. Das Hauptaugenmerk liegt auf der Inflation, die zu höheren kurzfristigen Zinssätzen führt, aber die geringeren Wachstumsrisiken werden bestimmen, wie weit die Zinssätze noch steigen und wie lange sie unverändert bleiben können.

¹ Der Fonds bewirbt unter anderem ökologische und soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (Sustainable Finance Disclosure Regulation - SFDR).

² Die Daten beziehen sich auf den 31. Dezember 2022 und basieren auf der Wertentwicklung der Anteilsklasse Man GLG Sustainable Strategic Income I USD. Die Performancedaten werden nach Abzug von Gebühren mit reinvestierten Erträgen angegeben. Sie berücksichtigen keine ggf. anfallenden Ausgabe- und Rücknahmegebühren. Renditen werden nach Abzug einer Managementgebühr von 0,43 % berechnet. Für andere Anteilsklassen werden eventuell höhere Gebühren erhoben.

Man GLG Sustainable Strategic Income – Kommentar zum Jahresbericht (Fortsetzung)

Wir machen uns nach wie vor Sorgen, dass es den Zentralbanken angesichts der höheren Kreditzinsen für private Haushalte und Unternehmen nicht gelingen wird, eine sanfte Landung für ihre jeweiligen Volkswirtschaften zu erreichen, und gehen davon aus, dass eine erhebliche Abschwächung des globalen Wachstums in Zukunft sehr wahrscheinlich ist. China könnte jedoch unterstützen, wenn es im Laufe des Jahres aus seiner selbst auferlegten coronabedingten Konjunkturlaute herauskommt.

In einem solchen Umfeld, insbesondere angesichts des starken Anstiegs der Renditen, sind Kern-Staatsanleihen in diesem Jahr in einer besseren Position, um ihren Status als sicherer Hafen wiederzuerlangen. Unternehmensanleihen mit höherer Bonität können auch in Zukunft im Vergleich zu risikoreicheren Kreditanlagen noch gut abschneiden. Ein gedämpftes wirtschaftliches Umfeld hat zwar weitreichende Auswirkungen auf die Kreditmärkte und führt in der Regel zu höheren Spreads und zu einer höheren Streuung der Kreditqualität, es bietet aber auch erhebliche Möglichkeiten, Preisverwerfungen und idiosynkratische Katalysatoren für Fonds mit flexiblem Mandat zu erkennen.

Wir erwarten für 2023 eine erhebliche Weiterentwicklung der Regulierung, insbesondere der EU-Taxonomie und anderer ESG-Regelwerke. Während die Definition des Begriffs „nachhaltig“ klarer wird, wird den Anlegern auch immer bewusster, dass einige Unternehmen und Fondsmanager die Messlatte nicht erfüllen, und ihre Präferenzen ändern sich entsprechend. Wir erwarten, dass ESG-Fonds weiterhin unter regulatorischen Druck geraten werden. Es überrascht daher nicht, dass Morningstar im vergangenen Jahr mehr als 1 Bio. USD an Vermögenswerten ihr ESG-Siegel entzogen hat³. Im Jahr 2023 wird der Schwerpunkt verstärkt auf der Offenlegung und Berichterstattung zur biologischen Vielfalt liegen. Neben der Eindämmung des Klimawandels wird zunehmend erkannt, dass der Schutz der biologischen Vielfalt eine der wichtigsten Umweltprioritäten ist. Höhere Zinsen und schwächere Volkswirtschaften werden die ESG-Eigenschaften von Investoren, Verbrauchern und Unternehmen auf den Prüfstand stellen. Vor allem ökologische Investitionen und Produkte haben in der Regel hohe Vorlaufkosten und lange Amortisationszeiträume, wie z. B. Elektrofahrzeuge. Langfristig gibt es jedoch weiterhin Rückenwind dank nachhaltigkeitsfreundlicher Gesetze wie dem US Inflation Reduction Act und RepowerEU.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

Bestimmte auf dieser Seite genannte Indizes/Kennzahlen wurden nur zu Informationszwecken angegeben. Sie sollen Vergleichspunkte für bestimmte Anlagenklassen, Anlagesektoren oder Finanzmärkte im Allgemeinen bieten („Markthintergrund“). Soweit nicht anders angegeben, ist der Anlageprozess des Fonds unabhängig von diesen Indizes/Kennzahlen.

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

³ Quelle: <https://www.bloomberg.com/news/articles/2022-02-10/funds-managing-1-trillion-stripped-of-esg-tag-by-morningstar>.

Man GLG Dynamic Income – Kommentar zum Jahresbericht

Zusammenfassung der Marktentwicklung

2022 war ein schwieriges Jahr für Investment-Grade-Anleger, da der Markt die schlechteste jährliche Gesamtrendite seit 1997 erzielte¹. Während die Zentralbanken weltweit versuchten, die galoppierende Inflation in den Griff zu bekommen, waren Rentenanleger gezwungen, sich mit einem raschen Anstieg der Zinssätze auseinanderzusetzen. Die Renditen 2-jähriger US-Staatsanleihen begannen das Jahr bei 0,7 % und beendeten es bei 4,4 %. Die kurzfristige Auswirkung dieses Umfelds war eine negative Gesamtrendite in den meisten Festzins-Bereichen. Optimistischer betrachtet bedeuten die Einbußen der Anleger im Jahr 2022, dass das Ausgangsniveau der Renditen und die potenziellen Gesamtrenditen der Rentenmärkte auf dem höchsten Stand seit über einem Jahrzehnt bleiben.

Es war richtig anzunehmen, dass zinsempfindlichere Märkte wie Staatsanleihen und Investment-Grade-Anleihen in diesem Umfeld unterdurchschnittlich abschneiden würden. Insgesamt erzielte der globale Investment-Grade-Markt eine Gesamtrendite von -14,1 %, wobei sich die Zinssätze mit -13,3 %, die Spreads mit -4,1 %, die Kuponerträge mit +2,7 % und die Wechselkurse mit +0,5 %¹ auswirkten.

Insgesamt lagen die Kreditspreads zum Jahresende bei 147 Bp bzw. hatten sich im Jahresverlauf um 48 Bp ausgeweitet. Europa und das Vereinigte Königreich blieben hinter den USA zurück und verzeichneten einen Anstieg um 69 Bp bzw. 81 Bp gegenüber +40 Bp in den USA. Auf Sektorbasis schnitten Verbraucherdienstleistungen, Einzelhandel, Freizeit und Technologie besser ab als der Gesamtmarkt, während die Immobilien, Grundstoffindustrie, Medien und Versicherungen unterdurchschnittlich abschnitten.

Performance-Rückblick

Der im Juni 2022 aufgelegte Man GLG Dynamic Income Fund hat sich seit seiner Auflegung gut entwickelt und eine positive Rendite (nach Abzug von Gebühren) erwirtschaftet. Der Fonds zielt darauf ab, durch einen flexiblen Anlageansatz in allen Bereichen des Kreditmarktes attraktive Erträge und Kapitalzuwächse zu erzielen. Zum Zeitpunkt der Auflegung war das Team der Ansicht, dass die Bewertungen an den IG- und HY-Märkten weiterhin attraktiv waren, und fokussierte den Fonds auf idiosynkratische Chancen in den Bereichen Energie, Finanzwerte und Basiskonsumgüter, die seit der Auflegung allesamt eine starke Performance erzielten. Seit der Auflegung gab es nur wenige Verlustbringer, vor allem im Immobilienbereich, von dem wir angesichts der attraktiven Bewertungen weiterhin überzeugt sind.

Ausblick

Angesichts von Renditen, die nahezu den Höchststand des letzten Jahrzehnts erreicht haben, sind wir der Meinung, dass Anleger weiterhin von einer Allokation in Anleihen profitieren können. Weltweit sind die Gelegenheiten nach wie vor gut, wir geben aber weiterhin Gesamteuropa den Vorzug und setzen auf Chancen im Investment-Grade-Bereich. Es ist in der Tat selten, dass sowohl die Zinssatz- als auch die Spread-Komponente gleichzeitig einen Mehrwert bieten. Die Weltwirtschaft verlangsamt sich zusehends, wobei die Auswirkungen einer strafferen Geldpolitik spürbar werden. Unserer Ansicht nach wird sich die Inflation im nächsten Jahr rasch abschwächen, da die Inputpreise stark zurückgegangen sind.

Eine Kombination aus günstigen Fundamentaldaten für Anleihen, insbesondere Verlangsamung des Wachstums und Inflation, und attraktiveren Renditen lässt uns konstruktiv nach vorne blicken. Unseres Erachtens ist bei der Titelauswahl ein differenzierterer Ansatz angebracht. Wir sind der Meinung, dass in bestimmten Bereichen des Marktes, vor allem in Europa, mit Schwerpunkt auf Immobilien, und bei Finanztiteln ein echter Mehrwert zu finden ist.

Die bisherige Wertentwicklung gibt keinen Aufschluss über zukünftige Ergebnisse. Renditen können infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die genannten Organisationen und/oder Finanzinstrumente sind nur zu Referenzzwecken angegeben. Der Inhalt dieses Informationsmaterials darf nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlung ausgelegt werden.

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

¹ The Morningstar Global Corporate Bond-Vergleichsgruppe.

Indexdefinitionen

CBOE Volatility Index (VIX Index)	Ein Index, der die Erwartungen des Marktes in Bezug auf die zukünftige Volatilität misst. Der VIX Index basiert auf Optionen auf den S&P 500® Index, der als der führende Indikator für den allgemeinen US-amerikanischen Aktienmarkt angesehen wird. Der VIX Index ist als der weltweit führende Maßstab für die Volatilität des US-amerikanischen Aktienmarktes anerkannt. Weitere Informationen finden Sie auf http://www.cboe.com/vix
FTSE 100 Index	Der FTSE 100 ist ein nach der Marktkapitalisierung gewichteter Index für im Vereinigten Königreich notierte Blue Chip-Unternehmen. Der Index gehört zur FTSE UK Index-Serie und soll die Entwicklung der 100 größten an der London Stock Exchange gehandelten Unternehmen messen, die Mindestkriterien in Bezug auf Größe und Liquidität erfüllen. Weitere Informationen finden Sie auf https://www.ftserussell.com/index-series/index-spotlights/uk-equity-indexes .
JP Morgan Emerging Market Bond Index Global (EMBI Global)	Der J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index Global („EMBI Global“) ist ein traditioneller, nach der Marktkapitalisierung gewichteter Index, der zur JPMorgan Emerging Market Bond Index- (EMBI-) Familie gehört. Hierbei handelt es sich um drei von J.P. Morgan angebotene Anleiheindizes, die Anleihen aus Schwellenländern nachbilden. Der EMBI Global bildet die Gesamttrenditen von gehandelten externen Schuldinstrumenten aus Schwellenländern ab und ist eine erweiterte Version des JPMorgan EMBI+. Wie der EMBI+ umfasst auch der EMBI Global auf USD lautende Brady Bonds, Darlehen und Eurobonds mit einem ausstehenden Nennwert von mindestens 500 Mio. USD. Er deckt mehr zulässige Instrumente ab als der EMBI+, da er etwas lockerere Grenzen für die Handelsliquidität am Sekundärmarkt hat als der EMBI+. Darüber hinaus definiert der EMBI Global Schwellenländer anhand einer Kombination aus von der Weltbank festgelegten Pro-Kopf-Einkommensspannen und der Schuldenumstrukturierungshistorie der einzelnen Länder. Dieses Kriterium ermöglicht es dem EMBI Global, eine Reihe von Ländern mit höheren Ratings einzubeziehen. Weitere Informationen finden Sie auf www.jpmorgan.com
JP Morgan Government Bond Index Emerging Market Global Diversified (EMBI Global Diversified)	Der Index ist eine umfassende Benchmark für Schwellenmarktschuldentitel, die von Schwellenländern begebene Lokalwährungsanleihen abbildet. Der EMBI Global Diversified ist als die investierbare Benchmark positioniert und umfasst nur Länder, die für den Großteil der internationalen Anlegerbasis zugänglich sind. Die Diversifizierungsmethodik begrenzt die Gewichtungen der größeren Länder im Index, indem nur ein bestimmter Teil der zulässigen aktuellen Nennbeträge ausstehender Schulden dieser Länder einbezogen wird, was zu einer gleichmäßigeren Verteilung der Gewichtungen über die Länder im Index hinweg führt. Der Index gehört der JPMorgan Emerging Market Bond Index- (EMBI-) Indexfamilie an, für die Renditen und Statistiken ab Dezember 1993 verfügbar sind. Weitere Informationen finden Sie auf www.jpmorgan.com
MSCI All Country World Index (MSCI ACWI)	Der MSCI ACWI Index, der führende globale Aktienindex von MSCI, soll die Entwicklung des gesamten Spektrums der Large- und Mid-Cap-Aktien in 23 Industrie- und 27 Schwellenländern abbilden. Zu November 2020 deckt der Index mehr als 3.000 Komponenten aus 11 Sektoren und ca. 85 % der um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung in jedem Land ab. Der Index ist anhand der Global Investable Market Index- (GIMI-) Methodik von MSCI aufgebaut. Diese soll Schwankungen berücksichtigen, die Bedingungen über Regionen, Marktkapitalisierungen, Sektoren, Stilsegmente und Kombinationen hinweg widerspiegeln. Weitere Informationen finden Sie auf www.msci.com
MSCI Emerging Markets Index	Der MSCI Emerging Markets Index erfasst Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 24 Schwellenländern*. Der Index deckt mit 1.136 Komponenten ca. 85 % der um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung in jedem Land ab. Weitere Informationen finden Sie auf www.msci.com
MSCI Europe Index	Der MSCI Europe Index erfasst Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 15 Industrieländern in Europa*. Der Index deckt mit 442 Komponenten ca. 85 % der um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung in den europäischen Industrieländern ab. Weitere Informationen finden Sie auf www.msci.com
MSCI Europe ex UK Index	Der MSCI Europe ex UK Index erfasst Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 14 Industrieländern in Europa. Der Index deckt mit 345 Komponenten ca. 85 % der um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung in den europäischen Industrieländern mit Ausnahme des Vereinigten Königreichs ab. Weitere Informationen finden Sie auf www.msci.com
MSCI World Index	Der MSCI World Index erfasst Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 23 Industrieländern*. Der Index deckt mit 1.634 Komponenten ca. 85 % der um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung in jedem Land ab. Weitere Informationen finden Sie auf www.msci.com
Russell/Nomura Large Cap Value Index	Der Russell/Nomura Large Cap Index enthält die 85 % der Substanztitel aus dem Russell/Nomura Total Market Index mit der höchsten um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung
Russell/Nomura Total Market Index	Der Russell/Nomura Total Market Index ist ein japanischer Aktienindex, der sich aus den 1.000 größten Aktien nach der Marktkapitalisierung unter Ausschluss stabiler Beteiligungen zusammensetzt und die 98 % der an allen japanischen Börsen notierten Aktien mit der höchsten um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung abdeckt. Weitere Informationen finden Sie auf www.ftse.com
S&P 500	Der Index ist ein weithin anerkannter Maßstab für den US-amerikanischen Aktienmarkt. Dieser Index ist ein nicht verwalteter nach der Marktkapitalisierung gewichteter Index, der 500 der US-Stammaktien mit den größten Kapitalisierungen umfasst. Die Renditen des S&P 500 umfassen die Wiederanlage von Dividenden. Weitere Informationen finden Sie auf https://eu.spindices.com/
Tokyo Stock Price Index (TOPIX)	Ein nach der Marktkapitalisierung gewichteter Index aller am Hauptmarkt der Börse Tokio notierten Unternehmen. Er ist ein Maßstab für den Gesamttrend auf dem Aktienmarkt und wird als Benchmark für die Anlage in japanischen Aktien verwendet. Weitere Informationen finden Sie auf https://www.jpix.co.jp/english/markets/indices/topix/

GLOSSAR

Absolute Return (Absolute Rendite)	<p>Dieser Begriff bezieht sich auf Anlagestrategien, die auf eine Rendite abzielen, die über null und in manchen Fällen über einer positiven Mindestrendite wie dem Libor liegt. Die Mindestrendite ist ein numerischer Wert für die Investmentperformance, der als Zielvorgabe dient, die ein Portfoliomanager übertreffen soll.</p> <p>Der Begriff „absolute Rendite“ kann sich auch auf die Gesamrendite (d. h. den Gesamtgewinn bzw. Gesamtverlust) eines Portfolios oder Fonds im Gegensatz zur relativen Rendite (d. h. dem relativen Gewinn oder Verlust) im Verhältnis zu einer Benchmark beziehen. Die Bezeichnung „relativ“ ist darauf zurückzuführen, dass die Performance vieler Fonds an einem Index gemessen wird.</p>
Aktive Verwaltung	<p>Eine aktive Verwaltung bedeutet, dass ein menschliches Element wie ein einzelner Manager, Co-Manager oder ein Managerteam zur aktiven Verwaltung des Portfolios eines Fonds herangezogen werden. Aktive Manager stützen sich auf analytisches Research, Prognosen und ihr eigenes Urteilsvermögen sowie ihre Erfahrung, wenn sie Anlageentscheidungen über den Kauf, Verkauf und das Halten von Wertpapieren treffen. Das Gegenteil einer aktiven Verwaltung ist die passive Verwaltung, bei der ein Index nachgebildet wird.</p>
Nebenanlagen	<p>Anlagen, bei denen es sich nicht um die Hauptanlagen eines Unternehmens handelt.</p>
Wertsteigerung	<p>Ein Anstieg des Marktwerts eines Vermögenswerts wie einer Aktie, einer Anleihe, eines Rohstoffs oder einer Immobilie, oder des Werts einer Währung gegenüber einer anderen. Das Gegenteil von Wertminderung.</p>
Vermögenswert	<p>Ein Objekt mit wirtschaftlichem Wert, das im Eigentum einer Person oder Gesellschaft steht, und insbesondere ein Objekt, das zu Geld gemacht werden kann. Beispiele sind Barmittel, Wertpapiere, Forderungen, Vorräte, Büroausstattung, Immobilien, Autos und sonstige Vermögensgegenstände.</p> <p>In einer Bilanz entsprechen die Vermögenswerte der Summe der Verbindlichkeiten, Stammaktien, Vorzugsaktien und Gewinnrücklagen.</p>
Anlagenklasse	<p>Eine Anlagenklasse ist eine Gruppe von Wertpapieren, die ähnliche Merkmale aufweisen, die sich am Markt ähnlich verhalten und die denselben Rechtsvorschriften unterliegen. Die drei Hauptanlagenklassen sind Aktien, Rentenwerte oder Anleihen und Zahlungsmitteläquivalente oder Geldmarktinstrumente. Manche Anlageexperten verwenden auch Immobilien, Rohstoffe und zunehmend Kryptowährungen wie Bitcoin in ihrem Anlagenklassenmix.</p>
Zahlungsbilanz	<p>Die Aufstellung der Nettofinanztransaktionen eines Landes mit anderen Ländern über einen bestimmten Zeitraum.</p>
Bilanz	<p>Ein finanzielles Dokument, das eine Momentaufnahme dessen bietet, was einer Gesellschaft gehört und was diese schuldet, sowie den von Gesellschaftern investierten Betrag.</p>
Bankakzept	<p>Ein Bankakzept ist eine von einem Nichtfinanzunternehmen begebene kurzfristige Kreditanlage, deren Zahlung von einer Bank garantiert wird. Akzente werden auf dem Sekundärmarkt mit einem Abschlag gegenüber ihrem Nennwert gehandelt.</p>
Benchmark	<p>Ein Standard, an dem die Wertentwicklung eines Fonds gemessen und verglichen werden kann (z. B. ein Aktienmarktindex wie der FTSE 100 oder ein Zinssatz wie der LIBOR).</p>
Blue Chip-Unternehmen	<p>Die Aktien von Großunternehmen mit nachweislich starken Erträgen, zuverlässigen Dividendenzahlungen und einer stetigen Aktienkursentwicklung. Blue Chips sind normalerweise die Aktien mit den höchsten Marktkapitalisierungen in einem bestimmten Markt, und sie werden am meisten gehandelt.</p>
Anleihe	<p>Ein für einen Zeitraum von über einem Jahr zur Aufnahme von Fremdkapital begebenes Schuldinstrument. Eine Anleihe ist im Allgemeinen ein Versprechen zur Rückzahlung des Kapitalbetrags zusammen mit Zinsen (Kupons) an einem bestimmten Datum (Fälligkeit). Manche Anleihen zahlen keine Zinsen, bei allen Anleihen muss jedoch der Kapitalbetrag zurückgezahlt werden. Wenn ein Anleger eine Anleihe kauft, wird er zum Gläubiger des Emittenten.</p>
Rückkauf	<p>Ein (Aktien-)Rückkauf liegt vor, wenn eine Gesellschaft ihre eigenen umlaufenden Aktien kauft, um die Anzahl der auf dem offenen Markt verfügbaren Aktien zu reduzieren. Unternehmen kaufen Aktien aus einer Reihe von Gründen zurück, wie z. B. zur Steigerung des Werts der verbleibenden verfügbaren Aktien durch eine Reduzierung des Angebots oder um zu verhindern, dass andere Aktionäre eine beherrschende Beteiligung erwerben.</p>
Zahlungsmitteläquivalente	<p>Zahlungsmitteläquivalente sind Anlagetitel zur kurzfristigen Anlage, sie haben eine hohe Kreditqualität und sind äußerst liquide. Diese Wertpapiere haben ein Profil mit einem niedrigen Risiko und niedrigen Erträgen und umfassen US-Schatzwechsel, Einlagenzertifikate, Bankakzente, Commercial Papers und sonstige Geldmarktinstrumente.</p>
Einlagenzertifikate	<p>Von einer Bank oder einem Einleger begebenes verzinsliches Zertifikat. Zinsen werden bei der Fälligkeit bezahlt.</p>
Organismus für gemeinsame Anlagen	<p>Eine Art von Anlageorganismus, bei dem Gelder von verschiedenen Anlegern eingeholt und alle eingeholten Gelder zusammen zur Finanzierung der Anlage verwendet werden.</p>

GLOSSAR (Fortsetzung)

Zinseszinsen	Die Erwirtschaftung von Zinsen auf Zinsen, oder genauer gesagt, die auf die Summe des Kapitalbetrags und der bereits aufgelaufenen Zinsen erwirtschafteten Zinsen. Die Rendite auf eine Anlage ist kumuliert, wenn sie Zinseszinsen berücksichtigt, d. h. wenn die Zinsen reinvestiert werden.
Commercial Paper	Eine Form der Kreditaufnahme durch Unternehmen und Institutionen in Form von Darlehen, bei denen die Darlehensgeber kein Recht haben, bei einem Zahlungsausfall auf das Vermögen des Darlehensnehmers zuzugreifen. Diese Darlehen werden für einen Zeitraum von höchstens einem Jahr vergeben.
Rohstoff	Ein Massenprodukt. Viele Rohstoffe wie Kaffee, Fleisch und Getreide sowie Rohstoffe wie Metalle und Öl werden an lokalen, regionalen und/oder internationalen Märkten, die als Rohstoffbörsen bezeichnet werden, auf Kassabasis oder über Futureskontrakte gehandelt, die den Kauf oder Verkauf eines Rohstoffs zu einem vorab festgelegten Preis an einem bestimmten zukünftigen Datum ermöglichen.
Stammaktien	Siehe <i>Stammaktien</i>
Basiskonsumgüter	Basiskonsumgüter sind wesentliche Produkte wie Lebensmittel, Getränke, Tabak und Haushaltswaren. Basiskonsumgüter sind Waren, die die Leute unabhängig von ihrer finanziellen Lage nicht aus ihren Budgets streichen können oder wollen (Investopedia).
Wandelanleihe	Eine von einem Unternehmen begebene Anleihe mit einem festen Fälligkeitsdatum, auf die Zinsen in Form eines Kupons gezahlt werden. Eine Wandelanleihe weist Anleihen- und Aktienmerkmale auf und ihre Bewertung entspricht beiden Anlagearten. Sie bietet dem Inhaber die Option, die Anleihe gegen eine bestimmte Anzahl von Aktien des Emittenten umzutauschen – mit anderen Worten: Sie enthält eine „eingebettete Option“.
Unternehmensanleihe	Eine von einem Unternehmen begebene Anleihe.
Kupon	Ein Begriff, der zur Bezeichnung der auf Anleihen gezahlten Zinsen verwendet wird. Er leitet sich davon ab, dass Anleihen früher als Inhaberdokumente (d. h. Zertifikate, auf denen der Eigentümer nicht genannt ist) begeben wurden, denen datierte Kupons beigefügt waren. Diese wurden von dem Dokument abgetrennt, wenn die Zahlung der Zinsen fällig wurde, und bei einer Zahlstelle zur Auszahlung der Zinsen eingereicht.
Länderrisiko	Länderrisiko ist ein Begriff für die mit der Anlage in einem bestimmten Land verbundenen Risiken. Das Länderrisiko variiert von einem Land zum anderen, und es kann politische, Wechselkurs-, wirtschaftliche und Übertragungsrisiken umfassen. Das Länderrisiko bezeichnet insbesondere das Risiko, dass eine ausländische Regierung ihre Verpflichtungen in Bezug auf ihre Anleihen oder sonstigen finanziellen Verbindlichkeiten nicht erfüllt. Im weiteren Sinne ist das Länderrisiko das Ausmaß, in dem sich politische und wirtschaftliche Unruhen auf die Wertpapiere von Emittenten auswirken, die in einem bestimmten Land tätig sind.
Kreditrating	Von Kreditratingagenturen vergebene Ratings, die der Einschätzung der Agentur in Bezug auf die qualitativen und quantitativen Informationen bezüglich eines Unternehmens oder Landes entsprechen. Ratings werden dazu verwendet, um Unternehmen und Länder auf der Grundlage der Wahrscheinlichkeit einzustufen, dass sie ihren Verpflichtungen (zur Rückzahlung ihrer Schulden) nicht nachkommen.
Kreditrisiko	Der Begriff „Kreditrisiko“ wird gewöhnlich in Bezug auf Anlagen in Anleihen verwendet und bezieht sich auf das Risiko eines Verlusts aufgrund der Unfähigkeit des Emittenten einer Anleihe zur vollständigen und planmäßigen Zahlung der Zinsen und zur Rückzahlung des Kapitals am Ende der Laufzeit der Anleihe. Bei Wertpapieren mit „AAA“ oder „Investment Grade“ wird vom geringsten Kreditrisiko ausgegangen, während Anleihen ohne Investment Grade – auch als Hochzinsanleihen (oder „Ramschanleihen“) bezeichnet – mit dem höchsten Kreditrisiko eingestuft werden. Je höher das Kreditrisiko ist, umso höher ist der Zinssatz, den der Darlehensnehmer zahlen muss, um Darlehensgeber anzuziehen.
Devisentermingeschäft	Ein verbindlicher Vertrag auf dem Devisenmarkt, der den Wechselkurs für den Kauf oder Verkauf einer Währung zu einem zukünftigen Datum festschreibt. Ein Devisentermingeschäft ist im Grunde ein Absicherungsmittel, bei dem keine Vorauszahlung erforderlich ist.
Leistungsbilanz	Geldflüsse in und aus einem Land in Bezug auf Handel zwischen Privatpersonen, wenn z. B. Arbeiter Geld an ihre Familien in anderen Ländern schicken. Die Leistungsbilanz umfasst die sichtbare Handelsbilanz (der Nettounterschied zwischen den Exporten und Importen von Waren) und die unsichtbare Handelsbilanz (Zahlungen und Einnahmen für Leistungen wie Transport, Bankleistungen und Tourismus).
Schuldtitel	Der Begriff „Schuldtitel“ bezieht sich auf Schuldinstrumente wie Staatsanleihen, Unternehmensanleihen, Einlagenzertifikate, Kommunalanleihen oder Vorzugsaktien, die zwischen zwei Parteien ge- und verkauft werden können und bei denen grundlegende Konditionen wie der Nennbetrag (der geliehene Betrag), der Zinssatz sowie die Fälligkeits- und Verlängerungsdaten festgelegt sind.
Deflation	Eine Deflation ist der allgemeine Rückgang der Preise für Waren und Dienstleistungen, der eintritt, wenn die Inflationsrate unter 0 % sinkt. Eine Deflation erfolgt automatisch, wenn die Geldmenge in einer Volkswirtschaft unveränderlich ist. Während einer Deflation sind die Kaufkraft von Währungen und Löhnen höher, als dies ansonsten der Fall gewesen wäre.

GLOSSAR (Fortsetzung)

Derivate	Finanzkontrakte wie Futures, Optionen und verschiedene Wertpapiere, die einen „synthetischen“ Zugang zu einem Basiswert wie einem Rohstoff, Aktienmarkt oder Rentenwert bieten. Die Preisschwankungen von Derivaten folgen im Allgemeinen den Preisschwankungen der Basiswerte, Derivate erfordern jedoch im Allgemeinen nur geringe Kapitalbeträge (Margen) zum Aufbau eines Engagements in den Basiswerten.
Industrieländer	Länder mit soliden, etablierten Volkswirtschaften mit einem hohen Wirtschaftswachstum und einem hohen Maß an Sicherheit. Es wird daher davon ausgegangen, dass diese sicherere, stabilere Anlagegelegenheiten bieten als Entwicklungsländer.
Dividende	Eine Dividende ist die Ausschüttung einer Entlohnung aus einem Teil der Erträge des Unternehmens und wird an eine Klasse von Anteilhabern gezahlt. Dividenden werden vom Verwaltungsrat des Unternehmens festgesetzt und verwaltet, sie müssen von den Anteilhabern jedoch durch Ausübung ihrer Stimmrechte bestätigt werden. Dividenden können als Barzahlungen oder in Form von Aktien oder sonstigen Vermögenswerten ausgeschüttet werden, wobei Bardividenden jedoch am häufigsten erfolgen.
Dividendenrendite	Siehe <i>Rendite</i> (3. Definition)
Gewinn je Aktie (Earnings per Share, EPS)	Der Gewinn nach Abzug von Steuern und Dividenden an Vorzugsaktionäre, geteilt durch die Gesamtzahl der umlaufenden Stammaktien. Die meisten Erfolgsrechnungen umfassen eine Berechnung des Gewinns je Aktie. Diese Berechnung gibt Aufschluss darüber, wie viel Geld die Aktionäre für jede gehaltene Aktie erhalten würden, wenn das Unternehmen seine gesamten Nettoerträge für den Zeitraum ausschütten würde. In Wirklichkeit schütten Unternehmen jedoch nicht ihre gesamten Erträge aus. Diese werden normalerweise in das Unternehmen reinvestiert.
Schwellenländer	„Schwellenmarkt“ ist ein Begriff zur Bezeichnung eines Entwicklungslands, in dem Anlagen voraussichtlich höhere Renditen erzielen würden, jedoch mit einem höheren Risiko. Globale Indexanbieter beziehen manchmal relativ wohlhabende Länder in diese Kategorie ein, deren Volkswirtschaften aus regulatorischer Sicht nach wie vor als unterentwickelt angesehen werden.
Aktie	Ein Eigentumsrecht, das eine Beteiligung an einem Unternehmen verbrieft.
Aktien swaps	Ein Aktienswap ist ein Arrangement in einem Futureskontrakt, demzufolge Glatstellungenunterschiede über Barzahlungen und nicht über die Auslieferung physischer Waren oder Wertpapiere abgewickelt werden. Dies ist im Allgemeinen einfacher, da sowohl Gewinne als auch Verluste in bar beglichen werden. Aktien swaps bieten Anlegern alle mit dem Eigentum an einem Wertpapier verbundenen Vorteile und Risiken, ohne dass dieses tatsächlich gehalten wird.
Aktiengebundenes Wertpapier	Eine Art von Schuldinstrument, bei dem die Rendite an die Entwicklung einer Gruppe zugrunde liegender Aktien geknüpft ist, die ebenfalls mit dem Wertpapier verbunden sind.
EPS	Siehe <i>Gewinn je Aktie</i>
Börsengehandelte Fonds (Exchange Traded Funds, ETFs)	Indexnachbildende Fonds, die wie Aktien an Börsen gehandelt werden können – sie verbinden somit die diversifizierten Anlagen eines Fonds mit den niedrigen Kosten und der Handelbarkeit einer Aktie.
Engagement	Der Begriff „Engagement“ (oder Marktengagement) bezieht sich auf den Währungsbetrag von Fonds, oder den Prozentsatz eines Portfolios, der in einem bestimmten Wertpapiertyp, einem Marktsektor oder einer Branche investiert ist, und wird gewöhnlich als Prozentsatz der gesamten Portfoliobestände ausgedrückt. Das Engagement entspricht dem Betrag, den ein Anleger aufgrund der spezifischen mit einer bestimmten Anlage verbundenen Risiken verlieren kann.
Außenbilanz	Siehe <i>Leistungsbilanz</i>
Derivative Finanzinstrumente	Siehe <i>Derivate</i>
Rentenwerte	Dieser Begriff bezeichnet Anleihen und sonstige Schuldinstrumente, da sie normalerweise einen festen Zinssatz zahlen.
Devisen (handel/-geschäfte/ -markt)	Dieser Begriff bezeichnet den Austausch einer Währung gegen eine andere oder die Umrechnung von einer Währung in eine andere. Er bezieht sich außerdem auf den globalen Markt, an dem Währungen nahezu den ganzen Tag lang gehandelt werden.
Terminkontrakt	Ein Terminkontrakt ist ein maßgeschneiderter Vertrag zwischen zwei Parteien über den Kauf oder Verkauf eines bestimmten Vermögenswerts zu einem zukünftigen Datum zu einem vereinbarten Preis. Im Gegensatz zu Aktien und Anleihen ist ein Terminkontrakt ein Derivat, dessen Wert von einem Basiswert abhängt. Im Gegensatz zu standardisierten Futures werden Terminkontrakte nicht an einer zentralen Börse gehandelt und können sehr flexibel ausgestaltet werden.
Freier Cashflow (Free Cash Flow, FCF)	Der Barbestand eines Unternehmens nach Abzug aller Ausgaben einschließlich von Dividenden, Schuldentilgungen, Steuern, Betriebskosten und Investitionsausgaben.

GLOSSAR (Fortsetzung)

Fondssektor	Fonds werden in Sektoren eingeordnet, um Vergleiche zwischen Fonds mit ähnlichen Anlagezielen und Anlagearten zu ermöglichen.
Futures-Kontrakte	Eine Vereinbarung über den Kauf oder Verkauf einer bestimmten Menge eines Wertpapiers, einer Währung oder eines Rohstoffs zu einem bestimmten zukünftigen Datum und zu einem vorab vereinbarten Preis.
BIP	Siehe <i>Bruttoinlandsprodukt</i>
BNE	Siehe <i>Bruttonationaleinkommen</i>
Staatsanleihe	Von einer Regierung begebene Anleihen.
Bruttoinlandsprodukt (BIP)	Der Gesamtwert der Waren- und Dienstleistungsproduktion einer Volkswirtschaft und neben dem BNE eine der zentralen Kennzahlen für das Wirtschaftswachstum.
Bruttonationaleinkommen (BNE)	Dieser Begriff entspricht dem BIP mit Ausnahme der Tatsache, dass hier die Einnahmen eines Landes aus Investitionen im Ausland hinzugezählt und die Einnahmen, die Ausländer in dem Land erzielen und ins Ausland schicken, abgezogen werden.
Index	Ein Index ist ein Portfolio mit Aktien, die anhand von einfachen, vorab bestimmten Regeln ausgewählt werden, und soll ein bestimmtes Anlageziel erfassen.
Inflation	Der Satz, mit dem das allgemeine Preisniveau für Waren und Dienstleistungen steigt und folglich die Kaufkraft der Währung nachlässt.
Zinssatz	Der Zinssatz ist der Betrag, ausgedrückt als Prozentsatz des Kapitalbetrags, den ein Darlehensgeber einem Darlehensnehmer für die Nutzung von Vermögenswerten berechnet. Zinssätze werden typischerweise auf Jahresbasis angegeben (sog. effektiver Jahreszins). Bei den geliehenen Vermögenswerten kann es sich um Barmittel, Konsumgüter und große Vermögenswerte wie Fahrzeuge oder Gebäude handeln.
Liquidität	Ein relativer Begriff zur Bezeichnung der Geschwindigkeit, mit der Vermögenswerte zu Geld gemacht werden können und umgekehrt.
Liquider Vermögenswert	Ein liquider Vermögenswert ist ein Vermögenswert, der schnell zu Geld gemacht werden kann, mit geringen Auswirkungen auf den Preis, der auf dem offenen Markt erzielt werden kann. Zu den liquiden Vermögenswerten gehören Geldmarktinstrumente und Staatsanleihen.
Börsennotiert	Wenn die Aktien von Unternehmen oder die Anteile von Fonds zum Handel an einer Börse zugelassen sind, werden sie als „börsennotierte“ Anlagen bezeichnet. Börsen haben „Notierungsanforderungen“ die alle Unternehmen/Fonds erfüllen müssen, bevor sie zur Notierung zugelassen werden. Das Gegenteil von börsennotiert ist außerbörslich.
Lokalwährung	Die in einem Land am häufigsten verwendete Währung. Dies umfasst gewöhnlich die Landeswährung des Landes.
Long-Position	Ein Wertpapier, das in Erwartung einer Wertsteigerung gekauft wird.
Marktkapitalisierung	Der Marktwert des ausgegebenen Aktienkapitals eines Unternehmens – mit anderen Worten: Die Anzahl der Aktien multipliziert mit dem aktuellen Preis dieser Aktien am Aktienmarkt. Unternehmen werden abhängig von ihrer Marktkapitalisierung als Large Cap, Mid Cap oder Small Cap eingestuft, wobei die konkreten Kriterien für die Einstufung jedoch vom jeweiligen Markt abhängen.
Fälligkeitsdatum	Das Fälligkeitsdatum ist das Datum, zu dem der Kapitalbetrag eines Schuldinstruments fällig und an den Anleger zurückgezahlt wird und die Zinszahlungen aufhören.
Geldmarktinstrumente	Instrumente, die von Regierungen und Unternehmen und sonstigen Emittenten verwendet werden, die kurzfristig Mittel aufnehmen wollen, gewöhnlich für weniger als ein Jahr. Sie werden auch als kurzfristige Schuldinstrumente bezeichnet. Der Begriff umfasst Einlagenzertifikate, Commercial Paper und kurzfristige britische Staatsanleihen.
Kommunalanleihe	Eine von einem Bundesstaat oder einer Kommunalverwaltung (oder von verbundenen Emittenten) in den USA zur Deckung von Investitionsausgaben begebene Anleihe.
Option	Ein Derivat, das dem Inhaber das Recht verleiht, jedoch keine Verpflichtung auferlegt, ein Wertpapier oder einen Vermögenswert zu einem bestimmten Preis innerhalb eines bestimmten Zeitraums oder zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt zu kaufen oder zu verkaufen.
Stammaktien	Wertpapiere, die ein Eigentumsrecht an einem börsengehandelten Unternehmen verbriefen. Die Inhaber haben Anspruch auf die von dem Unternehmen festgesetzten Dividenden und sie haben das Recht zur Abstimmung über die Bestellung von Verwaltungsratsmitgliedern und sonstige wichtige Angelegenheiten. Sie sind jedoch gegenüber Inhabern von Vorzugsaktien nachrangig.
Außerbörslich (Over the counter, OTC)	Dieser Begriff bezieht sich im Allgemeinen auf Aktien (er kann sich jedoch auch auf andere Finanzinstrumente beziehen), die nicht an einer Börse notiert sind und über ein Händlernetz gehandelt werden.
Überbewertet	Wenn ein Aktienkurs oder Markt über dem Niveau gehandelt wird, das durch die Fundamentaldaten gerechtfertigt ist.

GLOSSAR (Fortsetzung)

Übergewichtung	Ein Anlageportfolio, das im Vergleich zu der Gewichtung eines Wertpapiers im zugrunde liegenden Benchmarkportfolio eine übermäßige Menge dieses bestimmten Wertpapiers hält. Aktiv verwaltete Portfolios nehmen eine Übergewichtung eines Wertpapiers vor, wenn dies dem Portfolio die Erzielung von Überschussrenditen ermöglicht. „Übergewichtung“ kann sich auch auf die Einschätzung eines Investmentanalysten beziehen, dass das Wertpapier seine Branche, seinen Sektor oder den gesamten Markt übertreffen wird.
Passive Verwaltung	Die passive Verwaltung ist ein Verwaltungsstil, bei dem das Portfolio eines Fonds einen Marktindex abbildet. Die passive Verwaltung ist das Gegenteil der aktiven Verwaltung. Die passive Verwaltung wird auch als „passive Strategie“, „passives Investment“ oder „Index-Investment“ bezeichnet.
KBV	Siehe <i>Kurs-Buchwert-Verhältnis</i>
Vorzugsaktien	Auch als Vorzugsaktien bezeichnet. Aktien, die den Inhaber zu einer festen Dividende berechtigen, die gezahlt wird, bevor Dividenden an Inhaber von Stammaktien ausgeschüttet werden.
Vorzugsaktien	Siehe <i>Vorzugsaktien</i>
Kurs-Buchwert-Verhältnis (KBV)	Das KBV entspricht dem Wert, den die Marktteilnehmer dem Eigenkapital eines Unternehmens im Verhältnis zu seinem Buchwert (Summe der Vermögenswerte abzüglich der Summe der Verbindlichkeiten) zuschreiben. Der Marktwert einer Aktie ist eine zukunftsgerichtete Kennzahl, die die zukünftigen Cashflows eines Unternehmens berücksichtigt. Der Buchwert des Eigenkapitals ist eine Bilanzkennzahl, die auf dem Anschaffungskostenprinzip basiert und die bisherigen Aktienemissionen zuzüglich von Gewinnen oder Verlusten und abzüglich von Dividenden und Aktienrückkäufen widerspiegelt. Je höher die Kennzahl ist, umso höher ist die Prämie, die der Markt für das Unternehmen über seine Vermögenswerte hinaus bezahlt. Eine niedrige Kennzahl kann eine gute Anlagegelegenheit bedeuten, es könnte jedoch auch bedeuten, dass etwas mit dem Unternehmen nicht in Ordnung ist. Die Kennzahl ist bei bestimmten Unternehmensarten wie z. B. im Technologiesektor weniger aussagekräftig. Dies ist darauf zurückzuführen, dass diese Unternehmen versteckte Vermögenswerte wie geistige Eigentumsrechte haben, die wertvoll sind, jedoch nicht in den Buchwert eingehen.
Primärmarkt	Der Markt für Neuemissionen von Wertpapieren. Auf dem Primärmarkt wird das Wertpapier unmittelbar vom Emittenten gekauft.
Quantitative Analyse	Die quantitative Analyse (QA) ist eine Technik, die darauf abzielt, Verhaltensmuster mithilfe von mathematischen und statistischen Modellen, Messungen und Research zu erfassen. Quantitative Analysten versuchen, eine Realität in einen numerischen Wert auszudrücken. Die quantitative Analyse wird aus verschiedenen Gründen verwendet, unter anderem zur Messung, Performancebeurteilung oder Bewertung eines Finanzinstruments und zur Prognostizierung von Ereignissen wie Änderungen des Bruttoinlandsprodukts (BIP) eines Landes.
Quantitative Lockerung (Quantitative Easing, QE)	Die quantitative Lockerung ist eine unkonventionelle Geldpolitik, bei der eine Zentralbank staatliche Wertpapiere oder andere Wertpapiere auf dem Markt kauft, um die Zinssätze zu senken und die Geldmenge zu erhöhen. Die quantitative Lockerung erhöht die Geldmenge, indem Finanzinstitute mit Kapital überflutet werden, um die Kreditvergabe und Liquidität zu steigern. Wenn die kurzfristigen Zinssätze nahe bei null liegen und wenn das Drucken von Geld nicht in Frage kommt, kann eine quantitative Lockerung in Erwägung gezogen werden.
Quantitativer Handel	Eine Anlageform, bei der Computer eingesetzt werden, um Finanzdaten zu durchkämmen und absehbare Muster zu identifizieren. Quantitative Händler nutzen moderne Technologie, Mathematik und die Verfügbarkeit umfassender Datenbanken, um rationale Handelsentscheidungen zu treffen und Handelsgelegenheiten zu identifizieren.
Referenzindex	Ein Index, der zu Performancevergleichszwecken als Benchmark verwendet wird, der jedoch keine formelle Benchmark gemäß dem Prospekt des Fonds ist.
Kapitalrendite	Der Gewinn auf eine Anlage in Bezug auf den investierten Betrag, der nicht als steuerpflichtiges Ereignis anfallen und nicht als Ertrag versteuert wird.
Risikobereinigte Rendite	Die risikobereinigte Rendite bestimmt die Rendite einer Anlage, indem gemessen wird, wie hoch das Risiko ist, das zur Erzielung dieser Rendite eingegangen wurde. Dieses wird im Allgemeinen als Zahl oder Rating ausgedrückt. Risikobereinigte Renditen werden auf einzelne Wertpapiere, Investmentfonds und Portfolios angewendet.
Sekundärmarkt	Ein Markt, an dem ein Anleger Wertpapiere im Anschluss an die ursprüngliche Emission auf dem Primärmarkt von einem anderen Anleger anstatt vom Emittenten kauft.
Sektor	Ein Sektor ist ein Bereich der Wirtschaft, in dem Unternehmen dieselben oder miteinander verbundene Produkte oder Dienstleistungen gemeinsam haben. Ein Sektor kann auch eine Branche oder ein Markt sein, die bzw. der gemeinsame Betriebsmerkmale aufweist. Die Unterteilung einer Volkswirtschaft in Sektoren ermöglicht eine tiefgreifendere Analyse der gesamten Volkswirtschaft.
Anteil	Siehe <i>Aktien</i>
Short-Position	Fondsmanager nutzen diese Technik, um ein Wertpapier zu leihen, und verkaufen dieses mit der Absicht, es billiger zurückzukaufen, wenn der Preis fällt. Die Position profitiert davon, wenn das Wertpapier an Wert verliert. Bei OGAW-Fonds können Derivate – wie z. B. Aktienswaps – zur Simulation von Short-Positionen verwendet werden.
Wertpapier	Ein Oberbegriff für Aktien, Anleihen, Optionen, Zeichnungsrechte, Optionsscheine und sonstige handelbare Anlagen, die Ertragsansprüche oder ein Eigentumsrecht verleihen.

GLOSSAR (Fortsetzung)

Staatliche Schuldtitel	Bei Staatsschulden handelt es sich um die Schulden einer Zentralregierung. Hier handelt es sich um Schulden, die von nationalen Regierungen zur Finanzierung des Wachstums und der Entwicklung des Emissionslandes in Fremdwährungen begeben werden. Das Kreditrating des emittierenden Landes gibt Aufschluss über die Stabilität des emittierenden Landes, und dies hilft Anlegern dabei, bei der Beurteilung von Anlagen in staatliche Schuldtitel die Risiken abzuwägen.
Staatsanleihenrisiko	Siehe <i>Länderrisiko</i>
Aktie	Siehe <i>Aktien</i>
Aktioption	Das Recht zum Kauf oder Verkauf einer bestimmten Aktie zu einem bestimmten Preis an oder ab einem bestimmten Datum. Aktioptionen werden häufig bei Start-ups oder großen börsennotierten Unternehmen als Anreize für Mitarbeiter verwendet.
Swap	Ein Austausch von Zahlungsströmen zwischen zwei Parteien, typischerweise zur Reduzierung des Zins- oder Währungsrisikos.
Synthetisch	Dieser Begriff bezeichnet Finanzinstrumente, die künstlich geschaffen werden, indem andere Instrumente mit anderen Cashflow-Mustern simuliert werden. Die Struktur von synthetischen Produkten ist auf den Kapitalflussbedarf des Anlegers zugeschnitten. Sie werden in Form eines Vertrags geschaffen und daher als „synthetisch“ bezeichnet.
Übertragbares Wertpapier	Jedes Wertpapier, das an den Kapitalmärkten gehandelt werden kann.
Treasury Bill (T-Bill)	Ein Treasury Bill (T-Bill) ist eine kurzfristige Schuldverschreibung des US-Finanzministeriums mit einer Laufzeit von weniger als einem Jahr und wird bis zu einem Höchstbetrag von 5 Mio. USD in Einheiten von 1.000 USD ohne Ausschreibung verkauft. T-Bills haben unterschiedliche Laufzeiten und werden mit einem Abschlag gegenüber dem Nennwert begeben. Die Anleger erhalten keine regelmäßigen Zinszahlungen, T-Bills enthalten jedoch Zinsen, die sich in dem Betrag niederschlagen, der bei der Fälligkeit gezahlt wird.
Gesamtwirtschaftliche Produktion	Die Gesamtmenge der in einer Volkswirtschaft produzierten Waren und Dienstleistungen.
Gesamtrendite	Die Gesamtrendite ist die gesamte Rendite einer Anlage über einen bestimmten Zeitraum, einschließlich der Erträge aus Dividenden, Zinsen oder Mietzahlungen sowie sämtlicher Gewinne oder Verluste aus Änderungen des Marktwerts des Vermögenswerts. Sie wird normalerweise als Prozentsatz der Anschaffungskosten ausgedrückt und für kürzere Zeiträume als ein Jahr auf das Jahr hochgerechnet.
Unterbewertet	Wenn ein Aktienkurs oder Markt unter dem Niveau gehandelt wird, das durch die Fundamentaldaten gerechtfertigt ist.
Untergewichtung	Ein untergewichtetes Portfolio hält im Vergleich zu der Gewichtung des Wertpapiers im zugrunde liegenden Benchmarkportfolio eine unzureichende Menge eines bestimmten Wertpapiers. „Untergewichtung“ kann sich auch auf die Einschätzung eines Analysten in Bezug auf die zukünftige Performance eines Wertpapiers in Szenarien beziehen, in denen es voraussichtlich eine Underperformance erzielen wird.
Volatilität	Das Ausmaß, in dem der Preis eines Wertpapiers oder Rohstoffs oder das Marktniveau, Zinssätze oder Währungskurse im Laufe der Zeit schwanken. Eine hohe Volatilität bedeutet schnelle und starke Auf- und Abwärtsbewegungen über einen relativ kurzen Zeitraum. Eine niedrige Volatilität bedeutet viel geringere und weniger häufige Wertänderungen.
Optionsschein	Ein Finanzinstrument, das normalerweise mit einer Anleihe oder einem sonstigen Wertpapier verbunden ist und den Inhaber zum Kauf einer bestimmten Menge von Stammaktien zu einem bestimmten Preis innerhalb eines Zeitraums von Jahren oder dauerhaft berechtigt. Der Preis, zu dem die zugrunde liegenden Aktien ge- oder verkauft werden können, wird als der Ausübungspreis oder „Strike“ bezeichnet.
Rendite	<ol style="list-style-type: none"> 1. Die jährliche Rendite einer Anlage, ausgedrückt als Prozentsatz. 2. Für Anleihen und Schuldverschreibungen der Kuponsatz geteilt durch den Marktpreis. Dies ist kein genauer Maßstab für die Gesamtrendite, da Kapitalgewinne nicht berücksichtigt werden. 3. Für Wertpapiere die jährlichen Dividenden geteilt durch den Kaufpreis. Dies ist kein genauer Maßstab für die Gesamtrendite, da Kapitalgewinne nicht berücksichtigt werden. In dieser Bedeutung wird der Begriff auch als Dividendenrendite oder laufende Rendite bezeichnet.

Der Verwaltungsrat von Man Funds plc (der „Fonds“) legt hiermit seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 vor.

Hauptgeschäftstätigkeit und Überblick über die Geschäftslage

Der Fonds wurde als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds nach irischem Recht als Public Limited Company am 1. August 1996 unter der Registernummer 252520 in Irland gegründet. Der Fonds wurde von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) zugelassen. Der Fonds hat die Struktur eines Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds (jeweils ein „Portfolio“), und zum 31. Dezember 2022 umfasste der Fonds die folgenden zwanzig Portfolios, die alle in Betrieb waren:

- Man GLG Global Convertibles;
- Man GLG RI European Equity Leaders;
- Man GLG Japan CoreAlpha Equity;
- Man Numeric Emerging Markets Equity;
- Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity);
- Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates;
- Man GLG Global Emerging Markets Bond;
- Man GLG Pan-European Equity Growth;
- Man GLG RI Global Sustainable Growth;
- Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity);
- Man GLG RI Sustainable European Income;
- Man Numeric China A Equity;
- Man GLG Strategic Bond;
- Man GLG Asia (ex Japan) Equity;
- Man Numeric US High Yield;
- Man GLG Global Investment Grade Opportunities (am 10. November 2021 aufgelegt);
- Man GLG China Equity (am 14. Dezember 2021 aufgelegt);
- Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy (am 10. Februar 2022 aufgelegt);
- Man GLG Sustainable Strategic Income (am 23. März 2022 aufgelegt); und
- Man GLG Dynamic Income (am 30. Juni 2022 aufgelegt).

Ergebnisse des Geschäftsjahres und Finanzstatus zum 31. Dezember 2022

Ausführliche Kommentare zu den Ergebnissen für das Geschäftsjahr und zur Lage des Fonds zum 31. Dezember 2022 entnehmen Sie bitte den Berichten der Anlageverwalter, der Bilanz, der Gesamtergebnisrechnung und der Aufstellung des Wertpapierbestands. Alle Klassen rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile werden zusammen als die „rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile“ oder „Anteile“ bezeichnet.

Die Erträge der Klassen aller Teilfonds zum Ende des Geschäftsjahres werden in den untenstehenden Tabellen aufgeführt:

Anteilklassen	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<i>Man GLG Global Convertibles</i>		
D USD	(14,86 %)	(0,07 %)
D H EUR	(17,04 %)	(0,89 %)
DL USD	(14,73 %)	0,11 %
DL H EUR	(16,91 %)	(0,56 %)
DL H GBP	(15,75 %)	(0,03 %)
I USD	(14,22 %)	0,69 %
I H EUR	(16,40 %)	(0,15 %)
IL USD	(14,09 %)	0,71 %
IL H EUR	(16,27 %)	(0,14 %)
IM USD	(14,10 %)	0,87 %
IM H EUR	(16,29 %)	(0,03 %)
IM H GBP	(15,17 %)	0,67 %
IU H EUR	(16,08 %)	0,22 %
I H GBP	(15,27 %)	0,24 %

Ergebnisse des Geschäftsjahres und Finanzstatus zum 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

Anteilsklassen	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>		
D EUR	(14,20 %)	11,50 %
D C EUR	(14,78 %)	13,83 %
D C USD	(20,09 %)	5,59 %
D H GBP#	(8,32 %)	12,15 %
D H USD	(11,66 %)	12,51 %
I EUR	(13,55 %)	12,34 %
I C EUR	(14,15 %)	14,70 %
I C SEK	(7,23 %)	17,42 %
I C USD#	(17,64 %)	6,60 %
I H USD	(11,02 %)	13,36 %
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>		
D EUR	9,09 %	23,83 %
D EUR G Dist	5,91 %	20,21 %
D JPY	18,00 %	27,24 %
D USD	2,71 %	14,08 %
D H CHF	16,62 %	25,69 %
D H EUR	17,07 %	25,94 %
D H GBP	18,70 %	26,53 %
D H USD	19,94 %	27,05 %
I EUR	9,93 %	24,76 %
I EUR Dist	6,95 %	19,72 %
I GBP	16,15 %	15,90 %
I JPY	18,88 %	28,20 %
I JPY Dist	15,99 %	25,45 %
I SEK	18,77 %	27,02 %
I USD	3,51 %	14,93 %
I USD Dist	0,98 %	11,67 %
I H CHF	17,48 %	26,64 %
I H EUR	18,10 %	26,89 %
I H EUR Dist	15,13 %	26,24 %
I H GBP	19,51 %	27,48 %
I H GBP Dist	16,58 %	24,62 %
I H USD^^	20,79 %	28,01 %
I H USD Dist	17,80 %	25,12 %
IXX JPY	19,12 %	28,46 %
IXX H EUR	18,19 %	27,14 %
IXX H EUR Dist	15,37 %	24,07 %
IXX H GBP Dist	16,98 %	24,60 %
IXX H CHF*	7,21 %	k. A.
IXX H USD Dist*#	9,02 %	2,06 %
IXX H USD*#	6,83 %	k. A.
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>		
D CHF	(19,01 %)	5,68 %
D EUR	(15,02 %)	10,30 %
D USD	(20,25 %)	2,54 %
I EUR	(14,40 %)	11,17 %
I JPY	(7,94 %)	15,19 %
I SEK	(7,64 %)	13,73 %
I USD	(19,65 %)	3,30 %
I USD Dist+	k. A.	5,03 %
IMU USD	(19,52 %)	3,13 %
I GBP	(9,75 %)	(1,79 %)
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>		
D EUR	(14,53 %)	31,56 %
D USD	(19,78 %)	22,29 %
I EUR	(13,70 %)	32,70 %
I SEK	(6,93 %)	35,79 %
I USD	(19,18 %)	23,21 %
I H EUR	(21,72 %)	22,08 %

Ergebnisse des Geschäftsjahres und Finanzstatus zum 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

Anteilklassen	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>		
D C EUR	1,27 %	0,34 %
D C USD	(4,36 %)	(6,85 %)
I C EUR	2,59 %	0,82 %
I C EUR Dist+	k. A.	(3,12 %)
I C GBP	7,11 %	(5,46 %)
I C SEK	9,37 %	3,44 %
I C USD	(3,70 %)	(6,26 %)
I C USD Dist	(6,84 %)	(9,12 %)
I H EUR Dist	(8,84 %)	(10,08 %)
I H GBP	(4,83 %)	(6,49 %)
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>		
D C EUR	(4,82 %)	3,73 %
D C USD	(10,26 %)	(3,32 %)
D H EUR#	(1,48 %)	(4,20 %)
I C EUR	(4,00 %)	4,43 %
I C SEK	2,50 %	6,86 %
I C USD	(9,78 %)	(2,61 %)
I H EUR	(11,92 %)	(3,46 %)
I H EUR Dist+	k. A.	(7,09 %)
IF H EUR	(11,68 %)	(3,16 %)
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>		
D C EUR	(26,29 %)	17,18 %
D C USD	(30,82 %)	8,85 %
DF C EUR	(25,95 %)	17,70 %
I C CHF	(29,23 %)	13,10 %
I C EUR	(25,73 %)	18,06 %
I C SEK	(19,86 %)	20,96 %
I C USD	(30,31 %)	9,74 %
IF C EUR	(25,39 %)	18,58 %
DV C USD	(31,00 %)	8,93 %
IV C USD	(30,49 %)	9,71 %
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>		
D C EUR	(22,58 %)	22,85 %
I USD	(26,78 %)	14,96 %
I C EUR	(22,02 %)	23,69 %
I C GBP	(17,57 %)	15,96 %
I C SEK	(15,91 %)	26,54 %
IU FH NOK	(26,17 %)	16,82 %
I H (BRL) USD	(16,82 %)	(1,30 %)
<i>Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)</i>		
D C EUR	(16,05 %)	28,42 %
I C EUR	(15,43 %)	29,16 %
I C SEK	(8,56 %)	32,60 %
I C USD	(21,43 %)	19,61 %
I H GBP	(14,56 %)	29,67 %
I C GBP*	(4,10 %)	k. A.
<i>Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)</i>		
D C EUR	(10,38 %)	14,16 %
DF C EUR	(9,98 %)	14,67 %
I C EUR	(9,71 %)	15,01 %
I C EUR Dist	(11,83 %)	12,94 %
I C USD	(15,28 %)	6,88 %
IF C EUR	(9,31 %)	15,53 %
IM C EUR	(9,48 %)	15,39 %
I C EUR Dist Q	(12,36 %)	12,08 %

Ergebnisse des Geschäftsjahres und Finanzstatus zum 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

Anteilsklassen	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<i>Man Numeric China A Equity</i>		
D C EUR	(22,83 %)	21,65 %
D H EUR	(29,11 %)	11,94 %
I USD	(26,82 %)	13,91 %
I C EUR	(22,27 %)	22,69 %
I C GBP	(17,62 %)	14,93 %
I C SEK	(16,30 %)	25,79 %
<i>Man GLG Strategic Bond</i>		
D GBP	(7,74 %)	2,69 %
D GBP Dist	(11,34 %)	(1,61 %)
D H CHF	(9,57 %)	1,69 %
D H EUR	(9,28 %)	2,46 %
D H USD	(7,26 %)	2,71 %
DY H EUR	(9,38 %)	1,93 %
I GBP	(7,59 %)	3,06 %
I GBP Dist	(11,00 %)	(0,71 %)
I H CHF	(9,13 %)	2,09 %
I H EUR	(8,74 %)	2,22 %
I H EUR Dist	(12,50 %)	(1,92 %)
I H JPY	(8,86 %)	2,78 %
I H USD	(7,14 %)	3,49 %
I H USD Dist	(10,31 %)	(0,66 %)
IXF GBP	(7,10 %)	3,23 %
IXF GBP Dist	(11,54 %)	(0,35 %)
IXF H USD	(7,05 %)	3,41 %
DV H USD	(7,69 %)	1,94 %
IV H USD	(7,69 %)	1,96 %
D H USD Dist A	(11,22 %)	0,43 %
DY H USD	(7,56 %)	2,37 %
I GBP Dist A	(11,02 %)	0,09 %
I H EUR Dist A	(12,49 %)	(0,55 %)
I H USD Dist A#	(7,15 %)	0,19 %
<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i>		
I USD	(13,04 %)	0,02 %
I C CHF	(11,64 %)	3,18 %
I C EUR	(7,21 %)	7,84 %
I C GBP	(1,99 %)	1,15 %
IF C EUR	(7,12 %)	7,87 %
IF C GBP*	14,47 %	k. A.
<i>Man Numeric US High Yield</i>		
I USD	(11,09 %)	5,58 %
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>		
IF H EUR	(11,28 %)	1,03 %
I H EUR	(11,45 %)	0,96 %
I H GBP	(10,36 %)	1,08 %
I USD	(9,61 %)	1,44 %
I H EUR Dist^	(8,45 %)	k. A.
IF H GBP*	(6,92 %)	k. A.
IF H GBP Dist*	(9,93 %)	k. A.
IF EUR Dist*	0,36 %	k. A.
<i>Man GLG China Equity</i>		
I C EUR	(12,71 %)	0,02 %
I C GBP	(7,75 %)	(1,36 %)
IF C EUR	(12,31 %)	0,04 %
IF USD	(18,47 %)	1,11 %
I USD	(18,13 %)	(0,62 %)

Ergebnisse des Geschäftsjahres und Finanzstatus zum 31. Dezember 2022 (Fortsetzung)

Anteilstklassen	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
<i>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy**</i>		
I C EUR*	(7,25 %)	k. A.
I C GBP*	(2,52 %)	k. A.
I C USD*	(13,87 %)	k. A.
IF C EUR*	(7,03 %)	k. A.
IF C USD*	(13,79 %)	k. A.
<i>Man GLG Sustainable Strategic Income**</i>		
IF H EUR*	(9,65 %)	k. A.
IF USD*	(8,79 %)	k. A.
I H EUR*	(9,92 %)	k. A.
I H GBP*	(9,17 %)	k. A.
I USD*	(8,17 %)	k. A.
<i>Man GLG Dynamic Income**</i>		
I USD*	15,91 %	k. A.
IF H EUR*	13,29 %	k. A.
IF USD*	14,61 %	k. A.
I H EUR*	13,16 %	k. A.
I H GBP*	14,10 %	k. A.

*Die oben angegebene Rendite für die Anteilstklassen des jeweiligen Fonds bezieht sich auf den Zeitraum vom Auflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022. Einzelheiten zu den Auflegungsdaten der jeweiligen Anteilstklassen finden Sie in Erläuterung 21.

** Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, am 23. März 2022 bzw. am 30. Juni 2022 aufgenommen.

#Die oben angegebene Rendite für die Anteilstklassen der jeweiligen Portfolios bezieht sich auf den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum Datum der Rücknahme während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022.

+Die angegebene Rendite für die Anteilstklassen der jeweiligen Portfolios bezieht sich auf den Zeitraum vom 1. Januar 2021 bis zum Datum der Rücknahme während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021.

^Die angegebene Rendite für die Anteilstklassen der jeweiligen Portfolios bezieht sich auf den Zeitraum vom Auflegungsdatum bis zum Datum der Rücknahme während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022.

*#Die oben angegebene Rendite für die Anteilstklassen des jeweiligen Fonds bezieht sich auf den Zeitraum vom Wiederauflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022. Einzelheiten zu den Wiederauflegungsdaten der jeweiligen Anteilstklassen finden Sie in Erläuterung 21.

^^ Die Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H USD ist an der Luxemburger Börse notiert.

Dividenden

Der Verwaltungsrat schlägt zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 die Zahlung von Dividenden gemäß der nachfolgenden und der umseitigen Tabelle vor:

31. Dezember 2022

Teilfonds	Anteilstklasse	Dividende je Anteil	Zahlungsdatum
Man GLG Strategic Bond	Klasse D GBP Dist	0,0044 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist	0,0045 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist	0,0039 EUR	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H USD Dist	0,0044 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse IXF GBP Dist	0,0047 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse D H USD Dist A	0,0379 USD	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist A	3,4844 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist A	3,272 EUR	10. Januar 2023
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I C USD Dist	3,27 USD	11. Januar 2023
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I H EUR Dist	2,54 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse D EUR G Dist	0,18 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I EUR Dist	3,5 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H EUR Dist	4,73 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H GBP Dist	4,24 GBP	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H USD Dist	3,94 USD	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I JPY Dist	357,88 JPY	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I USD Dist	2,62 USD	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H EUR Dist	3,05 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H USD Dist	1,6 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H GBP Dist	3,51 GBP	11. Januar 2023
Man GLG RI Sustainable European Income	Klasse I C EUR Dist	3,08 EUR	11. Januar 2023
Man GLG RI Sustainable European Income	Klasse I C EUR Dist Q	0,21 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF H GBP Dist	1,73 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF EUR Dist	1,25 EUR	11. Januar 2023

Dividenden (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

<i>Teilfonds</i>	<i>Anteilsklasse</i>	<i>Dividende je Anteil</i>	<i>Zahlungsdatum</i>
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I EUR Dist	2,72 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H EUR Dist	3,11 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H GBP Dist	3,24 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H USD Dist	3,57 USD	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I JPY Dist	285,31 JPY	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I USD Dist	2,32 USD	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H EUR Dist	2,43 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H GBP Dist	2,60 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse D EUR G Dist	0,11 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse D H USD Dist A	0,0383 USD	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist A	3,4436 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist A	3,4758 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H USD Dist A	3,7506 USD	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse D GBP Dist	0,0023 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist	0,0024 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist	0,0021 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H USD Dist	0,0023 USD	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse IXF GBP Dist	0,0025 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I C USD Dist	3,33 USD	12. Januar 2022
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I H EUR Dist	2,65 EUR	12. Januar 2022
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	Klasse I C EUR Dist	2,93 EUR	12. Januar 2022
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	Klasse I C EUR Dist Q	0,41 EUR	12. Januar 2022

Für die übrigen Anteilsklassen der übrigen Portfolios schlägt der Verwaltungsrat keine Dividendenausschüttung vor.

Bedeutende Ereignisse im Verlauf des Geschäftsjahres

Prospekt

Ein überarbeiteter Prospekt mit Datum vom 1. Januar 2022 wurde herausgegeben. Die Änderungen am Prospekt umfassen allgemeine Aktualisierungen sowie Aktualisierungen im Hinblick auf die Benchmark-Reform und die entsprechenden Auswirkungen auf LIBOR und IBOR.

Am 21. Januar 2022 wurde eine neue Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben. Die Änderung am Prospekt wurde vorgenommen, um der Auflegung des neuen Portfolios Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Rechnung zu tragen.

Eine überarbeitete Ergänzung für die Numeric Investors LLC zum Prospekt vom 1. Januar 2022 wurde am 31. Januar 2022 herausgegeben. Die Änderungen am Prospekt spiegelten die Namensänderung des Man Numeric RI Global Equity und des Man Numeric RI European Equity zu Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate wider.

Am 28. Februar 2022 wurde eine neue Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben. Die Änderung am Prospekt wurde vorgenommen, um der Auflegung des neuen Portfolios Man GLG Sustainable Strategic Income Rechnung zu tragen.

Am 7. Juni 2022 wurde eine neue Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben. Die Änderung am Prospekt wurde vorgenommen, um der Auflegung des neuen Portfolios Man GLG Dynamic Income Rechnung zu tragen.

Am 1. September 2022 wurde eine überarbeitete Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben.

Ein überarbeiteter Prospekt mit Datum vom 1. Dezember 2022 wurde herausgegeben. Am 1. Dezember 2022 wurde eine überarbeitete Ergänzung zum Prospekt vom 1. Dezember 2022 für die GLG Partners LP Portfolios, Numeric Investors LLC und GLG LLC Portfolios herausgegeben.

Fondsauflegungen

Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, am 23. März 2022 bzw. am 30. Juni 2022 aufgenommen.

Anteilsklassen

Ausführliche Informationen über neue Anteilsklassen, die im Laufe des Jahres aufgelegt wurden, finden Sie in der Erläuterung 21.

Bedeutende Ereignisse im Verlauf des Geschäftsjahres (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat, die Anlageverwalter und der Manager sind sich der aktuellen Krise in der Ukraine und aller geltenden Sanktionen gegen Russland bewusst. Der Anlageverwalter hat die im Rahmen der Strategie gehaltenen Positionen auf ein etwaiges Engagement in Russland und der Ukraine überprüft. Der jeweilige Anlageverwalter hat geeignete Maßnahmen ergriffen, um bestimmte direkte Engagements gegenüber Russland zu reduzieren oder zu beseitigen, wo dies erforderlich war. Die Situation wird laufend überprüft. Alle Engagements wurden entweder verkauft oder bis zur ersten Märzwoche 2022 auf Null herabgesetzt. Der einzige Teilfonds, bei dem ein wesentliches Engagement in russischen Beteiligungen besteht, ist der Numeric Emerging Markets Equity Fund. Der Gesamtwert all dieser Anlagen vor der Herabsetzung auf Null entsprach 4,79 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 4. März 2022, dem Datum, an dem diese Anlagen mit Null neu bewertet wurden. Die anhaltende politische Instabilität in der Region ist ein zusätzlicher Risikofaktor, der überwacht wird und sich auf die Bewertung der Vermögenswerte des Fonds nach dem Jahresende auswirken könnte.

Darüber hinaus gab es keine weiteren bedeutenden Ereignisse während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022.

Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Am 19. Januar 2023 wurde eine überarbeitete Ergänzung zum Prospekt vom 1. Dezember 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben.

Der Man GLG RI Sustainable European Income und der Man GLG RI European Equity Leaders haben ihre Geschäftstätigkeit am 20. Januar 2023 bzw. 16. Februar 2023 eingestellt.

Seit dem Ende des Geschäftsjahres gab es keine sonstigen Ereignisse, die sich auf den Fonds ausgewirkt haben und im geprüften Abschluss erwähnt werden müssen.

Anlageziel

Die Anlageziele des Fonds sind in Erläuterung 1 des geprüften Abschlusses aufgeführt. Anlagen in den Fonds bergen ein gewisses Risiko, das unter anderem die Risiken umfasst, auf die in Erläuterung 6 des Abschlusses Bezug genommen wird. Einzelheiten zu den spezifischen Anlagerisiken des Fonds finden Sie im Prospekt.

Verwaltungsrat und Gesellschaftssekretär

Die im Geschäftsjahr und bis zum 19. April 2023 tätigen Verwaltungsratsmitglieder und der Gesellschaftssekretär sind auf Seite 3 aufgeführt. Sofern nichts Anderweitiges angegeben ist, waren sie während des gesamten Geschäftsjahres im Amt.

Beteiligungen des Verwaltungsrats und des Gesellschaftssekretärs

Weder die Verwaltungsratsmitglieder noch deren Familien, noch der Gesellschaftssekretär (Matsack Trust Limited) noch die Anlageverwalter hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 Anteile am Fonds. Die einzige Ausnahme hierzu bilden 29.998 Zeichneranteile, die von Man Asset Management (Irland) Limited gehalten wurden. Die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder wird in Erläuterung 9 zu diesem Abschluss ausgewiesen.

Aufgaben des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Berichts des Verwaltungsrats und die Finanzabschlüsse nach Maßgabe des Rechts Irlands verantwortlich.

Laut irischem Gesellschaftsrecht hat der Verwaltungsrat einen Abschluss zu erstellen, der einen wahrheitsgemäßen und fairen Überblick über die Situation des Fonds und die Gewinne oder Verluste des Fonds für das jeweilige Jahr enthält. Im Rahmen dieser Verpflichtung hat der Verwaltungsrat beschlossen, den Abschluss gemäß den International Financial Reporting Standards („IFRS“) in ihrer durch die Europäische Union übernommenen Fassung zu erstellen.

Laut Gesellschaftsrecht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur dann genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft zum Ende des Geschäftsjahres und des Gewinns oder Verlusts des Fonds für das Geschäftsjahr widerspiegelt und auch anderweitig die Bestimmungen des Companies Act von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) erfüllt.

Bei der Erstellung dieses Jahresabschlusses ist es die Aufgabe des Verwaltungsrats:

- geeignete Rechnungslegungsgrundsätze auszuwählen und diese einheitlich anzuwenden;
- Entscheidungen zu treffen und Schätzungen für die Rechnungslegung vorzunehmen, die angemessen und umsichtig sind;
- anzugeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt wurde, die entsprechenden Grundsätze anzugeben und die Auswirkungen und Gründe für wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen zu erläutern und
- soweit keine gegenteiligen Annahmen vorauszusetzen sind, den Abschluss unter der Prämisse zu erstellen, dass der Teilfonds seine Aktivitäten auch in Zukunft ausüben wird. Der Man GLG RI Sustainable European Income und der Man GLG RI European Equity Leaders haben ihre Geschäftstätigkeit am 20. Januar 2023 bzw. 16. Februar 2023 eingestellt. Daher werden die jeweiligen Abschlüsse nicht auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, sicherzustellen, dass der Fonds ordnungsgemäße Geschäftsbücher führt bzw. deren Führung veranlasst. Diese müssen die Transaktionen der Gesellschaft korrekt erläutern und erfassen und es jederzeit ermöglichen, die Vermögenswerte, die Verbindlichkeiten, die Finanzlage sowie den Gewinn oder Verlust des Fonds mit angemessener Genauigkeit zu ermitteln. Sie müssen die Möglichkeit bieten, sicherzustellen, dass sowohl der Abschluss als auch der Bericht des Verwaltungsrats den Companies Acts von 2014 entspricht, und die Prüfbarkeit dieses Abschlusses gewährleisten. Der Verwaltungsrat ist darüber hinaus für die Sicherung der Vermögenswerte des Fonds und somit für das Ergreifen angemessener Maßnahmen zur Verhinderung bzw. zur Aufdeckung von Betrug und anderen Unregelmäßigkeiten verantwortlich.

Die für die Erstellung und Veröffentlichung von Abschlüssen geltenden Rechtsvorschriften in Irland können von den Rechtsvorschriften anderer Länder abweichen.

Rechnungslegungsunterlagen

Der Verwaltungsrat ist gemäß Abschnitt 281 bis 285 des Companies Act von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) für eine ordnungsgemäße Buchführung verantwortlich. Um dies zu gewährleisten, hat der Verwaltungsrat als Dritten BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, einen erfahrenen und unabhängigen Fondsverwalter, hinzugezogen, um sicherzustellen, dass die Anforderungen gemäß Abschnitt 281 bis 285 des Companies Act von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) erfüllt werden. Die Geschäftsbücher und Aufzeichnungen werden am Sitz des Administrators in One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irland, verwahrt.

Unabhängiger Abschlussprüfer

Die unabhängigen Abschlussprüfer Ernst & Young, Chartered Accountants haben ihre Bereitschaft erklärt, weiterhin in Übereinstimmung mit Abschnitt 383(2) des Companies Act von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) im Amt zu bleiben.

Geschäftsführung

Die Verordnungen der Europäischen Gemeinschaften (Richtlinie 2006/46/EG) (Durchführungsverordnungen Nr. 450 von 2009 und Nr. 83 von 2010) (die „Verordnungen“) sehen die Einbeziehung einer Erklärung zur Unternehmensführung in den Bericht des Verwaltungsrats vor.

Obwohl für irische Organismen für gemeinsame Anlagen kein bestimmter Corporate-Governance-Kodex per Gesetz vorgeschrieben ist, unterliegt der Fonds Erfordernissen der Corporate Governance, die vorgegeben sind durch:

- i. den irischen Companies Act von 2014, der am Geschäftssitz des Fonds zur Einsichtnahme zur Verfügung steht;
- ii. die Satzung des Fonds, die zur Einsichtnahme am eingetragenen Sitz des Fonds zur Verfügung steht; und
- iii. die OGAW-Mitteilungen und Leitlinien der Zentralbank, die auf der Website der Zentralbank unter: <https://www.centralbank.ie/regulation/industry-market-sectors/funds/ucits> abgerufen werden können und am eingetragenen Sitz des Fonds zur Einsichtnahme zur Verfügung stehen.

Der Verwaltungsrat ist für die Einrichtung und Aufrechterhaltung angemessener interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme des Fonds hinsichtlich der Finanzberichterstattung verantwortlich. Solche Systeme dienen eher der Steuerung des Risikos von Fehler und Betrug bei der Realisierung der Bilanzierungsziele des Fonds und weniger der Eliminierung dieses Risikos und können demnach nur einen angemessenen, jedoch keinen absoluten Schutz vor wesentlichen Falschdarstellungen oder Verlusten bieten.

Der Verwaltungsrat hat Verfahren eingeführt, um sicherzustellen, dass alle relevanten Geschäftsbücher ordnungsgemäß geführt werden und jederzeit verfügbar sind, unter anderem für die Erstellung des Jahresabschlusses. Der Jahresabschluss des Teilfonds muss vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Zentralbank eingereicht werden. Der gesetzlich erforderliche Abschluss muss von unabhängigen Abschlussprüfern geprüft werden, die dem Verwaltungsrat jährlich über ihre Feststellungen Bericht erstatten.

Der Verwaltungsrat prüft und bespricht wesentliche Rechnungslegungs- und Berichterstattungsthemen nach Bedarf.

Die Einberufung und Durchführung von Versammlungen der Anteilinhaber wird durch die Satzung des Fonds sowie die Companies Acts geregelt. Der Verwaltungsrat kann zwar jederzeit eine außerordentliche Hauptversammlung des Fonds einberufen, er ist jedoch verpflichtet, innerhalb von zwölf Monaten nach dem Datum der letzten Jahreshauptversammlung eine Jahreshauptversammlung des Fonds einzuberufen. Anteilinhaber, die mindestens fünfundneunzig Prozent des eingezahlten Anteilskapitals des Fonds vertreten, können ebenfalls den Verwaltungsrat zur Einberufung einer Anteilinhaberversammlung auffordern. Für Jahreshauptversammlungen und sonstige Versammlungen, bei denen Sonderbeschlüsse erlassen werden sollen, gilt für die Einladung der Anteilinhaber eine Mindestfrist von einundzwanzig Tagen. Im Fall sonstiger Hauptversammlungen gilt eine Frist von vierzehn Tagen, sofern die Abschlussprüfer des Fonds sowie die zu einer Teilnahme und Stimmabgabe berechtigten Anteilinhaber nicht eine kürzere Frist vereinbaren.

Zwei entweder persönlich anwesende oder durch Stimmrechtsvertreter vertretene Anteilinhaber bilden eine beschlussfähige Mehrheit auf einer Hauptversammlung.

Der Fonds kann von Zeit zu Zeit durch einen einfachen Mehrheitsbeschluss das Anteilskapital um den in diesem Beschluss festgesetzten Betrag und/oder die festgesetzte Anzahl erhöhen.

Der Fonds kann außerdem durch ordentlichen Beschluss:

- 1) sein Anteilskapital oder einen Teil davon in Anteile mit höherem Betrag zusammenfassen;
- 2) vorbehaltlich der Bestimmung der Companies Acts seine Anteile oder einen Teil davon in Anteile mit einem geringeren Betrag oder Wert aufteilen und für diese aus dieser Aufteilung resultierenden Anteile gegenüber den anderen Vorzugsrechte, Nachbezugsrechte oder sonstigen Rechte festlegen oder sie Beschränkungen unterwerfen, die der Fonds in Bezug auf noch nicht ausgegebene oder neue Anteile auferlegen darf;
- 3) anteile annullieren, die zum Datum der Beschlussfassung weder gezeichnet noch Gegenstand einer Zeichnungsvereinbarung waren, und den Betrag seines genehmigten Anteilskapitals um den Betrag der so annullierten Anteile kürzen; oder
- 4) die Währung, auf die eine Anteilsklasse lautet, ändern.

Jeder persönlich anwesende oder durch einen Stimmrechtsvertreter vertretene Inhaber gewinnberechtigter oder nicht gewinnberechtigter Anteile, der an einer Abstimmung per Handzeichen teilnimmt, hat ein Anrecht auf eine Stimme. Bei einer Abstimmung mit Stimmzetteln hat jeder persönlich anwesende oder durch Stimmrechtsvertreter vertretene Inhaber von gewinnberechtigten Anteilen Anspruch auf eine Stimme in Bezug auf jeden von ihm gehaltenen Anteil, und jeder persönlich anwesende oder durch Stimmrechtsvertreter vertretene Inhaber nicht gewinnberechtigter Anteile hat Anspruch auf eine Stimme in Bezug auf alle von ihm gehaltenen nicht gewinnberechtigten Anteile.

Anteilinhaber können die Billigung eines ordentlichen Beschlusses oder eines Sonderbeschlusses auf einer Anteilinhaberversammlung beschließen. Ein ordentlicher Beschluss des Fonds erfordert eine einfache Mehrheit der von den auf der Versammlung, auf der dieser Beschluss vorgelegt wird, persönlich anwesenden oder durch Stimmrechtsvertreter vertretenen Anteilinhabern abgegebenen Stimmen. Ein Sonderbeschluss des Fonds erfordert eine Mehrheit von mindestens fünfundsiebzig Prozent der persönlich anwesenden oder durch Stimmrechtsvertreter vertretenen Anteilinhaber, die auf einer Hauptversammlung zwecks Verabschiedung eines Sonderbeschlusses abstimmen. Dies gilt unter anderem auch für einen Beschluss zur Änderung der Satzung.

Geschäftsführung (Fortsetzung)

Sofern über einen bei einer Hauptversammlung des Fonds verabschiedeten ordentlichen Beschluss nichts Anderweitiges bestimmt wird, umfasst der Verwaltungsrat mindestens ein und maximal zehn Mitglieder. Derzeit setzt sich der Verwaltungsrat des Fonds aus den vier Verwaltungsratsmitgliedern zusammen, die in den Angaben zur Gesellschaft in diesem Abschluss aufgeführt sind.

Die Geschäfte des Fonds werden vom Verwaltungsrat geführt. Er übt sämtliche Befugnisse des Fonds aus, die nach dem Companies Act von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) („Companies Act“) oder nach der Satzung des Fonds nicht vom Fonds auf einer Hauptversammlung auszuüben sind.

Eine Sitzung des Verwaltungsrats kann jederzeit durch ein Mitglied oder durch den Gesellschaftssekretär des Fonds auf Anforderung eines Verwaltungsratsmitglieds einberufen werden. Bei einer Sitzung des Verwaltungsrats auftretende Fragen werden mit Stimmenmehrheit entschieden. Im Fall einer Stimmengleichheit hat der oder die Vorsitzende keine ausschlaggebende Stimme und der Beschluss wird abgelehnt. Die für die Durchführung des Geschäfts auf einer Sitzung des Verwaltungsrats notwendige beschlussfähige Mehrheit beträgt zwei Verwaltungsratsmitglieder.

Der Verwaltungsrat hat den am 14. Dezember 2011 von der Irish Funds (IF) herausgegebenen freiwilligen „Corporate Governance Code for Irish Domiciled Collective Investment Schemes and Management Companies“ (der „Kodex“) mit Wirkung zum 31. Dezember 2012 angenommen. Der Verwaltungsrat hat die im Kodex vorgesehenen Maßnahmen geprüft und bewertet und ist der Auffassung, dass seine Corporate-Governance-Praktiken und -Verfahren seit der Übernahme des Kodex damit übereinstimmen.

Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass er unabhängig und im Interesse des Fonds als Ganzes handelt, und hat festgestellt, dass Samantha McConnell, Ronan Daly und Bronwyn Wright unabhängige Verwaltungsratsmitglieder gemäß der Definition im IF-Kodex sind.

Der Verwaltungsrat erklärt sich verantwortlich für die Einhaltung der einschlägigen Vorschriften in Section 225 des Companies Act von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung).

Der Verwaltungsrat bestätigt folgende Punkte:

- 1) Es wurde ein Compliance-Dokument verfasst, in dem Richtlinien festgelegt werden, die nach Meinung des Verwaltungsrats für die Gesellschaft angemessen sind und die Erfüllung der geltenden Vorschriften unterstützen.
- 2) Es wurden Maßnahmen getroffen und Strukturen geschaffen, die aus Sicht des Verwaltungsrats dafür geeignet sind, die Erfüllung geltender Vorschriften durch die Gesellschaft zu gewährleisten; und
- 3) Die unter Punkt (2) genannten Maßnahmen und Strukturen wurden während des Geschäftsjahrs überprüft

Der Verwaltungsrat bestätigt folgende Punkte für das Geschäftsjahr, das am 31. Dezember 2022 endet:

- a. Nach Kenntnis des Verwaltungsrats sind keine relevanten Prüfungsinformationen verfügbar, die den Abschlussprüfern der Gesellschaft nicht bekannt sind, und
- b. Der Verwaltungsrat hat alle erforderlichen Schritte unternommen, um Kenntnis von solchen Prüfungsinformationen zu erhalten und sicherzustellen, dass die Abschlussprüfer der Gesellschaft von diesen Informationen Kenntnis haben.

Prüfungsausschuss

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, dass die Einrichtung eines Prüfungsausschusses angesichts der Häufigkeit der Sitzungen des Verwaltungsrats im Jahr sowie der Größe des Verwaltungsrats nicht notwendig ist. Dafür werden die Aufgaben, die einem Prüfungsausschuss obliegen, von der Gesamtheit des Verwaltungsrats wahrgenommen.

Verwahrungs- und Eigentumsrisiko

Die Verwahrstelle ist zur Verwahrung der Finanzinstrumente verpflichtet, die verwahrt werden können, und sie muss diese Vermögenswerte der einzelnen Portfolios des Fonds für seine Anteilhaber halten. Die irische Zentralbank schreibt der Verwahrstelle vor, die nicht als Barmittel gehaltenen Vermögenswerte der einzelnen Portfolios getrennt zu halten und ausreichende Aufzeichnungen zu führen, anhand derer sich die Art und die Beträge sämtlicher Vermögenswerte in ihrem Besitz ermitteln lassen, ebenso wie die Eigentumsverhältnisse eines jeden Vermögenswerts und der Ort, an dem die Eigentumsnachweise dieser Vermögenswerte physisch aufbewahrt werden. Wenn die Verwahrstelle eine Unterdepotbank heranzieht, ist die Verwahrstelle weiterhin für die Vermögenswerte des Portfolios verantwortlich, sofern sie sich nicht im Einklang mit der maßgeblichen EU-Richtlinie von der Haftung befreit hat.

Es sollte jedoch beachtet werden, dass bezüglich der Verwahrung von Vermögenswerten und der Anerkennung der Interessen eines wirtschaftlichen Eigentümers wie z. B. eines Portfolios nicht in allen Rechtsordnungen dieselben Regeln und Vorschriften gelten wie in Irland. Daher besteht in solchen Rechtsordnungen ein Risiko, dass im Fall eines Konkurses oder einer Insolvenz einer Unterdepotbank das wirtschaftliche Eigentum eines Portfolios an den von einer solchen Unterdepotbank gehaltenen Vermögenswerten nicht anerkannt wird und somit die Gläubiger der Unterdepotbank einen Anspruch auf die Vermögenswerte des Portfolios anmelden könnten. In Rechtsordnungen, in denen das wirtschaftliche Eigentum des Portfolios an seinen Vermögenswerten letztendlich anerkannt wird, können dem Portfolio Verzögerungen und Kosten bei der Wiedererlangung dieser Vermögenswerte entstehen. Da die Portfolios in Märkten investieren können, in denen die Verwahr- und/oder Abrechnungssysteme nicht vollständig ausgereift sind, sind die in einem solchen Markt gehandelten Anlagen eines Portfolios, die Unterdepotbanken anvertraut wurden, wo dies erforderlich ist, eventuell einem Risiko ausgesetzt, für das die Verwahrstelle nicht haftet.

CRS-Datenschutzmitteilung

Der Verwaltungsrat bestätigt hiermit, dass er beabsichtigt, alle erforderlichen Maßnahmen zu ergreifen, um sämtliche Verpflichtungen zu erfüllen, die sich aus (i) dem Standard der OECD für den automatischen Austausch von Finanzkontoinformationen in Steuerangelegenheiten („der Standard“), der den gemeinsamen Meldestandard (Common Reporting Standard, „CRS“) umfasst, in der in Irland im Wege des maßgeblichen internationalen rechtlichen Rahmenwerks und des irischen Steuerrechts geltenden Form und (ii) der Richtlinie des EU-Rates 2014/107/EU zur Änderung der Richtlinie 2011/16/EU bezüglich der Verpflichtung zum automatischen Austausch von Informationen im Bereich der Besteuerung („DAC2“), die in Irland über das maßgebliche irische Steuerrecht zur Anwendung kommt, ergeben, um die Konformität bzw. mutmaßliche Konformität mit dem Standard/CRS und DAC2 ab dem 1. Januar 2020 sicherzustellen.

Diesbezüglich ist der Manager für den Fonds gemäß Section 891F und Section 891G des Irish Taxes Consolidation Act 1997 (in der jeweils geltenden Fassung) sowie gemäß im Rahmen dieser Bestimmungen verabschiedeter Verordnungen verpflichtet, bestimmte Informationen zur steuerlichen Behandlung der Anteilinhaber einzuholen (und auch Informationen in Bezug auf maßgebliche beherrschende Personen bestimmter Anteilinhaber einzuholen).

Unter bestimmten Umständen ist der Manager eventuell für den Fonds rechtlich dazu verpflichtet, diese Informationen und sonstige Finanzinformationen in Bezug auf die Beteiligung eines Anteilinhabers an dem Portfolio an die Irish Revenue Commissioners weiterzugeben (und in bestimmten Situationen kann er auch dazu verpflichtet sein, Informationen in Bezug auf maßgebliche beherrschende Personen bestimmter Anteilinhaber weiterzugeben). Sofern das Konto als meldepflichtiges Konto identifiziert wurde, werden die Irish Revenue Commissioners diese Informationen wiederum an das Land weitergeben, in dem die meldepflichtige(n) Person(en) in Bezug auf dieses meldepflichtige Konto ansässig ist bzw. sind.

Bei den Informationen, die in Bezug auf einen Anteilinhaber (und gegebenenfalls maßgebliche beherrschende Personen) gemeldet werden können, kann es sich unter anderem um den Namen, die Adresse, das Geburtsdatum, den Geburtsort, die Kontonummer, den Kontostand oder den Wert zum Jahresende (oder falls das Konto im Laufe des Jahres geschlossen wurde, den Kontostand oder den Wert zum Datum der Schließung des Kontos), im Kalenderjahr in Bezug auf das Konto vorgenommene Zahlungen (einschließlich von Rücknahme- und Dividenden-/Zinszahlungen), Angaben zu Steuersitzen und Steueridentifikationsnummer(n) handeln.

Transaktionen mit verbundenen Unternehmen

Der Verwaltungsrat hat sich davon überzeugt, dass Vereinbarungen vorliegen, die gewährleisten, dass mit verbundenen Parteien des Portfolios eingegangene Transaktionen so durchgeführt wurden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen und im besten Interesse der Anteilinhaber des Portfolios ausgehandelt worden. Der Verwaltungsrat ist überzeugt, dass mit verbundenen Parteien im Geschäftsjahr eingegangene Transaktionen den vorstehenden Anforderungen entsprechen.

Im Auftrag des Verwaltungsrats

Bronwyn Wright
Verwaltungsratsmitglied

Samantha McConnell
Verwaltungsratsmitglied

Datum: 19. April 2023

BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER

Für den Berichtszeitraum vom 1. Januar 2022 bis zum 31. Dezember 2022 (der „Berichtszeitraum“)

The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin (die „Verwahrstelle“, „wir“, „uns“ oder „unser“) hat die Führung der Man Funds plc (die „Gesellschaft“) für den Berichtszeitraum in ihrer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft geprüft.

Der vorliegende Bericht einschließlich unseres Bestätigungsvermerks wurde einzig und allein für die Anteilhaber der Gesellschaft im Einklang mit unserer Rolle als Verwahrstelle der Gesellschaft und zu keinem sonstigen Zweck erstellt. Hinsichtlich anderer Verwendungszwecke oder anderer Personen, denen dieser Bericht vorgelegt wird, übernehmen wir für die hierin zum Ausdruck gebrachte Meinung keinerlei Verantwortung.

Aufgaben der Verwahrstelle

Unsere Pflichten und Aufgaben sind in Verordnung 34 der Richtlinien der Europäischen Gemeinschaft (Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 (S.I. Nr. 352 von 2011) in der aktuellen Fassung (die „Verordnungen“) dargelegt.

Aus unserem Bericht soll hervorgehen, ob die Gesellschaft unserer Ansicht nach in dem betreffenden Zeitraum im Einklang mit den Bestimmungen der Gründungsdokumente und der Verordnungen geführt wurde. Die Einhaltung dieser Bestimmungen liegt einzig in der Verantwortung der Gesellschaft. Falls die Gesellschaft nicht entsprechend geführt wird, ist es unsere Verpflichtung als Verwahrstelle, anzugeben, in welcher Hinsicht sie nicht entsprechend geführt wurde und welche Schritte wir diesbezüglich unternommen haben.

Grundlage des Bestätigungsvermerks der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt Prüfungen durch, die sie ihres Erachtens für erforderlich hält, um ihren Pflichten nachzukommen und um sicherzustellen, dass die Gesellschaft in allen wesentlichen Punkten (i) im Einklang mit den Beschränkungen, die den Anlage- und Kreditaufnahmebefugnissen durch ihre Gründungsdokumente und die anwendbaren Vorschriften auferlegt wurden, und (ii) auf sonstige Weise gemäß den Bestimmungen ihrer Gründungsdokumente und den anwendbaren Regelungen geführt wurde.

Prüfungsurteil

Unserer Ansicht nach wurde die Gesellschaft im Zeitraum in jeder wesentlichen Hinsicht wie folgt geführt:

- (i) im Einklang mit den für die Gesellschaft geltenden Beschränkungen bezüglich der Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse, wie in den Gründungsdokumenten der Gesellschaft sowie den Verordnungen dargelegt; und
- (ii) ansonsten im Einklang mit den Bestimmungen der Gründungsdokumente und der Verordnungen.

Michelle Moroney

Für und im Namen von
The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin
Riverside II
Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublin 2
Irland

19. April 2023

Diese Seite wurde absichtlich freigelassen

	Erläute- rungen	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	3	225.903.642	10.957.430	77.959.577	6.185.868.786
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt	3	529.834	-	-	-
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	111.098.800	5.141.909	5.037.279	-
Forderungen gegenüber Brokern	3	52.092.629	920.068	-	1.835.582.368
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:					
Aktien	4	2.712.720.637	824	-	261.297.377.728
Verzinsliche Wertpapiere	4	867.080.397	118.781.156	-	-
Derivate	4	42.959.009	1.315.790	5.186	2.925.384.602
Forderungen aus Anteilszeichnungen		55.006	39	-	5.066.495
Zinsforderungen		9.420.879	285.927	-	-
Dividendenforderungen		4.632.579	-	111.664	303.360.131
Sonstige Aktiva	9	3.538.688	103.251	356.480	153.040.214
Summe Aktiva		4.029.502.266	137.506.394	83.470.186	272.705.680.324
Passiva					
Überziehungskredite	3	3.665.278	878.476	10.530	847.650
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	109.778.780	3.503.144	-	-
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3	84.211.955	-	-	3.306.505.621
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:					
Derivate	4	41.523.360	1.724.120	1.418.259	2.835.478.019
Pensionsgeschäfte	4	25.809.639	-	-	-
Anteilinhabertransaktionen		2.280.745	-	2.136	272.858.607
Zu zahlende Performancegebühren	8,9	219.340	6.372	-	-
Fällige Managementgebühren	8,9	2.097.977	80.920	59.350	162.473.442
Verbindlichkeiten aus Zinsen		537.554	6.581	175.763	-
Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren		5.168	-	4.842	-
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	8,9	6.046.106	240.712	229.084	317.587.825
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)		276.175.902	6.440.325	1.899.964	6.895.751.164
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen		3.753.326.364	131.066.069	81.570.222	265.809.929.160

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	*Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	*Man Numeric Europe RI Climate EUR
31.499.046	824.550	1.521.547	541.239	3.944.168	293.768	1.173.878
529.834	-	-	-	-	-	-
89.466.773	55.592	502.764	-	440.078	-	89.759
2.136.647	64.357	12	-	-	577	139.897
297.630.714	20.377.328	-	-	200.960.895	5.602.610	29.443.872
86.906.161	-	81.297.414	33.914.115	-	-	-
5.098.153	10	1.347.894	69.972	31.705	41.070	144
-	-	-	16	1.153	-	-
-	263	857.207	447.296	576	90	174
2.056.759	8.734	-	-	-	211	10.704
297.464	81.065	67.774	37.698	224.084	90.030	81.650
<u>515.621.551</u>	<u>21.411.899</u>	<u>85.594.612</u>	<u>35.010.336</u>	<u>205.602.659</u>	<u>6.028.356</u>	<u>30.940.078</u>
49.948	-	2	20	-	30	-
78.974.691	-	679.246	120.296	-	-	28
3.156.230	26.440	390	-	-	-	112.922
3.346.999	14.310	645.976	180	834.017	36.041	55.809
-	-	-	-	-	-	-
13.104	-	-	-	8.497	-	-
212.968	-	-	-	-	-	-
260.298	12.940	41.259	12.337	107.322	3.771	19.222
159.675	-	7.581	7.718	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
<u>624.991</u>	<u>91.631</u>	<u>173.453</u>	<u>147.251</u>	<u>335.005</u>	<u>118.305</u>	<u>101.273</u>
86.798.904	145.321	1.547.907	287.802	1.284.841	158.147	289.254
<u>428.822.647</u>	<u>21.266.578</u>	<u>84.046.705</u>	<u>34.722.534</u>	<u>204.317.818</u>	<u>5.870.209</u>	<u>30.650.824</u>

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

	Erläute- rungen	Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	3	385.551	628.385	19.101.660	5.692.016
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt	3	-	-	-	-
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	-	103.671	291.415	1.979.352
Forderungen gegenüber Brokern	3	-	-	10.699.490	-
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:					
Aktien	4	25.610.928	17.245.778	11.061.817	54.084.718
Verzinsliche Wertpapiere	4	-	810.647	230.847.951	-
Derivate	4	-	48.802	6.886.279	237.781
Forderungen aus Anteilszeichnungen		-	-	12.554	114
Zinsforderungen		63	212	2.846.390	2.155
Dividendenforderungen		-	-	54.875	19.001
Sonstige Aktiva	9	192.840	23.216	166.428	63.531
Summe Aktiva		26.189.382	18.860.711	281.968.859	62.078.668
Passiva					
Überziehungskredite	3	-	15.446	879.753	114
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	-	-	15.371.175	531.940
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3	-	81.418	9.777.356	-
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:					
Derivate	4	-	1.004	6.735.149	162.783
Pensionsgeschäfte	4	-	-	-	-
Anteilinhabertransaktionen		1.449	26.544	128.387	40
Zu zahlende Performancegebühren	8,9	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren	8,9	14.729	16.668	82.263	28.509
Verbindlichkeiten aus Zinsen		-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren		-	-	-	-
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	8,9	98.556	102.229	386.635	131.215
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)		114.734	243.309	33.360.718	854.601
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen		26.074.648	18.617.402	248.608.141	61.224.067

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man Numeric US High Yield USD	Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	Man GLG China Equity USD	**Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy EUR	**Man GLG Sustainable Strategic Income USD	**Man GLG Dynamic Income USD
315.909	5.403.177	149.069	649.953	1.344.585	1.505.716
-	-	-	-	-	-
-	5.901.297	327.580	115.939	348.507	855.287
-	15.722.680	-	-	-	6.278.133
-	-	9.071.272	34.006.850	-	-
35.714.137	184.234.283	692.336	-	15.462.358	31.580.790
-	3.976.785	15.874	-	130.847	120.076
-	-	-	-	-	-
701.004	2.973.092	-	98	209.018	519.720
-	-	-	42.841	-	-
11.558	121.642	91.404	129.346	43.790	92.313
<u>36.742.608</u>	<u>218.332.956</u>	<u>10.347.535</u>	<u>34.945.027</u>	<u>17.539.105</u>	<u>40.952.035</u>
-	-	4.371	2.647	1.105.051	-
-	2.680.000	179.055	-	-	220.010
-	31.387.723	-	-	-	12.548.608
-	2.689.399	294.747	-	214.253	278.785
-	21.462.250	-	-	-	4.347.389
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
15.275	32.930	5.990	22.080	6.207	9.430
107	140.635	1.163	-	-	26.502
-	-	-	-	-	-
<u>121.734</u>	<u>225.848</u>	<u>94.798</u>	<u>109.716</u>	<u>82.280</u>	<u>80.479</u>
<u>137.116</u>	<u>58.618.785</u>	<u>580.124</u>	<u>134.443</u>	<u>1.407.791</u>	<u>17.511.203</u>
<u>36.605.492</u>	<u>159.714.171</u>	<u>9.767.411</u>	<u>34.810.584</u>	<u>16.131.314</u>	<u>23.440.832</u>

** Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, am 23. März 2022 bzw. am 30. Juni 2022 aufgenommen.

Am 19. April 2023 im Auftrag des Verwaltungsrats genehmigt und zur Veröffentlichung freigegeben.

Bronwyn Wright
Verwaltungsratsmitglied

Samantha McConnell
Verwaltungsratsmitglied

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

	Erläute- rungen	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	3	139.228.439	42.556.187	7.009.184	2.343.482.643
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	118.768.447	212.173	4.030.000	-
Forderungen gegenüber Brokern	3	20.256.148	-	-	184.433.267
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:					
Aktien	4	3.219.333.090	899	252.883.580	166.402.938.716
Verzinsliche Wertpapiere	4	925.843.429	193.674.015	-	-
Derivate	4	36.117.060	1.480.538	1.197.652	928.985.375
Forderungen aus Anteilszeichnungen		1.877.032	-	-	214.594.019
Zinsforderungen		6.506.906	181.773	62	-
Dividendenforderungen		2.719.413	-	-	114.002.875
Sonstige Aktiva	9	3.251.499	115.267	630.196	76.273.140
Summe Aktiva		4.473.901.463	238.220.852	265.750.674	170.264.710.035
Passiva					
Überziehungskredite	3	473.272	58	556	-
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	108.766.042	460.000	-	57.052
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3	5.577.683	-	-	186.394.345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:					
Derivate	4	23.123.823	518.313	2.879.057	376.564.888
Pensionsgeschäfte	4	4.216.684	-	-	-
Anteilinhabertransaktionen		4.051.294	-	-	453.402.589
Zu zahlende Performancegebühren	8,9	2.022.857	344.321	-	-
Fällige Managementgebühren	8,9	2.417.493	179.746	177.180	103.398.959
Verbindlichkeiten aus Zinsen		49.130	-	301	-
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	8,9	5.229.848	276.981	284.795	173.478.130
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)		155.928.126	1.779.419	3.341.889	1.293.295.963
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen		4.317.973.337	236.441.433	262.408.785	168.971.414.072

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	*Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	*Man Numeric Europe RI Climate EUR
32.285.392	1.108.404	1.249.076	302.747	4.354.948	12.140.710	1.927.142
106.271.709	77.259	635.713	-	-	-	127.846
2.327.479	159.777	12	-	-	-	53.361
486.548.593	25.360.739	-	-	445.747.058	219.907.422	21.349.961
126.899.402	614.951	85.345.726	51.987.493	-	-	-
12.141.431	18.352	1.330.107	166.202	973.256	5.160.839	84.897
-	-	-	-	-	2.288	-
-	-	838.403	443.170	-	-	-
1.503.135	14.678	-	-	-	166	21.432
196.321	66.957	119.796	57.540	259.704	140.580	79.776
<u>768.173.462</u>	<u>27.421.117</u>	<u>89.518.833</u>	<u>52.957.152</u>	<u>451.334.966</u>	<u>237.352.005</u>	<u>23.644.415</u>
154	-	69	25	8	2.179	2
102.086.683	-	134.919	120.000	630.000	4.942.288	-
3.222.069	163.209	345	244.750	-	109	51.783
3.447.731	-	1.424.850	1.858	109.814	1.122.330	433
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	23.068	-	-
1.678.536	-	-	-	-	-	-
384.899	16.403	45.540	21.510	247.162	65.625	15.595
39.815	-	7.007	-	241	-	101
<u>716.920</u>	<u>84.512</u>	<u>158.485</u>	<u>149.288</u>	<u>503.115</u>	<u>232.913</u>	<u>80.254</u>
<u>111.576.807</u>	<u>264.124</u>	<u>1.771.215</u>	<u>537.431</u>	<u>1.513.408</u>	<u>6.365.444</u>	<u>148.168</u>
<u>656.596.655</u>	<u>27.156.993</u>	<u>87.747.618</u>	<u>52.419.721</u>	<u>449.821.558</u>	<u>230.986.561</u>	<u>23.496.247</u>

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

	Erläute- rungen	**Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	3	8.776	1.967.339	629.296	7.104.343
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	-	124.696	3.718.365	120.000
Forderungen gegenüber Brokern	3	-	-	11.888.984	-
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:					
Aktien	4	52.439.045	31.469.807	34.448.600	74.715.189
Verzinsliche Wertpapiere	4	-	-	242.551.053	-
Derivate	4	-	48.478	3.316.061	394.556
Forderungen aus Anteilszeichnungen		-	-	5.741	-
Zinsforderungen		-	-	2.333.697	-
Dividendenforderungen		-	-	88.661	65.145
Sonstige Aktiva	9	211.796	41.673	141.438	157.179
Summe Aktiva		<u>52.659.617</u>	<u>33.651.993</u>	<u>299.121.896</u>	<u>82.556.412</u>
Passiva					
Überziehungskredite	3	358.305	6	45.546	6
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3	-	-	4	305.214
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3	-	266.683	-	-
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:					
Derivate	4	-	10.977	6.849.258	169.635
Pensionsgeschäfte	4	-	-	-	-
Anteilinhabertransaktionen		-	-	59.401	-
Zu zahlende Performancegebühren	8,9	-	-	-	-
Fällige Managementgebühren	8,9	32.524	29.869	103.160	39.499
Verbindlichkeiten aus Zinsen		22	-	442	45
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	8,9	111.750	109.418	357.890	139.208
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)		<u>502.601</u>	<u>416.953</u>	<u>7.415.701</u>	<u>653.607</u>
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen		<u>52.157.016</u>	<u>33.235.040</u>	<u>291.706.195</u>	<u>81.902.805</u>

** Mit Wirkung vom 12. Mai 2021 wurde der Man GLG European Income Opportunities in Man GLG RI Sustainable European Income umbenannt.

Man Numeric US High Yield USD	#Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	#Man GLG China Equity USD
974.740	1.726.177	1.447.827
-	1.052.069	510.000
-	-	-
-	-	8.568.626
102.373.751	34.913.154	1.499.536
-	191.701	45.777
-	-	-
1.561.045	321.294	158
-	-	-
72.203	62.441	22.818
<u>104.981.739</u>	<u>38.266.836</u>	<u>12.094.742</u>
-	975	-
-	-	-
-	-	-
-	339.057	136.201
-	4.216.684	-
-	-	-
-	-	-
43.498	10.221	4.099
-	908	-
<u>185.067</u>	<u>44.710</u>	<u>23.966</u>
<u>228.565</u>	<u>4.612.555</u>	<u>164.266</u>
<u>104.753.174</u>	<u>33.654.281</u>	<u>11.930.476</u>

Der Man GLG Global Investment Grade Opportunities und der Man GLG China Equity haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. November 2021 bzw. am 14. Dezember 2021 aufgenommen.

	Erläute- rung	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		4.317.973.337	236.441.433	262.408.785	168.971.414.072
Ausgaben ⁻	10	1.850.306.125	16.377.280	2.159.570	163.443.548.567
Rücknahmen ⁻	10	(1.990.443.152)	(83.292.714)	(154.668.534)	(109.980.726.291)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Netto(verlust)/-gewinn für das Geschäftsjahr/ den Berichtszeitraum		(424.509.946)	(38.459.930)	(28.329.599)	43.375.692.812
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		<u>3.753.326.364</u>	<u>131.066.069</u>	<u>81.570.222</u>	<u>265.809.929.160</u>

	Erläu- terung	Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		52.157.016	33.235.040	291.706.195	81.902.805
Ausgaben ⁻	10	7.175.245	181.600	30.249.648	46.646.383
Rücknahmen ⁻	10	(29.161.588)	(5.929.734)	(50.560.965)	(58.470.296)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Netto(verlust)/-gewinn für das Geschäftsjahr/ den Berichtszeitraum		(4.096.025)	(8.869.504)	(22.786.737)	(8.854.825)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		<u>26.074.648</u>	<u>18.617.402</u>	<u>248.608.141</u>	<u>61.224.067</u>

⁻Umfasst unbare Transaktionen in Bezug auf Umschichtungen zwischen Anteilsklassen mit Wirkung im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	*Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	*Man Numeric Europe RI Climate EUR
656.596.655	27.156.993	87.747.618	52.419.721	449.821.558	230.986.561	23.496.247
41.095.484	431.388	49.782.309	4.364.251	67.640.216	44.465.961	30.883.461
(149.161.618)	(1.170.918)	(49.527.175)	(15.781.692)	(203.927.330)	(199.242.237)	(18.787.635)
(119.707.874)	(5.150.885)	(3.956.047)	(6.279.746)	(109.216.626)	(70.340.076)	(4.941.249)
<u>428.822.647</u>	<u>21.266.578</u>	<u>84.046.705</u>	<u>34.722.534</u>	<u>204.317.818</u>	<u>5.870.209</u>	<u>30.650.824</u>
Man Numeric US High Yield USD	Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	Man GLG China Equity USD	**Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy EUR	**Man GLG Sustainable Strategic Income USD	**Man GLG Dynamic Income USD	
104.753.174	33.654.281	11.930.476	-	-	-	
384.999	153.794.107	7.999.999	38.930.940	21.915.845	20.476.064	
(61.351.809)	(22.393.902)	(8.000.000)	-	(3.954.642)	-	
(7.180.872)	(5.340.315)	(2.163.064)	(4.120.356)	(1.829.889)	2.964.768	
<u>36.605.492</u>	<u>159.714.171</u>	<u>9.767.411</u>	<u>34.810.584</u>	<u>16.131.314</u>	<u>23.440.832</u>	

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

** Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, am 23. März 2022 bzw. am 30. Juni 2022 aufgenommen.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

	Erläuterung	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		4.095.364.268	234.611.424	241.220.857	118.976.964.191
Ausgaben~	10	2.225.224.363	118.888.616	49.716.799	136.301.700.003
Rücknahmen~	10	(2.388.147.752)	(107.957.879)	(64.797.302)	(128.551.815.368)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr/ den Berichtszeitraum		385.532.458	(9.100.728)	36.268.431	42.244.565.246
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		<u>4.317.973.337</u>	<u>236.441.433</u>	<u>262.408.785</u>	<u>168.971.414.072</u>

	Erläuterung	**Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		45.648.702	51.145.454	424.595.434	38.432.069
Ausgaben~	10	21.000.294	4.780.065	81.093.942	45.368.695
Rücknahmen~	10	(22.411.475)	(29.014.989)	(210.343.875)	(571.530)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr/ den Berichtszeitraum		7.919.495	6.324.510	(3.639.306)	(1.326.429)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums		<u>52.157.016</u>	<u>33.235.040</u>	<u>291.706.195</u>	<u>81.902.805</u>

~Umfasst unbare Transaktionen in Bezug auf Umschichtungen zwischen Anteilklassen mit Wirkung im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum.

* Mit Wirkung vom 12. Mai 2021 wurde der Man GLG European Income Opportunities in Man GLG RI Sustainable European Income umbenannt.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	**Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	**Man Numeric Europe RI Climate EUR
654.223.223	21.577.971	116.638.741	57.766.522	426.994.634	179.908.421	21.420.784
36.077.740	713.781	58.749.593	10.313.059	307.764.292	79.257.438	364.695
(55.347.550)	(148.610)	(80.867.057)	(11.873.428)	(377.335.826)	(54.893.495)	(4.573.815)
21.643.242	5.013.851	(6.773.659)	(3.786.432)	92.398.458	26.714.197	6.284.583
<u>656.596.655</u>	<u>27.156.993</u>	<u>87.747.618</u>	<u>52.419.721</u>	<u>449.821.558</u>	<u>230.986.561</u>	<u>23.496.247</u>
Man Numeric US High Yield USD	#Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	#Man GLG China Equity USD				
106.867.236	-	-				
25.567.317	33.982.911	12.004.739				
(34.076.155)	-	-				
6.394.776	(328.630)	(74.263)				
<u>104.753.174</u>	<u>33.654.281</u>	<u>11.930.476</u>				

** Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

Der Man GLG Global Investment Grade Opportunities und der Man GLG China Equity haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. November 2021 bzw. am 14. Dezember 2021 aufgenommen.

	Erläute- rungen	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Erträge					
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	7	(74.822.518)	(36.490.419)	(25.863.666)	47.202.013.202
Sonstige Einnahmen		1.843.100	80.512	1.922	141.765.301
		<u>(72.979.418)</u>	<u>(36.409.907)</u>	<u>(25.861.744)</u>	<u>47.343.778.503</u>
Sonstiges Gesamtergebnis					
Anpassung an Fremdwährungsbeträgen bei Aggregation	2 (o)	<u>(294.223.108)</u>	-	-	-
		(294.223.108)	-	-	-
Aufwendungen					
Managementgebühren	8,9	26.390.174	1.139.860	1.454.511	1.814.696.903
Verwaltungsgebühren	8,9	12.294.207	449.829	575.579	779.609.338
Sonstige Aufwendungen	2 (p)	3.632.734	136.501	356.354	64.837.469
Performancegebühren	8,9	605.803	13.724	-	-
Verwahrstellengebühren	8	1.630.685	35.619	42.654	51.813.087
Rechtskosten#		883.461	527.356	39.323	11.680.435
Prüfungsgebühren	17	208.557	9.345	8.629	3.911.900
Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats	8,9	47.407	2.000	2.298	2.233.138
Aufwendungen für Liquidation		5.101	-	4.842	-
Summe Aufwendungen		<u>45.698.129</u>	<u>2.314.234</u>	<u>2.484.190</u>	<u>2.728.782.270</u>
Aufwandsersatzung	9	7.952.061	264.464	350.856	399.551.090
Nettoaufwand		<u>37.746.068</u>	<u>2.049.770</u>	<u>2.133.334</u>	<u>2.329.231.180</u>
Finanzkosten					
Ausschüttungen an Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile		5.127.335	-	-	305.683.534
		<u>5.127.335</u>	-	-	<u>305.683.534</u>
Quellensteuer		14.434.017	253	334.521	1.333.170.977
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Netto(verlust)/-gewinn für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum		<u>(424.509.946)</u>	<u>(38.459.930)</u>	<u>(28.329.599)</u>	<u>43.375.692.812</u>

Alle ausgewiesenen Gewinne und Verluste für das Geschäftsjahr entstanden ausschließlich durch fortgeführte Geschäfte.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	*Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	*Man Numeric Europe RI Climate EUR
(111.769.951)	(4.838.659)	(3.339.264)	(6.040.383)	(106.572.919)	(69.318.072)	(4.547.111)
2.024	1.087	182.654	307	89.176	19.948	17.191
<u>(111.767.927)</u>	<u>(4.837.572)</u>	<u>(3.156.610)</u>	<u>(6.040.076)</u>	<u>(106.483.743)</u>	<u>(69.298.124)</u>	<u>(4.529.920)</u>
-	-	-	-	-	-	-
3.553.542	162.549	511.690	159.661	1.682.274	429.503	194.969
1.489.843	64.416	253.620	107.943	858.508	384.674	90.219
87.781	58.569	88.668	79.784	168.106	130.299	58.642
592.079	-	-	-	-	-	-
517.501	23.259	75.119	10.178	71.319	32.800	29.667
29.107	14.455	(2.188)	4.155	31.699	33.839	12.619
11.368	9.068	8.967	8.688	10.470	9.845	9.939
5.184	796	1.369	931	3.066	1.860	826
-	-	-	-	-	-	-
<u>6.286.405</u>	<u>333.112</u>	<u>937.245</u>	<u>371.340</u>	<u>2.825.442</u>	<u>1.022.820</u>	<u>396.881</u>
638.330	103.410	232.751	131.670	549.748	297.320	113.866
<u>5.648.075</u>	<u>229.702</u>	<u>704.494</u>	<u>239.670</u>	<u>2.275.694</u>	<u>725.500</u>	<u>283.015</u>
-	-	65	-	-	-	-
-	-	65	-	-	-	-
2.291.872	83.611	94.878	-	457.189	316.452	128.314
<u>(119.707.874)</u>	<u>(5.150.885)</u>	<u>(3.956.047)</u>	<u>(6.279.746)</u>	<u>(109.216.626)</u>	<u>(70.340.076)</u>	<u>(4.941.249)</u>

Alle für das Geschäftsjahr erfassten Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus Geschäftsbereichen, die zum Jahresende als fortgeführte Geschäftsbereiche angesehen wurden. Man GLG RI Sustainable European Income und Man GLG RI European Equity Leaders wurden nach dem Ende des Geschäftsjahrs eingestellt.

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

	Erläute- rungen	Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Erträge					
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	7	(3.638.870)	(8.453.169)	(19.243.569)	(8.245.800)
Sonstige Einnahmen		51.968	-	221.942	11
		<u>(3.586.902)</u>	<u>(8.453.169)</u>	<u>(19.021.627)</u>	<u>(8.245.789)</u>
Sonstiges Gesamtergebnis					
Anpassung an Fremdwährungsbeträgen bei Aggregation	2 (o)	-	-	-	-
		<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
Aufwendungen					
Managementgebühren	8,9	211.645	239.397	1.068.851	340.619
Verwaltungsgebühren	8,9	104.213	64.427	834.523	182.603
Sonstige Aufwendungen	2 (p)	80.344	53.731	176.903	95.754
Performancegebühren	8,9	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	8	17.851	128.900	64.692	61.651
Rechtskosten#		(1.768)	(1.193)	22.077	18.959
Prüfungsgebühren	17	9.818	8.704	10.350	9.344
Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats	8,9	864	798	2.875	1.145
Aufwendungen für Liquidation		-	-	-	-
Summe Aufwendungen		<u>422.967</u>	<u>494.764</u>	<u>2.180.271</u>	<u>710.075</u>
Aufwandsersatzung	9	131.510	129.889	611.062	240.413
Nettoaufwand		<u>291.457</u>	<u>364.875</u>	<u>1.569.209</u>	<u>469.662</u>
Finanzkosten					
Ausschüttungen an Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile		80.503	-	2.172.136	-
		<u>80.503</u>	<u>-</u>	<u>2.172.136</u>	<u>-</u>
Quellensteuer		137.163	51.460	23.765	139.374
		<u>137.163</u>	<u>51.460</u>	<u>23.765</u>	<u>139.374</u>
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Netto(verlust)/-gewinn für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum		<u>(4.096.025)</u>	<u>(8.869.504)</u>	<u>(22.786.737)</u>	<u>(8.854.825)</u>

Alle für das Geschäftsjahr erfassten Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus Geschäftsbereichen, die zum Jahresende als fortgeführte Geschäftsbereiche angesehen wurden. Man GLG RI Sustainable European Income und Man GLG RI European Equity Leaders wurden nach dem Ende des Geschäftsjahrs eingestellt.

Man Numeric US High Yield USD	Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	Man GLG China Equity USD	**Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy EUR	**Man GLG Sustainable Strategic Income USD	**Man GLG Dynamic Income USD
(6.849.975)	(4.142.740)	(2.064.956)	(3.720.447)	(1.762.530)	3.258.134
-	4.532	-	5.374	17.768	813
<u>(6.849.975)</u>	<u>(4.138.208)</u>	<u>(2.064.956)</u>	<u>(3.715.073)</u>	<u>(1.744.762)</u>	<u>3.258.947</u>
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
236.069	247.236	71.635	241.257	54.277	52.888
137.423	237.756	29.347	102.220	40.756	32.288
48.061	889.160	84.095	129.589	58.421	271.694
-	-	-	-	-	-
276	28.851	21.054	19.779	16.889	11.255
(1.218)	11.522	10.642	14.880	11.794	7.647
8.171	9.647	8.833	7.690	7.428	7.389
1.032	1.248	679	857	712	680
-	-	-	-	-	-
<u>429.814</u>	<u>1.425.420</u>	<u>226.285</u>	<u>516.272</u>	<u>190.277</u>	<u>383.841</u>
98.917	241.275	134.526	207.090	111.795	89.662
<u>330.897</u>	<u>1.184.145</u>	<u>91.759</u>	<u>309.182</u>	<u>78.482</u>	<u>294.179</u>
-	17.962	-	-	-	-
-	<u>17.962</u>	-	-	-	-
-	-	6.349	96.101	6.645	-
<u>(7.180.872)</u>	<u>(5.340.315)</u>	<u>(2.163.064)</u>	<u>(4.120.356)</u>	<u>(1.829.889)</u>	<u>2.964.768</u>

Alle für das Geschäftsjahr erfassten Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus Geschäftsbereichen, die zum Jahresende als fortgeführte Geschäftsbereiche angesehen wurden. Man GLG RI Sustainable European Income und Man GLG RI European Equity Leaders wurden nach dem Ende des Geschäftsjahrs eingestellt.

** Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, am 23. März 2022 bzw. am 30. Juni 2022 aufgenommen.

	Erläute- rungen	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Erträge					
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	7	656.353.195	(6.529.261)	39.205.792	44.899.150.041
Sonstige Einnahmen		<u>2.480.744</u>	<u>575.965</u>	<u>451.749</u>	<u>103.366.028</u>
		<u>658.833.939</u>	<u>(5.953.296)</u>	<u>39.657.541</u>	<u>45.002.516.069</u>
Sonstiges Gesamtergebnis					
Anpassung an Fremdwährungsbeträgen bei Aggregation	2 (o)	<u>(207.412.627)</u>	-	-	-
		<u>(207.412.627)</u>	-	-	-
Aufwendungen					
Managementgebühren	8,9	31.745.063	2.183.297	2.238.332	1.345.481.017
Verwaltungsgebühren	8,9	14.257.878	776.612	835.123	546.856.681
Sonstige Aufwendungen	2 (p)	3.921.119	146.741	158.298	46.885.670
Performancegebühren	8,9	1.893.524	214.988	-	-
Verwahrstellengebühren	8	1.725.538	49.241	60.431	36.580.115
Rechtskosten		633.305	111.131	26.485	14.682.997
Prüfungsgebühren	17	183.129	9.627	9.439	2.746.635
Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats	8,9	53.173	3.151	3.013	1.567.452
Transaktions- und Maklerkosten		<u>27.344</u>	-	-	-
Summe Aufwendungen		<u>54.440.073</u>	<u>3.494.788</u>	<u>3.331.121</u>	<u>1.994.800.567</u>
Aufwandsersatzung	9	<u>8.075.902</u>	<u>346.605</u>	<u>435.282</u>	<u>269.570.172</u>
Nettoaufwand		<u>46.364.171</u>	<u>3.148.183</u>	<u>2.895.839</u>	<u>1.725.230.395</u>
Finanzkosten					
Ausschüttungen an Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile		<u>5.791.893</u>	-	-	<u>162.183.560</u>
		<u>5.791.893</u>	-	-	<u>162.183.560</u>
Quellensteuer		<u>13.732.790</u>	<u>(751)</u>	<u>493.271</u>	<u>870.536.868</u>
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum		<u>385.532.458</u>	<u>(9.100.728)</u>	<u>36.268.431</u>	<u>42.244.565.246</u>

Alle ausgewiesenen Gewinne und Verluste für das Geschäftsjahr entstanden ausschließlich durch fortgeführte Geschäfte.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	**Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	**Man Numeric Europe RI Climate EUR
33.036.097	5.340.370	(4.219.789)	(3.215.710)	97.868.586	28.073.310	6.558.187
174.621	4.824	38.628	-	129.255	23.220	13.418
<u>33.210.718</u>	<u>5.345.194</u>	<u>(4.181.161)</u>	<u>(3.215.710)</u>	<u>97.997.841</u>	<u>28.096.530</u>	<u>6.571.605</u>
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
4.839.396	179.196	608.105	271.100	3.385.812	620.466	154.736
2.077.296	71.322	302.238	154.949	1.606.144	599.728	69.978
318.368	53.294	1.547.075	119.790	175.985	107.077	55.277
1.678.536	-	-	-	-	-	-
534.180	60.761	84.024	15.121	119.487	44.920	66.320
62.163	11.908	20.668	13.171	39.698	24.698	7.780
13.475	7.624	8.015	8.117	14.654	10.157	6.441
6.697	1.078	1.770	1.337	5.414	2.430	946
-	-	583	-	-	-	-
<u>9.530.111</u>	<u>385.183</u>	<u>2.572.478</u>	<u>583.585</u>	<u>5.347.194</u>	<u>1.409.476</u>	<u>361.478</u>
<u>743.948</u>	<u>131.740</u>	<u>311.001</u>	<u>169.057</u>	<u>839.993</u>	<u>358.756</u>	<u>135.595</u>
<u>8.786.163</u>	<u>253.443</u>	<u>2.261.477</u>	<u>414.528</u>	<u>4.507.201</u>	<u>1.050.720</u>	<u>225.883</u>
41.400	-	142.390	156.194	-	-	-
<u>41.400</u>	<u>-</u>	<u>142.390</u>	<u>156.194</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
2.739.913	77.900	188.631	-	1.092.182	331.613	61.139
<u>21.643.242</u>	<u>5.013.851</u>	<u>(6.773.659)</u>	<u>(3.786.432)</u>	<u>92.398.458</u>	<u>26.714.197</u>	<u>6.284.583</u>

Alle ausgewiesenen Gewinne und Verluste für das Geschäftsjahr entstanden ausschließlich durch fortgeführte Geschäfte.

** Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

	Erläute- rungen	#Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Erträge					
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	7	8.920.152	7.119.009	1.237.678	(629.539)
Sonstige Einnahmen		9.521	-	6.695	-
		<u>8.929.673</u>	<u>7.119.009</u>	<u>1.244.373</u>	<u>(629.539)</u>
Sonstiges Gesamtergebnis					
Anpassung an Fremdwährungsbeträgen bei Aggregation	2 (o)	-	-	-	-
Aufwendungen					
Managementgebühren	8,9	414.345	477.741	1.443.963	420.340
Verwaltungsgebühren	8,9	184.366	139.248	1.022.027	214.674
Sonstige Aufwendungen	2 (p)	107.942	77.447	190.147	148.585
Performancegebühren	8,9	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	8	17.824	125.325	75.194	27.881
Rechtskosten		15.498	17.565	36.824	58.067
Prüfungsgebühren	17	6.492	8.050	6.711	8.157
Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats	8,9	1.224	1.319	3.894	1.412
Transaktions- und Maklerkosten		-	-	19.461	-
Summe Aufwendungen		<u>747.691</u>	<u>846.695</u>	<u>2.798.221</u>	<u>879.116</u>
Aufwandsersatzung	9	168.413	155.920	655.485	304.227
Nettoaufwand		<u>579.278</u>	<u>690.775</u>	<u>2.142.736</u>	<u>574.889</u>
Finanzkosten					
Ausschüttungen an Inhaber von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen		273.411	-	2.656.526	-
		<u>273.411</u>	<u>-</u>	<u>2.656.526</u>	<u>-</u>
Quellensteuer		157.489	103.724	84.417	122.001
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum		<u>7.919.495</u>	<u>6.324.510</u>	<u>(3.639.306)</u>	<u>(1.326.429)</u>

Alle ausgewiesenen Gewinne und Verluste für das Geschäftsjahr entstanden ausschließlich durch fortgeführte Geschäfte.

Mit Wirkung vom 12. Mai 2021 wurde der Man GLG European Income Opportunities in Man GLG RI Sustainable European Income umbenannt.

Man Numeric US High Yield USD	*Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	*Man GLG China Equity USD
7.205.605	(305.985)	(69.016)
-	-	-
<u>7.205.605</u>	<u>(305.985)</u>	<u>(69.016)</u>
-	-	-
-	-	-
578.313	15.329	4.099
342.678	10.449	1.640
87.036	26.608	13.096
-	-	-
31.610	3.177	992
21.004	2.225	742
16.941	7.496	7.496
1.839	-	-
-	-	-
<u>1.079.421</u>	<u>65.284</u>	<u>28.065</u>
<u>268.592</u>	<u>42.639</u>	<u>22.818</u>
<u>810.829</u>	<u>22.645</u>	<u>5.247</u>
-	-	-
-	-	-
-	-	-
<u>6.394.776</u>	<u>(328.630)</u>	<u>(74.263)</u>

Alle ausgewiesenen Gewinne und Verluste für das Geschäftsjahr entstanden ausschließlich durch fortgeführte Geschäfte.

* Der Man GLG Global Investment Grade Opportunities und der Man GLG China Equity haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. November 2021 bzw. am 14. Dezember 2021 aufgenommen.

	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Cashflow aus Geschäftstätigkeit:				
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Netto(verlust)/-gewinn für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum	(424.509.946)	(38.459.930)	(28.329.599)	43.375.692.812
Berichtigungen zur Überleitung des Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum, der rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzuordnen ist, auf die Nettobarmittelbereitstellung/(-verwendung) aus der laufenden Geschäftstätigkeit:				
Rückgang/(Anstieg) der Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	7.669.647	(4.929.736)	(1.007.279)	-
(Anstieg)/Rückgang der Forderungen gegenüber Brokern	(31.836.481)	(920.068)	-	(1.651.149.101)
Rückgang/(Anstieg) der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:				
Aktien	506.612.453	75	252.883.580	(94.894.439.012)
Verzinsliche Wertpapiere	58.763.032	74.892.859	-	-
Derivate	11.557.588	1.370.555	(268.332)	462.513.904
(Anstieg)/Rückgang der Zinsforderungen	(2.913.973)	(104.154)	62	-
(Anstieg)/Rückgang der Dividendenforderungen	(1.913.166)	-	(111.664)	(189.357.256)
(Anstieg)/Rückgang sonstiger Vermögenswerte	(287.189)	12.016	273.716	(76.767.074)
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	(3.387.644)	3.043.144	-	(57.052)
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	78.634.272	-	-	3.120.111.276
Zunahme/(Abnahme) bei Pensionsgeschäften	21.592.955	-	-	-
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	(1.803.517)	(337.949)	-	-
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(319.516)	(98.826)	(117.830)	59.074.483
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Zinsen	488.424	6.581	175.462	-
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren	5.168	-	4.842	-
Anstieg/(Rückgang) der passiven Rechnungsabgrenzungsposten und sonstigen Verbindlichkeiten	816.258	(36.269)	(55.711)	144.109.695
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	219.168.365	34.438.298	223.447.247	(49.650.267.325)
Cashflow aus Finanzierungstätigkeit:				
Ausgabe von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen [~]	1.852.128.151	14.335.508	2.159.570	161.409.227.869
Rücknahme von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen [~]	(1.992.213.701)	(81.250.981)	(154.666.398)	(107.917.422.051)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus Finanzierungstätigkeit	(140.085.550)	(66.915.473)	(152.506.828)	53.491.805.818
Nettoanstieg/(-rückgang) der Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	138.755.167	42.556.129	7.008.628	2.343.482.643
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	217.837.982	10.078.954	77.949.047	6.185.021.136
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums bestehen aus:				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	220.440.367	10.957.430	77.959.577	6.185.868.786
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt	529.834	-	-	-
Überziehungskredite	(3.132.219)	(878.476)	(10.530)	(847.650)
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	217.837.982	10.078.954	77.949.047	6.185.021.136
Ergänzende Angaben zum Cashflow				
Erhaltene Dividenden (ohne Quellensteuer)	93.380.722	3.170	4.543.810	7.337.929.889
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	-	-	-	-
Erhaltene Zinsen (nach Abzug von Quellensteuern)	27.497.554	1.142.719	185.669	2.383.622
Gezahlte Zinsen	(9.660.433)	(338.542)	(67.785)	(16.026.008)
An Anteilinhaber gezahlte Bardividenden	(5.127.335)	-	-	(305.683.534)

[~]Ohne unbare Transaktionen in Bezug auf Umschichtungen zwischen Anteilklassen mit Wirkung im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	*Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD	*Man Numeric Europe RI Climate EUR
(119.707.874)	(5.150.885)	(3.956.047)	(6.279.746)	(109.216.626)	(70.340.076)	(4.941.249)
16.804.936	21.667	132.949	-	(440.078)	-	38.087
190.832	95.420	-	-	-	(577)	(86.536)
188.917.879	4.983.411	-	-	244.786.163	214.304.812	(8.093.911)
39.993.241	614.951	4.048.312	18.073.378	-	-	-
6.942.546	32.652	(796.661)	94.552	1.665.754	4.033.480	140.129
-	(263)	(18.804)	(4.126)	(576)	(90)	(174)
(553.624)	5.944	-	-	-	(45)	10.728
(101.143)	(14.108)	52.022	19.842	35.620	50.550	(1.874)
(23.111.992)	-	544.327	296	(630.000)	(4.942.288)	28
(65.839)	(136.769)	45	(244.750)	-	(109)	61.139
-	-	-	-	-	-	-
(1.465.568)	-	-	-	-	-	-
(124.601)	(3.463)	(4.281)	(9.173)	(139.840)	(61.854)	3.627
119.860	-	574	7.718	(241)	-	(101)
-	-	-	-	-	-	-
(91.929)	7.119	14.968	(2.037)	(168.110)	(114.608)	21.019
107.746.724	455.676	17.404	11.655.954	135.892.066	142.929.195	(12.849.088)
41.095.484	431.388	49.782.309	4.364.235	67.639.063	44.468.249	17.411.481
(149.148.514)	(1.170.918)	(49.527.175)	(15.781.692)	(203.941.901)	(199.242.237)	(5.315.655)
(108.053.030)	(739.530)	255.134	(11.417.457)	(136.302.838)	(154.773.988)	12.095.826
(306.306)	(283.854)	272.538	238.497	(410.772)	(11.844.793)	(753.262)
32.285.238	1.108.404	1.249.007	302.722	4.354.940	12.138.531	1.927.140
31.978.932	824.550	1.521.545	541.219	3.944.168	293.738	1.173.878
31.499.046	824.550	1.521.547	541.239	3.944.168	293.768	1.173.878
529.834	-	-	-	-	-	-
(49.948)	-	(2)	(20)	-	(30)	-
31.978.932	824.550	1.521.545	541.219	3.944.168	293.738	1.173.878
22.223.230	414.868	-	-	3.064.532	1.313.525	892.053
-	-	-	-	-	-	-
1.655.858	42.659	2.868.569	1.331.861	8.387	37.304	2.910
(2.464.387)	-	(290.199)	(1.396.464)	(11.271)	(8.977)	(7.709)
-	-	(65)	-	-	-	-

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

	Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD	Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD
Cashflow aus Geschäftstätigkeit:				
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Netto(verlust)/-gewinn für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum	(4.096.025)	(8.869.504)	(22.786.737)	(8.854.825)
Berichtigungen zur Überleitung des Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum, der rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzuordnen ist, auf die Nettobarmittelbereitstellung/(-verwendung) aus der laufenden Geschäftstätigkeit:				
Rückgang/(Anstieg) der Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	21.025	3.426.950	(1.859.352)
(Anstieg)/Rückgang der Forderungen gegenüber Brokern	-	-	1.189.494	-
Rückgang/(Anstieg) der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:				
Aktien	26.828.117	14.224.029	23.386.783	20.630.471
Verzinsliche Wertpapiere	-	(810.647)	11.703.102	-
Derivate	-	(10.297)	(3.684.327)	149.923
(Anstieg)/Rückgang der Zinsforderungen	(63)	(212)	(512.693)	(2.155)
(Anstieg)/Rückgang der Dividendenforderungen	-	-	33.786	46.144
(Anstieg)/Rückgang sonstiger Vermögenswerte	18.956	18.457	(24.990)	93.648
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	15.371.171	226.726
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	(185.265)	9.777.356	-
Zunahme/(Abnahme) bei Pensionsgeschäften	-	-	-	-
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	-	-	-	-
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(17.795)	(13.201)	(20.897)	(10.990)
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Zinsen	(22)	-	(442)	(45)
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren	-	-	-	-
Anstieg/(Rückgang) der passiven Rechnungsabgrenzungsposten und sonstigen Verbindlichkeiten	(13.194)	(7.189)	28.745	(7.993)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	22.719.974	4.367.196	37.887.301	10.411.552
Cashflow aus Finanzierungstätigkeit:				
Ausgabe von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen ¹	7.175.245	181.600	29.888.989	46.646.269
Rücknahme von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen ²	(29.160.139)	(5.903.190)	(50.138.133)	(58.470.256)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus Finanzierungstätigkeit	(21.984.894)	(5.721.590)	(20.249.144)	(11.823.987)
Nettoanstieg/(-rückgang) der Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	735.080	(1.354.394)	17.638.157	(1.412.435)
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	(349.529)	1.967.333	583.750	7.104.337
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	385.551	612.939	18.221.907	5.691.902
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente am Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums bestehen aus:				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	385.551	628.385	19.101.660	5.692.016
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	-	-	-	-
Überziehungskredite	-	(15.446)	(879.753)	(114)
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	385.551	612.939	18.221.907	5.691.902
Ergänzende Angaben zum Cashflow				
Erhaltene Dividenden (ohne Quellensteuer)	996.142	454.312	998.481	1.071.390
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	-	-	-	-
Erhaltene Zinsen (nach Abzug von Quellensteuern)	1.388	23.293	9.810.070	48.956
Gezahlte Zinsen	(2.216)	(1.722)	(2.832.566)	(90.955)
An Anteilinhaber gezahlte Bardividenden	(80.503)	-	(2.172.136)	-

¹Ohne unbare Transaktionen in Bezug auf Umschichtungen zwischen Anteilsklassen mit Wirkung im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man Numeric US High Yield USD	Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	Man GLG China Equity USD	**Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy EUR	**Man GLG Sustainable Strategic Income USD	**Man GLG Dynamic Income USD
(7.180.872)	(5.340.315)	(2.163.064)	(4.120.356)	(1.829.889)	2.964.768
-	(4.849.228)	182.420	(115.939)	(348.507)	(855.287)
-	(15.722.680)	-	-	-	(6.278.133)
-	-	(502.646)	(34.006.850)	-	-
66.659.614	(149.321.129)	807.200	-	(15.462.358)	(31.580.790)
-	(1.434.742)	188.449	-	83.406	158.709
860.041	(2.651.798)	158	(98)	(209.018)	(519.720)
-	-	-	(42.841)	-	-
60.645	(59.201)	(68.586)	(129.346)	(43.790)	(92.313)
-	2.680.000	179.055	-	-	220.010
-	31.387.723	-	-	-	12.548.608
-	17.245.566	-	-	-	4.347.389
-	-	-	-	-	-
(28.223)	22.709	1.891	22.080	6.207	9.430
107	139.727	1.163	-	-	26.502
-	-	-	-	-	-
(63.333)	181.138	70.832	109.716	82.280	80.479
60.307.979	(127.722.230)	(1.303.128)	(38.283.634)	(17.721.669)	(18.970.348)
384.999	153.794.107	7.999.999	38.930.940	21.915.845	20.476.064
(61.351.809)	(22.393.902)	(8.000.000)	-	(3.954.642)	-
(60.966.810)	131.400.205	(1)	38.930.940	17.961.203	20.476.064
(658.831)	3.677.975	(1.303.129)	647.306	239.534	1.505.716
974.740	1.725.202	1.447.827	-	-	-
315.909	5.403.177	144.698	647.306	239.534	1.505.716
315.909	5.403.177	149.069	649.953	1.344.585	1.505.716
-	-	-	-	-	-
-	-	(4.371)	(2.647)	(1.105.051)	-
315.909	5.403.177	144.698	647.306	239.534	1.505.716
-	-	88.430	372.102	-	-
-	-	-	-	-	-
3.874.090	2.810.843	16.780	3.910	298.213	511.841
52	(295.724)	(15.627)	(7.973)	(982.979)	(49.795)
-	(17.962)	-	-	-	-

** Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, am 23. März 2022 bzw. am 30. Juni 2022 aufgenommen.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

	Kombinierter Fonds USD	Man GLG Global Convertibles USD	Man GLG RI European Equity Leaders EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity JPY
Cashflow aus Geschäftstätigkeit:				
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum	385.532.458	(9.100.728)	36.268.431	42.244.565.246
Berichtigungen zur Überleitung des Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum, der rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzuordnen ist, auf die Nettobarmittelbereitstellung/(-verwendung) aus der laufenden Geschäftstätigkeit:				
Rückgang/(Anstieg) der Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	1.906.942	(65.059)	(2.343.348)	-
(Anstieg)/Rückgang der Forderungen gegenüber Brokern	(14.365.854)	-	737.459	(184.433.267)
(Anstieg)/Rückgang der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:				
Aktien	(405.631.946)	2.097	(32.452.713)	(49.595.841.980)
Verzinsliche Wertpapiere	166.384.217	(6.681.159)	-	-
Derivate	9.168.730	(363.037)	1.679.969	(189.580.247)
Rückgang/(Anstieg) der Zinsforderungen	3.877.760	77.709	85	-
Rückgang/(Anstieg) der Dividendenforderungen	1.262.343	-	-	106.779.842
(Anstieg)/Rückgang sonstiger Vermögenswerte	(550.993)	(15.687)	(51.688)	(59.852.326)
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	(6.871.274)	10.000	(89.848)	(147.319.591)
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	(4.795.763)	(2.739.137)	-	186.394.345
Zunahme/(Abnahme) bei Pensionsgeschäften	4.216.684	-	-	-
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	1.402.190	(244.690)	-	-
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	217.317	(18.299)	14.518	30.940.656
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Zinsen	(16.994)	-	(964)	-
Anstieg/(Rückgang) der passiven Rechnungsabgrenzungsposten und sonstigen Verbindlichkeiten	816.198	39.673	56.317	69.290.246
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	142.552.015	(19.098.317)	3.818.218	(7.539.057.076)
Cashflow aus Finanzierungstätigkeit:				
Ausgabe von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen~	2.227.755.821	118.801.055	49.716.799	136.428.703.666
Rücknahme von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen~	(2.385.035.146)	(107.870.318)	(64.818.033)	(128.128.591.045)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus Finanzierungstätigkeit	(157.279.325)	10.930.737	(15.101.234)	8.300.112.621
Nettoanstieg/(-rückgang) der Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	(14.727.310)	(8.167.580)	(11.283.016)	761.055.545
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	153.482.477	50.723.709	18.291.644	1.582.427.098
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	138.755.167	42.556.129	7.008.628	2.343.482.643
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	139.228.439	42.556.187	7.009.184	2.343.482.643
Überziehungskredite	(473.272)	(58)	(556)	-
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	138.755.167	42.556.129	7.008.628	2.343.482.643
Ergänzende Angaben zum Cashflow				
Erhaltene Dividenden (ohne Quellensteuer)	90.099.878	2.295	7.134.632	4.986.543.448
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	(63)	-	-	-
Erhaltene Zinsen (nach Abzug von Quellensteuern)	26.497.330	1.005.557	106.426	50.907
Gezahlte Zinsen	(4.793.374)	(37.716)	(174.968)	(11.638.374)
An Anteilinhaber gezahlte Bardividenden	(5.791.893)	-	-	(162.183.560)

~Ohne unbare Transaktionen in Bezug auf Umschichtungen zwischen Anteilklassen mit Wirkung im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man Numeric Emerging Markets Equity USD	*Man Numeric RI US Large Cap Equity USD	**Man Numeric Global RI Climate USD	Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond USD	Man GLG Pan- European Equity Growth EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth USD
21.643.242	-	5.013.851	(6.773.659)	(3.786.432)	92.398.458	26.714.197
5.317.151	-	51.243	1.011.204	-	-	-
2.353.374	-	(36.812)	(12)	-	-	-
7.585.807	-	(6.333.461)	-	-	(24.858.118)	(45.876.571)
(18.230.795)	-	514.758	29.546.493	5.506.959	-	-
2.079.171	-	37.641	(493.480)	63.172	(108.402)	(1.492.449)
-	-	-	699.864	53.172	-	-
123.341	-	4.735	-	-	-	-
(4.099)	86.613	(3.239)	(30.393)	(11.016)	(79.052)	(24.196)
(3.984.072)	-	-	(705.067)	(650.955)	190.000	2.316.893
(1.540.725)	-	4.852	(1.440.127)	(719.550)	-	109
-	-	-	-	-	-	-
1.678.536	-	-	-	-	-	-
1.653	-	3.528	(13.597)	(2.593)	60.752	21.527
(4.900)	-	-	(7.288)	-	(95)	(26)
43.178	(96.562)	12.697	6.235	41.094	124.553	50.995
17.060.862	(9.949)	(730.207)	21.800.173	493.851	67.728.096	(18.289.521)
36.077.740	-	713.781	58.749.593	10.804.113	307.766.352	79.270.545
(55.351.679)	-	(148.610)	(80.880.079)	(11.873.428)	(377.312.758)	(54.893.495)
(19.273.939)	-	565.171	(22.130.486)	(1.069.315)	(69.546.406)	24.377.050
(2.213.077)	(9.949)	(165.036)	(330.313)	(575.464)	(1.818.310)	6.087.529
34.498.315	9.949	1.273.440	1.579.320	878.186	6.173.250	6.051.002
32.285.238	-	1.108.404	1.249.007	302.722	4.354.940	12.138.531
32.285.392	-	1.108.404	1.249.076	302.747	4.354.948	12.140.710
(154)	-	-	(69)	(25)	(8)	(2.179)
32.285.238	-	1.108.404	1.249.007	302.722	4.354.940	12.138.531
22.166.141	-	350.189	-	-	4.443.087	1.192.651
-	-	-	-	-	-	-
89.244	-	13.014	4.269.846	1.142.431	860	970
(3.839.981)	-	(1.393)	(65.069)	(1.772)	(54.752)	(13.021)
(41.400)	-	-	(142.390)	(156.194)	-	-

* Der Man Numeric RI US Large Cap Equity hat seine Geschäftstätigkeit am 25. Februar 2020 eingestellt.

** Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurde der Man Numeric RI Global Equity in Man Numeric Global RI Climate umbenannt.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

	##Man Numeric Europe RI Climate EUR	#Man GLG Iberian Opportunities EUR	**Man GLG RI Sustainable European Income EUR	Man Numeric China A Equity USD
Cashflow aus Geschäftstätigkeit:				
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnender Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum	6.284.583	-	7.919.495	6.324.510
Berichtigungen zur Überleitung des Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr/den Berichtszeitraum, der rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzuordnen ist, auf die Nettobarmittelbereitstellung/(-verwendung) aus der laufenden Geschäftstätigkeit:				
Rückgang/(Anstieg) der Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	(127.846)	-	-	(41.782)
(Anstieg)/Rückgang der Forderungen gegenüber Brokern	76.038	-	-	-
(Anstieg)/Rückgang der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:				
Aktien	(1.094.977)	-	(7.479.460)	17.425.409
Verzinsliche Wertpapiere	-	-	-	-
Derivate	13.402	-	-	78.651
Rückgang/(Anstieg) der Zinsforderungen	-	-	-	-
Rückgang/(Anstieg) der Dividendenforderungen	4.439	-	-	-
(Anstieg)/Rückgang sonstiger Vermögenswerte	(20.616)	15.375	23.623	(7.015)
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	(104.333)	-	-	149.461
Zunahme/(Abnahme) bei Pensionsgeschäften	-	-	-	-
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	-	-	(25.871)	-
Anstieg/(Rückgang) der Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	1.243	(613)	7.097	(7.929)
(Rückgang)/Anstieg der Verbindlichkeiten aus Zinsen	15	-	(11)	-
Anstieg/(Rückgang) der passiven Rechnungsabgrenzungsposten und sonstigen Verbindlichkeiten	15.725	(72.293)	25.898	11.130
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus laufender Geschäftstätigkeit	5.047.673	(57.531)	470.771	23.932.435
Cashflow aus Finanzierungstätigkeit:				
Ausgabe von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen~	364.695	-	21.000.294	4.780.065
Rücknahme von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen~	(4.573.815)	-	(22.436.016)	(29.014.989)
Nettomittel(abfluss)/-zufluss aus Finanzierungstätigkeit	(4.209.120)	-	(1.435.722)	(24.234.924)
Nettoanstieg/(-rückgang) der Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	838.553	(57.531)	(964.951)	(302.489)
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	1.088.587	57.531	615.422	2.269.822
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	1.927.140	-	(349.529)	1.967.333
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	1.927.142	-	8.776	1.967.339
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.927.142	-	8.776	1.967.339
Überziehungskredite	(2)	-	(358.305)	(6)
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	1.927.140	-	(349.529)	1.967.333
Ergänzende Angaben zum Cashflow				
Erhaltene Dividenden (ohne Quellensteuer)	555.475	-	1.699.176	929.485
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	(8)	-	-	(54)
Erhaltene Zinsen (nach Abzug von Quellensteuern)	1.063	-	-	19
Gezahlte Zinsen	(9.890)	-	(10.368)	(3.678)
An Anteilinhaber gezahlte Bardividenden	-	-	(273.411)	-

~Ohne unbare Transaktionen in Bezug auf Umschichtungen zwischen Anteilklassen mit Wirkung im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum.

Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurde der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

Der Man GLG Iberian Opportunities hat seine Geschäftstätigkeit am 2. Dezember 2020 eingestellt.

* Mit Wirkung vom 12. Mai 2021 wurde der Man GLG European Income Opportunities in Man GLG RI Sustainable European Income umbenannt.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

Man GLG Strategic Bond GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity USD	Man Numeric US High Yield USD	#Man GLG Global Investment Grade Opportunities USD	#Man GLG China Equity USD
(3.639.306)	(1.326.429)	6.394.776	(328.630)	(74.263)
(995.744)	1.175.472	-	(1.052.069)	(510.000)
(11.888.984)	25.789	-	-	-
(135.382)	(41.555.256)	-	-	(8.568.626)
137.936.427	-	549.667	(34.913.154)	(1.499.536)
5.915.972	388.826	-	147.356	90.424
2.324.551	-	161.525	(321.294)	(158)
(10)	(23.878)	-	-	-
111.100	(70.166)	(481)	(62.441)	(22.818)
(2.049.996)	305.214	-	-	-
-	(140)	-	-	-
-	-	-	4.216.684	-
-	-	-	-	-
(39.861)	21.050	(4.024)	10.221	4.099
(2.528)	(878)	-	908	-
(112.261)	82.428	116.831	44.710	23.966
<u>127.423.978</u>	<u>(40.977.968)</u>	<u>7.218.294</u>	<u>(32.257.709)</u>	<u>(10.556.912)</u>
81.223.919	45.368.695	25.567.317	33.982.911	12.004.739
(210.410.967)	(571.530)	(34.076.155)	-	-
<u>(129.187.048)</u>	<u>44.797.165</u>	<u>(8.508.838)</u>	<u>33.982.911</u>	<u>12.004.739</u>
(1.763.070)	3.819.197	(1.290.544)	1.725.202	1.447.827
2.346.820	3.285.140	2.265.284	-	-
<u>583.750</u>	<u>7.104.337</u>	<u>974.740</u>	<u>1.725.202</u>	<u>1.447.827</u>
629.296	7.104.343	974.740	1.726.177	1.447.827
(45.546)	(6)	-	(975)	-
<u>583.750</u>	<u>7.104.337</u>	<u>974.740</u>	<u>1.725.202</u>	<u>1.447.827</u>
1.954.119	1.138.558	-	-	-
-	-	-	-	-
9.415.081	676	6.826.041	(206.286)	55
(287.838)	(11.621)	(7.512)	(14.425)	-
(2.656.526)	-	-	-	-

Der Man GLG Global Investment Grade Opportunities und der Man GLG China Equity haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. November 2021 bzw. am 14. Dezember 2021 aufgenommen.

Die Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

1. Allgemeines

Man Funds plc (der „Fonds“) wurde als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds nach irischem Recht als Public Limited Company am 1. August 1996 unter der Registernummer 252520 in Irland gegründet. Der Fonds wurde von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) gemäß den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Verordnungen“) und den Central Bank (Supervision und Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Verordnungen der Zentralbank“) zugelassen. Zum 31. Dezember 2022 ist Man GLG Japan CoreAlpha Equity Klasse I H USD an der Luxembourg Stock Exchange notiert. Die Anlageverwalter des Fonds sind GLG Partners LP für Man GLG Portfolios, GLG LLC für GLG LLC Portfolios und Numeric Investors LLC für Man Numeric Portfolios (die „Anlageverwalter“). Der eingetragene Sitz des Fonds ist 70 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland. Der Fonds hat keine Angestellten.

Der Fonds hat die Struktur eines Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds (jeweils ein „Portfolio“), so dass der Verwaltungsrat jeweils mit Genehmigung der Zentralbank verschiedene Portfolios auflegen kann. Jedes Portfolio besteht aus verschiedenen Serien rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile und wird im Einklang mit den für das jeweilige Portfolio geltenden Anlagezielen bzw. der entsprechenden Anlagepolitik mit Kapital ausgestattet. Zum 31. Dezember 2022 umfasste der Fonds zwanzig Portfolios:

Man GLG Portfolios

- Man GLG Global Convertibles;
- Man GLG RI European Equity Leaders;
- Man GLG Japan CoreAlpha Equity;
- Man GLG Pan-European Equity Growth;
- Man GLG RI Global Sustainable Growth;
- Man GLG RI Sustainable European Income;
- Man GLG Strategic Bond;
- Man GLG Asia (ex Japan) Equity;
- Man GLG Global Investment Grade Opportunities (am 10. November 2021 aufgelegt);
- Man GLG China Equity (am 14. Dezember 2021 aufgelegt);
- Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy (am 10. Februar 2022 aufgelegt);
- Man GLG Sustainable Strategic Income (am 23. März 2022 aufgelegt); und
- Man GLG Dynamic Income (am 30. Juni 2022 aufgelegt)

Man Numeric Portfolios

- Man Numeric Emerging Markets Equity;
- Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity);
- Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity);
- Man Numeric China A Equity; und
- Man Numeric US High Yield.

GLG LLC Portfolios

- Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates und
- Man GLG Global Emerging Markets Bond.

Zum 31. Dezember 2022 waren folgende Portfolios bei der Schweizer Finanzmarktaufsichtsbehörde („FINMA“) registriert:

- Man GLG Global Convertibles;
- Man GLG RI European Equity Leaders;
- Man GLG Japan CoreAlpha Equity;
- Man Numeric Emerging Markets Equity;
- Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity);
- Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates;
- Man GLG Global Emerging Markets Bond;
- Man GLG Pan-European Equity Growth;
- Man GLG RI Global Sustainable Growth;
- Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity);
- Man GLG RI Sustainable European Income;
- Man Numeric China A Equity;
- Man GLG Strategic Bond;
- Man GLG Asia (ex Japan) Equity;
- Man Numeric US High Yield;
- Man GLG Global Investment Grade Opportunities (am 10. November 2021 aufgelegt);
- Man GLG China Equity (am 14. Dezember 2021 aufgelegt);
- Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy (am 10. Februar 2022 aufgelegt);
- Man GLG Sustainable Strategic Income (am 23. März 2022 aufgelegt); und
- Man GLG Dynamic Income (am 30. Juni 2022 aufgelegt).

Alle Klassen rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile werden zusammen als die „rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile“ oder „Anteile“ bezeichnet.

Zum 31. Dezember 2022 waren zwanzig Portfolios im Umlauf.

1. Allgemeines (Fortsetzung)

Die Anlageziele und die Anlagepolitik eines jeden aktiven Portfolios sind nachstehend ausgeführt.

Man GLG Global Convertibles

Das Anlageziel des Man GLG Global Convertibles besteht in einer kumulierten Wertsteigerung des Anlegerkapitals. Zu diesem Zweck investiert er weltweit in ein aktiv verwaltetes Portfolio aus Wandelanleihen, wandelbaren Vorzugsaktien, Schuldtiteln, Optionsscheinen und sonstigen aktienbezogenen Wertpapieren, die insbesondere Instrumente wie Aktienoptionen und Aktienswaps umfassen können. Dabei soll er eine geringere Volatilität als ein Portfolio der zugrunde liegenden Aktien auf den internationalen Wertpapiermärkten aufweisen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D USD, D H EUR, DL USD, DL H EUR, DL H GBP, I USD, I H EUR, IL USD, IL H EUR, IM USD, IM H EUR, IM H GBP, IU H EUR und I H GBP im Umlauf.

Man GLG RI European Equity Leaders

Das Anlageziel des Man GLG RI European Equity Leaders besteht darin, eine hohe Gesamrendite für eine angemessene langfristige Wertsteigerung des Anlegerkapitals zu bieten. Das Portfolio investiert mindestens zwei Drittel des Nettovermögens (nach Abzug zusätzlicher liquider Mittel) in Aktienwerte (außer Wertpapiere, die in Aktienwerte wandelbar sind) von Emittenten mit Sitz in Europa oder von Emittenten, die einen wesentlichen Teil ihres Einkommens mit Aktivitäten in Europa erzielen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D EUR, D C EUR, D C USD, D H USD, I EUR, I C EUR, I C SEK und I H USD im Umlauf.

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

Das Anlageziel des Man GLG Japan CoreAlpha Equity besteht darin, eine hohe Gesamrendite für eine angemessene langfristige Wertsteigerung des Anlegerkapitals zu bieten. Das Portfolio investiert vorrangig in Wertpapiere von japanischen Emittenten oder von Emittenten, die einen wesentlichen Teil ihres Einkommens mit Aktivitäten in Japan erzielen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D EUR, D EUR G Dist, D JPY, D USD, D H CHF, D H EUR, D H GBP, D H USD, I EUR, I EUR Dist, I GBP, I JPY, I JPY Dist, I SEK, I USD, I USD Dist, I H CHF, I H EUR, I H EUR Dist, I H GBP, I H GBP Dist, I H USD, I H USD Dist, IXX JPY, IXX H CHF, IXX H EUR, IXX H EUR Dist, IXX H GBP Dist, IXX H USD und IXX H USD Dist im Umlauf.

Klasse I H USD ist an der Luxemburger Börse notiert.

Man Numeric Emerging Markets Equity

Das Anlageziel des Man Numeric Emerging Markets Equity besteht in der Erwirtschaftung einer Anlagenrendite, die höher als die Rendite ist, die mit Anlagen im MSCI Emerging Markets Index erzielt werden kann. Das Portfolio verfolgt dieses Anlageziel, indem es eigene quantitative Modelle von Numeric für die Auswahl von zu kaufenden oder zu verkaufenden Wertpapieren verwendet, um die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens gemäß der Man Numeric Emerging Markets-Strategie vorzunehmen. Dies beinhaltet die Aufnahme von Long-Positionen in Bezug auf Emittenten, die primär in Schwellenmärkten weltweit ansässig sind und nach Auffassung von Numeric eine Gelegenheit für kurzfristige Anlagegewinne darstellen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D CHF, D EUR, D USD, I EUR, I JPY, I SEK, I USD, IMU USD und I GBP im Umlauf.

Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)

Das Anlageziel des Man Numeric Global RI Climate besteht in der Erwirtschaftung einer Anlagenrendite, die höher als die Rendite ist, die mit Anlagen im MSCI World Index erzielt werden kann. Das Portfolio verfolgt dieses Anlageziel, indem es eigene quantitative Modelle von Numeric für die Auswahl von zu kaufenden oder zu verkaufenden Wertpapieren verwendet, um die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens gemäß der Man Numeric Global Core-Strategie vorzunehmen. Dies beinhaltet die Aufnahme von Long-Positionen in Bezug auf Emittenten, die in Ländern ansässig sind, die im MSCI World Index enthalten sind, und nach Auffassung von Numeric eine Gelegenheit für kurzfristige Anlagegewinne darstellen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D EUR, D USD, I EUR, I SEK, I USD und I H EUR im Umlauf.

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates

Das Anlageziel des Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates besteht in der Erwirtschaftung einer langfristigen Rendite. Zu diesem Zweck investiert das Portfolio vornehmlich in ein Portfolio von auf lokale Währungen lautenden Anleihen aus Schwellenmärkten, Devisenterminkontrakten und/oder sonstigen Derivaten. Das Portfolio investiert vornehmlich in Anleihen und Devisentermingeschäfte.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, D C USD, I C EUR, I C GBP, I C SEK, I C USD, I C USD Dist, I H EUR Dist und I H GBP im Umlauf.

Man GLG Global Emerging Markets Bond

Das Anlageziel des Man GLG Global Emerging Markets Bond besteht in der Erwirtschaftung einer Rendite unter allen Marktbedingungen. Zu diesem Zweck investiert das Portfolio vornehmlich direkt in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten oder indirekt über die Nutzung von Derivaten. Das Portfolio investiert vornehmlich in Anleihen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, D C USD, I C EUR, I C SEK, I C USD, I H EUR und IF H EUR im Umlauf.

Man GLG Pan-European Equity Growth

Das Anlageziel des Man GLG Pan-European Equity Growth besteht in einem mittel- bis langfristigen Zuwachs des angelegten Kapitals. Der Teilfonds ist ein konzentrierter Long-Only-Fonds, der in europäische Unternehmen aller Marktkapitalisierungen investiert.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, D C USD, DF C EUR, DV C USD, I C CHF, I C EUR, I C SEK, I C USD, IF C EUR und IV C USD im Umlauf.

Man GLG RI Global Sustainable Growth

Das Anlageziel des Man GLG RI Global Sustainable Growth besteht darin, den MSCI All Country World Index über die Anlage in übertragbare Wertpapiere, börsengehandelte oder im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente, Geldmarktinstrumente, sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente langfristig erheblich zu übertreffen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, I C EUR, I C GBP, I C SEK, I USD, IU FH NOK und I H (BRL) USD im Umlauf.

1. Allgemeines (Fortsetzung)

Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)

Das Anlageziel des Man Numeric Europe RI Climate besteht in der Erwirtschaftung einer Anlagenrendite, die höher als die Rendite ist, die mit Anlagen im MSCI Europe Index erzielt werden kann. Das Portfolio verfolgt dieses Anlageziel, indem es eigene quantitative Modelle von Numeric für die Auswahl von zu kaufenden oder zu verkaufenden Wertpapieren verwendet, um die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens gemäß der Man Numeric European Core-Strategie vorzunehmen. Die Strategie beinhaltet die Aufnahme von Long-Positionen in Bezug auf Emittenten, die in Ländern ansässig sind, die im MSCI Europe Index enthalten sind, und nach Auffassung von Numeric eine Gelegenheit für kurzfristige Anlagegewinne darstellen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, I C EUR, I C SEK, I C USD, I C GBP und I H GBP im Umlauf.

Man GLG RI Sustainable European Income

Das Anlageziel des Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities) besteht in der Erwirtschaftung von Dividendenströmen und eines langfristigen Kapitalwachstums mit einem aktiv verwalteten Portfolio. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens in Übereinstimmung mit einer Long-Only-Strategie, indem es die Nettoerlöse von Anteilen ganz oder teilweise in (i) übertragbare Wertpapiere; (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente; und (iii) andere zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen investiert.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, DF C EUR, I C EUR, I C EUR Dist, I C USD, IF C EUR, IM C EUR und I C EUR Dist Q im Umlauf.

Man Numeric China A Equity

Das Anlageziel des Man Numeric China A Equity besteht darin, eine Anlagenrendite zu erzielen, die die mit Anlagen im MSCI China A Net Return Index USD erzielbaren Renditen übersteigt. Der Teilfonds strebt an, sein Ziel zu erreichen, indem er die proprietären quantitativen Modelle von Numeric zur Auswahl von Aktienwerten für den Erwerb oder Verkauf verwendet, um seine gesamten oder im Wesentlichen seine gesamten Vermögenswerte in Übereinstimmung mit der Man Numeric China-Strategie zuzuweisen. Im Rahmen der Strategie werden unter anderem in Bezug auf Emittenten in China, die nach Meinung von Numeric hinsichtlich chinesischer A-Aktien Anlagegewinne ermöglichen, Long-Positionen eingegangen.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D C EUR, D H EUR, I USD, I C EUR, I C GBP und I C SEK im Umlauf.

Man GLG Strategic Bond

Das Anlageziel des Man GLG Strategic Bond besteht darin, den Anlegern eine Gesamtrendite zu bieten, mit monatlichen Erträgen und der Möglichkeit des Kapitalwachstums. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens in Übereinstimmung mit einer Long-Only-Strategie, indem es die Nettoerlöse von Anteilen ganz oder teilweise in (i) übertragbare Wertpapiere; (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente; und (iii) Geldmarktinstrumente, (iv) sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente investiert.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen D GBP, D GBP Dist, D H CHF, D H EUR, D H USD, D H USD Dist A, DV H USD, DY H EUR, DY H USD, I GBP, I GBP Dist, I GBP Dist A, I H CHF, I H EUR, I H EUR Dist, I H EUR Dist A, I H JPY, I H USD, I H USD Dist, IV H USD, IXF GBP, IXF GBP Dist und IXF H USD im Umlauf.

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

Das Anlageziel des Man GLG Asia (ex Japan) Equity besteht in einem mittel- bis langfristigen Zuwachs des angelegten Kapitals. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation seiner gesamten oder im Wesentlichen seiner gesamten Nettoerlöse von Anteilen zu (i) übertragbaren Wertpapieren, (ii) börsengehandelten und im Freiverkehr gehandelten derivativen Finanzinstrumenten, (iii) Geldmarktinstrumenten, (iv) sonstigen Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten. Mindestens 51 % des Werts des Portfolios werden durchgehend in Aktienwerte investiert, die an einer Börse zum amtlichen Handel zugelassen sind oder die an einem organisierten Markt gehandelt werden.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen I USD, I C CHF, I C EUR, I C GBP, IF C EUR und IF C GBP im Umlauf.

Man Numeric US High Yield

Das Anlageziel des Portfolios besteht darin, eine Anlagenrendite zu erzielen, die die aus Anlagen im ICE BAML US High Yield Index verfügbaren Renditen übersteigt. Das Portfolio verfolgt dieses Anlageziel, indem es eigene quantitative Modelle von Numeric für die Auswahl von zu kaufenden oder zu verkaufenden Wertpapieren verwendet, um die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens gemäß der Man Numeric U.S. High Yield-Strategie (die „US-Hochzins-Strategie“) vorzunehmen. Die Strategie beinhaltet das Eingehen von Long-Positionen hauptsächlich in auf US-Dollar lautenden hochverzinslichen Unternehmensanleihen, die an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klasse I USD im Umlauf.

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

Das Anlageziel des Man GLG Global Investment Grade Opportunities besteht darin, mittel- bis langfristig Erträge und Kapitalwachstum zu erzielen. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation des gesamten oder eines Großteils seines Vermögens in (i) übertragbare Wertpapiere, (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente, (iii) Geldmarktinstrumente, (iv) andere Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen IF H EUR, I H EUR, I H GBP, I USD, I H EUR Dist, IF H GBP, IF H GBP Dist und IF EUR Dist im Umlauf.

Man GLG China Equity

Das Anlageziel des Man GLG China Equity besteht in der Erwirtschaftung mittel- bis langfristigen Kapitalwachstums. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation seines gesamten oder im Wesentlichen seines gesamten Vermögens in (i) übertragbare Wertpapiere, (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente, (iii) Geldmarktinstrumente, (iv) andere Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente. Mindestens 51 % des Werts des Teilfonds werden durchgehend in Aktienwerte investiert, die an einer Börse zum amtlichen Handel zugelassen sind oder die an einem organisierten Markt gehandelt werden.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen I C EUR, I C GBP, IF C EUR, IF USD und I USD im Umlauf.

1. Allgemeines (Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy

Das nachhaltige Anlageziel des Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy besteht darin, die Finanzierung von Unternehmen zu unterstützen, die Lösungen und Technologien in Verbindung mit dem Kampf gegen Wasserknappheit anbieten, die die Versorgung und Aufbereitung von qualitativ hochwertigem Wasser verbessern und/oder die Herausforderungen der Kreislaufwirtschaft in Angriff nehmen. Mit diesem Ziel strebt der Teilfonds auch eine langfristige Wertsteigerung des Anlegerkapitals durch die Anlage in den Aktien dieser Unternehmen an. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation seines gesamten oder im Wesentlichen seines gesamten Vermögens in (i) übertragbare Wertpapiere, (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente, (iii) Geldmarktinstrumente, (iv) andere Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente. Das Portfolio wird durchgehend in Aktienwerte investiert, die an einer Börse zum amtlichen Handel zugelassen sind oder die an einem organisierten Markt gehandelt werden.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen I C EUR, I C GBP, I C USD, IF C EUR und IF C USD im Umlauf.

Man GLG Sustainable Strategic Income

Das Anlageziel des Man GLG Sustainable Strategic Income besteht darin, eine Gesamtrendite für Anleger zu erzielen, indem er in ein Portfolio aus Anleihen investiert, die attraktive Erträge bieten, und dabei langfristig die Kriterien in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) sorgfältig berücksichtigt. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation seines gesamten oder im Wesentlichen seines gesamten Vermögens in (i) übertragbare Wertpapiere, (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente, (iii) Geldmarktinstrumente, (iv) andere Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen I H EUR, I H GBP, IF H EUR, IF USD und I USD im Umlauf.

Man GLG Dynamic Income

Das Anlageziel des Man GLG Dynamic Income besteht darin, auf mittel- bis langfristige Sicht Erträge und Kapitalzuwachs zu erwirtschaften, indem er vorwiegend in von Anleihen investiert, die von Unternehmen und Regierungen weltweit begeben werden. Das Portfolio verfolgt sein Anlageziel durch die Allokation seines gesamten oder im Wesentlichen seines gesamten Vermögens in (i) übertragbare Wertpapiere, (ii) börsengehandelte und im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente, (iii) Geldmarktinstrumente, (iv) andere Organismen für gemeinsame Anlagen und (v) Einlagen, Zahlungsmittel oder Zahlungsmitteläquivalente.

Zum 31. Dezember 2022 waren Anteile der Klassen I USD, IF H EUR, IF USD, I H EUR und I H GBP im Umlauf.

2. Wesentliche Grundsätze für die Rechnungslegung

(a) Rechnungslegungsrichtlinien

Der Abschluss wurde gemäß den International Financial Reporting Standards („IFRS“) erstellt, wie sie in der Europäischen Union („EU“) anzuwenden sind. Der Abschluss wurde mit Ausnahme der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf der Basis des beizulegenden Zeitwerts angesetzt wurden, auf Anschaffungskostenbasis erstellt.

(b) Änderungen der Rechnungslegungsgrundsätze und Angaben

Die für die Erstellung des geprüften Abschlusses verwendeten Rechnungslegungsgrundsätze stimmen mit denjenigen überein, die für die Erstellung des Abschlusses des Fonds für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 verwendet wurden.

Vom Fonds übernommene neue Standards, Interpretationen und Änderungen:

Es gab im laufenden Jahr keine neueren für den Fonds geltenden Verlautbarungen zur Rechnungslegung.

Zum Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses waren mehrere andere Standards und Interpretationen verabschiedet, werden jedoch noch nicht angewendet. Das Management erwartet, dass die Anwendung dieser Standards und Interpretationen in zukünftigen Zeiträumen keine wesentliche Auswirkung auf den Jahresabschluss des Fonds haben wird.

(c) Nutzung von Annahmen und Schätzungen

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses gemäß IFRS muss das Management Beurteilungen, Schätzungen und Annahmen vornehmen, die die im Jahresabschluss und in den Erläuterungen ausgewiesenen Beträge und Offenlegungen einschließlich bestimmter Bewertungsannahmen beeinflussen können. Unsicherheiten über diese Annahmen und Schätzungen können bewirken, dass in Zukunft eine erhebliche Anpassung des Buchwerts von Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten erforderlich ist.

(d) Unternehmensfortführung

Das Management hat die Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung bewertet und festgestellt, dass der Fonds über die Ressourcen verfügt, seine Geschäfte über einen Zeitraum von mindestens einem Jahr ab dem Datum, zu dem dieser Abschluss zur Herausgabe verfügbar ist, weiterzuführen. Darüber hinaus ist sich das Management keiner wesentlichen Unwägbarkeiten bewusst, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Daher wird der Abschluss auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt.

(e) Zinserträge und Zinsaufwand

Zinserträge und -aufwendungen werden bei ihrem Anfallen auf der Grundlage des Effektivzinssatzes in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

(f) Dividenderträge und Dividendenaufwand

Dividenderträge aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten werden in der Gesamtergebnisrechnung in den Dividenden erfasst, wenn der Anspruch des Fonds auf den Erhalt von Zahlungen begründet wird. Dividenderträge werden gegebenenfalls vor Abzug von Quellensteuern erfasst.

2. Wesentliche Grundsätze für die Rechnungslegung (Fortsetzung)

(g) Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Für die Zwecke des Nettoinventarwerts („NIW“) wird die Bewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten im Einklang mit dem Prospekt berechnet. Für Zwecke des Abschlusses wurden finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten anhand der nachstehend beschriebenen Grundsätze gemäß IFRS bewertet.

Zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 bestanden keine wesentlichen Differenzen zwischen diesen Bewertungsmethoden.

Im Einklang mit dem International Financial Reporting Standard („IFRS“) 9 *Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung* klassifiziert der Fonds seine finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten beim erstmaligen Ansatz in die nachstehend erörterten Kategorien von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten.

Nach IFRS 9 wird ein finanzieller Vermögenswert anhand der folgenden Bewertungsmethoden klassifiziert: zu fortgeführten Anschaffungskosten oder zum beizulegenden Zeitwert, wobei die Aufwendungen und Erträge im sonstigen Ergebnis (fair value through other comprehensive income, „FVOCI“) oder vollständig im Periodenergebnis (fair value through profit or loss, „FVTPL“) zu erfassen sind. Die Klassifizierung von finanziellen Vermögenswerten nach IFRS 9 basiert auf dem Geschäftsmodell, in dem ein finanzieller Vermögenswert verwaltet wird, und auf seinen vertraglichen Cashflow-Merkmalen.

Bei der Beurteilung der Klassifizierung seiner finanziellen Vermögenswerte hat der Fonds folgende Erwägungen berücksichtigt:

o ob er im Rahmen eines Geschäftsmodells gehalten wird, dessen Ziel es ist, Vermögenswerte nur zu halten, um vertragliche Cashflows zu erwirtschaften („Geschäftsmodell-Test“); und

o ob seine Vertragsbedingungen zu bestimmten Zeitpunkten zu Cashflows führen, die ausschließlich aus Kapital- und Zinszahlungen bestehen („SPPI-Test“).

Sowohl der Geschäftsmodelltest als auch der SPPI-Test müssen bestanden sein, damit ein finanzieller Vermögenswert zu fortgeführten Anschaffungskosten oder zum FVOCI bilanziert werden kann. Wenn beide Tests nicht bestanden sind, muss der finanzielle Vermögenswert zum FVTPL bewertet werden.

Der Fonds klassifiziert seine Anlagen auf der Grundlage des Geschäftsmodells des Fonds für die Verwaltung dieser finanziellen Vermögenswerte und der vertraglichen Cashflow-Merkmale der finanziellen Vermögenswerte. Die Verwaltung des Portfolios der finanziellen Vermögenswerte sowie die Beurteilung der Performance erfolgen auf der Grundlage des beizulegenden Zeitwerts. Der Fonds ist in erster Linie auf Informationen zum beizulegenden Zeitwert fokussiert und verwendet diese Informationen zur Beurteilung der Performance der Vermögenswerte sowie zur Entscheidungsfindung. Der Fonds hat nicht von der Möglichkeit Gebrauch gemacht, ASCOTs, Unternehmensanleihen, Wandelanleihen, Stammaktien, Credit Default Swaps, Aktienswaps, Futures-Kontrakte, Devisenterminkontrakte, Staatsanleihen, Zinsswaps, hypothekarisch besicherte Wertpapiere, Real Estate Investment Trusts und Pensionsgeschäfte unwiderruflich als zum FVOCI bewertet einzustufen.

Die vertraglichen Cashflows der Schuldtitel des Fonds bestehen ausschließlich aus Kapital und Zinsen. Diese Wertpapiere werden jedoch weder zum Zweck der Vereinnahmung der vertraglichen Cashflows noch zur Vereinnahmung der vertraglichen Cashflows und zum Verkauf gehalten. Die Vereinnahmung der vertraglichen Cashflows ist für das Erreichen des Ziels des Geschäftsmodells des Fonds nur nebensächlich.

Der Fonds weist einen finanziellen Vermögenswert bzw. eine finanzielle Verbindlichkeit nur dann aus, wenn er Vertragspartei der Regelungen des betreffenden Finanzinstruments wird. Reguläre Käufe und Verkäufe von Anlagen werden am Handelstag verbucht, d. h. an dem Tag, an dem der Fonds die Verpflichtung zum Kauf oder Verkauf des Vermögenswerts eingeht. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen. Sämtliche Transaktionskosten für solche Instrumente werden umgehend in der Gesamterfolgsrechnung ausgewiesen.

Nach der Erstbewertung bewertet der Fonds Finanzinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert klassifiziert sind, zu ihren beizulegenden Zeitwerten.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Datum der Bilanz.

Wenn der zuletzt gehandelte Preis nicht in der Spanne zwischen Geld- und Briefkurs liegt, legt das Management den Punkt innerhalb der Spanne zwischen Geld- und Briefkurs fest, der den Zeitwert am besten wiedergibt.

Der Verwaltungsrat hat einen unabhängigen Preisausschuss (Independent Pricing Committee, „IPC“) ernannt, der bestimmte Dienstleistungen bezüglich der Bewertungsstrategien und -verfahren im Zusammenhang mit dem Fonds durchführt. Der IPC ist ein unabhängiges Gremium, das: (1) eine Preismatrix erstellt (eine Tabelle, die für bestimmte Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eine Bewertungsquelle darlegt), die die Verwaltungsratsmitglieder für den Fonds angenommen haben und die der Administrator zur Berechnung des Werts von vom Fonds gehaltenen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten verwendet; und (2) die Preise für Positionen im Fonds festlegt, die laut Preismatrix keinen unabhängig feststellbaren Wert haben. Zudem bietet der IPC allgemeine Unterstützung und überwacht den Bewertungsprozess.

Der Fonds kann von Zeit zu Zeit in Finanzinstrumente oder Wertpapiere investieren, die nicht auf einem aktiven Markt gehandelt werden (z. B. OTC- Derivate und Privatplatzierungen von Aktien und festverzinslichen Wertpapieren). Diese Finanzinstrumente werden zu ihrem beizulegenden Zeitwert entsprechend der Beschreibung in den nachfolgenden Rechnungslegungsgrundsätzen bewertet.

Alle börsengehandelten derivativen Instrumente (insbesondere Optionen und Futures), die auf einem Markt gehandelt werden, sind zum Abrechnungspreis für solche Instrumente auf einem solchen Markt am jeweiligen Bewertungstag zu bewerten. Wenn kein Abrechnungspreis vorliegt, wird ihr wahrscheinlicher Realisationswert vom Fonds sorgfältig und gemäß den Grundsätzen von Treu und Glauben bestimmt.

Kapitalanlagen werden ausgebucht, wenn die Rechte zum Erhalt von Zahlungen verfallen sind oder der Fonds im Wesentlichen alle eigentumsbezogenen Risiken und Vergütungen übertragen hat.

(h) Leerverkäufe

Der Fonds darf Leerverkäufe von Wertpapieren vornehmen. Ein Leerverkauf ist eine Transaktion, in der der Fonds ein Wertpapier verkauft, das er nicht besitzt. Aus Leerverkäufen erzielte Erlöse werden als Verbindlichkeiten ausgewiesen, und der Fonds verbucht einen nicht realisierten Gewinn oder Verlust in Höhe der Differenz zwischen den erhaltenen Erlösen und dem Wert der offenen Short-Position. Der Fonds verbucht einen realisierten Gewinn oder Verlust, wenn die Short-Position glattgestellt wird. Bei Leerverkäufen trägt der Fonds das Marktrisiko einer ungünstigen Preisänderung des leerverkauften Wertpapiers über die erhaltenen Erlöse hinaus. Bei Leerverkäufen besteht für den Fonds eine potenziell unbegrenzte Haftung.

2. Wesentliche Grundsätze für die Rechnungslegung (Fortsetzung)

(i) Saldierung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden miteinander verrechnet und als Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, sofern es einen rechtlich durchsetzbaren Anspruch auf die Verrechnung der angesetzten Beträge gibt und die Abrechnung auf Nettobasis erfolgen bzw. die Realisierung der Vermögenswerte und Begleichung der Verbindlichkeiten zeitgleich durchgeführt werden soll. Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 werden keine finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in der Bilanz saldiert. Siehe Erläuterung 5.

(j) Derivate

Der Fonds kann mit derivativen Finanzinstrumenten handeln, deren Wert auf zugrunde liegenden Vermögenswerten, Indizes, Währungen oder Zinssätzen basiert. Die nicht realisierten Nettogewinne oder Nettoverluste repräsentieren die voraussichtlichen künftigen Cashflows aus dem Handel eher als Kontrakt- oder Nennbeträge.

Der Fonds handelte Asset Swapped Convertible Option Transactions, Aktienswaps, Devisenterminkontrakte, Futures-Kontrakte, Optionskontrakte, Swapkontrakte, Credit Default Swaps, Zinsswaps, Total Return Swaps und Optionsscheine.

- Asset Swapped Convertible Option Transactions („ASCOTs“)

Eine Asset Swapped Convertible Option Transaction („ASCOT“) ist eine Option auf eine Wandelanleihe, die zur Trennung einer Wandelanleihe in ihre zwei Komponenten verwendet wird: eine Anleihe und eine Option für den Kauf von Aktien. Wenn das Wandlungsrecht von einer Anleihe getrennt wird, hat der Inhaber eine Anleihe mit einer recht stabilen Anleiherendite und eine volatile, jedoch potentiell sehr wertvolle Option.

- Aktienswaps

Aktienswaps werden zum Handelstag ausgewiesen und auf Grundlage der Differenz zur fiktiven Long-/Short-Position der zugrunde liegenden Aktie bewertet. Für die Berechnung werden ein Referenzkurs zum Datum, an dem der Swap abgeschlossen wird, und der Marktwert am Tag des Handelsschlusses (oder zum Berichtsdatum, wenn dieses vor Ende des Swaps liegt) herangezogen. Die Differenz zwischen dem bei erstmaligem Ansatz ausgewiesenen Betrag und dem Marktwert der offenen Aktienswaps wird in der Bilanz in den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten und in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden zum Glattestellungs- oder Handelstag des Swaps verbucht und in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

- Devisenterminkontrakte

Devisenterminkontrakte werden zum Handelstag ausgewiesen und zum am letzten Geschäftstag des Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs bewertet. Die Differenz zwischen dem beizulegenden Zeitwert des ursprünglichen Betrags des Kontrakts und dem beizulegenden Zeitwert der offenen Devisenterminkontraktposition wird in der Bilanz in den finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten und in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden zum Fälligkeits- oder Handelstag des Kontrakts verbucht und in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

- Futures-Kontrakte

Futures-Kontrakte werden zum Handelstag ausgewiesen und zum letzten Handelskurs am letzten Geschäftstag des Geschäftsjahres bewertet. Die Differenz zwischen dem ursprünglichen Betrag des Kontrakts und dem beizulegenden Zeitwert der offenen Devisenterminkontraktposition wird in der Bilanz in den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten und in der Gesamtergebnisrechnung im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden zum Glattestellungs- oder Handelstag des Kontrakts verbucht und in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

- Optionskontrakte

Der Fonds kann in Optionskontrakte investieren. Ein Optionskontrakt ist für den Käufer mit dem Recht, nicht aber mit der Pflicht, verbunden, einen spezifischen Basiswert innerhalb eines bestimmten Jahres zu einer nicht erstattungsfähigen Gebühr („Prämie“) zu kaufen („Kaufoption“) oder zu verkaufen („Verkaufsoption“). Der maximale Verlust eines Käufers einer Option besteht im Verlust der Prämie. Der Verkäufer einer Kaufoption trägt das Risiko einer ungünstigen Veränderung des Wertes des Basiswertes der Option und der Verlust ist, sofern keine ausgleichende Long-Position eingegangen wird, theoretisch unbegrenzt. Der Verlust für den Verkäufer einer Verkaufsoption ist auf den Ausübungspreis der Option im Gegensatz zu der für ihren Verkauf eingenommenen Prämie begrenzt. Optionskontrakte werden zum beizulegenden Zeitwert – sofern verfügbar, mit Bezug zu notierten Marktkursen – ausgewiesen oder auf der Grundlage von Preismodellen, die den Zeitwert des Geldes, die Volatilität sowie die aktuellen Marktkurse und Kontraktpreise des zugrunde liegenden Finanzinstruments berücksichtigen.

- Swap-Kontrakte

Swap-Kontrakte sind vertragliche Vereinbarungen zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf festgelegte Nennbeträge über eine bestimmte Zeitspanne. Die Swap-Kontrakte werden als ein Betrag bewertet, der gleich dem Gewinn oder Verlust ist, der realisiert würde, wenn die Position am Bewertungstag geschlossen würde. Im Wesentlichen bestehen die Swap-Kontrakte des Fonds aus Credit Default Swaps, Zinsswaps und Total Return Swaps.

Swap-Kontrakte werden täglich zum Marktpreis bewertet, und Wertänderungen werden als nicht realisierter Gewinn/(Verlust) ausgewiesen. Wenn ein Swap-Kontrakt aufgelöst wird, verbucht der Fonds einen realisierten Gewinn/(Verlust) in Höhe der Differenz zwischen den Erlösen aus der Auflösungstransaktion (oder deren Kosten) und dem Einstandspreis, sofern zutreffend. Swaptransaktionen beinhalten Kredit- und Marktrisikofaktoren in unterschiedlichem Ausmaß über die in der Bilanz erfassten Beträge hinaus. Zu diesen Risiken zählt die Möglichkeit, dass kein liquider Markt für diese Vereinbarungen vorhanden ist, dass die Gegenpartei der Vereinbarungen ihre Leistungspflicht nicht erfüllt oder der Bedeutung der vertraglichen Bedingungen in den Vereinbarungen widerspricht und dass ungünstige Veränderungen der mit diesen Transaktionen verbundenen Zinssätze und/oder Marktwerte eintreten.

- Credit Default Swaps

Der Fonds kann Credit Default Swaps abschließen, um sein Engagement in bestimmten Marktsektoren zu verwalten oder um das Kreditrisiko zu reduzieren. Der Fonds kann Vereinbarungen über Credit Default Swaps als Absicherungsmaßnahme gegen den Ausfall eines Emittenten (als Sicherungsnehmer) und/oder für ein Kreditengagement in einem Emittenten abschließen, in dem er anderweitig nicht engagiert ist (als Sicherungsgeber). Credit Default Swaps sind Vereinbarungen, in denen eine Partei fixe regelmäßige Zahlungen an die Gegenpartei als Gegenleistung für eine Garantie von der Gegenpartei für eine spezifische Zahlung leistet, falls ein negatives Kreditereignis eintritt (z. B. Zahlungsausfall, Konkurs oder Umschuldung). Der Fonds kann Credit Default Swaps entweder kaufen oder verkaufen. Als Käufer erhält der Fonds entweder vom Verkäufer einen Betrag gleich dem Nennbetrag des Swap und liefert das bezeichnete Wertpapier oder einem Index zugrunde liegende Wertpapiere, oder er erhält einen Nettzahlungsausgleich gleich dem Nennbetrag des Swaps abzüglich dem Verwertungswert des Wertpapiers oder der einem Index zugrunde liegenden Wertpapiere.

2. Wesentliche Grundsätze für die Rechnungslegung (Fortsetzung)

(j) Derivate (Fortsetzung)

- Credit Default Swaps (Fortsetzung)

Als Verkäufer zahlt der Fonds dem Käufer entweder einen Betrag gleich dem Nennbetrag des Swaps und erhält die Lieferung des bezeichneten Wertpapiers oder einem Index zugrunde liegende Wertpapiere, oder er zahlt einen Nettzahlungsausgleich gleich dem Nennbetrag des Swaps abzüglich des Verwertungswerts des Wertpapiers oder der einem Index zugrunde liegenden Wertpapiere. Bei einem Zahlungsausfall der Gegenpartei kann der Fonds im Rahmen der Vereinbarung gezahlte Beträge entweder teilweise oder vollständig einziehen, indem er Verbindlichkeiten und/oder Forderungen mit gehaltenen oder verpfändeten Sicherheiten saldiert. Diese erhaltenen oder vom Fonds geleisteten regelmäßigen Zahlungen werden in der Gesamtergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

- Zinsswaps

Zinsswaps beziehen sich auf Kontrakte, die der Fonds mit großen Brokern abgeschlossen hat, bei denen der Fonds entweder einen variablen Zinssatz als Gegenleistung für die Zahlung bzw. den Erhalt eines festen Zinssatzes erhält oder zahlt. Die Zahlungsströme werden in der Regel gegeneinander aufgerechnet, wobei der Nettobetrag von der einen an die andere Partei gezahlt wird. Änderungen im Wert der Zinsswap-Vereinbarungen und in den dabei erhaltenen oder gezahlten Summen werden in der Gesamtergebnisrechnung als Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

- Total Return Swaps

Total Return Swaps sind Kontrakte, bei denen der Fonds auf Basis des Total Return (der Gesamrendite) eines bestimmten Vermögenswerts eine Reihe von Kapitalflüssen zahlt oder erhält und im Gegenzug einen festen oder variablen Zins auf Basis desselben bestimmten Vermögenswerts zahlt bzw. erhält.

- Optionsscheine

Der Fonds investiert über notierte Börsen und im außerbörslichen Handel in Optionsscheine. Die börsennotierten Optionsscheine werden an anerkannten Börsen gehandelt und zum letzten Handelspreis bewertet. Außerbörslich gehandelte Optionsscheine werden unter Bezugnahme auf quotierte Preise bewertet. Änderungen bei den realisierten und nicht realisierten Gewinnen und Verlusten werden in der Gesamtergebnisrechnung erfasst.

(k) Realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste

Alle realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus Wertpapieren und Derivaten werden in der Gesamtergebnisrechnung als Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Die Anschaffungskosten von Wertpapieren werden auf Einzelbasis verbucht. Nicht realisierte Gewinne und Verluste umfassen Änderungen des Zeitwertes von Finanzinstrumenten während des Geschäftsjahres und Umkehrungen nicht realisierter Gewinne und Verluste aus Vorjahren von Finanzinstrumenten, die im Geschäftsjahr realisiert wurden. Realisierte Gewinne und Verluste stellen die Differenz zwischen dem ursprünglichen Buchwert und dem Veräußerungsbetrag eines Instruments und Barzahlungen oder Eingängen in Bezug auf Derivatkontrakte (abzüglich Zahlungen oder Eingänge auf Sicherheitenkonten für diese Instrumente) dar.

(l) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind Zusatzkosten, die separat erkennbar und direkt einem Kauf, einer Emission oder einem Verkauf eines finanziellen Vermögenswerts oder einer finanziellen Verbindlichkeit zugeordnet werden können. Die dem Fonds im Geschäftsjahr entstandenen Transaktionskosten werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

(m) Funktionale und Berichtswährung

Im Abschluss des Fonds enthaltene Posten werden unter Zugrundelegung der Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds, in dem dieser tätig ist, bewertet (die „funktionale Währung“). Dies ist der US-Dollar („USD“) für alle Teilfonds, mit Ausnahme des Man GLG RI European Equity Leaders, des Man GLG Pan-European Equity Growth, des Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity), des Man GLG RI Sustainable European Income und des Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, für die die funktionale Währung der Euro („EUR“) ist, des Man GLG Japan CoreAlpha Equity, für den die funktionale Währung der japanische Yen („JPY“) ist, und des Man GLG Strategic Bond, für den die funktionale Währung das Pfund Sterling („GBP“) ist. Der Fonds hat die funktionale Währung jedes Teilfonds als Berichtswährung für diesen Abschluss übernommen. Die funktionale Währung der einzelnen Teilfonds hat sich seit ihrer Auflegung nicht geändert. Die funktionale und Berichtswährung des Fonds ist der US-Dollar.

(n) Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der Fonds kann gemäß den Bedingungen des Pensionsgeschäfts mit ausgewählten Kontrahenten Wertpapiere im Rahmen von Pensionsgeschäften („Pensionsgeschäfte“) verkaufen, bei denen der Fonds Wertpapiere als Sicherheiten erwirbt, wobei sich der Kontrahent zum Rückkauf und der Fonds zum Rückverkauf der Wertpapiere zu einem vereinbarten Zeitpunkt und Preis verpflichtet. Der Fonds und die Kontrahenten dürfen die mit der Transaktion verbundenen Sicherheiten verkaufen, weiterverpfänden oder verwenden. Bei einem Ausfall gemäß den Bedingungen des Pensionsgeschäfts haben beide Parteien das Recht auf Aufrechnung. Pensionsgeschäfte schlagen sich in der Bilanz nieder und werden in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Realisierte Gewinne/Verluste werden in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Die Differenz zwischen dem Verkaufs- und dem Rückkaufpreis wird als Zinsaufwand behandelt, über die Laufzeit des Geschäfts abgegrenzt und in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

Wertpapiere, die mit Vereinbarung des Rückverkaufs zu einem bestimmten zukünftigen Termin gekauft werden („umgekehrte Pensionsgeschäfte“) werden nur in der Bilanz ausgewiesen, wenn sie anschließend an Dritte verkauft werden (Re-Hypothekisierung). In diesem Fall wird die Verpflichtung zur Rückgabe der Wertpapiere als Leerverkauf unter zu Handelszwecken gehaltenen Verbindlichkeiten erfasst und zum beizulegenden Zeitwert angesetzt. Eventuelle Gewinne oder Verluste werden in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. Die geleisteten Gegenwerte werden ausgebucht und eine entsprechende Forderung in der Bilanz ausgewiesen, die das Recht des Fonds auf Rückerhalt abbildet. Die Differenz zwischen den Kauf- und Wiederverkaufspreisen wird als Zinsertrag behandelt und jeweils anhand der Effektivzinismethode über die Dauer des Geschäfts abgegrenzt und in der Gesamtergebnisrechnung als Zinsaufwand ausgewiesen.

(o) Fremdwährungen

Die auf Fremdwährungen lautenden Transaktionen während des Geschäftsjahres werden zu den an den Transaktionstagen geltenden Wechselkursen umgerechnet. Auf Fremdwährungen lautende Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden zu den am Bilanzdatum geltenden Wechselkursen umgerechnet. Bei Anlagetransaktionen und Anlagen, die zum Ende des Geschäftsjahres in Fremdwährungen gehalten werden, werden die daraus resultierenden Gewinne oder Verluste in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen. Alle anderen Fremdwährungsgewinne und -verluste werden ebenfalls in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

2. Wesentliche Grundsätze für die Rechnungslegung (Fortsetzung)

(o) Fremdwährungen (Fortsetzung)

Die kombinierten Fondssalden lauten auf USD, der Berichtswährung des Fonds insgesamt. Für kombinierte Fondssalden in der Bilanz werden die nicht auf US-Dollar lautenden Portfolios anhand des zum Bilanzstichtag geltenden Wechselkurses umgerechnet. Für kombinierte Fondssalden in der Gesamtergebnisrechnung werden die nicht auf US-Dollar lautenden Portfolios anhand des während des Geschäftsjahres geltenden durchschnittlichen Wechselkurses umgerechnet. Die kombinierten Zeichnungen und Rücknahmen in der Aufstellung über die Entwicklung des Nettovermögens werden ebenfalls anhand des während des laufenden Geschäftsjahres geltenden durchschnittlichen Wechselkurses umgerechnet. Der Umrechnungs(verlust)/-gewinn aus der Erstellung der kombinierten Fondssalden im Abschluss in Höhe von (294.223.108 USD) (2021: 207.412.627 USD) ist in der Spalte „Kombinierter Fonds“ der Gesamtergebnisrechnung als sonstiges Gesamtergebnis ausgewiesen. Der Gewinn/Verlust hat keine Auswirkungen auf die einzelnen Portfolios.

(p) Sonstige Aufwendungen

Die sonstigen Aufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung periodengerecht abgegrenzt.

(q) Investor Money Regulations

Zeichnungs- und Rücknahmegelder werden über ein Teilfonds-Barmittelsammelkonto im Namen des Teilfonds weitergeleitet. Bis zur Ausgabe von Anteilen und/oder bis zur Zahlung von Zeichnungserlösen auf ein Konto im Namen des Teilfonds und bis zur Zahlung von Rücknahmeerlösen oder Ausschüttungen sind die entsprechenden Anleger ungesicherte Gläubiger des Teilfonds in Bezug auf von diesem oder an diesen gezahlten Beträgen.

(r) Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile

Rücknehmbare Anteile werden in folgenden Fällen als Eigenkapitalinstrumente eingestuft:

- Die rücknehmbaren Anteile gewähren dem Inhaber im Fall einer Liquidation des Fonds ein Anrecht auf einen proportionalen Anteil am Nettovermögen des Fonds;
- Die rücknehmbaren Anteile sind einer Klasse von Instrumenten zugeordnet, die allen anderen Klassen von Instrumenten untergeordnet ist;
- Alle rücknehmbaren Anteile in der Klasse von Instrumenten, die allen anderen Klassen von Instrumenten untergeordnet ist, weisen identische Merkmale auf;
- Die rücknehmbaren Anteile sind nicht mit einer vertraglichen Verpflichtung behaftet, Barmittel oder andere finanzielle Vermögenswerte, abgesehen von den Rechten des Inhabers auf einen proportionalen Anteil des Nettovermögens des Fonds, bereitzustellen; und
- Die den rücknehmbaren Anteilen über die Laufzeit des Instruments zuzurechnenden erwarteten Gesamtcashflows beruhen im Wesentlichen auf dem Gewinn oder Verlust, der Veränderung des ausgewiesenen Nettovermögens oder der Veränderung des beizulegenden Zeitwerts des ausgewiesenen und nicht ausgewiesenen Nettovermögens des Fonds über die Laufzeit des Instruments.

Neben den rücknehmbaren Anteilen mit all den oben aufgeführten Merkmalen darf der Fonds keine weiteren Finanzinstrumente oder Kontrakte aufweisen, die:

- Gesamtcashflows haben, die im Wesentlichen auf dem Gewinn oder Verlust, der Veränderung des ausgewiesenen Nettovermögens oder der Veränderung des beizulegenden Zeitwerts des ausgewiesenen und nicht ausgewiesenen Nettovermögens des Fonds beruhen; und
- Den Effekt haben, die verbleibende Rendite der Inhaber rücknehmbarer Anteile wesentlich zu beschränken oder festzulegen.

Der Fonds beurteilt die Klassifizierung der rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile fortlaufend. Wenn die rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile nicht mehr über alle Merkmale verfügen bzw. alle dargelegten Bedingungen erfüllen, um als Eigenkapital eingestuft zu werden, stuft der Fonds sie als finanzielle Verbindlichkeiten ein und bewertet sie zum beizulegenden Zeitwert am Tag der Reklassifizierung. Etwaige Differenzen gegenüber dem vorherigen Buchwert werden im Eigenkapital verbucht. Wenn die rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile im weiteren Verlauf über sämtliche Merkmale verfügen und die Bedingungen für eine Einstufung als Eigenkapital erfüllen, stuft der Fonds sie als Eigenkapitalinstrumente ein und bewertet sie zum beizulegenden Zeitwert der Verbindlichkeiten am Tag der Reklassifizierung.

Zum 31. Dezember 2022 stuft der Fonds seine rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile als Verbindlichkeiten ein.

Anteilinhabertransaktionen umfassen vorab erhaltene Zeichnungen und Rücknahmen, deren Auszahlung läuft.

(s) Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Die in der Bilanz ausgewiesenen Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente können Bankguthaben, Sichteinlagen, kurzfristige Einlagen bei Finanzinstituten und kurzfristig hochliquide Anlagen umfassen, die jederzeit in bekannte Barbeträge getauscht werden können und unwesentlichen Wertänderungsrisiken ausgesetzt sind, mit ursprünglichen Laufzeiten von bis zu drei Monaten. Kurzfristige Anlagen, die zu dem Zweck gehalten werden, kurzfristige Liquiditätsverpflichtungen zu erfüllen, sowie verfügungsbeschränkte Einschusskonten gelten nicht als liquide Mittel.

(t) Überziehungskredite

Die in der Bilanz ausgewiesenen Überziehungskredite bestehen aus den negativen Salden der Bankkonten zum Jahresende. Auf diese Überziehungssalden werden Zinsen erhoben.

(u) Forderungen und Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern

Forderungen und Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern beinhalten Beträge, die als Sicherheiten für offene Derivatkontrakte übertragen wurden. Forderungen aus Leerverkäufen und Sicherheiten können ganz oder teilweise beschränkt werden, bis die entsprechenden Wertpapiere erworben werden. Soweit Anteile auf Marge gekauft werden, kann die Margenschuld durch die entsprechenden Anteile besichert werden.

(v) Forderungen/Verbindlichkeiten gegenüber Brokern

Forderungen gegenüber Brokern beinhalten Forderungen für (in regulären Transaktionen) verkaufte Wertpapiere, hinsichtlich derer ein Vertrag unterzeichnet wurde, die zum Bilanzstichtag aber noch nicht ausgeliefert worden waren. Diese werden zu fortgeführten Anschaffungskosten unter Anwendung der Effektivzinsmethode abzüglich etwaiger Berichtigungen für Wertminderungen ausgewiesen. Die Verbindlichkeiten gegenüber Brokern sind Verbindlichkeiten für (in regulären Transaktionen) gekaufte Wertpapiere, hinsichtlich derer ein Vertrag unterzeichnet wurde, die zum Bilanzstichtag aber noch nicht ausgeliefert worden waren. Diese werden zu fortgeführten Anschaffungskosten unter Anwendung der Effektivzinsmethode ausgewiesen.

2. Wesentliche Grundsätze für die Rechnungslegung (Fortsetzung)

(w) Ausschüttungen an Anteilinhaber

Gemäß dem Prospekt des Fonds kann der Fonds seine ausschüttungsfähigen Erträge vollständig an die Anteilinhaber ausschütten.

Die ausschüttungsfähigen Erträge umfassen Kapitalerträge aus der Veräußerung von Anlagen.

Nicht realisierte Gewinne und Verluste gehen in das den Anteilinhabern zuzurechnende Nettovermögen ein und sind bis zu ihrer Realisierung nicht ausschüttungsfähig. Kapitalverluste werden nicht an die Anteilinhaber weitergegeben, sondern zur Verrechnung mit zukünftig erzielten Kapitalerträgen einbehalten. Ausschüttungen an Anteilinhaber werden in der Gesamtergebnisrechnung als Finanzkosten erfasst.

3. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt, Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt, Überziehungskredite, Forderungen und Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern

Zum Ende des Geschäftsjahrs wurden die unter den Posten Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt, Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt, Überziehungskredite sowie Forderungen und Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern ausgewiesenen Beträge bei The Bank of New York Mellon (London Branch), Barclays Plc, BNP Paribas, Citibank N.A., Credit Suisse Securities Europe Limited, Goldman Sachs International, HSBC Bank Plc, JP Morgan Securities Plc, Morgan Stanley & Co. International Plc, Nomura Holdings und Societe Generale gehalten. Die Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern entsprechen den Salden der beim Broker gehaltenen Marginkonten und die Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern entsprechen einem zum Ende des Berichtszeitraums aufgrund von Margen oder Sicherheiten an den Broker zu zahlenden Betrag. Darin sind als Sicherheiten für offene Derivate, Short-Positionen oder auf Margin gekaufte Finanzinstrumente übertragene Beträge (die einem Sicherungsrecht unterliegen), bei Banken gehaltene Tagesgelder und sonstige kurzfristig hochliquide Anlagen mit ursprünglichen Fälligkeiten von weniger als drei Monaten enthalten.

Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern beinhalten Forderungen für verkaufte Finanzinstrumente und Verbindlichkeiten für gekaufte Finanzinstrumente, hinsichtlich derer ein Vertrag unterzeichnet wurde, die zum Bilanzstichtag aber noch nicht abgerechnet bzw. ausgeliefert worden waren.

Der Anteil der Salden bei Brokern/Verbindlichkeiten gegenüber Brokern, die am 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 aus Sicherheiten bestehen, ist nachstehend dargelegt:

	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Man GLG Global Convertibles	1.638.765 USD	(247.827 USD)
Man GLG RI European Equity Leaders	5.037.279 EUR	4.030.000 EUR
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	-	(57.052 JPY)
Man Numeric Emerging Markets Equity	10.492.082 USD	4.185.026 USD
Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)	55.592 USD	77.259 USD
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	(176.482 USD)	500.794 USD
Man GLG Global Emerging Markets Bond	(120.296 USD)	(120.000 USD)
Man GLG Pan-European Equity Growth	440.078 EUR	(630.000 EUR)
Man GLG RI Global Sustainable Growth	-	(4.942.288 USD)
Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)	89.731 EUR	127.846 EUR
Man Numeric China A Equity	103.671 USD	124.696 USD
Man GLG Strategic Bond	(15.079.760 GBP)	3.718.361 GBP
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	1.447.412 USD	(185.214 USD)
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	3.221.297 USD	1.052.069 USD
Man GLG China Equity	148.525 USD	510.000 USD
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy	115.939 EUR	k. A.
Man GLG Sustainable Strategic Income	348.507 USD	k. A.
Man GLG Dynamic Income	635.277 USD	k. A.

Nach dem Erlass Nr. 254 des russischen Präsidenten Wladimir Putin vom Mai 2022 wurde die Zahlung von Dividenden durch russische Gesellschaften mit beschränkter Haftung an ihre ausländischen Gesellschafter eingeschränkt. Wenn eine russische Gesellschaft mit beschränkter Haftung einen Beschluss über eine Dividendenausschüttung an ihre Gesellschafter fasste, musste eine solche Ausschüttung in Höhe von über 10 Millionen Rubel in russischen Rubeln auf ein spezielles Sperrkonto des Typs „S“ – allgemein als Konto des Typs „C“ bezeichnet – erfolgen, das in Russland eröffnet wurde. Aufgrund der Art der Beschränkung können die vom Fonds im Laufe des Geschäftsjahrs erhaltenen Dividenden in Höhe von 204.346 USD (umgerechnet in USD zum Wechselkurs vom 31. Dezember 2022) nicht vom Fonds verwendet werden und wurden daher in der Vermögensaufstellung als Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt eingestuft.

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Erhaltene Sicherheiten

Pensionsgeschäfte:

	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Passiva		
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	21.462.250 USD	4.216.684 USD
Man GLG Dynamic Income	4.347.389 USD	-

Zum 31. Dezember 2022 belief sich der beizulegende Zeitwert der als Sicherheiten für die Pensionsgeschäfte verpfändeten Wertpapiere auf 24.318.697 USD (31. Dezember 2021: 4.830.563 USD) für den Man GLG Global Investment Grade Opportunities und 5.743.770 USD (31. Dezember 2021: null USD) für den Man GLG Dynamic Income.

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten

Der Fonds klassifiziert die Bewertung des beizulegenden Zeitwertes mit Hilfe einer Zeitwerthierarchie, die die Maßgeblichkeit der Parameter bei der Ermittlung der Bewertung gemäß IFRS 13 „Bemessung des beizulegenden Zeitwertes“ wiedergibt.

Die Zeitwerthierarchie kennt folgende Stufen:

- Stufe 1 – Notierte Marktkurse auf einem aktiven Markt für ein identisches Instrument.
- Stufe 2 – Bewertungsmethoden auf der Grundlage beobachtbarer Parameter. Diese Kategorie beinhaltet Instrumente, die anhand von notierten Marktkursen auf aktiven Märkten für ähnliche Instrumente, notierten Kursen für ähnliche Instrumente auf Märkten, die nicht als aktiv gelten, oder anderen Bewertungsmethoden basieren, bei denen alle wesentlichen Parameter direkt oder indirekt beobachtbare Marktdaten sind.
- Stufe 3 – Bewertungsmethoden anhand wesentlicher nicht beobachtbarer Parameter. In diese Kategorie fallen alle Instrumente, deren Bewertungsmethode Parameter berücksichtigt, die nicht auf beobachtbaren Daten beruhen und bei denen die nicht beobachtbaren Parameter eine wesentliche Auswirkung auf die Bewertung des Instruments haben könnten. In diese Kategorie fallen Instrumente, die auf der Grundlage von notierten Kursen für ähnliche Instrumente bewertet werden, bei denen wesentliche nicht beobachtbare Anpassungen oder Annahmen erforderlich sind, um die Unterschiede zwischen den Instrumenten abzubilden.

Bewertungsmethoden

Börsennotierte oder öffentlich gehandelte Anlagen in Aktien und Schuldtiteln, Staatsanleihen, verwalteten Fonds und Derivaten

Wenn die beizulegenden Zeitwerte börsennotierter Wertpapiere und Schuldtitel sowie öffentlich gehandelter Derivate am Bilanzstichtag auf notierten Marktkursen oder verbindlichen Kursnotierungen von Händlern beruhen, ohne Abzug von Transaktionskosten, werden die Instrumente in Stufe 1 der Hierarchie eingestuft.

Nicht notierte Schuldtitel und Schatzwechsel

Der Fonds investiert in Schuldtitel, Unternehmens- und Staatsanleihen sowie Schatzpapiere. Wenn kein notierter Preis an einem aktiven Markt vorliegt, werden diese anhand beobachtbarer Parameter bewertet, wozu beispielsweise Preise bei kürzlich durchgeführten Transaktionen mit Wertpapieren des Emittenten oder vergleichbarer Emittenten und Zinsstrukturkurven zählen. Die Bewertungen werden gegebenenfalls angepasst, um Differenzen bei den Bedingungen der Instrumente zu berücksichtigen. Soweit die wesentlichen Parameter beobachtbar sind, ordnet der Fonds diese Anlagen der Stufe 2 zu.

Außerbörslich gehandelte (OTC-) Derivate

Der Fonds wendet weithin anerkannte Bewertungsmodelle an, um den beizulegenden Zeitwert von außerbörslich gehandelten Zinsswaps, Währungsswaps und Devisenterminkontrakten zu ermitteln. Zu den am häufigsten angewandten Bewertungsverfahren zählen Terminpreis- und Swap-Modelle, bei denen Barwerte berechnet werden. Die Modelle berücksichtigen diverse Parameter, darunter Anpassungen sowohl der Verbindlichkeiten als auch der Guthaben aufgrund des Kreditrisikos der Gegenpartei bzw. des eigenen Kreditrisikos, Devisenkassa- und -terminkurse und Zinsstrukturkurven. Für diese Finanzinstrumente sind wesentliche Parameter der Modelle auf dem Markt beobachtbar und sie werden daher in Stufe 2 eingestuft.

Der beizulegende Zeitwert für alle anderen Finanzinstrumente wird anhand von Bewertungsmethoden bestimmt. Zu den Bewertungsverfahren gehören Barwertberechnungen, Vergleiche mit ähnlichen Instrumenten, für die Marktpreise verfügbar sind, Optionspreismodelle und andere relevante Bewertungsmodelle.

Die folgenden Tabellen fassen die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumente zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 sowie die in der Bilanz ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzinstrumente, gruppiert nach den einzelnen Stufen der Zeitwerthierarchie, zusammen:

Man GLG Global Convertibles

31. Dezember 2022

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	824	-	-	824
Summe Aktien und verwaltete Fonds	824	-	-	824
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Wandelanleihen	-	107.609.538	2.457.144	110.066.682
Unternehmensanleihen	-	8.714.474	-	8.714.474
Summe verzinsliche Wertpapiere	-	116.324.012	2.457.144	118.781.156
<u>Derivate</u>				
ASCOTs	-	7.602	-	7.602
Devisenterminkontrakte	-	829.915	-	829.915
Total Return Swaps	-	478.273	-	478.273
Summe Derivate	-	1.315.790	-	1.315.790
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	824	117.639.802	2.457.144	120.097.770
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	(1.221)	-	(1.221)
Devisenterminkontrakte	-	(402.006)	-	(402.006)
Total Return Swaps	-	(1.320.893)	-	(1.320.893)
Summe Derivate	-	(1.724.120)	-	(1.724.120)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(1.724.120)	-	(1.724.120)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Global Convertibles (Fortsetzung)
31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	899	-	-	899
Summe Aktien und verwaltete Fonds	899	-	-	899
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Wandelanleihen	-	124.307.409	1.551.050	125.858.459
Unternehmensanleihen	-	7.824.996	-	7.824.996
Staatsanleihen	59.990.560	-	-	59.990.560
Summe verzinsliche Wertpapiere	59.990.560	132.132.405	1.551.050	193.674.015
<u>Derivate</u>				
ASCOTs	-	63.975	-	63.975
Aktienwaps	-	1.026	-	1.026
Devisenterminkontrakte	-	1.415.537	-	1.415.537
Summe Derivate	-	1.480.538	-	1.480.538
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	59.991.459	133.612.943	1.551.050	195.155.452
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(518.313)	-	(518.313)
Summe Derivate	-	(518.313)	-	(518.313)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(518.313)	-	(518.313)

Man GLG RI European Equity Leaders

31. Dezember 2022

	EUR	EUR	EUR	EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	5.186	-	5.186
Summe Derivate	-	5.186	-	5.186
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	-	5.186	-	5.186
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	(1.038.374)	-	(1.038.374)
Devisenterminkontrakte	-	(379.885)	-	(379.885)
Summe Derivate	-	(1.418.259)	-	(1.418.259)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(1.418.259)	-	(1.418.259)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG RI European Equity Leaders (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Summe beizulegender Zeitwert EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	252.883.580	-	-	252.883.580
Summe Aktien und verwaltete Fonds	252.883.580	-	-	252.883.580
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	1.197.652	-	1.197.652
Summe Derivate	-	1.197.652	-	1.197.652
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	252.883.580	1.197.652	-	254.081.232
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Aktienswaps	-	(1.558.099)	-	(1.558.099)
Devisenterminkontrakte	-	(1.320.958)	-	(1.320.958)
Summe Derivate	-	(2.879.057)	-	(2.879.057)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(2.879.057)	-	(2.879.057)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

31. Dezember 2022

	JPY	JPY	JPY	JPY
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	261.297.377.728	-	-	261.297.377.728
Summe Aktien und verwaltete Fonds	261.297.377.728	-	-	261.297.377.728
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	2.925.384.602	-	2.925.384.602
Summe Derivate	-	2.925.384.602	-	2.925.384.602
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	261.297.377.728	2.925.384.602	-	264.222.762.330
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(2.741.354.159)	-	(2.741.354.159)
Futures-Kontrakte	(94.123.860)	-	-	(94.123.860)
Summe Derivate	(94.123.860)	(2.741.354.159)	-	(2.835.478.019)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(94.123.860)	(2.741.354.159)	-	(2.835.478.019)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Summe beizulegender Zeitwert JPY
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	166.402.938.716	-	-	166.402.938.716
Summe Aktien und verwaltete Fonds	166.402.938.716	-	-	166.402.938.716
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	928.985.375	-	928.985.375
Summe Derivate	-	928.985.375	-	928.985.375
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	166.402.938.716	928.985.375	-	167.331.924.091
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(372.824.350)	-	(372.824.350)
Futures-Kontrakte	(3.740.538)	-	-	(3.740.538)
Summe Derivate	(3.740.538)	(372.824.350)	-	(376.564.888)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(3.740.538)	(372.824.350)	-	(376.564.888)

Man Numeric Emerging Markets Equity

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	296.725.039	-	905.675	297.630.714
Summe Aktien und verwaltete Fonds	296.725.039	-	905.675	297.630.714
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	86.906.161	-	-	86.906.161
Summe verzinsliche Wertpapiere	86.906.161	-	-	86.906.161
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	5.098.153	-	5.098.153
Summe Derivate	-	5.098.153	-	5.098.153
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	383.631.200	5.098.153	905.675	389.635.028
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	(3.165.633)	-	(3.165.633)
Futures-Kontrakte	(181.366)	-	-	(181.366)
Summe Derivate	(181.366)	(3.165.633)	-	(3.346.999)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(181.366)	(3.165.633)	-	(3.346.999)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man Numeric Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	477.220.167	-	-	477.220.167
Vorzugsaktien	9.328.426	-	-	9.328.426
Summe Aktien und verwaltete Fonds	486.548.593	-	-	486.548.593
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	126.899.402	-	-	126.899.402
Summe verzinsliche Wertpapiere	126.899.402	-	-	126.899.402
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	12.141.431	-	12.141.431
Summe Derivate	-	12.141.431	-	12.141.431
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	613.447.995	12.141.431	-	625.589.426

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Zu Handelszwecken gehalten:

Derivate

Aktienwaps	-	(3.378.406)	-	(3.378.406)
Futures-Kontrakte	(69.325)	-	-	(69.325)
Summe Derivate	(69.325)	(3.378.406)	-	(3.447.731)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(69.325)	(3.378.406)	-	(3.447.731)

Man Numeric Global RI Climate

(vormals Man Numeric RI Global Equity)

31. Dezember 2022

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Zu Handelszwecken gehalten:

Aktien und verwaltete Fonds

Aktien	20.377.328	-	-	20.377.328
Summe Aktien und verwaltete Fonds	20.377.328	-	-	20.377.328

Derivate

Devisenterminkontrakte	-	10	-	10
Summe Derivate	-	10	-	10

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte

20.377.328	10	-	20.377.338
------------	----	---	------------

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Zu Handelszwecken gehalten:

Derivate

Futures-Kontrakte	(14.310)	-	-	(14.310)
Summe Derivate	(14.310)	-	-	(14.310)

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten

(14.310)	-	-	(14.310)
----------	---	---	----------

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man Numeric Global RI Climate
(vormals Man Numeric RI Global Equity) (Fortsetzung)
31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	24.736.065	-	-	24.736.065
Immobilienanlagefonds	624.674	-	-	624.674
Summe Aktien und verwaltete Fonds	25.360.739	-	-	25.360.739
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	614.951	-	-	614.951
Summe verzinsliche Wertpapiere	614.951	-	-	614.951
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	12	-	12
Futures-Kontrakte	18.340	-	-	18.340
Summe Derivate	18.340	12	-	18.352
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	25.994.030	12	-	25.994.042

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates
31. Dezember 2022

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	27.557.320	53.740.094	-	81.297.414
Summe verzinsliche Wertpapiere	27.557.320	53.740.094	-	81.297.414
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	1.347.894	-	1.347.894
Summe Derivate	-	1.347.894	-	1.347.894
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	27.557.320	55.087.988	-	82.645.308
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(601.288)	-	(601.288)
Zinsswaps	-	(44.688)	-	(44.688)
Summe Derivate	-	(645.976)	-	(645.976)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(645.976)	-	(645.976)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	33.925.958	51.419.768	-	85.345.726
Summe verzinsliche Wertpapiere	<u>33.925.958</u>	<u>51.419.768</u>	<u>-</u>	<u>85.345.726</u>
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	1.094.408	-	1.094.408
Zinsswaps	-	235.699	-	235.699
Summe Derivate	<u>-</u>	<u>1.330.107</u>	<u>-</u>	<u>1.330.107</u>
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	<u>33.925.958</u>	<u>52.749.875</u>	<u>-</u>	<u>86.675.833</u>
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(1.413.417)	-	(1.413.417)
Zinsswaps	-	(11.433)	-	(11.433)
Summe Derivate	<u>-</u>	<u>(1.424.850)</u>	<u>-</u>	<u>(1.424.850)</u>
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	<u>-</u>	<u>(1.424.850)</u>	<u>-</u>	<u>(1.424.850)</u>
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>				
31. Dezember 2022				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Unternehmensanleihen	-	2.279.271	-	2.279.271
Staatsanleihen	6.386.056	25.248.788	-	31.634.844
Summe verzinsliche Wertpapiere	<u>6.386.056</u>	<u>27.528.059</u>	<u>-</u>	<u>33.914.115</u>
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	69.972	-	69.972
Summe Derivate	<u>-</u>	<u>69.972</u>	<u>-</u>	<u>69.972</u>
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	<u>6.386.056</u>	<u>27.598.031</u>	<u>-</u>	<u>33.984.087</u>
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(180)	-	(180)
Summe Derivate	<u>-</u>	<u>(180)</u>	<u>-</u>	<u>(180)</u>
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	<u>-</u>	<u>(180)</u>	<u>-</u>	<u>(180)</u>

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)
31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Unternehmensanleihen	-	2.813.387	-	2.813.387
Staatsanleihen	10.751.224	38.422.882	-	49.174.106
Summe verzinsliche Wertpapiere	10.751.224	41.236.269	-	51.987.493
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	166.202	-	166.202
Summe Derivate	-	166.202	-	166.202
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	10.751.224	41.402.471	-	52.153.695
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(1.858)	-	(1.858)
Summe Derivate	-	(1.858)	-	(1.858)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(1.858)	-	(1.858)

Man GLG Pan-European Equity Growth
31. Dezember 2022

	EUR	EUR	EUR	EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	200.960.895	-	-	200.960.895
Summe Aktien und verwaltete Fonds	200.960.895	-	-	200.960.895
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	31.705	-	31.705
Summe Derivate	-	31.705	-	31.705
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	200.960.895	31.705	-	200.992.600
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(834.017)	-	(834.017)
Summe Derivate	-	(834.017)	-	(834.017)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(834.017)	-	(834.017)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Pan-European Equity Growth (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Summe beizulegender Zeitwert EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	445.747.058	-	-	445.747.058
Summe Aktien und verwaltete Fonds	445.747.058	-	-	445.747.058
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	973.256	-	973.256
Summe Derivate	-	973.256	-	973.256
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	445.747.058	973.256	-	446.720.314

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Zu Handelszwecken gehalten:

Derivate

Devisenterminkontrakte	-	(109.814)	-	(109.814)
Summe Derivate	-	(109.814)	-	(109.814)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(109.814)	-	(109.814)

Man GLG RI Global Sustainable Growth

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	5.602.610	-	-	5.602.610
Summe Aktien und verwaltete Fonds	5.602.610	-	-	5.602.610
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	41.070	-	41.070
Summe Derivate	-	41.070	-	41.070
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	5.602.610	41.070	-	5.643.680
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(36.041)	-	(36.041)
Summe Derivate	-	(36.041)	-	(36.041)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(36.041)	-	(36.041)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth (Fortsetzung)
31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	219.907.422	-	-	219.907.422
Summe Aktien und verwaltete Fonds	219.907.422	-	-	219.907.422
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	5.160.839	-	5.160.839
Summe Derivate	-	5.160.839	-	5.160.839
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	219.907.422	5.160.839	-	225.068.261
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(1.122.330)	-	(1.122.330)
Summe Derivate	-	(1.122.330)	-	(1.122.330)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(1.122.330)	-	(1.122.330)

Man Numeric Europe RI Climate
(vormals Man Numeric RI European Equity)

31. Dezember 2022

	EUR	EUR	EUR	EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	29.443.872	-	-	29.443.872
Summe Aktien und verwaltete Fonds	29.443.872	-	-	29.443.872
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	144	-	144
Summe Derivate	-	144	-	144
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	29.443.872	144	-	29.444.016
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(34.128)	-	(34.128)
Futures-Kontrakte	(21.681)	-	-	(21.681)
Summe Derivate	(21.681)	(34.128)	-	(55.809)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(21.681)	(34.128)	-	(55.809)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man Numeric Europe RI Climate
(vormals Man Numeric RI European Equity) (Fortsetzung)
31. Dezember 2021

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Summe beizulegender Zeitwert EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	21.246.611	-	-	21.246.611
Immobilienanlagefonds	103.350	-	-	103.350
Summe Aktien und verwaltete Fonds	21.349.961	-	-	21.349.961
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	40.722	-	40.722
Futures-Kontrakte	44.175	-	-	44.175
Summe Derivate	44.175	40.722	-	84.897
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	21.394.136	40.722	-	21.434.858
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(433)	-	(433)
Summe Derivate	-	(433)	-	(433)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(433)	-	(433)

Man GLG RI Sustainable European Income
(vormals Man GLG European Income Opportunities)
31. Dezember 2022

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	25.610.928	-	-	25.610.928
Summe Aktien und verwaltete Fonds	25.610.928	-	-	25.610.928
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	25.610.928	-	-	25.610.928
31. Dezember 2021				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	50.619.245	-	-	50.619.245
Vorzugsaktien	1.819.800	-	-	1.819.800
Summe Aktien und verwaltete Fonds	52.439.045	-	-	52.439.045
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	52.439.045	-	-	52.439.045

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man Numeric China A Equity
31. Dezember 2022

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	17.245.778	-	-	17.245.778
Summe Aktien und verwaltete Fonds	17.245.778	-	-	17.245.778
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	810.647	-	-	810.647
Summe verzinsliche Wertpapiere	810.647	-	-	810.647
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	36.664	-	36.664
Futures-Kontrakte	12.138	-	-	12.138
Summe Derivate	12.138	36.664	-	48.802
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	18.068.563	36.664	-	18.105.227
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(1.004)	-	(1.004)
Summe Derivate	-	(1.004)	-	(1.004)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(1.004)	-	(1.004)
31. Dezember 2021				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	31.469.807	-	-	31.469.807
Summe Aktien und verwaltete Fonds	31.469.807	-	-	31.469.807
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	48.478	-	48.478
Summe Derivate	-	48.478	-	48.478
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	31.469.807	48.478	-	31.518.285
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(785)	-	(785)
Futures-Kontrakte	(10.192)	-	-	(10.192)
Summe Derivate	(10.192)	(785)	-	(10.977)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(10.192)	(785)	-	(10.977)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Strategic Bond

31. Dezember 2022

	Stufe 1 GBP	Stufe 2 GBP	Stufe 3 GBP	Summe beizulegender Zeitwert GBP
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Vorzugsaktien	11.061.817	-	-	11.061.817
Summe Aktien und verwaltete Fonds	11.061.817	-	-	11.061.817
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Unternehmensanleihen	-	173.952.534	-	173.952.534
Staatsanleihen	56.893.933	-	-	56.893.933
Hypothekenbesicherte Wertpapiere	-	1.484	-	1.484
Summe verzinsliche Wertpapiere	56.893.933	173.954.018	-	230.847.951
<u>Derivate</u>				
Futures-Kontrakte	85.017	-	-	85.017
Devisenterminkontrakte	-	6.801.262	-	6.801.262
Summe Derivate	85.017	6.801.262	-	6.886.279
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	68.040.767	180.755.280	-	248.796.047
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(6.735.149)	-	(6.735.149)
Summe Derivate	-	(6.735.149)	-	(6.735.149)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(6.735.149)	-	(6.735.149)
31. Dezember 2021				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Vorzugsaktien	34.448.600	-	-	34.448.600
Summe Aktien und verwaltete Fonds	34.448.600	-	-	34.448.600
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Wandelanleihen	-	7.820.980	-	7.820.980
Unternehmensanleihen	-	187.701.394	-	187.701.394
Staatsanleihen	29.960.346	17.066.359	-	47.026.705
Hypothekenbesicherte Wertpapiere	-	1.974	-	1.974
Summe verzinsliche Wertpapiere	29.960.346	212.590.707	-	242.551.053
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	3.316.061	-	3.316.061
Summe Derivate	-	3.316.061	-	3.316.061
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	64.408.946	215.906.768	-	280.315.714
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(6.849.258)	-	(6.849.258)
Summe Derivate	-	(6.849.258)	-	(6.849.258)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(6.849.258)	-	(6.849.258)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity
31. Dezember 2022

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	54.084.718	-	-	54.084.718
Summe Aktien und verwaltete Fonds	54.084.718	-	-	54.084.718
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	237.781	-	237.781
Summe Derivate	-	237.781	-	237.781
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	54.084.718	237.781	-	54.322.499
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(9)	-	(9)
Aktienwaps	-	(162.774)	-	(162.774)
Summe Derivate	-	(162.783)	-	(162.783)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(162.783)	-	(162.783)
31. Dezember 2021				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	74.715.189	-	-	74.715.189
Summe Aktien und verwaltete Fonds	74.715.189	-	-	74.715.189
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	241.315	-	241.315
Devisenterminkontrakte	-	73.483	-	73.483
Futures-Kontrakte	79.758	-	-	79.758
Summe Derivate	79.758	314.798	-	394.556
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	74.794.947	314.798	-	75.109.745
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(169.635)	-	(169.635)
Summe Derivate	-	(169.635)	-	(169.635)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(169.635)	-	(169.635)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man Numeric US High Yield

31. Dezember 2022

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Unternehmensanleihen	-	35.714.137	-	35.714.137
Summe verzinsliche Wertpapiere	-	35.714.137	-	35.714.137
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
	-	35.714.137	-	35.714.137

31. Dezember 2021

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Zu Handelszwecken gehalten:

Verzinsliche Wertpapiere

Unternehmensanleihen	-	102.373.751	-	102.373.751
Summe verzinsliche Wertpapiere	-	102.373.751	-	102.373.751

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte

	-	102.373.751	-	102.373.751
--	---	-------------	---	-------------

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

31. Dezember 2022

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Zu Handelszwecken gehalten:

Verzinsliche Wertpapiere

Wandelanleihen	-	7.678.255	-	7.678.255
Unternehmensanleihen	-	176.556.028	-	176.556.028
Summe verzinsliche Wertpapiere	-	184.234.283	-	184.234.283

Derivate

Credit Default Swaps	-	201.530	-	201.530
Devisenterminkontrakte	-	3.649.844	-	3.649.844
Zinsswaps	-	125.411	-	125.411
Summe Derivate	-	3.976.785	-	3.976.785

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte

	-	188.211.068	-	188.211.068
--	---	-------------	---	-------------

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Zu Handelszwecken gehalten:

Derivate

Credit Default Swaps	-	(861.955)	-	(861.955)
Devisenterminkontrakte	-	(1.010.599)	-	(1.010.599)
Futures-Kontrakte	(164.562)	-	-	(164.562)
Zinsswaps	-	(652.283)	-	(652.283)
Summe Derivate	(164.562)	(2.524.837)	-	(2.689.399)

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten

	(164.562)	(2.524.837)	-	(2.689.399)
--	-----------	-------------	---	-------------

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

(Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Wandelanleihen	-	1.875.798	-	1.875.798
Unternehmensanleihen	-	33.037.356	-	33.037.356
Summe verzinsliche Wertpapiere	-	34.913.154	-	34.913.154
<u>Derivate</u>				
Credit Default Swaps	-	31.145	-	31.145
Devisenterminkontrakte	-	93.887	-	93.887
Futures-Kontrakte	45.890	-	-	45.890
Zinsswaps	-	20.779	-	20.779
Summe Derivate	45.890	145.811	-	191.701
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	45.890	35.058.965	-	35.104.855

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Zu Handelszwecken gehalten:

Derivate

Credit Default Swaps	-	(77.534)	-	(77.534)
Devisenterminkontrakte	-	(247.257)	-	(247.257)
Futures-Kontrakte	(14.266)	-	-	(14.266)
Summe Derivate	(14.266)	(324.791)	-	(339.057)

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten

(14.266) (324.791) - (339.057)

Man GLG China Equity

31. Dezember 2022

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Zu Handelszwecken gehalten:

Aktien und verwaltete Fonds

Aktien	9.071.272	-	-	9.071.272
Summe Aktien und verwaltete Fonds	9.071.272	-	-	9.071.272

Verzinsliche Wertpapiere

Staatsanleihen	692.336	-	-	692.336
Summe verzinsliche Wertpapiere	692.336	-	-	692.336

Derivate

Aktienwaps	-	9.791	-	9.791
Devisenterminkontrakte	-	6.083	-	6.083
Summe Derivate	-	15.874	-	15.874

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte

9.763.608 15.874 - 9.779.482

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Zu Handelszwecken gehalten:

Derivate

Aktienwaps	-	(285.920)	-	(285.920)
Devisenterminkontrakte	-	(8.827)	-	(8.827)
Summe Derivate	-	(294.747)	-	(294.747)

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten

- (294.747) - (294.747)

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG China Equity (Fortsetzung)
31. Dezember 2021

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	8.568.626	-	-	8.568.626
Summe Aktien und verwaltete Fonds	8.568.626	-	-	8.568.626
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Staatsanleihen	1.499.536	-	-	1.499.536
Summe verzinsliche Wertpapiere	1.499.536	-	-	1.499.536
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	36.539	-	36.539
Devisenterminkontrakte	-	9.238	-	9.238
Summe Derivate	-	45.777	-	45.777
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	10.068.162	45.777	-	10.113.939
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Aktienwaps	-	(127.332)	-	(127.332)
Devisenterminkontrakte	-	(8.869)	-	(8.869)
Summe Derivate	-	(136.201)	-	(136.201)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(136.201)	-	(136.201)

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy

31. Dezember 2022

	EUR	EUR	EUR	EUR
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Aktien und verwaltete Fonds</u>				
Aktien	33.499.294	-	-	33.499.294
Vorzugsaktien	507.556	-	-	507.556
Summe Aktien und verwaltete Fonds	34.006.850	-	-	34.006.850
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	34.006.850	-	-	34.006.850

Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy hat seine Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022 aufgenommen. Daher wurden im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 keine Anlagen gehalten.

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Man GLG Sustainable Strategic Income
31. Dezember 2022

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Unternehmensanleihen	-	14.593.747	-	14.593.747
Staatsanleihen	868.611	-	-	868.611
Summe verzinsliche Wertpapiere	868.611	14.593.747	-	15.462.358
<u>Derivate</u>				
Futures-Kontrakte	6.328	-	-	6.328
Devisenterminkontrakte	-	124.519	-	124.519
Summe Derivate	6.328	124.519	-	130.847
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	874.939	14.718.266	-	15.593.205
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Devisenterminkontrakte	-	(214.253)	-	(214.253)
Summe Derivate	-	(214.253)	-	(214.253)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(214.253)	-	(214.253)

Der Man GLG Sustainable Strategic Income hat seine Geschäftstätigkeit am 23. März 2022 aufgenommen. Daher wurden im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 keine Anlagen gehalten.

Man GLG Dynamic Income
31. Dezember 2022

	Stufe 1 USD	Stufe 2 USD	Stufe 3 USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Verzinsliche Wertpapiere</u>				
Unternehmensanleihen	-	29.471.396	-	29.471.396
Wandelanleihen	-	2.109.394	-	2.109.394
Summe verzinsliche Wertpapiere	-	31.580.790	-	31.580.790
<u>Derivate</u>				
Futures-Kontrakte	10.247	-	-	10.247
Devisenterminkontrakte	-	109.829	-	109.829
Summe Derivate	10.247	109.829	-	120.076
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	10.247	31.690.619	-	31.700.866
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
<i>Zu Handelszwecken gehalten:</i>				
<u>Derivate</u>				
Credit Default Swaps	-	(143.012)	-	(143.012)
Devisenterminkontrakte	-	(135.773)	-	(135.773)
Summe Derivate	-	(278.785)	-	(278.785)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-	(278.785)	-	(278.785)

Der Man GLG Dynamic Income hat seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2022 aufgenommen. Daher wurden im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 keine Anlagen gehalten.

Kurzfristige Salden werden in den Tabellen nicht berücksichtigt, da ihr Buchwert zum Ende des Geschäftsjahres in etwa ihrem beizulegenden Zeitwert entspricht.

Anlagen werden an jedem Rechnungslegungszeitpunkt überprüft, um zu gewährleisten, dass sie entsprechend ihrer oben beschriebenen Zeitwerthierarchie korrekt in die Stufen 1, 2 und 3 klassifiziert sind. Wenn sich die Eigenschaften einer Anlage im Jahresverlauf ändern und Anlagen nicht länger die Kriterien einer bestimmten Stufe erfüllen, werden sie am Ende des entsprechenden Berichtsjahres in eine angemessenere Stufe übertragen.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 gab es keine Transfers zwischen Stufe 1 und Stufe 2.

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Ein Abgleich der Bewegungen in Vermögenswerten/Verbindlichkeiten der Stufe 3 für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ist nachfolgend aufgeführt:

Man GLG Global Convertibles

	Aktien und verwaltete Fonds USD	Verzinsliche Wertpapiere USD	Derivate USD	Summe beizulegender Zeitwert USD
31. Dezember 2022				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:				
Anfangssaldo	-	1.551.050	-	1.551.050
Summe Gewinne und Verluste				
- Realisiert	-	-	-	-
- Nicht realisiert	-	906.094	-	906.094
Käufe	-	-	-	-
Verkäufe	-	-	-	-
Übertragungen in Stufe 3	-	-	-	-
Übertragungen aus Stufe 3	-	-	-	-
Schlussaldo	<u>-</u>	<u>2.457.144</u>	<u>-</u>	<u>2.457.144</u>

31. Dezember 2021

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:				
Anfangssaldo	-	1.635.147	-	1.635.147
Summe Gewinne und Verluste				
- Realisiert	-	-	-	-
- Nicht realisiert	-	(84.097)	-	(84.097)
Käufe	-	-	-	-
Verkäufe	-	-	-	-
Übertragungen in Stufe 3	-	-	-	-
Übertragungen aus Stufe 3	-	-	-	-
Schlussaldo	<u>-</u>	<u>1.551.050</u>	<u>-</u>	<u>1.551.050</u>

Man Numeric Emerging Markets Equity

31. Dezember 2022

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:				
Anfangssaldo	-	-	-	-
Summe Gewinne und Verluste				
- Realisiert	-	-	-	-
- Nicht realisiert	-	-	-	-
Käufe	-	-	-	-
Verkäufe	-	-	-	-
Übertragungen in Stufe 3	905.675	-	-	905.675
Übertragungen aus Stufe 3	-	-	-	-
Schlussaldo	<u>905.675</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>905.675</u>

Alle in den obigen Tabellen angegebenen realisierten und nicht realisierten Nettogewinne/(-verluste) sind in der beiliegenden Gesamtergebnisrechnung berücksichtigt. Der Nettobetrag von 906.094 USD (31. Dezember 2021: (84.097 USD)) für den Man GLG Global Convertibles bezieht sich auf die zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 vom Fonds gehaltenen Finanzinstrumente und ist in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Der beizulegende Zeitwert von Anlagen, die in Stufe 3 eingestuft sind, beruht auf nicht beobachtbaren Parametern und kann erheblichen Schwankungen unterliegen. Aufgrund der inhärenten Unsicherheit der Bewertung dieser Anlagen können die Schätzungen des Fonds bezüglich des beizulegenden Zeitwerts erheblich von den beizulegenden Zeitwerten abweichen, die verwendet worden wären, wenn für die Bewertung dieser Anlagen beobachtbare Parameter vorgelegen hätten. Die sich hieraus ergebenden Differenzen könnten erheblich sein.

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Beizulegender Zeitwert von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

In den Tabellen unten sind die für Bewertungen von Anlagen der Stufe 3 verwendeten Bewertungsmethoden angegeben, und die Auswirkungen wesentlicher nicht beobachtbarer Parameter, die zur Bewertung von Anlagen dieser Kategorie verwendet werden, sind darin quantifiziert. Die Größenordnungen dieses beizulegenden Zeitwerts sind für die entsprechenden Parameter nicht repräsentativ, die zur Berechnung des beizulegenden Zeitwertes eines Vermögenswertes oder einer Verbindlichkeit der Stufe 3 zu verwenden sind. Dementsprechend stellen die Größenordnungen des unten dargestellten beizulegenden Zeitwerts keine Unsicherheiten oder möglichen Größenordnungen der Zeitwertbewertung von Vermögenswerten/Verbindlichkeiten der Stufe 3 des Teilfonds dar.

Man GLG Global Convertibles

31. Dezember 2022	Beizulegender Wert USD	Bewertungs- methode	Nicht beobachtbare Parameter	Bereich
Wandelanleihen	2.457.144	Geschätzte Rückzahlung	Zeitraum bis zur Abwicklung, Voraussichtlicher Cashflow	2.438.530 USD – 2.475.759 USD
31. Dezember 2021				
Wandelanleihen	1.551.050	Geschätzte Rückzahlung	Zeitraum bis zur Abwicklung, Voraussichtlicher Cashflow	1.447.357 USD – 1.760.299 USD

Man Numeric Emerging Markets Equity

31. Dezember 2022				
Aktien	905.675	Abgezinst ausgesetzter Kurs	Graumarkthandel	k.A.

Die Auswirkungen der vorstehend angegebenen Abschlagsspanne auf den beizulegenden Zeitwert entsprechen der Einschätzung des Anlageverwalters in Bezug auf die Spanne möglicher Illiquiditätsabschläge. Die Auswirkung der Spanne möglicher Bewertungen auf den beizulegenden Zeitwert von Anlagen ist ein Rückgang/Anstieg von bis zu (18.614 USD)/18.615 USD (31. Dezember 2021: (103.693 USD)/209.249 USD) für Man GLG Global Convertibles.

Devisenterminkontrakte

Im Rahmen seiner Portfoliomangementtechniken kann der Fonds außerdem zur wirtschaftlichen Absicherung seiner Verbindlichkeiten gegenüber Anteilhabern, die nicht auf die funktionale Währung lauten, Devisenterminkontrakte einsetzen (auch wenn kein formelles Hedge-Accounting erfolgt). Devisenterminkontrakte können zudem für Handelszwecke eingesetzt werden. Von dem Fonds eingegangene Forward-Kontrakte stellen eine feste Verpflichtung dar, eine vereinbarte oder vertraglich festgelegte Menge eines Basiswerts oder einer Fremdwährung zu einem bestimmten Zeitpunkt zu einem festgelegten Preis zu kaufen oder zu verkaufen.

Devisenterminkontrakte können den Fonds unter Umständen jenen Risiken aussetzen, die mit dem Fehlen eines Börsenmarktes, an dem man eine offene Position glattstellen kann, verbunden sind. Die Anlageverwalter führen im Rahmen der allgemeinen Verwaltung des Marktrisikos des Fonds eine strenge Überwachung des Risikos des Fonds in Bezug auf Devisenterminkontrakte durch.

Derivative Finanzinstrumente

Der Fonds kann mit derivativen Finanzinstrumenten handeln, unter anderem auch mit Futures, Devisenterminkontrakten, ASCOTs, Credit Default Swaps, Aktienswaps und Zinsswaps, deren Wert auf zugrunde liegenden Vermögenswerten, Indizes, Währungen oder Zinssätzen basiert.

Der Fonds ist beim Handel mit derivativen Finanzinstrumenten dem Markt- und Kreditrisiko ausgesetzt. Das Marktrisiko ist das Potenzial von Wertänderungen aufgrund von Änderungen der Marktzinssätze, Wechselkurse, Indizes und Wertänderungen der zugrunde liegenden Finanzinstrumente. Kreditrisiken entstehen durch die Möglichkeit, dass ein Verlust eintritt, wenn eine Gegenpartei ihre vertraglichen Verpflichtungen nicht erfüllt. Im Wesentlichen werden alle Derivatekontrakte auf der Basis von Sicherheitsleistungen ausgeführt. Diese Transaktionen können den Fonds einem wesentlichen außerbilanziellen Risiko aussetzen, wenn Einschusshinterlegungen und Sicherheitsleistungen nicht ausreichen, um entstandene Verluste zu decken.

Die Anlageverwalter verwalten das mit diesen Transaktionen verbundene Risiko durch die Aufrechterhaltung von Einschusshinterlegungen und Sicherheitsleistungen bei ihren Brokern gemäß individuellen Börsenbestimmungen und internen Richtlinien. Die Anlageverwalter übernehmen auch eine aktive Rolle bei der täglichen Verwaltung und Kontrolle der Markt- und Gegenparteiensrisiken des Fonds und der Überwachung von Handelsaktivitäten und Einschusshöhen und hinterlegen gegebenenfalls zusätzliche Sicherheiten oder reduzieren Positionen.

Credit Default Swaps sind Kontrakte, bei denen der Fonds einen Zinsfluss im Austausch dafür zahlt oder erhält, dass die Gegenpartei das Risiko eines Ausfalls oder einer Nichtzahlung einer Referenzstruktur übernimmt oder verkauft, auf die sich der Swap bezieht. Wenn der Fonds Schutz gekauft hat, ist der maximale potenzielle Verlust der Wert der Zinsflüsse, die der Fonds vertragsgemäß bis zur Fälligkeit des Kontrakts zahlen muss. Wenn der Fonds Schutz verkauft hat, ist der maximale potenzielle Verlust der Nennwert des verkauften Schutzes. Zum 31. Dezember 2022 beträgt die maximale potenzielle Auszahlung im Rahmen von Credit Default Swaps, bei denen das Portfolio Schutz verkauft hat, 7.547.682 USD (31. Dezember 2021: 1.523.480 USD) für den Man GLG Global Investment Grade Opportunities und 790.299 USD (31. Dezember 2021: null USD) für den Man GLG Dynamic Income.

Der beizulegende Zeitwert dieser Kontrakte belief sich zum 31. Dezember 2022 auf (475.539 USD) (31. Dezember 2021: (31.145 USD)) für den Man GLG Global Investment Grade Opportunities und (143.012 USD) USD (31. Dezember 2021: null USD) für den Man GLG Dynamic Income.

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente (Fortsetzung)

Der Fonds kann Put- und Call-Optionen über Freiverkehrsmärkte kaufen oder verkaufen. Vom Fonds gekaufte Optionen bieten dem Fonds die Gelegenheit, den Basiswert vor oder beim Ablauf der Option zu einem vereinbarten Wert zu kaufen (Call-Optionen) oder zu verkaufen (Put-Optionen). Vom Fonds verkaufte Optionen bieten dem Käufer der Option die Gelegenheit, den Basiswert vor oder beim Ablauf der Option zu einem vereinbarten Wert vom Fonds zu kaufen bzw. an diesen zu verkaufen. Die aus dem Verkauf von Optionen erhaltenen Prämien werden im Einklang mit Erläuterung 2 zum Marktwert bewertet, und die sich daraus ergebenden Gewinne oder Verluste werden in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. Der Fonds kann auch in Swaptions investieren, bei denen es sich um eine Kombination der Merkmale von Optionen und Zinsswaps handelt. Der maximale Verlust eines Käufers einer Option besteht im Verlust der Prämie. Der Verkäufer einer Kaufoption trägt das Risiko einer ungünstigen Veränderung des Wertes des Basiswertes der Option und der Verlust ist, sofern keine ausgleichende Long-Position eingegangen wird, theoretisch unbegrenzt.

Derivative Finanzinstrumente basieren generell auf Nennbeträgen, die im Abschluss nicht ausgewiesen werden. Diese Nennbeträge repräsentieren den theoretischen Kapitalwert, auf dem die Cashflows der Derivatetransaktionen basieren. Anstatt Nennbeträgen werden nicht realisierte Gewinne oder Verluste oder die vom Fonds gehandelten börsengehandelten Derivate in die Bilanz aufgenommen. Die nicht realisierten Nettogewinne oder Nettoverluste repräsentieren die voraussichtlichen künftigen Cashflows aus Handelsaktivitäten des Fonds eher als Kontrakt- oder Nennbeträge.

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 war der Fonds durch seine Anlagen in derivativen Finanzinstrumenten in zugrunde liegenden Positionen mit folgenden Nominalbeträgen engagiert:

	Long		Short		Nennwert	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	USD	USD	USD	USD	USD	USD
<i>Man GLG Global Convertibles</i>						
ASCOTs	218.396	-	-	437.097	-	-
Aktienwaps	83.006	-	-	83.006	-	-
Devisenterminkontrakte	31.546.779	105.873.408	70.290.498	-	156.708.408	-
Total Return Swaps	24.330.960	-	-	-	-	-
	<u>56.179.141</u>	<u>105.873.408</u>	<u>70.810.601</u>	<u>156.708.408</u>		
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>						
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktienwaps	80.092.386	-	-	7.606.234	-	-
Devisenterminkontrakte	603.005	42.237.022	111.224.345	-	133.353.831	-
	<u>80.695.391</u>	<u>42.237.022</u>	<u>118.830.579</u>	<u>133.353.831</u>		
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>						
	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Devisenterminkontrakte	223.313.236.925	331.827.316.588	118.994.299.124	-	178.099.138.512	-
Futures-Kontrakte	4.123.018.860	-	2.553.500.538	-	-	-
	<u>227.436.255.785</u>	<u>331.827.316.588</u>	<u>121.547.799.662</u>	<u>178.099.138.512</u>		
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>						
	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Aktienwaps	113.607.513	-	-	140.511.534	-	-
Futures-Kontrakte	11.358.376	-	-	14.478.350	-	-
	<u>124.965.889</u>	<u>-</u>	<u>154.989.884</u>	<u>-</u>		
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>						
Devisenterminkontrakte	-	1.319	-	19	-	1.813
Futures-Kontrakte	595.350	-	-	1.397.720	-	-
	<u>595.350</u>	<u>1.319</u>	<u>1.397.739</u>	<u>1.813</u>		
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>						
Devisenterminkontrakte	14.694.307	37.392.097	39.589.753	-	64.501.070	-
Zinsswaps	5.492.687	-	11.391.158	-	5.299.079	-
	<u>20.186.994</u>	<u>37.392.097</u>	<u>50.980.911</u>	<u>69.800.149</u>		
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>						
Devisenterminkontrakte	89.474	8.869.642	502.811	-	23.872.494	-
	<u>89.474</u>	<u>8.869.642</u>	<u>502.811</u>	<u>23.872.494</u>		

4. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente (Fortsetzung)

	Long		Short		Nennwert	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>						
Devisenterminkontrakte	52.529.992	11.234.265	44.686.501	82.800.229		
	<u>52.529.992</u>	<u>11.234.265</u>	<u>44.686.501</u>	<u>82.800.229</u>		
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>						
Devisenterminkontrakte	3.315.104	3.438.091	110.948.587	223.185.888		
	<u>3.315.104</u>	<u>3.438.091</u>	<u>110.948.587</u>	<u>223.185.888</u>		
<i>Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)</i>						
Devisenterminkontrakte	23.167	2.042.355	28.456	2.444.193		
Futures-Kontrakte	745.011	-	1.789.165	-		
	<u>768.178</u>	<u>2.042.355</u>	<u>1.817.621</u>	<u>2.444.193</u>		
<i>Man Numeric China A Equity</i>						
Devisenterminkontrakte	240.182	4.722.417	110.670	7.011.311		
Futures-Kontrakte	1.322.430	-	1.642.888	-		
	<u>1.562.612</u>	<u>4.722.417</u>	<u>1.753.558</u>	<u>7.011.311</u>		
<i>Man GLG Strategic Bond</i>						
Devisenterminkontrakte	301.251.700	324.816.098	269.152.640	301.097.681		
Futures-Kontrakte	-	42.916.332	-	-		
	<u>301.251.700</u>	<u>367.732.430</u>	<u>269.152.640</u>	<u>301.097.681</u>		
<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i>						
Aktien swaps	6.214.787	-	511.130	-		
Devisenterminkontrakte	2.691	-	11.500.660	18.724.643		
Futures-Kontrakte	-	-	3.850.289	-		
	<u>6.217.478</u>	<u>-</u>	<u>15.862.079</u>	<u>18.724.643</u>		
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>						
Credit Default Swaps	19.955.419	7.547.682	700.000	1.523.480		
Devisenterminkontrakte	124.111.558	119.783.444	17.091.009	13.366.024		
Futures-Kontrakte	16.048.875	-	3.332.609	2.507.981		
Zinsswaps	6.070.955	240.850	-	270.890		
	<u>166.186.807</u>	<u>127.571.706</u>	<u>21.123.618</u>	<u>17.668.375</u>		
<i>Man GLG China Equity</i>						
Aktien swaps	931.504	-	2.868.331	-		
Devisenterminkontrakte	1.755.718	2.057.755	9.848.192	10.298.323		
	<u>2.687.222</u>	<u>2.057.755</u>	<u>12.716.523</u>	<u>10.298.323</u>		
<i>Man GLG Sustainable Strategic Income</i>						
Devisenterminkontrakte	11.839.087	19.842.641	-	-		
Futures-Kontrakte	-	2.272.063	-	-		
	<u>11.839.087</u>	<u>22.114.704</u>	<u>-</u>	<u>-</u>		
<i>Man GLG Dynamic Income</i>						
Credit Default Swaps	-	790.299	-	-		
Devisenterminkontrakte	16.444.442	1.017.644	-	-		
Futures-Kontrakte	-	376.711	-	-		
	<u>16.444.442</u>	<u>2.184.654</u>	<u>-</u>	<u>-</u>		

Der Man GLG RI Sustainable European Income, der Man Numeric US High Yield und der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 keine Derivate.

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 werden keine Finanzinstrumente des Fonds in der Bilanz des Fonds saldiert ausgewiesen. Die folgenden Tabellen enthalten Informationen zu den finanziellen Auswirkungen der Saldierung von Instrumenten, für die eine durchsetzbare Netting-Rahmenvereinbarung oder eine vergleichbare Vereinbarung für Ausfallereignisse gemäß Definition in diesen Vereinbarungen besteht.

Man GLG Global Convertibles

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Citibank N.A.	5.115.262	-	(1.466.234)	3.649.028
Morgan Stanley & Co. International Plc	499.847	-	(7.781)	492.066
Nomura Holdings	6.649	-	-	6.649
Summe	5.621.758	-	(1.474.015)	4.147.743

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der ungeprüften Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag USD
		Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Citibank N.A.	(1.466.234)	1.466.234	-	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	(7.781)	7.781	-	-
Summe	(1.474.015)	1.474.015	-	-

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Morgan Stanley & Co. International Plc	88.132	-	-	88.132
Nomura Holdings	126.700	-	-	126.700
Summe	214.832	-	-	214.832

Zum 31. Dezember 2021 unterlagen keine finanziellen Verbindlichkeiten der Saldierung.

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG RI European Equity Leaders

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte EUR	Gehaltene Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
Gegenpartei				
Morgan Stanley & Co. International Plc	4.690.820	-	(1.038.374)	3.652.446
Summe	4.690.820	-	(1.038.374)	3.652.446

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten EUR	Verpfändete Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
Gegenpartei				
Morgan Stanley & Co. International Plc	(1.038.374)	1.038.374	-	-
Summe	(1.038.374)	1.038.374	-	-

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung erhaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte EUR	Gehaltene Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
Gegenpartei				
Morgan Stanley & Co. International Plc	4.030.000	-	(1.558.099)	2.471.901
Summe	4.030.000	-	(1.558.099)	2.471.901

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten EUR	Verpfändete Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
Gegenpartei				
Morgan Stanley & Co. International Plc	(1.558.099)	1.558.099	-	-
Summe	(1.558.099)	1.558.099	-	-

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten JPY	Verpfändete Barsicherheiten JPY	Finanzinstru- mente JPY	Nettobetrag JPY
Morgan Stanley & Co. International Plc	(94.123.860)	-	-	(94.123.860)
Summe	(94.123.860)	-	-	(94.123.860)

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten JPY	Verpfändete Barsicherheiten JPY	Finanzinstru- mente JPY	Nettobetrag JPY
Morgan Stanley & Co. International Plc	(3.740.538)	-	-	(3.740.538)
Summe	(3.740.538)	-	-	(3.740.538)

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 gab es keine der Saldierung unterliegenden finanziellen Vermögenswerte.

Man Numeric Emerging Markets Equity

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	Nettobetrag USD
Goldman Sachs International	494.208	-	(181.366)	312.842
Morgan Stanley & Co. International Plc	94.089.199	-	(82.150.945)	11.938.254
Summe	94.583.407	-	(82.332.311)	12.251.096

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	Nettobetrag USD
Goldman Sachs International	(181.366)	181.366	-	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	(82.150.945)	82.150.945	-	-
Summe	(82.332.311)	82.332.311	-	-

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man Numeric Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	943.266	-	(69.325)	873.941
Morgan Stanley & Co. International Plc	117.560.071	-	(105.489.284)	12.070.787
Summe	118.503.337	-	(105.558.609)	12.944.728

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	(69.325)	69.325	-	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	(105.489.284)	105.328.443	160.841	-
Summe	(105.558.609)	105.397.768	160.841	-

Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	55.592	-	(14.310)	41.282
Summe	55.592	-	(14.310)	41.282

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	(14.310)	14.310	-	-
Summe	(14.310)	14.310	-	-

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity) (Fortsetzung)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung erhaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte	Gehaltene Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
	USD	USD	USD	USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	95.599	-	-	95.599
Summe	95.599	-	-	95.599

Zum 31. Dezember 2021 unterlagen keine finanziellen Verbindlichkeiten der Saldierung.

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte	Gehaltene Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
	USD	USD	USD	USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	502.764	-	(44.688)	458.076
HSBC Bank Plc	1.347.888	(679.246)	(561.668)	106.974
Summe	1.850.652	(679.246)	(606.356)	565.050

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten	Verpfändete Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
	USD	USD	USD	USD
Gegenpartei				
Goldman Sachs International	(44.688)	44.688	-	-
HSBC Bank Plc	(1.240.914)	-	1.240.914	-
Summe	(1.285.602)	44.688	1.240.914	-

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte	Gehaltene Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
	USD	USD	USD	USD
Gegenpartei				
Credit Suisse Securities Europe Limited	251.278	(14.919)	(11.433)	224.926
HSBC Bank Plc	1.585.727	-	(1.413.417)	172.310
Summe	1.837.005	(14.919)	(1.424.850)	397.236

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten	Verpfändete Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
Gegenpartei	USD	USD	USD	USD
Credit Suisse Securities Europe Limited	(26.352)	15.579	10.773	-
HSBC Bank Plc	(1.413.417)	620.135	793.282	-
Summe	(1.439.769)	635.714	804.055	-

Man GLG Global Emerging Markets Bond

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung erhaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte	Gehaltene Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
Gegenpartei	USD	USD	USD	USD
HSBC Bank Plc	33.984.087	-	-	33.984.087
Summe	33.984.087	-	-	33.984.087

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung erhaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte	Gehaltene Barsicherheiten	Finanzinstrumente	Nettobetrag
Gegenpartei	USD	USD	USD	USD
HSBC Bank Plc	52.153.696	-	-	52.153.696
Summe	52.153.696	-	-	52.153.696

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 gab es keine der Saldierung unterliegenden finanziellen Verbindlichkeiten.

Man GLG Pan-European Equity Growth

Das Portfolio verzeichnete zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 keine finanziellen Auswirkungen der Saldierung von Instrumenten, für die eine durchsetzbare Netting-Rahmenvereinbarung besteht.

Man GLG RI Global Sustainable Growth

Das Portfolio verzeichnete zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 keine finanziellen Auswirkungen der Saldierung von Instrumenten, für die eine durchsetzbare Netting-Rahmenvereinbarung besteht.

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte EUR	Gehaltene Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
Goldman Sachs International	89.759	-	(21.708)	68.051
Summe	89.759	-	(21.708)	68.051

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten EUR	Verpfändete Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
		In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		
Goldman Sachs International	(21.708)	21.708	-	-
Summe	(21.708)	21.708	-	-

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung erhaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte EUR	Gehaltene Barsicherheiten EUR	Finanzinstru- mente EUR	Nettobetrag EUR
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
Goldman Sachs International	172.021	-	-	172.021
Summe	172.021	-	-	172.021

Zum 31. Dezember 2021 unterlagen keine finanziellen Verbindlichkeiten der Saldierung.

Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)

Das Portfolio verzeichnete zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 keine finanziellen Auswirkungen der Saldierung von Instrumenten, für die eine durchsetzbare Netting-Rahmenvereinbarung besteht.

Man Numeric China A Equity

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	Nettobetrag USD
		In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		
Morgan Stanley & Co. International Plc	115.809	-	-	115.809
Summe	115.809	-	-	115.809

Zum 31. Dezember 2022 unterlagen keine finanziellen Verbindlichkeiten der Saldierung.

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man Numeric China A Equity (Fortsetzung)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Morgan Stanley & Co. International Plc	124.696	-	(10.192)	114.504
Summe	124.696	-	(10.192)	114.504

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag USD
		Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Morgan Stanley & Co. International Plc	(10.192)	10.192	-	-
Summe	(10.192)	10.192	-	-

Man GLG Strategic Bond

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte GBP	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag GBP
		Gehaltene Barsicherheiten GBP	Finanzinstru- mente GBP	
HSBC Bank Plc	267.490	-	(267.490)	-
JP Morgan Securities Plc	185.387	-	(523)	184.864
Summe	452.877	-	(268.013)	184.864

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten GBP	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag GBP
		Verpfändete Barsicherheiten GBP	Finanzinstru- mente GBP	
HSBC Bank Plc	(14.946.514)	191.046	76.444	(14.679.024)
JP Morgan Securities Plc	(523)	523	-	-
Summe	(14.947.037)	191.569	76.444	(14.679.024)

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG Strategic Bond (Fortsetzung)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte GBP	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag GBP
		Gehaltene Barsicherheiten GBP	Finanzinstru- mente GBP	
HSBC Bank Plc	739.435	-	(739.435)	-
JP Morgan Securities Plc	378.567	-	-	378.567
Summe	1.118.002	-	(739.435)	378.567

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten GBP	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag GBP
		Verpfändete Barsicherheiten GBP	Finanzinstru- mente GBP	
Credit Suisse Securities Europe Limited	(4)	-	-	(4)
HSBC Bank Plc	(849.015)	719.798	19.637	(109.580)
Summe	(849.019)	719.798	19.637	(109.584)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Morgan Stanley & Co. International Plc	1.239.352	-	(313.199)	926.153
Societe Generale	977.781	-	(381.515)	596.266
Summe	2.217.133	-	(694.714)	1.522.419

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag USD
		Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Morgan Stanley & Co. International Plc	(313.199)	313.199	-	-
Societe Generale	(381.515)	381.515	-	-
Summe	(694.714)	694.714	-	-

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity (Fortsetzung)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Credit Suisse AG Ireland	241.315	(110.000)	-	131.315
Goldman Sachs International	173	-	-	173
Morgan Stanley & Co. International Plc	79.758	(79.758)	-	-
Summe	321.246	(189.758)	-	131.488

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag USD
		Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Credit Suisse AG Ireland	(110.000)	-	110.000	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	(195.214)	-	79.758	(115.456)
Summe	(305.214)	-	189.758	(115.456)

Man Numeric US High Yield

Das Portfolio verzeichnete zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 keine finanziellen Auswirkungen der Saldierung von Instrumenten, für die eine durchsetzbare Netting-Rahmenvereinbarung besteht.

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Barclays Plc	25.410.150	-	(21.462.251)	3.947.899
JP Morgan Securities Plc	20.761.184	-	(17.171.019)	3.590.165
Morgan Stanley & Co. International Plc	6.850	-	(1.906)	4.944
Summe	46.178.184	-	(38.635.176)	7.543.008

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Barclays Plc	(21.462.251)	1.182.884	20.279.367	-
Goldman Sachs International	(170.917)	-	-	(170.917)
JP Morgan Securities Plc	(17.171.019)	4.711.562	12.459.457	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	(1.906)	1.906	-	-
Summe	(38.806.093)	5.896.352	32.738.824	(170.917)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Barclays Plc	4.797.394	-	(4.216.684)	580.710
Goldman Sachs International	48.007	-	(14.266)	33.741
JP Morgan Securities Plc	958.701	-	(77.534)	881.167
Morgan Stanley & Co. International Plc	3.175	-	-	3.175
Summe	5.807.277	-	(4.308.484)	1.498.793

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Barclays Plc	(4.216.684)	-	4.216.684	-
Goldman Sachs International	(14.266)	-	14.266	-
JP Morgan Securities Plc	(77.534)	-	77.534	-
Summe	(4.308.484)	-	4.308.484	-

Man GLG China Equity

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	337.371	-	(337.371)	-
Summe	337.371	-	(337.371)	-

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG China Equity (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	(464.975)	327.580	9.791	(127.604)
Summe	(464.975)	327.580	9.791	(127.604)

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	546.539	-	(127.332)	419.207
Summe	546.539	-	(127.332)	419.207

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2021:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstrumente USD	Nettobetrag USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	(127.332)	127.332	-	-
Summe	(127.332)	127.332	-	-

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte EUR	Gehaltene Barsicherheiten EUR	Finanzinstrumente EUR	Nettobetrag EUR
Morgan Stanley & Co. International Plc	115.939	-	-	115.939
Summe	115.939	-	-	115.939

Zum 31. Dezember 2022 unterlagen keine finanziellen Verbindlichkeiten der Saldierung.

Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy hat seine Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022 aufgenommen, daher sind keine Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ausgewiesen.

5. Saldierung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Man GLG Sustainable Strategic Income

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
JP Morgan Securities Plc	264.835	-	-	264.835
Summe	264.835	-	-	264.835

Zum 31. Dezember 2022 unterlagen keine finanziellen Verbindlichkeiten der Saldierung.

Der Man GLG Sustainable Strategic Income hat seine Geschäftstätigkeit am 23. März 2022 aufgenommen, daher sind keine Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ausgewiesen.

Man GLG Dynamic Income

In folgender Tabelle sind die finanziellen Nettovermögenswerte je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022 zusammengefasst:

Saldierung gehaltener finanzieller Vermögenswerte, derivativer Vermögenswerte und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Vermögenswerte USD	In der Bilanz nicht saldiertes Bruttovermögen		Nettobetrag USD
		Gehaltene Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Barclays Plc	5.739.774	(220.010)	(4.347.389)	1.172.375
Goldman Sachs International	10.247	-	-	10.247
JP Morgan Securities Plc	7.133.420	-	(6.413.487)	719.933
Summe	12.883.441	(220.010)	(10.760.876)	1.902.555

In der folgenden Tabelle sind die finanziellen Nettoverbindlichkeiten je Gegenpartei zum 31. Dezember 2022:

Saldierung verpfändeter finanzieller Verbindlichkeiten, derivativer Verbindlichkeiten und Sicherheiten nach Gegenparteien

Gegenpartei	(i)	(ii)		(iii)=(i)+(ii)
	In der Bilanz ausgewiesene Bruttobeträge der Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz nicht saldierte Bruttoverbindlichkeiten		Nettobetrag USD
		Verpfändete Barsicherheiten USD	Finanzinstru- mente USD	
Barclays Plc	(4.567.399)	-	4.567.399	-
JP Morgan Securities Plc	(6.413.487)	855.287	5.558.200	-
Summe	(10.980.886)	855.287	10.125.599	-

Der Man GLG Dynamic Income hat seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2022 aufgenommen, daher sind keine Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ausgewiesen.

6. Finanzrisikomanagement

Gesamtrisikomanagement

Die Anlageaktivitäten des Fonds setzen ihn verschiedenen Risikoarten aus, die mit den Finanzinstrumenten und Märkten zusammenhängen, in die er investiert. Die wichtigsten finanziellen Risiken, denen der Fonds ausgesetzt ist, sind Marktrisiko, Kreditrisiko und Liquiditätsrisiko. Das Marktrisiko umfasst das Aktienkursrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko. Der Fonds verwaltet diese Risiken auf aggregierter Basis zusammen mit den Risiken, die mit seinen Anlageaktivitäten verbunden sind, im Rahmen seiner allgemeinen Risikomanagementverfahren.

Die Art und der Umfang der zu Stichtagen der Bilanz ausstehenden Finanzinstrumente und die vom Fonds eingesetzten Risikomanagementverfahren werden nachstehend diskutiert.

Die folgende Zusammenfassung soll keine ausführliche Zusammenfassung aller Risiken sein, und Anleger werden für eine detailliertere Diskussion der mit Anlagen in den Fonds verbundenen Risiken auf den Prospekt verwiesen.

Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder die künftigen Cashflows von Finanzinstrumenten aufgrund von Änderungen von Marktvariablen wie Zinssätzen, Wechselkursen und Wertpapierkursen schwanken.

Das Marktrisiko umfasst u. a. Aktienrisiken, Zinsrisiken, Kreditspannenrisiken, Schwankungs- und Fremdwährungsrisiken. Inwieweit er diesen Risikofaktoren ausgesetzt ist, wird entweder mittels dem „Value at Risk“- („VaR“) oder dem Commitment-Ansatz bewertet und überwacht.

Der Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates, der Man GLG Global Emerging Markets Bond, der GLG Pan European Equity Growth und der MAN GLG RI Sustainable Growth verwenden den relativen VaR-Ansatz für das Risikomanagement (absoluter VaR/relativer VaR).

Alle verbleibenden Portfolios verwenden den Commitment-Ansatz für das Risikomanagement.

Die nachfolgende Tabelle zeigt den im Jahr 2022 für das Portfolio berechneten VaR. Ein Monte Carlo VaR-Modell wird täglich berechnet, mit einem Konfidenzintervall von 99 %, über einen Halbezeitraum von 20 Tagen, unter Verwendung eines historischen Beobachtungszeitraums von mindestens 1 Jahr. Dies bedeutet, dass das Portfolio erwartungsgemäß in 99 % der Zeit nicht mehr als den angegebenen Verlust verzeichnet. Die Ergebnisse basieren auf in der Vergangenheit beobachteten Korrelationen und Volatilitäten, die eventuell keine exakten Prognosen für die Zukunft darstellen.

Die nachfolgende Tabelle zeigt den VaR des Fonds auf der Basis von 2x Benchmark-VaR zum 31. Dezember 2022 und 2021:

Name des Fonds	Benchmark		Relativer VaR im Jahr 2022	Relativer VaR im Jahr 2021
Man GLG Pan-European Equity Growth	MSCI Europe (EUR, NDTR)	Min.	1,35	0,86
		Max.	1,74	1,78
		Mittelwert	1,49	1,42
		Jahresende	1,43	1,41
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD	Min.	0,71	0,72
		Max.	0,99	0,98
		Mittelwert	0,85	0,84
		Jahresende	0,89	0,76
Man GLG RI Global Sustainable Growth	MSCI World Total Return Net Dividend	Min.	0,13	1,07
		Max.	1,63	1,69
		Mittelwert	1,30	1,44
		Jahresende	1,28	1,33
Man GLG Global Emerging Markets Bond	J.P. Morgan EMBI Global Composite	Min.	0,71	0,73
		Max.	1,12	0,88
		Mittelwert	0,90	0,79
		Jahresende	0,87	0,77

Zinsrisiko

Zinsrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder die künftigen Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Änderungen der Marktzinssätze schwanken.

Der Fonds ist mit seinen bei Banken vorgehaltenen liquiden Mitteln, bei den Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern und bei bestimmten Derivatkontrakten einem Zinsrisiko ausgesetzt. Dieses Risiko ist aufgrund des allgemein kurzfristigen Charakters dieser Bestände nicht unbedingt wesentlich. Ein bedeutenderes Risiko besteht jedoch dahingehend, dass sich Änderungen von Zinssätzen positiv oder negativ auf den Wert aller vom Fonds gehaltenen Finanzinstrumente auswirken.

Der Fonds ist über seine Anlage in Schuldtiteln direkt dem Zinsrisiko ausgesetzt. Die Anlagestrategie ist bewusst darauf ausgelegt, Renditen durch Handelsstrategien zu erzielen, die sich darauf konzentrieren, Zinssatzdifferenzen auszunutzen. Die Sensitivität dieser Engagements wird anhand der im Abschnitt „Marktrisiko“ bereitgestellten VaR-Gesamtanalyse modelliert. Kurzfristige staatliche Schatzwechsel sind in den Tabellen auf den folgenden Seiten als keinem Zinsänderungsrisiko ausgesetzt ausgewiesen.

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Die folgenden Tabellen enthalten ausführliche Informationen zur Exponierung des Fonds gegenüber dem Zinsrisiko, jeweils nach entweder Fälligkeit oder Zinsanpassung (je nachdem, welcher Zeitpunkt früher liegt):

Man GLG Global Convertibles

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	10.957.430	-	-	-	10.957.430
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	5.141.909	-	-	-	5.141.909
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	920.068	920.068
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	118.781.156	-	1.316.614	120.097.770
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	39	39
Zinsforderungen	-	-	-	285.927	285.927
Sonstige Aktiva	-	-	-	103.251	103.251
Summe Aktiva	16.099.339	118.781.156	-	2.625.899	137.506.394
Passiva					
Überziehungskredite	878.476	-	-	-	878.476
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3.503.144	-	-	-	3.503.144
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	1.724.120	1.724.120
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	6.372	6.372
Fällige Managementgebühren	-	-	-	80.920	80.920
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	6.581	6.581
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	240.712	240.712
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	4.381.620	-	-	2.058.705	6.440.325
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	11.717.719	118.781.156	-	567.194	131.066.069
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	42.556.187	-	-	-	42.556.187
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	212.173	-	-	-	212.173
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	63.959.217	-	131.196.235	195.155.452
Zinsforderungen	-	-	-	181.773	181.773
Sonstige Aktiva	-	-	-	115.267	115.267
Summe Aktiva	42.768.360	63.959.217	-	131.493.275	238.220.852
Passiva					
Überziehungskredite	58	-	-	-	58
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	460.000	-	-	-	460.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	518.313	518.313
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	344.321	344.321
Fällige Managementgebühren	-	-	-	179.746	179.746
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	276.981	276.981
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	460.058	-	-	1.319.361	1.779.419
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	42.308.302	63.959.217	-	130.173.914	236.441.433

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI European Equity Leaders

	Weniger als ein Monat EUR	Ein Monat bis ein Jahr EUR	Mehr als ein Jahr EUR	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt EUR	Summe EUR
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	77.959.577	-	-	-	77.959.577
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	5.037.279	-	-	-	5.037.279
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	5.186	5.186
Dividendenforderungen	-	-	-	111.664	111.664
Sonstige Aktiva	-	-	-	356.480	356.480
Summe Aktiva	82.996.856	-	-	473.330	83.470.186
Passiva					
Überziehungskredite	10.530	-	-	-	10.530
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	1.418.259	1.418.259
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	2.136	2.136
Fällige Managementgebühren	-	-	-	59.350	59.350
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	175.763	175.763
Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren	-	-	-	4.842	4.842
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	229.084	229.084
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	10.530	-	-	1.889.434	1.899.964
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	82.986.326	-	-	(1.416.104)	81.570.222
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	7.009.184	-	-	-	7.009.184
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	4.030.000	-	-	-	4.030.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	254.081.232	254.081.232
Zinsforderungen	-	-	-	62	62
Sonstige Aktiva	-	-	-	630.196	630.196
Summe Aktiva	11.039.184	-	-	254.711.490	265.750.674
Passiva					
Überziehungskredite	556	-	-	-	556
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	2.879.057	2.879.057
Fällige Managementgebühren	-	-	-	177.180	177.180
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	301	301
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	284.795	284.795
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	556	-	-	3.341.333	3.341.889
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	11.038.628	-	-	251.370.157	262.408.785

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

	Weniger als ein Monat JPY	Ein Monat bis ein Jahr JPY	Mehr als ein Jahr JPY	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt JPY	Summe JPY
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	6.185.868.786	-	-	-	6.185.868.786
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	1.835.582.368	1.835.582.368
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	264.222.762.330	264.222.762.330
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	5.066.495	5.066.495
Dividendenforderungen	-	-	-	303.360.131	303.360.131
Sonstige Aktiva	-	-	-	153.040.214	153.040.214
Summe Aktiva	6.185.868.786	-	-	266.519.811.538	272.705.680.324
Passiva					
Überziehungskredite	847.650	-	-	-	847.650
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	3.306.505.621	3.306.505.621
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	2.835.478.019	2.835.478.019
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	272.858.607	272.858.607
Fällige Managementgebühren	-	-	-	162.473.442	162.473.442
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	317.587.825	317.587.825
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	847.650	-	-	6.894.903.514	6.895.751.164
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	6.185.021.136	-	-	259.624.908.024	265.809.929.160
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	2.343.482.643	-	-	-	2.343.482.643
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	184.433.267	184.433.267
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	167.331.924.091	167.331.924.091
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	214.594.019	214.594.019
Dividendenforderungen	-	-	-	114.002.875	114.002.875
Sonstige Aktiva	-	-	-	76.273.140	76.273.140
Summe Aktiva	2.343.482.643	-	-	167.921.227.392	170.264.710.035
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	57.052	-	-	-	57.052
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	186.394.345	186.394.345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	376.564.888	376.564.888
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	453.402.589	453.402.589
Fällige Managementgebühren	-	-	-	103.398.959	103.398.959
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	173.478.130	173.478.130
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	57.052	-	-	1.293.238.911	1.293.295.963
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	2.343.425.591	-	-	166.627.988.481	168.971.414.072

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Emerging Markets Equity

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	31.499.046	-	-	-	31.499.046
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt	529.834	-	-	-	529.834
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	89.466.773	-	-	-	89.466.773
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	2.136.647	2.136.647
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	389.635.028	389.635.028
Dividendenforderungen	-	-	-	2.056.759	2.056.759
Sonstige Aktiva	-	-	-	297.464	297.464
Summe Aktiva	121.495.653	-	-	394.125.898	515.621.551
Passiva					
Überziehungskredite	49.948	-	-	-	49.948
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	78.974.691	-	-	-	78.974.691
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	3.156.230	3.156.230
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	3.346.999	3.346.999
Anteilhabertransaktionen	-	-	-	13.104	13.104
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	212.968	212.968
Fällige Managementgebühren	-	-	-	260.298	260.298
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	159.675	159.675
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	624.991	624.991
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettvermögen)	79.024.639	-	-	7.774.265	86.798.904
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettvermögen	42.471.014	-	-	386.351.633	428.822.647
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	32.285.392	-	-	-	32.285.392
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	106.271.709	-	-	-	106.271.709
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	2.327.479	2.327.479
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	625.589.426	625.589.426
Dividendenforderungen	-	-	-	1.503.135	1.503.135
Sonstige Aktiva	-	-	-	196.321	196.321
Summe Aktiva	138.557.101	-	-	629.616.361	768.173.462
Passiva					
Überziehungskredite	154	-	-	-	154
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	102.086.683	-	-	-	102.086.683
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	3.222.069	3.222.069
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	3.447.731	3.447.731
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	1.678.536	1.678.536
Fällige Managementgebühren	-	-	-	384.899	384.899
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	39.815	39.815
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	716.920	716.920
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettvermögen)	102.086.837	-	-	9.489.970	111.576.807
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettvermögen	36.470.264	-	-	620.126.391	656.596.655

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	824.550	-	-	-	824.550
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	55.592	-	-	-	55.592
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	64.357	64.357
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	20.377.338	20.377.338
Zinsforderungen	-	-	-	263	263
Dividendenforderungen	-	-	-	8.734	8.734
Sonstige Aktiva	-	-	-	81.065	81.065
Summe Aktiva	880.142	-	-	20.531.757	21.411.899
Passiva					
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	26.440	26.440
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	14.310	14.310
Fällige Managementgebühren	-	-	-	12.940	12.940
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	91.631	91.631
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	145.321	145.321
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	880.142	-	-	20.386.436	21.266.578
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.108.404	-	-	-	1.108.404
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	77.259	-	-	-	77.259
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	159.777	159.777
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	25.994.042	25.994.042
Dividendenforderungen	-	-	-	14.678	14.678
Sonstige Aktiva	-	-	-	66.957	66.957
Summe Aktiva	1.185.663	-	-	26.235.454	27.421.117
Passiva					
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	163.209	163.209
Fällige Managementgebühren	-	-	-	16.403	16.403
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	84.512	84.512
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	264.124	264.124
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.185.663	-	-	25.971.330	27.156.993

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	1.521.547	-	-	-	1.521.547
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	502.764	-	-	-	502.764
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	12	12
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	53.740.094	-	28.905.214	82.645.308
Zinsforderungen	-	-	-	857.207	857.207
Sonstige Aktiva	-	-	-	67.774	67.774
Summe Aktiva	2.024.311	53.740.094	-	29.830.207	85.594.612
Passiva					
Überziehungskredite	2	-	-	-	2
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	679.246	-	-	-	679.246
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	390	390
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	44.688	601.288	645.976
Fällige Managementgebühren	-	-	-	41.259	41.259
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	7.581	7.581
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	173.453	173.453
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	679.248	-	44.688	823.971	1.547.907
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.345.063	53.740.094	(44.688)	29.006.236	84.046.705
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.249.076	-	-	-	1.249.076
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	635.713	-	-	-	635.713
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	12	12
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	51.542.042	113.425	35.020.366	86.675.833
Zinsforderungen	-	-	-	838.403	838.403
Sonstige Aktiva	-	-	-	119.796	119.796
Summe Aktiva	1.884.789	51.542.042	113.425	35.978.577	89.518.833
Passiva					
Überziehungskredite	69	-	-	-	69
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	134.919	-	-	-	134.919
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	345	345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	11.433	1.413.417	1.424.850
Fällige Managementgebühren	-	-	-	45.540	45.540
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	7.007	7.007
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	158.485	158.485
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	134.988	-	11.433	1.624.794	1.771.215
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.749.801	51.542.042	101.992	34.353.783	87.747.618

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Bond

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	541.239	-	-	-	541.239
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	27.292.584	-	6.691.503	33.984.087
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	16	16
Zinsforderungen	-	-	-	447.296	447.296
Sonstige Aktiva	-	-	-	37.698	37.698
Summe Aktiva	541.239	27.292.584	-	7.176.513	35.010.336
Passiva					
Überziehungskredite	20	-	-	-	20
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	120.296	-	-	-	120.296
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	180	180
Fällige Managementgebühren	-	-	-	12.337	12.337
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	7.718	7.718
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	147.251	147.251
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	120.316	-	-	167.486	287.802
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	420.923	27.292.584	-	7.009.027	34.722.534
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	302.747	-	-	-	302.747
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	42.529.527	-	9.624.168	52.153.695
Zinsforderungen	-	-	-	443.170	443.170
Sonstige Aktiva	-	-	-	57.540	57.540
Summe Aktiva	302.747	42.529.527	-	10.124.878	52.957.152
Passiva					
Überziehungskredite	25	-	-	-	25
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	120.000	-	-	-	120.000
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	244.750	-	-	-	244.750
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	1.858	1.858
Fällige Managementgebühren	-	-	-	21.510	21.510
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	149.288	149.288
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	364.775	-	-	172.656	537.431
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	(62.028)	42.529.527	-	9.952.222	52.419.721

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Pan-European Equity Growth

	Weniger als ein Monat EUR	Ein Monat bis ein Jahr EUR	Mehr als ein Jahr EUR	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt EUR	Summe EUR
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	3.944.168	-	-	-	3.944.168
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	440.078	-	-	-	440.078
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	200.992.600	200.992.600
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	1.153	1.153
Zinsforderungen	-	-	-	576	576
Sonstige Aktiva	-	-	-	224.084	224.084
Summe Aktiva	4.384.246	-	-	201.218.413	205.602.659
Passiva					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	834.017	834.017
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	8.497	8.497
Fällige Managementgebühren	-	-	-	107.322	107.322
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	335.005	335.005
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	1.284.841	1.284.841
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	4.384.246	-	-	199.933.572	204.317.818
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	4.354.948	-	-	-	4.354.948
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	446.720.314	446.720.314
Sonstige Aktiva	-	-	-	259.704	259.704
Summe Aktiva	4.354.948	-	-	446.980.018	451.334.966
Passiva					
Überziehungskredite	8	-	-	-	8
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	630.000	-	-	-	630.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	109.814	109.814
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	23.068	23.068
Fällige Managementgebühren	-	-	-	247.162	247.162
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	241	241
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	503.115	503.115
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	630.008	-	-	883.400	1.513.408
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	3.724.940	-	-	446.096.618	449.821.558

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	293.768	-	-	-	293.768
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	577	577
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	5.643.680	5.643.680
Zinsforderungen	-	-	-	90	90
Dividendenforderungen	-	-	-	211	211
Sonstige Aktiva	-	-	-	90.030	90.030
Summe Aktiva	293.768	-	-	5.734.588	6.028.356
Passiva					
Überziehungskredite	30	-	-	-	30
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	36.041	36.041
Fällige Managementgebühren	-	-	-	3.771	3.771
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	118.305	118.305
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	30	-	-	158.117	158.147
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	293.738	-	-	5.576.471	5.870.209
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	12.140.710	-	-	-	12.140.710
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	225.068.261	225.068.261
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	2.288	2.288
Dividendenforderungen	-	-	-	166	166
Sonstige Aktiva	-	-	-	140.580	140.580
Summe Aktiva	12.140.710	-	-	225.211.295	237.352.005
Passiva					
Überziehungskredite	2.179	-	-	-	2.179
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	4.942.288	-	-	-	4.942.288
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	109	109
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	1.122.330	1.122.330
Fällige Managementgebühren	-	-	-	65.625	65.625
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	232.913	232.913
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	4.944.467	-	-	1.420.977	6.365.444
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	7.196.243	-	-	223.790.318	230.986.561

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)

	Weniger als ein Monat EUR	Ein Monat bis ein Jahr EUR	Mehr als ein Jahr EUR	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt EUR	Summe EUR
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	1.173.878	-	-	-	1.173.878
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	89.759	-	-	-	89.759
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	139.897	139.897
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	29.444.016	29.444.016
Zinsforderungen	-	-	-	174	174
Dividendenforderungen	-	-	-	10.704	10.704
Sonstige Aktiva	-	-	-	81.650	81.650
Summe Aktiva	1.263.637	-	-	29.676.441	30.940.078
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	28	-	-	-	28
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	112.922	112.922
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	55.809	55.809
Fällige Managementgebühren	-	-	-	19.222	19.222
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	101.273	101.273
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	28	-	-	289.226	289.254
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.263.609	-	-	29.387.215	30.650.824
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.927.142	-	-	-	1.927.142
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	127.846	-	-	-	127.846
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	53.361	53.361
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	21.434.858	21.434.858
Dividendenforderungen	-	-	-	21.432	21.432
Sonstige Aktiva	-	-	-	79.776	79.776
Summe Aktiva	2.054.988	-	-	21.589.427	23.644.415
Passiva					
Überziehungskredite	2	-	-	-	2
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	51.783	51.783
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	433	433
Fällige Managementgebühren	-	-	-	15.595	15.595
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	101	101
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	80.254	80.254
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	2	-	-	148.166	148.168
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	2.054.986	-	-	21.441.261	23.496.247

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)

	Weniger als ein Monat EUR	Ein Monat bis ein Jahr EUR	Mehr als ein Jahr EUR	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt EUR	Summe EUR
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	385.551	-	-	-	385.551
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	25.610.928	25.610.928
Zinsforderungen	-	-	-	63	63
Sonstige Aktiva	-	-	-	192.840	192.840
Summe Aktiva	385.551	-	-	25.803.831	26.189.382
Passiva					
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	1.449	1.449
Fällige Managementgebühren	-	-	-	14.729	14.729
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	98.556	98.556
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	114.734	114.734
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	385.551	-	-	25.689.097	26.074.648
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	8.776	-	-	-	8.776
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	52.439.045	52.439.045
Sonstige Aktiva	-	-	-	211.796	211.796
Summe Aktiva	8.776	-	-	52.650.841	52.659.617
Passiva					
Überziehungskredite	358.305	-	-	-	358.305
Fällige Managementgebühren	-	-	-	32.524	32.524
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	22	22
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	111.750	111.750
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	358.305	-	-	144.296	502.601
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	(349.529)	-	-	52.506.545	52.157.016

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric China A Equity

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	628.385	-	-	-	628.385
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	103.671	-	-	-	103.671
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	18.105.227	18.105.227
Zinsforderungen	-	-	-	212	212
Sonstige Aktiva	-	-	-	23.216	23.216
Summe Aktiva	732.056	-	-	18.128.655	18.860.711
Passiva					
Überziehungskredite	15.446	-	-	-	15.446
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	81.418	81.418
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	26.544	26.544
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	1.004	1.004
Fällige Managementgebühren	-	-	-	16.668	16.668
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	102.229	102.229
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	15.446	-	-	227.863	243.309
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	716.610	-	-	17.900.792	18.617.402
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.967.339	-	-	-	1.967.339
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	124.696	-	-	-	124.696
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	31.518.285	31.518.285
Sonstige Aktiva	-	-	-	41.673	41.673
Summe Aktiva	2.092.035	-	-	31.559.958	33.651.993
Passiva					
Überziehungskredite	6	-	-	-	6
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	266.683	266.683
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	10.977	10.977
Fällige Managementgebühren	-	-	-	29.869	29.869
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	109.418	109.418
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	6	-	-	416.947	416.953
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	2.092.029	-	-	31.143.011	33.235.040

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Strategic Bond

	Weniger als ein Monat GBP	Ein Monat bis ein Jahr GBP	Mehr als ein Jahr GBP	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt GBP	Summe GBP
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	19.101.660	-	-	-	19.101.660
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	291.415	-	-	-	291.415
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	10.699.490	10.699.490
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	219.803.964	11.043.987	17.948.096	248.796.047
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	12.554	12.554
Zinsforderungen	-	-	-	2.846.390	2.846.390
Dividendenforderungen	-	-	-	54.875	54.875
Sonstige Aktiva	-	-	-	166.428	166.428
Summe Aktiva	19.393.075	219.803.964	11.043.987	31.727.833	281.968.859
Passiva					
Überziehungskredite	879.753	-	-	-	879.753
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	15.371.175	-	-	-	15.371.175
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	9.777.356	9.777.356
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	6.735.149	6.735.149
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	128.387	128.387
Fällige Managementgebühren	-	-	-	82.263	82.263
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	386.635	386.635
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	16.250.928	-	-	17.109.790	33.360.718
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	3.142.147	219.803.964	11.043.987	14.618.043	248.608.141
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	629.296	-	-	-	629.296
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3.718.365	-	-	-	3.718.365
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	11.888.984	11.888.984
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	242.551.053	-	37.764.661	280.315.714
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	5.741	5.741
Zinsforderungen	-	-	-	2.333.697	2.333.697
Dividendenforderungen	-	-	-	88.661	88.661
Sonstige Aktiva	-	-	-	141.438	141.438
Summe Aktiva	4.347.661	242.551.053	-	52.223.182	299.121.896
Passiva					
Überziehungskredite	45.546	-	-	-	45.546
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	4	-	-	-	4
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	6.849.258	6.849.258
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	59.401	59.401
Fällige Managementgebühren	-	-	-	103.160	103.160
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	442	442
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	357.890	357.890
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	45.550	-	-	7.370.151	7.415.701
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	4.302.111	242.551.053	-	44.853.031	291.706.195

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	5.692.016	-	-	-	5.692.016
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	1.979.352	-	-	-	1.979.352
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	54.322.499	54.322.499
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	114	114
Zinsforderungen	-	-	-	2.155	2.155
Dividendenforderungen	-	-	-	19.001	19.001
Sonstige Aktiva	-	-	-	63.531	63.531
Summe Aktiva	7.671.368	-	-	54.407.300	62.078.668
Passiva					
Überziehungskredite	114	-	-	-	114
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	531.940	-	-	-	531.940
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	162.783	162.783
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	40	40
Fällige Managementgebühren	-	-	-	28.509	28.509
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	131.215	131.215
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	532.054	-	-	322.547	854.601
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	7.139.314	-	-	54.084.753	61.224.067
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	7.104.343	-	-	-	7.104.343
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	120.000	-	-	-	120.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	75.109.745	75.109.745
Dividendenforderungen	-	-	-	65.145	65.145
Sonstige Aktiva	-	-	-	157.179	157.179
Summe Aktiva	7.224.343	-	-	75.332.069	82.556.412
Passiva					
Überziehungskredite	6	-	-	-	6
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	305.214	-	-	-	305.214
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	169.635	169.635
Fällige Managementgebühren	-	-	-	39.499	39.499
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	45	45
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	139.208	139.208
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	305.220	-	-	348.387	653.607
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	6.919.123	-	-	74.983.682	81.902.805

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric US High Yield

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	315.909	-	-	-	315.909
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	35.714.137	-	-	35.714.137
Zinsforderungen	-	-	-	701.004	701.004
Sonstige Aktiva	-	-	-	11.558	11.558
Summe Aktiva	315.909	35.714.137	-	712.562	36.742.608
Passiva					
Fällige Managementgebühren	-	-	-	15.275	15.275
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	107	107
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	121.734	121.734
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	137.116	137.116
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	315.909	35.714.137	-	575.446	36.605.492
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	974.740	-	-	-	974.740
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	102.373.751	-	-	102.373.751
Zinsforderungen	-	-	-	1.561.045	1.561.045
Sonstige Aktiva	-	-	-	72.203	72.203
Summe Aktiva	974.740	102.373.751	-	1.633.248	104.981.739
Passiva					
Fällige Managementgebühren	-	-	-	43.498	43.498
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	185.067	185.067
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	228.565	228.565
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	974.740	102.373.751	-	1.404.683	104.753.174

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	5.403.177	-	-	-	5.403.177
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	5.901.297	-	-	-	5.901.297
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	15.722.680	15.722.680
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	184.234.283	125.411	3.851.374	188.211.068
Zinsforderungen	-	-	-	2.973.092	2.973.092
Sonstige Aktiva	-	-	-	121.642	121.642
Summe Aktiva	11.304.474	184.234.283	125.411	22.668.788	218.332.956
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	2.680.000	-	-	-	2.680.000
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	31.387.723	-	-	-	31.387.723
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	652.283	2.037.116	2.689.399
Pensionsgeschäfte	21.462.250	-	-	-	21.462.250
Fällige Managementgebühren	-	-	-	32.930	32.930
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	140.635	140.635
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	225.848	225.848
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	55.529.973	-	652.283	2.436.529	58.618.785
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	(44.225.499)	184.234.283	(526.872)	20.232.259	159.714.171
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.726.177	-	-	-	1.726.177
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	1.052.069	-	-	-	1.052.069
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	33.419.206	20.779	1.664.870	35.104.855
Zinsforderungen	-	-	-	321.294	321.294
Sonstige Aktiva	-	-	-	62.441	62.441
Summe Aktiva	2.778.246	33.419.206	20.779	2.048.605	38.266.836
Passiva					
Überziehungskredite	975	-	-	-	975
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	339.057	339.057
Pensionsgeschäfte	4.216.684	-	-	-	4.216.684
Fällige Managementgebühren	-	-	-	10.221	10.221
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	908	908
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	44.710	44.710
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	4.217.659	-	-	394.896	4.612.555
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	(1.439.413)	33.419.206	20.779	1.653.709	33.654.281

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG China Equity

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	149.069	-	-	-	149.069
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	327.580	-	-	-	327.580
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	9.779.482	9.779.482
Sonstige Aktiva	-	-	-	91.404	91.404
Summe Aktiva	476.649	-	-	9.870.886	10.347.535
Passiva					
Überziehungskredite	4.371	-	-	-	4.371
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	179.055	-	-	-	179.055
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	294.747	294.747
Fällige Managementgebühren	-	-	-	5.990	5.990
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	1.163	1.163
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	94.798	94.798
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	183.426	-	-	396.698	580.124
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	293.223	-	-	9.474.188	9.767.411
31. Dezember 2021					
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.447.827	-	-	-	1.447.827
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	510.000	-	-	-	510.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	10.113.939	10.113.939
Zinsforderungen	-	-	-	158	158
Sonstige Aktiva	-	-	-	22.818	22.818
Summe Aktiva	1.957.827	-	-	10.136.915	12.094.742
Passiva					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	136.201	136.201
Fällige Managementgebühren	-	-	-	4.099	4.099
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	23.966	23.966
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	164.266	164.266
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.957.827	-	-	9.972.649	11.930.476

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy

31. Dezember 2022	Weniger als ein Monat EUR	Ein Monat bis ein Jahr EUR	Mehr als ein Jahr EUR	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt EUR	Summe EUR
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	649.953	-	-	-	649.953
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	115.939	-	-	-	115.939
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	-	-	34.006.850	34.006.850
Zinsforderungen	-	-	-	98	98
Dividendenforderungen	-	-	-	42.841	42.841
Sonstige Aktiva	-	-	-	129.346	129.346
Summe Aktiva	765.892	-	-	34.179.135	34.945.027
Passiva					
Überziehungskredite	2.647	-	-	-	2.647
Fällige Managementgebühren	-	-	-	22.080	22.080
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	109.716	109.716
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	2.647	-	-	131.796	134.443
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	763.245	-	-	34.047.339	34.810.584

Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy hat seine Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022 aufgenommen, daher sind keine Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ausgewiesen.

Man GLG Sustainable Strategic Income

31. Dezember 2022	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	1.344.585	-	-	-	1.344.585
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	348.507	-	-	-	348.507
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	15.462.358	-	130.847	15.593.205
Zinsforderungen	-	-	-	209.018	209.018
Sonstige Aktiva	-	-	-	43.790	43.790
Summe Aktiva	1.693.092	15.462.358	-	383.655	17.539.105
Passiva					
Überziehungskredite	1.105.051	-	-	-	1.105.051
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	214.253	214.253
Fällige Managementgebühren	-	-	-	6.207	6.207
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	82.280	82.280
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	1.105.051	-	-	302.740	1.407.791
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	588.041	15.462.358	-	80.915	16.131.314

Der Man GLG Sustainable Strategic Income hat seine Geschäftstätigkeit am 23. März 2022 aufgenommen, daher sind keine Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ausgewiesen.

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Dynamic Income

31. Dezember 2022	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.505.716	-	-	-	1.505.716
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	855.287	-	-	-	855.287
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	6.278.133	6.278.133
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	31.580.790	-	120.076	31.700.866
Zinsforderungen	-	-	-	519.720	519.720
Sonstige Aktiva	-	-	-	92.313	92.313
Summe Aktiva	2.361.003	31.580.790	-	7.010.242	40.952.035
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	220.010	-	-	-	220.010
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	12.548.608	-	-	-	12.548.608
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	278.785	278.785
Pensionsgeschäfte	4.347.389	-	-	-	4.347.389
Fällige Managementgebühren	-	-	-	9.430	9.430
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	26.502	26.502
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	80.479	80.479
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	17.116.007	-	-	395.196	17.511.203
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	(14.755.004)	31.580.790	-	6.615.046	23.440.832

Der Man GLG Dynamic Income hat seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2022 aufgenommen, daher sind keine Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 ausgewiesen.

Bei den Verbindlichkeiten, die keinem Zinsrisiko ausgesetzt sind, handelt es sich um erfolgswirksam bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstigen Verbindlichkeiten. Diese Beträge erfordern normalerweise eine vertragliche Abwicklung innerhalb eines Quartals und in allen Fällen innerhalb eines Jahres.

Die folgenden Tabellen liefern ausführliche Informationen zu den Auswirkungen eines Anstiegs/Rückgangs der Zinssätze um 50 Basispunkte (Bp) auf das Nettovermögen bei ansonsten unveränderten Bedingungen, beruhend auf der Annahme, dass ein Anstieg/Rückgang des Basiszinssatzes um 50 Bp einen entsprechenden Anstieg/Rückgang des Werts des Nettovermögens um 50 Bp zur Folge haben würde. In Wirklichkeit hätte ein Anstieg/Rückgang um 50 Bp keinen direkt korrelierenden Anstieg/Rückgang des beizulegenden Zeitwerts des Nettovermögens zur Folge, da die Veränderung des Werts des Nettovermögens von der jeweiligen Anlageklasse und/oder der Marktstimmung bezüglich der Zinsempfindlichkeit abhängen würde. Die im Abschnitt „Marktrisiko“ dargestellten Volatilitätskennzahlen erfassen - neben anderen Variablen - diese tatsächlichen Zinsempfindlichkeiten.

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
<i>Man GLG Global Convertibles</i>					
31. Dezember 2022					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	11.776.308	119.375.062	-	567.194	131.718.564
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	11.659.130	118.187.250	-	567.194	130.413.574
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	42.519.844	64.279.013	-	130.173.914	236.972.771
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	42.096.760	63.639.421	-	130.173.914	235.910.095
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>					
31. Dezember 2022	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	83.401.258	-	-	(1.416.104)	81.985.154
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	82.571.394	-	-	(1.416.104)	81.155.290
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	11.093.821	-	-	251.370.157	262.463.978
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	10.983.435	-	-	251.370.157	262.353.592
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>					
31. Dezember 2022	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	6.215.946.242	-	-	259.624.908.024	265.840.854.266
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	6.154.096.030	-	-	259.624.908.024	265.779.004.054
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	2.355.142.719	-	-	166.627.988.481	168.983.131.200
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	2.331.708.463	-	-	166.627.988.481	168.959.696.944
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	42.683.369	-	-	386.351.633	429.035.002
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	42.258.659	-	-	386.351.633	428.610.292
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	36.652.615	-	-	620.126.391	656.779.006
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	36.287.913	-	-	620.126.391	656.414.304
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	884.543	-	-	20.386.436	21.270.979
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	875.741	-	-	20.386.436	21.262.177

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Global RI Climate

(vormals Man Numeric RI Global Equity)

(Fortsetzung)

31. Dezember 2021

	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	1.191.591	-	-	25.971.330	27.162.921
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	1.179.735	-	-	25.971.330	27.151.065

Man GLG Global Emerging Markets

Local Currency Rates

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	1.351.788	54.008.794	(44.911)	29.151.267	84.466.938
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	1.338.338	53.471.394	(44.465)	28.861.205	83.626.472

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	1.758.550	51.799.752	102.502	34.353.783	88.014.587
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	1.741.052	51.284.332	101.482	34.353.783	87.480.649

Man GLG Global Emerging Markets

Bond

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	423.028	27.429.047	-	7.009.027	34.861.102
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	418.818	27.156.121	-	7.009.027	34.583.966

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	(62.338)	42.742.175	-	9.952.222	52.632.059
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	(61.718)	42.316.879	-	9.952.222	52.207.383

Man GLG Pan-European Equity Growth

31. Dezember 2022

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	4.406.167	-	-	199.933.572	204.339.739
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	4.362.325	-	-	199.933.572	204.295.897

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	3.743.565	-	-	446.096.618	449.840.183
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	3.706.315	-	-	446.096.618	449.802.933

Man GLG RI Global Sustainable Growth

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	295.207	-	-	5.576.471	5.871.678
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	292.269	-	-	5.576.471	5.868.740

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	7.232.224	-	-	223.790.318	231.022.542
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	7.160.262	-	-	223.790.318	230.950.580

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Europe RI Climate

(vormals Man Numeric RI European Equity)

31. Dezember 2022

	Weniger als ein Monat EUR	Ein Monat bis ein Jahr EUR	Mehr als ein Jahr EUR	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt EUR	Summe EUR
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	1.269.927	-	-	29.387.215	30.657.142
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	1.257.291	-	-	29.387.215	30.644.506

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	2.065.261	-	-	21.441.261	23.506.522
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	2.044.711	-	-	21.441.261	23.485.972

Man GLG RI Sustainable European Income

31. Dezember 2022

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	387.479	-	-	25.689.097	26.076.576
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	383.623	-	-	25.689.097	26.072.720

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	(351.277)	-	-	52.506.545	52.155.268
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	(347.781)	-	-	52.506.545	52.158.764

Man Numeric China A Equity

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	720.193	-	-	17.900.792	18.620.985
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	713.027	-	-	17.900.792	18.613.819

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	2.102.489	-	-	31.143.011	33.245.500
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	2.081.569	-	-	31.143.011	33.224.580

Man GLG Strategic Bond

31. Dezember 2022

	GBP	GBP	GBP	GBP	Summe GBP
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	3.157.858	220.902.984	11.099.207	14.618.043	249.778.092
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	3.126.436	218.704.944	10.988.767	14.618.043	247.438.190

31. Dezember 2021

Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	4.323.622	243.763.808	-	44.853.031	292.940.461
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	4.280.600	241.338.298	-	44.853.031	290.471.929

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

31. Dezember 2022

	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	7.175.011	-	-	54.084.753	61.259.764
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	7.103.617	-	-	54.084.753	61.188.370

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i> <i>(Fortsetzung)</i>	Weniger als ein Monat USD	Ein Monat bis ein Jahr USD	Mehr als ein Jahr USD	Keinem Zinsrisiko ausgesetzt USD	Summe USD
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	6.953.719	-	-	74.983.682	81.937.401
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	6.884.527	-	-	74.983.682	81.868.209
<i>Man Numeric US High Yield</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	317.489	35.892.708	-	575.446	36.785.643
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	314.329	35.535.566	-	575.446	36.425.341
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	979.614	102.885.620	-	1.404.683	105.269.917
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	969.866	101.861.882	-	1.404.683	104.236.431
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	(44.446.626)	185.155.454	(529.506)	20.232.259	160.411.581
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	(44.004.372)	183.313.112	(524.238)	20.232.259	159.016.761
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	(1.446.610)	33.586.302	20.883	1.653.709	33.814.284
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	(1.432.216)	33.252.110	20.675	1.653.709	33.494.278
<i>Man GLG China Equity</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	294.689	-	-	9.474.188	9.768.877
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	291.757	-	-	9.474.188	9.765.945
31. Dezember 2021					
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	1.967.616	-	-	9.972.649	11.940.265
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	1.948.038	-	-	9.972.649	11.920.687
<i>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy</i>					
31. Dezember 2022	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	767.061	-	-	34.047.339	34.814.400
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	759.429	-	-	34.047.339	34.806.768
<i>Man GLG Sustainable Strategic Income</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	590.981	15.539.670	-	80.915	16.211.566
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	585.101	15.385.046	-	80.915	16.051.062
<i>Man GLG Dynamic Income</i>					
31. Dezember 2022	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen nach einem Anstieg um 50 Bp	(14.828.779)	31.738.694	-	6.615.046	23.524.961
Nettovermögen nach einem Rückgang um 50 Bp	(14.681.229)	31.422.886	-	6.615.046	23.356.703

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

Der Fonds ist über seine Anlagestrategie indirekt dem Zinsrisiko ausgesetzt. Die Anlagestrategie ist bewusst darauf ausgelegt, Renditen durch Handelsstrategien zu erzielen, die sich darauf konzentrieren, Zinssatzdifferenzen auszunutzen. Die Sensitivität dieser Engagements wird anhand der im Abschnitt „Marktrisiko“ bereitgestellten VaR-Gesamtanalyse modelliert.

Währungsrisiko

Es besteht ein Währungsrisiko, wenn Kapitalwerte und Verbindlichkeiten in Währungen angegeben werden, die nicht der funktionalen Währung entsprechen, und in Hinsicht auf rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile in einer nicht-funktionalen Währung. Der Fonds kann Devisenterminkontrakte für Währungsspekulationen sowie zur Absicherung seines Engagements in auf Fremdwährungen lautenden Anteilsklassen einsetzen.

Nachfolgend sind die auf Fremdwährungen lautenden monetären Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zusammengefasst:

Man GLG Global Convertibles

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben

	EUR	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	3.715.761	152.974	7.088.695	10.957.430
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	2.377	-	5.139.532	5.141.909
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	920.068	920.068
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	17.396.053	13.134.583	89.567.134	120.097.770
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	39	39
Zinsforderungen	15.215	20.887	249.825	285.927
Sonstige Aktiva	-	-	103.251	103.251
Summe Aktiva	21.129.406	13.308.444	103.068.544	137.506.394
Passiva				
Überziehungskredite	878.437	-	39	878.476
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	36	145.341	3.357.767	3.503.144
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.132.562	189.552	402.006	1.724.120
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	6.372	6.372
Fällige Managementgebühren	-	-	80.920	80.920
Verbindlichkeiten aus Zinsen	(3.392)	11.042	(1.069)	6.581
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	240.712	240.712
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	2.007.643	345.935	4.086.747	6.440.325
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	19.121.763	12.962.509	98.981.797	131.066.069

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben

	EUR	JPY	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	741.530	-	272.238	41.542.419	42.556.187
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	212.173	212.173
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	34.757.729	15.756.843	15.244.769	129.396.111	195.155.452
Zinsforderungen	36.498	376	41.685	103.214	181.773
Sonstige Aktiva	-	-	-	115.267	115.267
Summe Aktiva	35.535.757	15.757.219	15.558.692	171.369.184	238.220.852
Passiva					
Überziehungskredite	-	57	1	-	58
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	460.000	460.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	518.313	518.313
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	344.321	344.321
Fällige Managementgebühren	-	-	-	179.746	179.746
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	276.981	276.981
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	57	1	1.779.361	1.779.419
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	35.535.757	15.757.162	15.558.691	169.589.823	236.441.433

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI European Equity Leaders
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben				Sonstige	EUR	Summe EUR
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt				-	77.959.577	77.959.577
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern				-	5.037.279	5.037.279
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				-	5.186	5.186
Dividendenforderungen				-	111.664	111.664
Sonstige Aktiva				-	356.480	356.480
Summe Aktiva				-	83.470.186	83.470.186
Passiva						
Überziehungskredite				10.530	-	10.530
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				-	1.418.259	1.418.259
Anteilinhabertransaktionen				-	2.136	2.136
Fällige Managementgebühren				-	59.350	59.350
Verbindlichkeiten aus Zinsen				-	175.763	175.763
Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren				-	4.842	4.842
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten				-	229.084	229.084
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)				10.530	1.889.434	1.899.964
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				(10.530)	81.580.752	81.570.222

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben						
	CHF	DKK	GBP	Sonstige	EUR	Summe EUR
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	-	11.910	1.968	6.995.306	7.009.184
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	4.030.000	4.030.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	27.648.070	14.488.634	67.065.550	-	144.878.978	254.081.232
Zinsforderungen	-	-	-	-	62	62
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	630.196	630.196
Summe Aktiva	27.648.070	14.488.634	67.077.460	1.968	156.534.542	265.750.674
Passiva						
Überziehungskredite	513	-	-	43	-	556
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	2.879.057	2.879.057
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	177.180	177.180
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	301	301
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	284.795	284.795
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	513	-	-	43	3.341.333	3.341.889
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	27.647.557	14.488.634	67.077.460	1.925	153.193.209	262.408.785

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem JPY-Gegenwert angegeben			
	Sonstige	JPY	Summe JPY
Aktiva			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	302.650.544	5.883.218.242	6.185.868.786
Forderungen gegenüber Brokern	-	1.835.582.368	1.835.582.368
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	264.222.762.330	264.222.762.330
Forderungen aus Anteilszeichnungen	2.255.100	2.811.395	5.066.495
Dividendenforderungen	-	303.360.131	303.360.131
Sonstige Aktiva	-	153.040.214	153.040.214
Summe Aktiva	304.905.644	272.400.774.680	272.705.680.324
Passiva			
Überziehungskredite	-	847.650	847.650
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	3.306.505.621	3.306.505.621
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	2.835.478.019	2.835.478.019
Anteilinhabertransaktionen	262.488.046	10.370.561	272.858.607
Fällige Managementgebühren	-	162.473.442	162.473.442
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	317.587.825	317.587.825
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	262.488.046	6.633.263.118	6.895.751.164
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	42.417.598	265.767.511.562	265.809.929.160

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem JPY-Gegenwert angegeben			
	Sonstige	JPY	Summe JPY
Aktiva			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	6.559.953	2.336.922.690	2.343.482.643
Forderungen gegenüber Brokern	-	184.433.267	184.433.267
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	167.331.924.091	167.331.924.091
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	214.594.019	214.594.019
Dividendenforderungen	-	114.002.875	114.002.875
Sonstige Aktiva	-	76.273.140	76.273.140
Summe Aktiva	6.559.953	170.258.150.082	170.264.710.035
Passiva			
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	57.052	57.052
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	(23)	186.394.368	186.394.345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	376.564.888	376.564.888
Anteilinhabertransaktionen	-	453.402.589	453.402.589
Fällige Managementgebühren	-	103.398.959	103.398.959
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	173.478.130	173.478.130
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	(23)	1.293.295.986	1.293.295.963
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	6.559.976	168.964.854.096	168.971.414.072

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Emerging Markets Equity
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben						
	HKD	KRW	TWD	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	41.579	178.654	222.746	4.944.092	26.111.975	31.499.046
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – beschränkt	-	-	-	-	-	529.834
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	89.466.773	89.466.773
Forderungen gegenüber Brokern	456.076	455.147	-	697.106	528.318	2.136.647
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	72.659.745	52.289.820	41.037.560	52.046.670	171.601.233	389.635.028
Dividendenforderungen	14.164	1.041.128	49.441	436.380	515.646	2.056.759
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	297.464	297.464
Summe Aktiva	73.171.564	53.964.749	41.309.747	58.654.082	288.521.409	515.621.551
Passiva						
Überziehungskredite	-	-	-	49.948	-	49.948
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	78.974.691	78.974.691
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	320.447	1.075.345	521.130	343.117	896.191	3.156.230
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	3.165.633	181.366	3.346.999
Anteilhabertransaktionen	-	-	-	-	13.104	13.104
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	-	212.968	212.968
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	260.298	260.298
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	159.675	159.675
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	624.991	624.991
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	320.447	1.075.345	521.130	3.558.698	81.323.284	86.798.904
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	72.851.117	52.889.404	40.788.617	55.095.384	207.198.125	428.822.647

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben						
	HKD	KRW	TWD	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	26.050	-	233.920	3.266.067	28.759.355	32.285.392
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	106.271.709	106.271.709
Forderungen gegenüber Brokern	974.138	77.307	540.131	121.658	614.245	2.327.479
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	137.843.975	89.888.918	63.595.695	93.514.437	240.746.401	625.589.426
Dividendenforderungen	53.063	945.610	11.190	181.611	311.661	1.503.135
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	196.321	196.321
Summe Aktiva	138.897.226	90.911.835	64.380.936	97.083.773	376.899.692	768.173.462
Passiva						
Überziehungskredite	-	53	-	101	-	154
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	102.086.683	102.086.683
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	544.928	559.791	543.430	521.963	1.051.957	3.222.069
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	3.378.406	69.325	3.447.731
Zu zahlende Performancegebühren	-	-	-	-	1.678.536	1.678.536
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	384.899	384.899
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	39.815	39.815
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	716.920	716.920
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	544.928	559.844	543.430	3.900.470	106.028.135	111.576.807
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	138.352.298	90.351.991	63.837.506	93.183.303	270.871.557	656.596.655

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

*Man Numeric Global RI Climate
(vormals Man Numeric RI Global Equity)*
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben						
	CAD	EUR	GBP	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	944	9.717	423	37.934	775.532	824.550
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	48.750	1	-	-	6.841	55.592
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	-	64.357	64.357
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.079.351	3.146.524	1.099.142	4.319.863	10.732.458	20.377.338
Zinsforderungen	-	-	-	-	263	263
Dividendenforderungen	1.560	-	2.057	-	5.117	8.734
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	81.065	81.065
Summe Aktiva	1.130.605	3.156.242	1.101.622	4.357.797	11.665.633	21.411.899
Passiva						
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	26.440	-	26.440
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	14.310	14.310
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	12.940	12.940
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	91.631	91.631
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	26.440	118.881	145.321
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.130.605	3.156.242	1.101.622	4.331.357	11.546.752	21.266.578

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben				
	EUR	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	56	150.467	957.881	1.108.404
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	1	52.293	24.965	77.259
Forderungen gegenüber Brokern	-	70.275	89.502	159.777
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.010.462	5.312.639	17.670.941	25.994.042
Dividendenforderungen	-	8.350	6.328	14.678
Sonstige Aktiva	-	-	66.957	66.957
Summe Aktiva	3.010.519	5.594.024	18.816.574	27.421.117
Passiva				
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	45.353	117.856	163.209
Fällige Managementgebühren	-	-	16.403	16.403
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	84.512	84.512
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	45.353	218.771	264.124
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	3.010.519	5.548.671	18.597.803	27.156.993

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben									
	CZK	IDR	MXN	MYR	PLN	ZAR	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva									
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	45.282	240.324	355.819	71.813	-	73.882	124.803	609.624	1.521.547
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	-	502.764	502.764
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	-	12	12
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	7.984.991	7.404.628	8.608.271	5.857.148	5.912.714	4.388.095	13.584.247	28.905.214	82.645.308
Zinsforderungen	45.761	68.489	78.132	44.308	74.510	182.447	363.354	206	857.207
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	-	-	67.774	67.774
Summe Aktiva	8.076.034	7.713.441	9.042.222	5.973.269	5.987.224	4.644.424	14.072.404	30.085.594	85.594.612
Passiva									
Überziehungskredite	-	-	-	-	-	-	2	-	2
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	-	679.246	679.246
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	390	-	390
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	44.688	601.288	645.976
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	-	-	41.259	41.259
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	(310)	-	-	-	-	7.891	-	7.581
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	173.453	173.453
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	(310)	-	-	-	-	52.971	1.495.246	1.547.907
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	8.076.034	7.713.751	9.042.222	5.973.269	5.987.224	4.644.424	14.019.433	28.590.348	84.046.705

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben									
	COP	CZK	IDR	MXN	PEN	Sonstige	USD	Summe USD	
Aktiva									
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	678	-	15.407	4	-	156.971	1.076.016	1.249.076	
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	635.713	635.713	
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	12	12	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.522.475	11.132.015	7.650.724	8.004.634	4.616.785	15.728.834	35.020.366	86.675.833	
Zinsforderungen	125.952	52.565	73.208	65.296	124.182	397.200	-	838.403	
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	-	119.796	119.796	
Summe Aktiva	4.649.105	11.184.580	7.739.339	8.069.934	4.740.967	16.283.005	36.851.903	89.518.833	

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates (Fortsetzung)
Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben	COP	CZK	IDR	MXN	PEN	Sonstige	USD	Summe USD
Passiva								
Überziehungskredite	-	-	-	-	-	69	-	69
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	14.919	120.000	134.919
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	345	-	345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	11.433	1.413.417	1.424.850
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	-	45.540	45.540
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	(341)	-	-	7.246	102	7.007
Passive								
Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	158.485	158.485
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	(341)	-	-	34.012	1.737.544	1.771.215
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	4.649.105	11.184.580	7.739.680	8.069.934	4.740.967	16.248.993	35.114.359	87.747.618

Man GLG Global Emerging Markets Bond
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	5.135	536.104	541.239
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	33.984.087	33.984.087
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	16	16
Zinsforderungen	-	447.296	447.296
Sonstige Aktiva	-	37.698	37.698
Summe Aktiva	5.135	35.005.201	35.010.336
Passiva			
Überziehungskredite	4	16	20
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	120.296	120.296
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	180	180
Fällige Managementgebühren	-	12.337	12.337
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	7.718	7.718
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	147.251	147.251
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	4	287.798	287.802
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	5.131	34.717.403	34.722.534

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung) Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben			
	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva			
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	302.747	302.747
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	-	52.153.695	52.153.695
Zinsforderungen	-	443.170	443.170
Sonstige Aktiva	-	57.540	57.540
Summe Aktiva	-	52.957.152	52.957.152
Passiva			
Überziehungskredite	25	-	25
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	120.000	120.000
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	244.750	244.750
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	1.858	1.858
Fällige Managementgebühren	-	21.510	21.510
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	149.288	149.288
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	25	537.406	537.431
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	(25)	52.419.746	52.419.721

Man GLG Pan-European Equity Growth Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben							
	CHF	DKK	GBP	USD	Sonstige	EUR	Summe EUR
Aktiva							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	10.127	-	179	28.250	-	3.905.612	3.944.168
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	440.078	440.078
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	23.632.956	26.592.632	18.247.014	10.479.137	6.561.069	115.479.792	200.992.600
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	-	-	1.153	1.153
Zinsforderungen	-	-	-	-	-	576	576
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	224.084	224.084
Summe Aktiva	23.643.083	26.592.632	18.247.193	10.507.387	6.561.069	120.051.295	205.602.659
Passiva							
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	834.017	834.017
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	-	-	8.497	8.497
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	107.322	107.322
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	335.005	335.005
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	-	-	1.284.841	1.284.841
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	23.643.083	26.592.632	18.247.193	10.507.387	6.561.069	118.766.454	204.317.818

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Pan-European Equity Growth (Fortsetzung)
Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben						Summe
	CHF	DKK	GBP	Sonstige	EUR	EUR
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	9.648	-	-	17.910	4.327.390	4.354.948
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	56.946.100	49.071.906	56.730.618	24.343.042	259.628.648	446.720.314
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	259.704	259.704
Summe Aktiva	56.955.748	49.071.906	56.730.618	24.360.952	264.215.742	451.334.966
Passiva						
Überziehungskredite	-	-	3	5	-	8
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	630.000	630.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	109.814	109.814
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	-	23.068	23.068
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	247.162	247.162
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	241	241
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	503.115	503.115
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	3	5	1.513.400	1.513.408
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	56.955.748	49.071.906	56.730.615	24.360.947	262.702.342	449.821.558

Man GLG RI Global Sustainable Growth
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben						Summe
	CHF	DKK	EUR	Sonstige	USD	USD
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	-	-	15.478	13.142	265.148	293.768
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	420	157	-	577
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	409.772	649.150	2.090.704	347.351	2.146.703	5.643.680
Zinsforderungen	-	-	-	-	90	90
Dividendenforderungen	-	-	(8.492)	-	8.703	211
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	90.030	90.030
Summe Aktiva	409.772	649.150	2.098.110	360.650	2.510.674	6.028.356
Passiva						
Überziehungskredite	30	-	-	-	-	30
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	36.041	36.041
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	3.771	3.771
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	118.305	118.305
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	30	-	-	-	158.117	158.147
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	409.742	649.150	2.098.110	360.650	2.352.557	5.870.209

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben							Summe
	CHF	DKK	EUR	Sonstige	USD	USD	
Aktiva							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	-	11.371	13.545	12.115.794	12.140.710	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	24.205.964	20.055.612	70.562.732	10.478.187	99.765.766	225.068.261	
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	-	2.288	2.288	
Dividendenforderungen	-	-	(8.492)	-	8.658	166	
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	140.580	140.580	
Summe Aktiva	24.205.964	20.055.612	70.565.611	10.491.732	112.033.086	237.352.005	
Passiva							
Überziehungskredite	-	19	-	2.160	-	2.179	
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	4.942.288	4.942.288	
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	109	-	-	109	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	1.122.330	1.122.330	
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	65.625	65.625	
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	232.913	232.913	
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	19	109	2.160	6.363.156	6.365.444	
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	24.205.964	20.055.593	70.565.502	10.489.572	105.669.930	230.986.561	

Man Numeric Europe RI Climate

(vormals Man Numeric RI European Equity)

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben								Summe
	CHF	DKK	GBP	NOK	SEK	Sonstige	EUR	EUR
Aktiva								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	12.165	52.889	19.474	-	-	4.967	1.084.383	1.173.878
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	89.759	89.759
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	85.075	-	-	54.822	139.897
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.635.153	1.516.396	4.401.445	1.990.641	3.657.451	-	13.242.930	29.444.016
Zinsforderungen	-	-	-	-	-	-	174	174
Dividendenforderungen	-	-	10.704	-	-	-	-	10.704
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	-	81.650	81.650
Summe Aktiva	4.647.318	1.569.285	4.431.623	2.075.716	3.657.451	4.967	14.553.718	30.940.078
Passiva								
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	28	-	28
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	-	-	32	-	-	112.890	112.922
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	55.809	55.809
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	-	19.222	19.222
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	101.273	101.273
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	32	-	28	289.194	289.254
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	4.647.318	1.569.285	4.431.623	2.075.684	3.657.451	4.939	14.264.524	30.650.824

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric Europe RI Climate
(vormals *Man Numeric RI European Equity*) (Fortsetzung)
Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben	CHF	DKK	GBP	NOK	Sonstige	EUR	Summe EUR
Aktiva							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	27.789	44.405	8	40.940	2.131	1.811.869	1.927.142
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	127.846	127.846
Forderungen gegenüber Brokern	7	19.510	10.972	42	6	22.824	53.361
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.344.445	1.198.625	4.574.332	1.221.666	842.874	11.252.916	21.434.858
Dividendenforderungen	-	-	12.652	-	-	8.780	21.432
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	79.776	79.776
Summe Aktiva	2.372.241	1.262.540	4.597.964	1.262.648	845.011	13.304.011	23.644.415
Passiva							
Überziehungskredite	-	-	-	-	2	-	2
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	8.567	-	4.003	8.474	3.019	27.720	51.783
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	433	433
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	15.595	15.595
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	-	101	101
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	80.254	80.254
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	8.567	-	4.003	8.474	3.021	124.103	148.168
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	2.363.674	1.262.540	4.593.961	1.254.174	841.990	13.179.908	23.496.247

Man GLG RI Sustainable European Income
(vormals *Man GLG European Income Opportunities*)
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben	CHF	GBP	Sonstige	EUR	Summe EUR
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	-	35	4.748	380.768	385.551
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.263.329	3.817.539	1.836.616	16.693.444	25.610.928
Zinsforderungen	-	-	-	63	63
Sonstige Aktiva	-	-	-	192.840	192.840
Summe Aktiva	3.263.329	3.817.574	1.841.364	17.267.115	26.189.382
Passiva					
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	1.449	1.449
Fällige Managementgebühren	-	-	-	14.729	14.729
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	13	(13)	-
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	98.556	98.556
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	13	114.721	114.734
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	3.263.329	3.817.574	1.841.351	17.152.394	26.074.648

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable European Income
(vormals Man GLG European Income Opportunities) (Fortsetzung)
Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben							Summe
	CHF	DKK	GBP	SEK	Sonstige	EUR	EUR
Aktiva							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	-	-	-	8.776	-	8.776
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	6.567.404	2.833.922	6.270.379	4.002.600	-	32.764.740	52.439.045
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	211.796	211.796
Summe Aktiva	6.567.404	2.833.922	6.270.379	4.002.600	8.776	32.976.536	52.659.617
Passiva							
Überziehungskredite	30	49	-	-	-	358.226	358.305
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	32.524	32.524
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	13	9	22
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	111.750	111.750
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	30	49	-	-	13	502.509	502.601
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	6.567.374	2.833.873	6.270.379	4.002.600	8.763	32.474.027	52.157.016

Man Numeric China A Equity
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben				Summe
	CNY	Sonstige	USD	USD
Aktiva				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	251	-	628.134	628.385
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	103.671	103.671
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	17.245.778	-	859.449	18.105.227
Zinsforderungen	-	-	212	212
Sonstige Aktiva	-	-	23.216	23.216
Summe Aktiva	17.246.029	-	1.614.682	18.860.711
Passiva				
Überziehungskredite	-	(10.605)	26.051	15.446
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	81.418	-	-	81.418
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	1.004	1.004
Anteilinhabertransaktionen	-	26.544	-	26.544
Fällige Managementgebühren	-	-	16.668	16.668
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	102.229	102.229
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	81.418	15.939	145.952	243.309
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	17.164.611	(15.939)	1.468.730	18.617.402

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric China A Equity (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben				
	CNY	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	-	1.967.339	1.967.339
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	124.696	124.696
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	31.469.807	-	48.478	31.518.285
Sonstige Aktiva	-	-	41.673	41.673
Summe Aktiva	31.469.807	-	2.182.186	33.651.993
Passiva				
Überziehungskredite	-	6	-	6
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	266.673	10	-	266.683
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	10.977	10.977
Fällige Managementgebühren	-	-	29.869	29.869
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	109.418	109.418
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	266.673	16	150.264	416.953
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	31.203.134	(16)	2.031.922	33.235.040

Man GLG Strategic Bond

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem GBP-Gegenwert angegeben					
	EUR	USD	Sonstige	GBP	Summe GBP
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	1.574.418	11.909.577	-	5.617.665	19.101.660
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	65.409	215.961	-	10.045	291.415
Forderungen gegenüber Brokern	10.689.338	10.152	-	-	10.699.490
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	45.235.546	134.107.604	-	69.452.897	248.796.047
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	12.554	12.554
Zinsforderungen	946.093	1.236.426	-	663.871	2.846.390
Dividendenforderungen	-	-	-	54.875	54.875
Sonstige Aktiva	-	-	-	166.428	166.428
Summe Aktiva	58.510.804	147.479.720	-	75.978.335	281.968.859
Passiva					
Überziehungskredite	879.753	-	-	-	879.753
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	14.751.568	-	619.607	15.371.175
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	9.777.356	-	-	9.777.356
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	6.735.149	6.735.149
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	128.387	128.387
Fällige Managementgebühren	-	-	-	82.263	82.263
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	386.635	386.635
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	879.753	24.528.924	-	7.952.041	33.360.718
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	57.631.051	122.950.796	-	68.026.294	248.608.141

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Strategic Bond (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem GBP-Gegenwert angegeben

	AUD	USD	Sonstige	GBP	Summe GBP
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	11.291	277.278	27.997	312.730	629.296
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	1.088.382	2.629.983	3.718.365
Forderungen gegenüber Brokern	-	-	-	11.888.984	11.888.984
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	17.066.359	131.512.457	13.159.103	118.577.795	280.315.714
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	5.741	5.741
Zinsforderungen	5.455	1.276.000	118.597	933.645	2.333.697
Dividendenforderungen	-	-	-	88.661	88.661
Sonstige Aktiva	-	-	-	141.438	141.438
Summe Aktiva	17.083.105	133.065.735	14.394.079	134.578.977	299.121.896
Passiva					
Überziehungskredite	-	-	45.546	-	45.546
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	4	-	-	4
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	6.849.258	6.849.258
Anteilinhabertransaktionen	-	7.154	-	52.247	59.401
Fällige Managementgebühren	-	-	-	103.160	103.160
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	442	442
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	357.890	357.890
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	7.158	45.546	7.362.997	7.415.701
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	17.083.105	133.058.577	14.348.533	127.215.980	291.706.195

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben

	CNY	HKD	IDR	KRW	TWD	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	-	92.851	-	-	28.900	88.418	5.481.847	5.692.016
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	351.218	-	-	-	-	1.628.134	1.979.352
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.425.750	18.049.941	3.324.919	3.772.635	7.654.491	4.424.247	12.670.516	54.322.499
Forderungen aus Anteilszeichnungen	-	-	-	-	-	-	114	114
Zinsforderungen	-	-	-	-	-	-	2.155	2.155
Dividendenforderungen	-	-	-	-	19.001	-	-	19.001
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	-	63.531	63.531
Summe Aktiva	4.425.750	18.494.010	3.324.919	3.772.635	7.702.392	4.512.665	19.846.297	62.078.668
Passiva								
Überziehungskredite	-	-	-	-	-	-	114	114
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	-	531.940	531.940
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	162.774	9	162.783
Anteilinhabertransaktionen	-	-	-	-	-	-	40	40
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	-	28.509	28.509
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	131.215	131.215
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	-	-	162.774	691.827	854.601
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	4.425.750	18.494.010	3.324.919	3.772.635	7.702.392	4.349.891	19.154.470	61.224.067

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben	CNY	HKD	KRW	TWD	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	10.472	-	-	-	66.940	7.026.931	7.104.343
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	-	120.000	120.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.301.249	29.750.120	6.572.942	12.841.516	11.094.372	10.549.546	75.109.745
Dividendenforderungen	-	-	40.617	24.528	-	-	65.145
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	157.179	157.179
Summe Aktiva	4.311.721	29.750.120	6.613.559	12.866.044	11.161.312	17.853.656	82.556.412
Passiva							
Überziehungskredite	-	-	-	-	6	-	6
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	33.425	-	-	-	271.789	305.214
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	169.635	169.635
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	-	45	45
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	39.499	39.499
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	139.208	139.208
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	33.425	-	-	6	620.176	653.607
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	4.311.721	29.716.695	6.613.559	12.866.044	11.161.306	17.233.480	81.902.805

Man Numeric US High Yield

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben	USD	Summe USD
Aktiva		
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	315.909	315.909
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	35.714.137	35.714.137
Zinsforderungen	701.004	701.004
Sonstige Aktiva	11.558	11.558
Summe Aktiva	36.742.608	36.742.608
Passiva		
Fällige Managementgebühren	15.275	15.275
Verbindlichkeiten aus Zinsen	107	107
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	121.734	121.734
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	137.116	137.116
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	36.605.492	36.605.492

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben	USD	Summe USD
Aktiva		
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	974.740	974.740
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	102.373.751	102.373.751
Zinsforderungen	1.561.045	1.561.045
Sonstige Aktiva	72.203	72.203
Summe Aktiva	104.981.739	104.981.739
Passiva		
Fällige Managementgebühren	43.498	43.498
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	185.067	185.067
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	228.565	228.565
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	104.753.174	104.753.174

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben					Summe
	EUR	GBP	Sonstige	USD	USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	23.551	647.186	1.176	4.731.264	5.403.177
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	2.557.650	402.393	1	2.941.253	5.901.297
Forderungen gegenüber Brokern	8.708.792	4.166.436	-	2.847.452	15.722.680
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	95.961.400	48.912.568	915.972	42.421.128	188.211.068
Zinsforderungen	1.427.883	903.685	47.688	593.836	2.973.092
Sonstige Aktiva	-	-	-	121.642	121.642
Summe Aktiva	108.679.276	55.032.268	964.837	53.656.575	218.332.956
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	2.680.000	2.680.000
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	17.431.887	8.285.714	-	5.670.122	31.387.723
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	784.436	443.987	-	1.460.976	2.689.399
Pensionsgeschäfte	15.483.833	3.175.005	-	2.803.412	21.462.250
Fällige Managementgebühren	-	-	-	32.930	32.930
Verbindlichkeiten aus Zinsen	34.506	59.121	-	47.008	140.635
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	225.848	225.848
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	33.734.662	11.963.827	-	12.920.296	58.618.785
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	74.944.614	43.068.441	964.837	40.736.279	159.714.171

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben					Summe
	EUR	GBP	Sonstige	USD	USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	21.596	232	1.704.349	1.726.177
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	520.950	13.543	-	517.576	1.052.069
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	9.343.331	7.885.524	1.356.747	16.519.253	35.104.855
Zinsforderungen	85.338	47.698	34.077	154.181	321.294
Sonstige Aktiva	-	-	-	62.441	62.441
Summe Aktiva	9.949.619	7.968.361	1.391.056	18.957.800	38.266.836
Passiva					
Überziehungskredite	975	-	-	-	975
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	758	-	338.299	339.057
Pensionsgeschäfte	1.598.554	-	-	2.618.130	4.216.684
Fällige Managementgebühren	-	-	-	10.221	10.221
Verbindlichkeiten aus Zinsen	(663)	82	-	1.489	908
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	44.710	44.710
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	1.598.866	840	-	3.012.849	4.612.555
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	8.350.753	7.967.521	1.391.056	15.944.951	33.654.281

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG China Equity

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben						
	CNY	HKD	TWD	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	-	-	-	-	149.069	149.069
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	327.580	327.580
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.331.551	4.688.705	714.221	-	3.045.005	9.779.482
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	91.404	91.404
Summe Aktiva	1.331.551	4.688.705	714.221	-	3.613.058	10.347.535
Passiva						
Überziehungskredite	-	-	-	4.371	-	4.371
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	-	179.055	179.055
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	285.920	-	-	-	8.827	294.747
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	5.990	5.990
Verbindlichkeiten aus Zinsen	-	-	-	-	1.163	1.163
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	94.798	94.798
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	285.920	-	-	4.371	289.833	580.124
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	1.045.631	4.688.705	714.221	(4.371)	3.323.225	9.767.411

Zum 31. Dezember 2021

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben				
	HKD	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	-	-	1.447.827	1.447.827
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	510.000	-	510.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	8.037.796	36.539	2.039.604	10.113.939
Zinsforderungen	-	-	158	158
Sonstige Aktiva	-	-	22.818	22.818
Summe Aktiva	8.037.796	546.539	3.510.407	12.094.742
Passiva				
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	127.332	8.869	136.201
Fällige Managementgebühren	-	-	4.099	4.099
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	23.966	23.966
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	127.332	36.934	164.266
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	8.037.796	419.207	3.473.473	11.930.476

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem EUR-Gegenwert angegeben								Summe
	CAD	CHF	GBP	USD	Sonstige	EUR	EUR	
Aktiva								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	1.842	-	-	-	-	648.111	649.953	
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	9.532	-	106.407	115.939	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.166.557	2.261.724	3.141.549	21.537.550	542.826	4.356.644	34.006.850	
Zinsforderungen	-	-	-	-	-	98	98	
Dividendenforderungen	2.124	-	30.519	10.198	-	-	42.841	
Sonstige Aktiva	-	-	-	-	-	129.346	129.346	
Summe Aktiva	2.170.523	2.261.724	3.172.068	21.557.280	542.826	5.240.606	34.945.027	
Passiva								
Überziehungskredite	-	-	-	2.647	-	-	2.647	
Fällige Managementgebühren	-	-	-	-	-	22.080	22.080	
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	109.716	109.716	
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	2.647	-	131.796	134.443	
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	2.170.523	2.261.724	3.172.068	21.554.633	542.826	5.108.810	34.810.584	

Man GLG Sustainable Strategic Income
Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben						Summe
	EUR	GBP	Sonstige	USD	USD	
Aktiva						
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	33.797	31.532	-	1.279.256	1.344.585	
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	53.296	-	-	295.211	348.507	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.612.020	4.333.329	-	7.647.856	15.593.205	
Zinsforderungen	54.988	31.982	-	122.048	209.018	
Sonstige Aktiva	-	-	-	43.790	43.790	
Summe Aktiva	3.754.101	4.396.843	-	9.388.161	17.539.105	
Passiva						
Überziehungskredite	-	-	-	1.105.051	1.105.051	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	-	-	214.253	214.253	
Fällige Managementgebühren	-	-	-	6.207	6.207	
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	82.280	82.280	
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	-	-	-	1.407.791	1.407.791	
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	3.754.101	4.396.843	-	7.980.370	16.131.314	

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Dynamic Income

Zum 31. Dezember 2022

Die Beträge sind mit ihrem USD-Gegenwert angegeben	EUR	GBP	Sonstige	USD	Summe USD
Aktiva					
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente – unbeschränkt	23.589	343.366	-	1.138.761	1.505.716
Forderungen aus Sicherheiten gegenüber Brokern	636.453	-	-	218.834	855.287
Forderungen gegenüber Brokern	5.566.570	711.563	-	-	6.278.133
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	18.065.687	7.177.902	-	6.457.277	31.700.866
Zinsforderungen	274.133	149.646	-	95.941	519.720
Sonstige Aktiva	-	-	-	92.313	92.313
Summe Aktiva	24.566.432	8.382.477	-	8.003.126	40.952.035
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	-	-	-	220.010	220.010
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	11.132.877	1.415.731	-	-	12.548.608
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	143.012	-	-	135.773	278.785
Pensionsgeschäfte	1.966.083	2.381.306	-	-	4.347.389
Fällige Managementgebühren	-	-	-	9.430	9.430
Verbindlichkeiten aus Zinsen	5.090	21.412	-	-	26.502
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	80.479	80.479
Summe Verbindlichkeiten (ohne das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnende Nettovermögen)	13.247.062	3.818.449	-	445.692	17.511.203
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	11.319.370	4.564.028	-	7.557.434	23.440.832

Sonstiges Preis-/Kursrisiko

Sonstige Marktrisiken ergeben sich im Wesentlichen aus der Unsicherheit hinsichtlich der zukünftigen Kurse der Finanzinstrumente im Bestand. Sie stellen den potenziellen Verlust dar, der dem Fonds durch das Halten von Marktpositionen in Hinblick auf Kursbewegungen entstehen kann, die durch für das individuelle Anlageinstrument spezifische Faktoren bedingt sind oder durch Faktoren, die alle am betreffenden Markt gehandelten Instrumente betreffen.

Kredit-/Kontrahentenrisiko

Die Anlageverwalter führen für sämtliche Kontrahenten eine Due Diligence-Prüfung (Sorgfaltsprüfung) durch, bevor diese als Dienstleister oder Gegenpartei des Fonds zugelassen werden, und eine Überprüfung der Bonität stellt einen Teil dieses Prozesses dar. Die Bonität der Banken und Broker sowie der Verwahrstelle des Fonds wird regelmäßig überwacht und bei sämtlichen Allokationsentscheidungen berücksichtigt.

Der Fonds geht ein Kredit-/Kontrahentenrisiko in Bezug auf die Parteien ein, mit denen er in Geschäftsbeziehungen steht, und trägt zudem das Abwicklungsrisiko. Das Kreditrisiko ist das Risiko, dass eine Gegenpartei eines Finanzinstrumentes einer Verbindlichkeit oder Verpflichtung, die sie gegenüber dem Fonds eingegangen ist, nicht nachkommt. Es stellt z. B. das finanzielle Risiko dar, dass ein Wertpapieremittent (ein Staat oder ein Unternehmen) einer Verbindlichkeit oder Verpflichtung nicht nachkommt oder Konkurs anmeldet. Der Fonds hält die Konzentration des Kreditrisikos gering, indem er Transaktionen mit einer Vielzahl von Kunden und Geschäftspartnern an anerkannten und renommierten Börsen abwickelt. Der Fonds kauft und verkauft Wertpapiere nur über Broker, die durch die Anlageverwalter als akzeptable Gegenparteien anerkannt wurden.

Finanzielle Vermögenswerte, die den Fonds einem potenziellen Kontrahenten-Kreditrisiko aussetzen, bestehen hauptsächlich aus Anlagen in Barmittelbeständen, Einlagen bei und Forderungen gegenüber Brokern und sonstigen Forderungen. Das Ausmaß des Kontrahenten-/Kreditrisikos für den Fonds im Hinblick auf diese finanziellen Vermögenswerte entspricht näherungsweise deren Wertansatz in der Bilanz des Fonds. Darüber hinaus werden, wenn der Fonds Darlehen zur Finanzierung von kreditfinanzierten Anlagen aufnimmt, beim Kontrahenten zusätzliche Sicherheiten hinterlegt, damit dieser gegen etwaige negative Entwicklungen hinterlegter Sicherheiten abgesichert ist. Die meisten Finanzdienstleister sehen für diese Sicherheit einen gewissen zusätzlichen Schutz vor. Ein solcher kann jedoch möglicherweise für den Fonds nicht verfügbar sein, so dass der Fonds dem Bonitätsrisiko des Kontrahenten ausgesetzt sein kann.

Kreditrisiken entstehen auch aus Transaktionen mit Brokern im Zusammenhang mit noch abzurechnenden Transaktionen. Die Risiken im Zusammenhang mit nicht abgerechneten Transaktionen werden aufgrund der kurzen Abrechnungsfristen und der hohen Bonität der eingesetzten Broker als gering betrachtet. Es stehen in erster Linie Makler-Salden von großen renommierten Broker-Häusern aus, weshalb von einem minimalen Ausfallrisiko ausgegangen wird. Da „Lieferung gegen Zahlung“ das Standardverfahren für die Geschäftsabwicklung ist, besteht kein signifikantes Kreditrisiko aus der Abrechnung von Transaktionen.

Das Kreditrisiko ist das Risiko, dass ein Kontrahent nicht in der Lage sein wird, einer Verpflichtung, die er gegenüber dem Fonds eingegangen ist, nachzukommen.

Das maximale Kreditrisiko des Fonds (ohne Berücksichtigung des Werts von Sicherheiten und anderen Wertpapieren im Bestand) für den Fall, dass Gegenparteien ihren Verpflichtungen zum 31. Dezember 2022 in Bezug auf sämtliche Klassen erfasster Finanzanlagen, einschließlich Derivaten, nicht nachkommen, entspricht dem in der Bilanz ausgewiesenen Buchwert dieser Vermögenswerte. Das Kreditrisiko wird durch die größere Anzahl von Gegenparteien und die regelmäßige Überwachung des Konzentrationsrisikos gemindert.

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Kredit-/Kontrahentenrisiko (Fortsetzung)

Die Engagements bestehen gegenüber The Bank of New York Mellon (Niederlassung London), Barclays Capital Plc, BNP Paribas, Citibank N.A., Credit Suisse AG Ireland, Credit Suisse Securities Europe Limited, Goldman Sachs International, JP Morgan Securities Plc, HSBC Bank Plc, Morgan Stanley & Co. International Plc, Nomura Holdings und Societe Generale (die „Broker“).

Zum 31. Dezember 2022 wurde der Großteil der Vermögenswerte des Fonds bei Brokern gehalten. Jeder dieser Gegenparteien wird vom Fonds als erstklassig bewertet und als angesehenes Institut erachtet, und deshalb gelten sowohl das individuelle als auch das gesamte Kreditrisiko als nicht wesentlich.

Die folgende Tabelle liefert ausführliche Informationen zu den primären Kontrahentenrisiken des Fonds:

Bonitätsratings	Rating-Agentur	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021	
		USD	%	USD	%
<i>Man GLG Global Convertibles</i>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	130.311.693	94,84 %	207.801.792	87,27 %
BNP Paribas	Aa3 Moody's	2	0,00 %	30.056.941	12,62 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	12.350	0,00 %	-	0,00 %
Citibank N.A.	Aa3 Moody's	6.570.647	4,78 %	-	-
Credit Suisse Securities Europe Limited	A- S&P	-	0,01 %	31.940	0,02 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	501.802	0,37 %	88.212	0,04 %
Nomura Holdings	Baa1 Moody's	6.649	0,00 %	126.700	0,05 %
		137.403.143	100,00 %	238.105.585	100,00 %
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>					
		EUR	%	EUR	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	77.912.244	93,74 %	256.203.807	96,64 %
BNP Paribas	Aa3 Moody's	-	0,00 %	4.886.609	1,84 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	5.201.462	6,26 %	4.030.062	1,52 %
		83.113.706	100,00 %	265.120.478	100,00 %
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>					
		JPY	%	JPY	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	272.349.816.540	99,93 %	170.091.256.357	99,94 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	202.823.570	0,07 %	97.180.538	0,06 %
		272.552.640.110	100,00 %	170.188.436.895	100,00 %
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>					
		USD	%	USD	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	418.606.568	81,23 %	640.546.780	83,41 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	494.208	0,10 %	930.467	0,12 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	96.223.311	18,67 %	126.499.894	16,47 %
		515.324.087	100,00 %	767.977.141	100,00 %
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	21.275.243	99,74 %	27.283.290	99,74 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	55.591	0,26 %	70.870	0,26 %
		21.330.834	100,00 %	27.354.160	100,00 %
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	83.676.174	97,83 %	87.544.431	97,93 %
Credit Suisse Securities Europe Limited	A- S&P	-	0,00 %	268.867	0,30 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	502.764	0,59 %	-	-
HSBC Bank Plc	A3 Moody's	1.347.888	1,58 %	1.585.727	1,77 %
JP Morgan Securities Plc	Aa3 Moody's	12	0,00 %	12	0,00 %
		85.526.838	100,00 %	89.399.037	100,00 %
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	34.972.638	100,00 %	52.899.612	100,00 %
		34.972.638	100,00 %	52.899.612	100,00 %
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>					
		EUR	%	EUR	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	205.378.575	100,00 %	451.075.262	100,00 %
		205.378.575	100,00 %	451.075.262	100,00 %
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>					
		USD	%	USD	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	5.927.452	99,82 %	237.030.695	99,92 %
BNP Paribas	Aa3 Moody's	10.874	0,18 %	180.730	0,08 %
		5.938.326	100,00 %	237.211.425	100,00 %

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Kredit-/Kontrahentenrisiko (Fortsetzung)

Bonitätsratings	Rating-Agentur	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2021
		EUR	%	EUR	%
<u>Man Numeric Europe RI Climate</u> <u>(vormals Man Numeric RI European Equity)</u>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	30.768.669	99,71 %	23.431.574	99,44 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	89.759	0,29 %	133.065	0,56 %
		30.858.428	100,00 %	23.564.639	100,00 %
<u>Man GLG RI Sustainable European Income</u> <u>(vormals Man GLG European Income Opportunities)</u>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	25.996.542	100,00 %	52.447.821	100,00 %
		25.996.542	100,00 %	52.447.821	100,00 %
<u>Man Numeric China A Equity</u>					
		USD	%	USD	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	18.721.686	99,39 %	33.485.624	99,63 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	115.809	0,61 %	124.696	0,37 %
		18.837.495	100,00 %	33.610.320	100,00 %
<u>Man GLG Strategic Bond</u>					
		GBP	%	GBP	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	281.806.742	100,00 %	297.817.577	99,61 %
Credit Suisse Securities Europe Limited	A- S&P	-	-	15	0,00 %
HSBC Bank Plc	A3 Moody's	(874.286)	(0,31 %)	739.435	0,25 %
JP Morgan Securities Plc	Aa3 Moody's	869.976	0,31 %	423.431	0,14 %
		281.802.432	100,00 %	298.980.458	100,00 %
<u>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</u>					
		USD	%	USD	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	59.798.110	96,43 %	77.742.827	94,35 %
Credit Suisse AG Ireland	Baa2 Moody's	-	0,00 %	247.051	0,30 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	-	0,00 %	173	0,00 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	1.242.265	2,00 %	4.409.182	5,35 %
Societe Generale	A1 Moody's	974.762	1,57 %	-	-
		62.015.137	100,00 %	82.399.233	100,00 %
<u>Man Numeric US High Yield</u>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	36.731.050	100,00 %	104.909.536	100,00 %
		36.731.050	100,00 %	104.909.536	100,00 %
<u>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</u>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	170.245.531	78,02 %	32.304.156	84,55 %
Barclays Plc	Baa2 Moody's	25.969.203	11,90 %	4.819.965	12,62 %
BNP Paribas	Aa3 Moody's	273	0,00 %	-	-
JP Morgan Securities Plc	Aa3 Moody's	21.122.657	9,68 %	958.701	2,51 %
Goldman Sachs International	A1 Moody's	866.708	0,40 %	118.398	0,31 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	6.942	0,00 %	3.175	0,01 %
		218.211.314	100,00 %	38.204.395	100,00 %
<u>Man GLG China Equity</u>					
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	9.918.760	96,71 %	11.525.227	95,47 %
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	337.371	3,29 %	546.697	4,53 %
		10.256.131	100,00 %	12.071.924	100,00 %
<u>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy</u>					
		EUR	%	EUR	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	34.699.742	99,67 %	-	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	Aa3 Moody's	115.939	0,33 %	-	-
		34.815.681	100,00 %	-	-
<u>Man GLG Sustainable Strategic Income</u>					
		USD	%	USD	%
Bank of New York Mellon	A1 Moody's	17.164.380	98,11 %	-	-
JP Morgan Securities Plc	Aa3 Moody's	330.935	1,89 %	-	-
		17.495.315	100,00 %	-	-

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Kredit-/Kontrahentenrisiko (Fortsetzung)

	Bonitätsratings	Rating- Agentur	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021	31. Dezember 2021
			USD	%	USD	%
<i>Man GLG Dynamic Income</i>						
Bank of New York Mellon	A1	Moody's	27.683.833	67,75 %	-	-
Barclays Plc	Baa2	Moody's	5.862.518	14,35 %	-	-
JP Morgan Securities Plc	Aa3	Moody's	7.281.985	17,82 %	-	-
Goldman Sachs International	A1	Moody's	31.386	0,08 %	-	-
			40.859.722	100,00 %	-	-

Darüber hinaus wies der Fonds zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 kein Kreditrisiko aus Kreditinstrumenten auf, bezüglich derer er über Credit Default Swaps Schutz an Dritte verkauft hatte.

Die Tabellen unten und auf der nächsten Seite zeigen die Aufschlüsselung nach Kreditspread aller im Portfolio gehaltener Schuldtitel. Hierbei sind weder Absicherungsgeschäfte berücksichtigt, bei denen es sich nicht um Schuldtitel handelt (z. B. Aktien), noch bei Kreditinstituten gehaltene Einlagen. Der „Kreditspread“ ist ein Maß, das die Renditedifferenz eines Schuldtitels im Verhältnis zu einem angenommenen risikolosen Schuldtitel darstellt. Für bestimmte Klassen von Wertpapieren ist der Kreditspread die vom Markt verwendete Notierungsmethode. Für andere lässt sich der Kreditspread vom Marktpreis ableiten.

<i>Man GLG Global Convertibles</i> Spread	Schuldtitel	Schuldtitel
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	1.231.737	67.169.819
25-100	32.709.083	45.480.861
100-200	29.238.030	30.777.394
200-300	35.266.429	24.078.511
300-400	13.251.109	11.301.999
400-500	13.912.373	6.353.916
500-700	7.405.719	8.752.811
700-1000	8.221.508	1.151.320
> 1000	846.193	1.172.509
	142.082.181	196.239.140

<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i> Spread	Schuldtitel	Schuldtitel
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	86.895.982	-
	86.895.982	-

<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i> Spread	Schuldtitel	Schuldtitel
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	82.080.963	86.035.261
100-200	-	57.588
200-300	-	42.114
400-500	42.103	-
> 1000	17.889	22.328
	82.140.955	86.157.291

<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
Spread	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	6.385.636	13.516.059
25-100	6.644.212	17.659.983
100-200	7.321.506	10.875.462
200-300	3.946.144	4.563.605
300-400	2.735.254	2.555.945
400-500	723.939	996.449
500-700	3.778.051	307.493
700-1000	1.081.557	1.105.616
> 1000	1.598.128	787.849
	<u>34.214.427</u>	<u>52.368.461</u>

<i>Man Numeric China A Equity</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
Spread	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	810.579	-
	<u>810.579</u>	<u>-</u>

<i>Man GLG Strategic Bond</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
Spread	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	57.109.657	45.666.039
25-100	(41.199.862)	447
100-200	6.399.811	58.797.576
200-300	22.254.354	54.397.709
300-400	53.934.808	48.009.415
400-500	53.492.518	43.926.570
500-700	27.432.372	22.098.187
700-1000	13.449.670	-
> 1000	9.375.177	-
	<u>202.248.505</u>	<u>272.895.943</u>

<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
Spread	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	-	856.252
25-100	8.049.745	2.355.448
100-200	(6.647.322)	8.538.506
200-300	1.677.283	9.857.896
300-400	7.302.674	4.550.056
400-500	40.056.854	2.693.084
500-700	65.621.590	5.358.364
700-1000	48.290.215	1.953.892
> 1000	25.429.591	710.722
	<u>189.780.630</u>	<u>36.874.220</u>

<i>Man GLG China Equity</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
Spread	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	692.243	1.499.535
	<u>692.243</u>	<u>1.499.535</u>

<i>Man GLG Sustainable Strategic Income</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
Spread	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
0-25	874.759	-
25-100	(1.855.049)	-
100-200	2.702.596	-
200-300	3.014.680	-
300-400	5.167.387	-
400-500	2.494.031	-
500-700	783.484	-
700-1000	219.389	-
	<u>13.401.277</u>	<u>-</u>

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Kredit-/Kontrahentenrisiko (Fortsetzung)

<i>Man GLG Dynamic Income</i>	Schuldtitel	Schuldtitel
<u>Spread</u>	<u>31. Dezember 2022</u>	<u>31. Dezember 2021</u>
0-25	(141.870)	-
25-100	(224.594)	-
100-200	121.424	-
300-400	256.782	-
400-500	2.908.685	-
500-700	12.790.774	-
700-1000	11.285.302	-
> 1000	5.356.389	-
	<u>32.352.892</u>	<u>-</u>

Zum 31. Dezember 2022 belief sich der Wert der Vermögenswerte des Man GLG Global Convertibles und des Man GLG Global Emerging Markets Bond, die als überfällig angesehen werden, auf 2.514.939 USD bzw. 130.475 USD (2021: 1.647.964 USD bzw. 63.000 USD).

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse des Alters finanzieller Vermögenswerte, die als überfällig angesehen werden:

<i>Man GLG Global Convertibles</i>	<u>31. Dezember 2022</u>	<u>31. Dezember 2021</u>
Über 3 Jahre	2.457.144 USD	1.590.169 USD

Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko ist als das Risiko definiert, dass der Fonds in Schwierigkeiten gerät, seinen Verpflichtungen aus finanziellen Verbindlichkeiten nachzukommen, die durch Lieferung von Barmitteln oder anderen finanziellen Vermögenswerten abgerechnet werden. Rücknahmeanträge von Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile stellen für den Fonds das größte Liquiditätsrisiko dar.

Die rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile des Teilfonds werden gemäß den Angaben in Erläuterung 10 zurückgenommen. Der Teilfonds ist potenziell täglichen Rücknahmen durch Anteilinhaber ausgesetzt.

Die Finanzinstrumente des Fonds umfassen Finanzinstrumente, die Stufe 1 zugeordnet sind und als leicht veräußerbar gelten, da sie allesamt an großen, anerkannten Börsen notiert sind.

Die Finanzinstrumente des Fonds umfassen außerdem Anlagen in Finanzinstrumenten der Stufen 2 und 3. Diese sind nicht an einem aktiven öffentlichen Markt notiert und können allgemein illiquide sein. Daher ist der Fonds gegebenenfalls nicht in der Lage, einige seiner Anlagen in diesen Instrumenten zur Erfüllung seiner Liquiditätsanforderungen zu einem Betrag zu liquidieren, der in der Nähe ihres beizulegenden Zeitwertes liegt.

Die Hauptverbindlichkeit des Teilfonds bezieht sich auf die Notwendigkeit, Rücknahmeanträge von Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile auszuführen. Der Teilfonds versucht, dieses Risiko zu mindern, indem er vornehmlich in Wertpapiere investiert, die an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden. Bei den Anlagen handelt es sich somit hauptsächlich um veräußerbare Wertpapiere, die zeitnah verkauft werden können. Darüber hinaus wird die die Rücknahmefrist auf die von den Anlageverwaltern vereinbarte erwartete Liquidität der zugrunde liegenden Anlagen abgestimmt.

Die Verwaltungsgesellschaft hat die Liquiditätsanforderungen der ESMA per September 2020 umgesetzt und die diesbezüglichen Stress-Tests werden nun laufend von der Verwaltungsgesellschaft überwacht.

Die nachfolgende Tabelle fasst das Fälligkeitsprofil der finanziellen Verbindlichkeiten des Fonds zusammen:

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Convertibles

	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	878.476	-	-	-	878.476
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	3.503.144	-	-	-	3.503.144
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	403.227	-	17.798	1.303.095	1.724.120
Zu zahlende Performancegebühren	6.372	-	-	-	6.372
Fällige Managementgebühren	80.920	-	-	-	80.920
Verbindlichkeiten aus Zinsen	6.581	-	-	-	6.581
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	240.712	-	-	-	240.712
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	131.066.069	-	-	-	131.066.069
Summe Verbindlichkeiten	136.185.501	-	17.798	1.303.095	137.506.394

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	58	-	-	-	58
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	460.000	-	-	-	460.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	518.313	-	-	-	518.313
Zu zahlende Performancegebühren	344.321	-	-	-	344.321
Fällige Managementgebühren	179.746	-	-	-	179.746
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	276.981	-	-	-	276.981
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	236.441.433	-	-	-	236.441.433
Summe Verbindlichkeiten	238.220.852	-	-	-	238.220.852

Zum 31. Dezember 2022 lagen Wertpapiere, die nicht leicht veräußerbar sein könnten, im Wert von 2.457.144 USD vor (31. Dezember 2021: 1.551.050 USD).

Man GLG RI European Equity Leaders

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	10.530	-	-	-	10.530
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.418.259	-	-	-	1.418.259
Anteilinhabertransaktionen	2.136	-	-	-	2.136
Fällige Managementgebühren	59.350	-	-	-	59.350
Verbindlichkeiten aus Zinsen	175.763	-	-	-	175.763
Verbindlichkeiten aus Liquidationsgebühren	4.842	-	-	-	4.842
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	229.084	-	-	-	229.084
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	81.570.222	-	-	-	81.570.222
Summe Verbindlichkeiten	83.470.186	-	-	-	83.470.186

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	556	-	-	-	556
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.879.057	-	-	-	2.879.057
Fällige Managementgebühren	177.180	-	-	-	177.180
Verbindlichkeiten aus Zinsen	301	-	-	-	301
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	284.795	-	-	-	284.795
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	262.408.785	-	-	-	262.408.785
Summe Verbindlichkeiten	265.750.674	-	-	-	265.750.674

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

	Weniger als 1 Monat JPY	1 bis 3 Monate JPY	3 bis 12 Monate JPY	Mehr als 1 Jahr JPY	Summe JPY
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	847.650	-	-	-	847.650
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3.306.505.621	-	-	-	3.306.505.621
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	2.741.354.159	94.123.860	-	-	2.835.478.019
Anteilinhabertransaktionen	272.858.607	-	-	-	272.858.607
Fällige Managementgebühren	162.473.442	-	-	-	162.473.442
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	317.587.825	-	-	-	317.587.825
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	265.809.929.160	-	-	-	265.809.929.160
Summe Verbindlichkeiten	272.611.556.464	94.123.860	-	-	272.705.680.324

31. Dezember 2021

Passiva:					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	57.052	-	-	-	57.052
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	186.394.345	-	-	-	186.394.345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	372.824.350	3.740.538	-	-	376.564.888
Anteilinhabertransaktionen	453.402.589	-	-	-	453.402.589
Fällige Managementgebühren	103.398.959	-	-	-	103.398.959
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	173.478.130	-	-	-	173.478.130
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	168.971.414.072	-	-	-	168.971.414.072
Summe Verbindlichkeiten	170.260.969.497	3.740.538	-	-	170.264.710.035

Man Numeric Emerging Markets Equity

	USD	USD	USD	USD	USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	49.948	-	-	-	49.948
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	78.974.691	-	-	-	78.974.691
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3.156.230	-	-	-	3.156.230
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.165.633	181.366	-	-	3.346.999
Anteilinhabertransaktionen	13.104	-	-	-	13.104
Zu zahlende Performancegebühren	212.968	-	-	-	212.968
Fällige Managementgebühren	260.298	-	-	-	260.298
Verbindlichkeiten aus Zinsen	159.675	-	-	-	159.675
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	624.991	-	-	-	624.991
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	428.822.647	-	-	-	428.822.647
Summe Verbindlichkeiten	515.440.185	181.366	-	-	515.621.551

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	154	-	-	-	154
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	102.086.683	-	-	-	102.086.683
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	3.222.069	-	-	-	3.222.069
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	3.378.406	69.325	-	-	3.447.731
Zu zahlende Performancegebühren	1.678.536	-	-	-	1.678.536
Fällige Managementgebühren	384.899	-	-	-	384.899
Verbindlichkeiten aus Zinsen	39.815	-	-	-	39.815
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	716.920	-	-	-	716.920
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	656.596.655	-	-	-	656.596.655
Summe Verbindlichkeiten	768.104.137	69.325	-	-	768.173.462

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

*Man Numeric Global RI Climate
(vormals Man Numeric RI Global Equity)*

	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	26.440	-	-	-	26.440
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	-	14.310	-	-	14.310
Fällige Managementgebühren	12.940	-	-	-	12.940
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	91.631	-	-	-	91.631
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	21.266.578	-	-	-	21.266.578
Summe Verbindlichkeiten	21.397.589	14.310	-	-	21.411.899

31. Dezember 2021

Passiva:

Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	163.209	-	-	-	163.209
Fällige Managementgebühren	16.403	-	-	-	16.403
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	84.512	-	-	-	84.512
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	27.156.993	-	-	-	27.156.993
Summe Verbindlichkeiten	27.421.117	-	-	-	27.421.117

Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates

31. Dezember 2022

Passiva:

Überziehungskredite	2	-	-	-	2
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	679.246	-	-	-	679.246
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	390	-	-	-	390
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	601.288	-	-	44.688	645.976
Fällige Managementgebühren	41.259	-	-	-	41.259
Verbindlichkeiten aus Zinsen	7.581	-	-	-	7.581
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	173.453	-	-	-	173.453
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	84.046.705	-	-	-	84.046.705
Summe Verbindlichkeiten	85.549.924	-	-	44.688	85.594.612

31. Dezember 2021

Passiva:

Überziehungskredite	69	-	-	-	69
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	134.919	-	-	-	134.919
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	345	-	-	-	345
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.413.417	-	-	11.433	1.424.850
Fällige Managementgebühren	45.540	-	-	-	45.540
Verbindlichkeiten aus Zinsen	7.007	-	-	-	7.007
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	158.485	-	-	-	158.485
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	87.747.618	-	-	-	87.747.618
Summe Verbindlichkeiten	89.507.400	-	-	11.433	89.518.833

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Bond

	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	20	-	-	-	20
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	120.296	-	-	-	120.296
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	180	-	-	-	180
Fällige Managementgebühren	12.337	-	-	-	12.337
Verbindlichkeiten aus Zinsen	7.718	-	-	-	7.718
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	147.251	-	-	-	147.251
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	34.722.534	-	-	-	34.722.534
Summe Verbindlichkeiten	35.010.336	-	-	-	35.010.336

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	25	-	-	-	25
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	120.000	-	-	-	120.000
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	244.750	-	-	-	244.750
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.858	-	-	-	1.858
Fällige Managementgebühren	21.510	-	-	-	21.510
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	149.288	-	-	-	149.288
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	52.419.721	-	-	-	52.419.721
Summe Verbindlichkeiten	52.957.152	-	-	-	52.957.152

Man GLG Pan-European Equity Growth

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	834.017	-	-	-	834.017
Anteilinhabertransaktionen	8.497	-	-	-	8.497
Fällige Managementgebühren	107.322	-	-	-	107.322
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	335.005	-	-	-	335.005
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	204.317.818	-	-	-	204.317.818
Summe Verbindlichkeiten	205.602.659	-	-	-	205.602.659

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	8	-	-	-	8
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	630.000	-	-	-	630.000
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	109.814	-	-	-	109.814
Anteilinhabertransaktionen	23.068	-	-	-	23.068
Fällige Managementgebühren	247.162	-	-	-	247.162
Verbindlichkeiten aus Zinsen	241	-	-	-	241
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	503.115	-	-	-	503.115
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	449.821.558	-	-	-	449.821.558
Summe Verbindlichkeiten	451.334.966	-	-	-	451.334.966

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth

	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	30	-	-	-	30
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	36.041	-	-	-	36.041
Fällige Managementgebühren	3.771	-	-	-	3.771
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	118.305	-	-	-	118.305
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	5.870.209	-	-	-	5.870.209
Summe Verbindlichkeiten	6.028.356	-	-	-	6.028.356

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	2.179	-	-	-	2.179
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	4.942.288	-	-	-	4.942.288
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	109	-	-	-	109
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.122.330	-	-	-	1.122.330
Fällige Managementgebühren	65.625	-	-	-	65.625
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	232.913	-	-	-	232.913
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	230.986.561	-	-	-	230.986.561
Summe Verbindlichkeiten	237.352.005	-	-	-	237.352.005

Man Numeric Europe RI Climate

(vormals Man Numeric RI European Equity)

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	28	-	-	-	28
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	112.922	-	-	-	112.922
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	34.128	21.681	-	-	55.809
Fällige Managementgebühren	19.222	-	-	-	19.222
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	101.273	-	-	-	101.273
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	30.650.824	-	-	-	30.650.824
Summe Verbindlichkeiten	30.918.397	21.681	-	-	30.940.078

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	2	-	-	-	2
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	51.783	-	-	-	51.783
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	433	-	-	-	433
Fällige Managementgebühren	15.595	-	-	-	15.595
Verbindlichkeiten aus Zinsen	101	-	-	-	101
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	80.254	-	-	-	80.254
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	23.496.247	-	-	-	23.496.247
Summe Verbindlichkeiten	23.644.415	-	-	-	23.644.415

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable European Income
(vormals Man GLG European Income Opportunities)

	Weniger als 1 Monat EUR	1 bis 3 Monate EUR	3 bis 12 Monate EUR	Mehr als 1 Jahr EUR	Summe EUR
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Anteilinhabertransaktionen	1.449	-	-	-	1.449
Fällige Managementgebühren	14.729	-	-	-	14.729
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	98.556	-	-	-	98.556
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	26.074.648	-	-	-	26.074.648
Summe Verbindlichkeiten	26.189.382	-	-	-	26.189.382

31. Dezember 2021

Passiva:

Überziehungskredite	358.305	-	-	-	358.305
Fällige Managementgebühren	32.524	-	-	-	32.524
Verbindlichkeiten aus Zinsen	22	-	-	-	22
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	111.750	-	-	-	111.750
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	52.157.016	-	-	-	52.157.016
Summe Verbindlichkeiten	52.659.617	-	-	-	52.659.617

Man Numeric China A Equity

31. Dezember 2022

Passiva:

	USD	USD	USD	USD	USD
Überziehungskredite	15.446	-	-	-	15.446
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	81.418	-	-	-	81.418
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.004	-	-	-	1.004
Anteilinhabertransaktionen	26.544	-	-	-	26.544
Fällige Managementgebühren	16.668	-	-	-	16.668
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	102.229	-	-	-	102.229
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	18.617.402	-	-	-	18.617.402
Summe Verbindlichkeiten	18.860.711	-	-	-	18.860.711

31. Dezember 2021

Passiva:

Überziehungskredite	6	-	-	-	6
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	266.683	-	-	-	266.683
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	10.977	-	-	-	10.977
Fällige Managementgebühren	29.869	-	-	-	29.869
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	109.418	-	-	-	109.418
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	33.235.040	-	-	-	33.235.040
Summe Verbindlichkeiten	33.651.993	-	-	-	33.651.993

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Strategic Bond

	Weniger als 1 Monat GBP	1 bis 3 Monate GBP	3 bis 12 Monate GBP	Mehr als 1 Jahr GBP	Summe GBP
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	879.753	-	-	-	879.753
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	15.371.175	-	-	-	15.371.175
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	9.777.356	-	-	-	9.777.356
Anteilinhabertransaktionen	6.735.149	-	-	-	6.735.149
Fällige Managementgebühren	128.387	-	-	-	128.387
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	82.263	-	-	-	82.263
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	386.635	-	-	-	386.635
Summe Verbindlichkeiten	248.608.141	-	-	-	248.608.141
	281.968.859	-	-	-	281.968.859

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	45.546	-	-	-	45.546
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	4	-	-	-	4
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	6.849.258	-	-	-	6.849.258
Anteilinhabertransaktionen	59.401	-	-	-	59.401
Fällige Managementgebühren	103.160	-	-	-	103.160
Verbindlichkeiten aus Zinsen	442	-	-	-	442
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	357.890	-	-	-	357.890
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	291.706.195	-	-	-	291.706.195
Summe Verbindlichkeiten	299.121.896	-	-	-	299.121.896

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

	USD	USD	USD	USD	USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	114	-	-	-	114
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	531.940	-	-	-	531.940
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	162.783	-	-	-	162.783
Anteilinhabertransaktionen	40	-	-	-	40
Fällige Managementgebühren	28.509	-	-	-	28.509
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	131.215	-	-	-	131.215
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	61.224.067	-	-	-	61.224.067
Summe Verbindlichkeiten	62.078.668	-	-	-	62.078.668

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	6	-	-	-	6
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	305.214	-	-	-	305.214
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	169.635	-	-	-	169.635
Fällige Managementgebühren	39.499	-	-	-	39.499
Verbindlichkeiten aus Zinsen	45	-	-	-	45
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	139.208	-	-	-	139.208
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	81.902.805	-	-	-	81.902.805
Summe Verbindlichkeiten	82.556.412	-	-	-	82.556.412

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man Numeric US High Yield

	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Fällige Managementgebühren	15.275	-	-	-	15.275
Verbindlichkeiten aus Zinsen	107	-	-	-	107
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	121.734	-	-	-	121.734
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	36.605.492	-	-	-	36.605.492
Summe Verbindlichkeiten	36.742.608	-	-	-	36.742.608

31. Dezember 2021

Passiva:					
Fällige Managementgebühren	43.498	-	-	-	43.498
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	185.067	-	-	-	185.067
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	104.753.174	-	-	-	104.753.174
Summe Verbindlichkeiten	104.981.739	-	-	-	104.981.739

Man GLG Global Investment Grade Opportunities

31. Dezember 2022

Passiva:					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	2.680.000	-	-	-	2.680.000
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	31.387.723	-	-	-	31.387.723
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1.010.598	164.562	103.375	1.410.864	2.689.399
Pensionsgeschäfte	21.462.250	-	-	-	21.462.250
Fällige Managementgebühren	32.930	-	-	-	32.930
Verbindlichkeiten aus Zinsen	140.635	-	-	-	140.635
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	225.848	-	-	-	225.848
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	159.714.171	-	-	-	159.714.171
Summe Verbindlichkeiten	216.654.155	164.562	103.375	1.410.864	218.332.956

31. Dezember 2021

Passiva:					
Überziehungskredite	975	-	-	-	975
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	247.257	14.266	-	77.534	339.057
Pensionsgeschäfte	4.216.684	-	-	-	4.216.684
Fällige Managementgebühren	10.221	-	-	-	10.221
Verbindlichkeiten aus Zinsen	908	-	-	-	908
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	44.710	-	-	-	44.710
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	33.654.281	-	-	-	33.654.281
Summe Verbindlichkeiten	38.175.036	14.266	-	77.534	38.266.836

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG China Equity

	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	4.371	-	-	-	4.371
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	179.055	-	-	-	179.055
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	294.747	-	-	-	294.747
Fällige Managementgebühren	5.990	-	-	-	5.990
Verbindlichkeiten aus Zinsen	1.163	-	-	-	1.163
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	94.798	-	-	-	94.798
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	9.767.411	-	-	-	9.767.411
Summe Verbindlichkeiten	10.347.535	-	-	-	10.347.535

31. Dezember 2021

Passiva:					
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	136.201	-	-	-	136.201
Fällige Managementgebühren	4.099	-	-	-	4.099
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	23.966	-	-	-	23.966
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	11.930.476	-	-	-	11.930.476
Summe Verbindlichkeiten	12.094.742	-	-	-	12.094.742

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy

	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	2.647	-	-	-	2.647
Fällige Managementgebühren	22.080	-	-	-	22.080
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	109.716	-	-	-	109.716
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	34.810.584	-	-	-	34.810.584
Summe Verbindlichkeiten	34.945.027	-	-	-	34.945.027

Man GLG Sustainable Strategic Income

	USD	USD	USD	USD	USD
31. Dezember 2022					
Passiva:					
Überziehungskredite	1.105.051	-	-	-	1.105.051
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	214.253	-	-	-	214.253
Fällige Managementgebühren	6.207	-	-	-	6.207
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	82.280	-	-	-	82.280
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	16.131.314	-	-	-	16.131.314
Summe Verbindlichkeiten	17.539.105	-	-	-	17.539.105

6. Finanzrisikomanagement (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Man GLG Dynamic Income

31. Dezember 2022	Weniger als 1 Monat USD	1 bis 3 Monate USD	3 bis 12 Monate USD	Mehr als 1 Jahr USD	Summe USD
Passiva:					
Verbindlichkeiten aus Sicherheiten gegenüber Brokern	220.010	-	-	-	220.010
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	12.548.608	-	-	-	12.548.608
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	135.773	-	-	143.012	278.785
Pensionsgeschäfte	4.347.389	-	-	-	4.347.389
Fällige Managementgebühren	9.430	-	-	-	9.430
Verbindlichkeiten aus Zinsen	26.502	-	-	-	26.502
Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten	80.479	-	-	-	80.479
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	23.440.832	-	-	-	23.440.832
Summe Verbindlichkeiten	40.809.023	-	-	143.012	40.952.035

Cybersicherheitsrisiko

Es können Cybersicherheitsverstöße eintreten, die einer unbefugten Partei den Zugriff auf die Vermögenswerte des Fonds, Anteilinhaberdaten oder proprietäre Informationen ermöglichen, oder die dazu führen können, dass die Plattform, der Anlageverwalter, die Vertriebsgesellschaft, der Administrator oder die Verwahrstelle Datenbeschädigung oder Betriebsstörungen erleiden. Der Fonds kann von vorsätzlichen Cybersicherheitsverstößen betroffen sein. Hierbei handelt es sich unter anderem um den unbefugten Zugriff auf Systeme, Netzwerke oder Geräte (wie z. B. durch „Hacken“), das Infizieren mit Computerviren oder sonstigem schädlichem Softwarecode und um Angriffe, die den Betrieb, Geschäftsprozesse oder die Zugänglichkeit oder das Funktionieren von Websites einstellen, ausschalten, verlangsamen oder auf sonstige Weise stören. Darüber hinaus können unbeabsichtigte Vorfälle eintreten, wie z. B. die unbeabsichtigte Weitergabe vertraulicher Informationen (die möglicherweise einen Verstoß gegen maßgebliche Datenschutzbestimmungen verursacht).

Ein Cybersicherheitsverstoß könnte zum Verlust oder Diebstahl von Anteilinhaberdaten oder -mitteln, zum Verlust des Zugriffs auf elektronische Systeme, zum Verlust oder Diebstahl von urheberrechtlich geschützten Informationen oder Unternehmensdaten, zur physischen Beschädigung eines Computer- oder Netzwerksystems oder zu mit Systemreparaturen verbundenen Kosten führen. Derartige Vorfälle könnten der Gesellschaft, dem Anlageverwalter, der Vertriebsgesellschaft, dem Administrator, der Verwahrstelle oder sonstigen Dienstleistern aufsichtsrechtliche Bußgelder, eine Rufschädigung, zusätzliche Compliance-Kosten oder finanzielle Verluste verursachen. Folglich können die Anteilinhaber ihr investiertes Kapital ganz oder teilweise verlieren. Darüber hinaus könnten derartige Vorfälle Emittenten betreffen, in die ein Fonds investiert, und dies könnte dazu führen, dass Anlagen eines Fonds an Wert verlieren, was wiederum dazu führen könnte, dass Anleger einschließlich des betroffenen Fonds und seiner Anteilinhaber ihre Anlage in diesen Emittenten ganz oder teilweise verlieren könnten.

Zum 31. Dezember 2022 wurden keine derartigen Fälle berichtet.

Optionsverkäufe

Als Optionsverkäufer erhält der Fonds eingangs eine Prämie und trägt anschließend das Risiko ungünstiger Kursentwicklungen des der Option zugrunde liegenden Finanzinstruments. Aufgrund des Verkaufs von Optionskontrakten ist der Fonds verpflichtet, auf Wunsch des Käufers den Basiswert zu einem festgelegten Kurs zu kaufen oder zu verkaufen. Dieser Kurs kann von dem am jeweiligen Termin geltenden Marktkurs abweichen. Der Verkauf von Optionen kann Verluste verursachen, die die vereinnahmten Prämien weit übersteigen.

Leerverkäufe

Leer verkaufte Wertpapiere sind Wertpapiere, die vom Fonds verkauft wurden, obwohl er sie nicht besaß, weil er mit einem Rückgang im Marktwert des Wertpapiers rechnete. Der Fonds geht damit das Risiko ein, dass der Wert des Wertpapiers steigt, statt zu fallen. Entsprechend kann der Abrechnungsbetrag der Verbindlichkeit aus leer verkauften Wertpapieren den in der Bilanz ausgewiesenen Betrag übersteigen, da der Fonds zum Kauf des Wertpapiers auf dem Markt zu geltenden Kursen verpflichtet ist, um seine Verpflichtungen zu erfüllen.

Sanktionsanalyse

Das Financial Crime Compliance („FCC“)-Team des Anlageverwalters hat die geltenden Sanktionsregelungen analysiert und externe Berater konsultiert, um zu beurteilen, ob der Fonds Dividendenzahlungen von russischen Emittenten erhalten darf, und ist zu dem Schluss gekommen, dass die Dividendenzahlungen selbst nicht von den Aufsichtsbehörden verboten sind und es keine Beschränkungen für den Erhalt von Zahlungen in Rubel gibt. Es wurde jedoch auch geprüft, welche Probleme sich bei der Auszahlung der Dividenden ergeben könnten, wenn sie beispielsweise von einer Bank gezahlt werden, die von der britischen oder amerikanischen Regierung sanktioniert wird. Sowohl im Vereinigten Königreich als auch in den USA sind die Banken verpflichtet, Gelder, die von einer benannten Bank überwiesen werden, zu sperren, selbst wenn der Überweisende nicht benannt ist. Diese Bedenken wurden auch von der Verwahrstelle/Unterverwahrstelle des Fonds geäußert, wobei die Verwahrstellen die Rückführung der Erlöse in die Basiswährung und die Verwendung des Barsaldos in jeglicher Form untersagten, unabhängig davon, ob die Dividenden auf die Bankkonten der Fonds oder auf getrennte Bankkonten überwiesen werden.

7. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten

	Konsolidierter Fonds 31. Dezember 2022 USD	Man GLG Global Convertibles 31. Dezember 2022 USD	Man GLG RI European Equity Leaders 31. Dezember 2022 EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity 31. Dezember 2022 JPY
Zinserträge	30.411.527	1.246.873	185.607	2.383.622
Zinsaufwendungen	(10.148.857)	(345.123)	(243.247)	(16.026.008)
Dividendenerträge	109.727.905	3.423	4.989.995	8.860.458.122
	<u>129.990.575</u>	<u>905.173</u>	<u>4.932.355</u>	<u>8.846.815.736</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	109.831.707	(33.009.055)	1.944.723	40.800.109.863
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(15.178.724)	703.157	1.048.604	(2.268.492.141)
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>94.652.983</u>	<u>(32.305.898)</u>	<u>2.993.327</u>	<u>38.531.617.722</u>
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Anlagen	(299.412.063)	(5.159.557)	(33.789.931)	(169.884.151)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(54.013)	69.863	583	(6.536.105)
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne	<u>(299.466.076)</u>	<u>(5.089.694)</u>	<u>(33.789.348)</u>	<u>(176.420.256)</u>
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>(74.822.518)</u>	<u>(36.490.419)</u>	<u>(25.863.666)</u>	<u>47.202.013.202</u>
			Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates 31. Dezember 2022 USD	Man GLG Global Emerging Markets Bond 31. Dezember 2022 USD
Zinserträge	1.656.058	12.644	2.982.251	1.335.987
Zinsaufwendungen	(2.584.247)	-	(290.773)	(1.404.182)
Dividendenerträge	25.068.525	522.813	-	-
	<u>24.140.336</u>	<u>535.457</u>	<u>2.691.478</u>	<u>(68.195)</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(63.848.725)	792.997	(7.002.941)	(3.257.187)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(1.677.854)	(23.478)	290.633	(604.042)
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>(65.526.579)</u>	<u>769.519</u>	<u>(6.712.308)</u>	<u>(3.861.229)</u>
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Anlagen	(70.246.124)	(6.139.389)	668.909	(2.111.069)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(137.584)	(4.246)	12.657	110
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne	<u>(70.383.708)</u>	<u>(6.143.635)</u>	<u>681.566</u>	<u>(2.110.959)</u>
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>(111.769.951)</u>	<u>(4.838.659)</u>	<u>(3.339.264)</u>	<u>(6.040.383)</u>

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurde der Man Numeric RI Global Equity in Man Numeric Global RI Climate umbenannt.

7. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Man GLG Pan-European Equity Growth 31. Dezember 2022 EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth 31. Dezember 2022 USD	##Man Numeric Europe RI Climate 31. Dezember 2022 EUR	Man GLG RI Sustainable European Income 31. Dezember 2022 EUR
Zinserträge	8.963	37.394	3.084	1.451
Zinsaufwendungen	(11.030)	(8.977)	(7.608)	(2.194)
Dividendenerträge	3.521.721	1.630.022	1.009.639	1.133.305
	<u>3.519.654</u>	<u>1.658.439</u>	<u>1.005.115</u>	<u>1.132.562</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(12.737.183)	(35.472.533)	662.647	2.161.395
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	727.248	7.385.717	300.949	(10.358)
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>(12.009.935)</u>	<u>(28.086.816)</u>	<u>963.596</u>	<u>2.151.037</u>
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Anlagen	(98.082.428)	(42.890.325)	(6.515.167)	(6.922.486)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(210)	630	(655)	17
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne	<u>(98.082.638)</u>	<u>(42.889.695)</u>	<u>(6.515.822)</u>	<u>(6.922.469)</u>
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>(106.572.919)</u>	<u>(69.318.072)</u>	<u>(4.547.111)</u>	<u>(3.638.870)</u>

Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurde der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

	Man Numeric China A Equity 31. Dezember 2022 USD	Man GLG Strategic Bond 31. Dezember 2022 GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity 31. Dezember 2022 USD	Man Numeric US High Yield 31. Dezember 2022 USD
Zinserträge	23.505	10.346.632	51.416	3.014.049
Zinsaufwendungen	(1.722)	(2.832.124)	(90.910)	(5)
Dividendenerträge	505.772	964.591	1.164.315	-
	<u>527.555</u>	<u>8.479.099</u>	<u>1.124.821</u>	<u>3.013.994</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(5.492.185)	(7.840.099)	(6.207.685)	(6.039.598)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(508.291)	(2.004.536)	(211.546)	-
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>(6.000.476)</u>	<u>(9.844.635)</u>	<u>(6.419.231)</u>	<u>(6.039.598)</u>
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Anlagen	(2.980.823)	(17.942.233)	(2.951.916)	(3.824.371)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	575	64.200	526	-
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne	<u>(2.980.248)</u>	<u>(17.878.033)</u>	<u>(2.951.390)</u>	<u>(3.824.371)</u>
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>(8.453.169)</u>	<u>(19.243.569)</u>	<u>(8.245.800)</u>	<u>(6.849.975)</u>

7. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Man GLG Global Investment Grade Opportunities 31. Dezember 2022 USD	Man GLG China Equity 31. Dezember 2022 USD	**Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy 31. Dezember 2022 EUR	**Man GLG Sustainable Strategic Income 31. Dezember 2022 USD
Zinserträge	5.462.641	16.622	4.008	513.876
Zinsaufwendungen	(435.451)	(16.790)	(7.973)	(982.979)
Dividendenerträge	-	94.779	511.044	-
	<u>5.027.190</u>	<u>94.611</u>	<u>507.079</u>	<u>(469.103)</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(17.854.883)	(1.951.113)	(2.099.004)	(1.614.039)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	<u>(2.105.297)</u>	<u>6.626</u>	<u>(1.477.826)</u>	<u>1.102.604</u>
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>(19.960.180)</u>	<u>(1.944.487)</u>	<u>(3.576.830)</u>	<u>(511.435)</u>
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Anlagen	10.806.107	(215.070)	(649.859)	(786.177)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	<u>(15.857)</u>	<u>(10)</u>	<u>(837)</u>	<u>4.185</u>
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne	<u>10.790.250</u>	<u>(215.080)</u>	<u>(650.696)</u>	<u>(781.992)</u>
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>(4.142.740)</u>	<u>(2.064.956)</u>	<u>(3.720.447)</u>	<u>(1.762.530)</u>
				**Man GLG Dynamic Income 31. Dezember 2022 USD
Zinserträge				1.031.561
Zinsaufwendungen				(76.297)
Dividendenerträge				-
				<u>955.264</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen				(1.031.348)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen				<u>(324.321)</u>
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)				<u>(1.355.669)</u>
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Anlagen				3.671.627
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen				<u>(13.088)</u>
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne				<u>3.658.539</u>
Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten				<u>3.258.134</u>

** Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, 23. März 2022 bzw. 30. Juni 2022 aufgenommen.

7. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Kombinierter Fonds 31. Dezember 2021 USD	Man GLG Global Convertibles 31. Dezember 2021 USD	Man GLG RI European Equity Leaders 31. Dezember 2021 EUR	Man GLG Japan CoreAlpha Equity 31. Dezember 2021 JPY
Zinserträge	22.619.570	926.811	106.341	50.907
Zinsaufwendungen	(4.776.380)	(37.716)	(174.004)	(11.638.374)
Dividendenerträge	102.570.325	2.580	7.627.903	5.750.300.474
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	(63)	-	-	-
	<u>120.413.452</u>	<u>891.675</u>	<u>7.560.240</u>	<u>5.738.713.007</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	510.226.810	11.087.588	31.101.090	22.622.299.562
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(2.870.279)	821.722	1.711.376	84.830.417
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>507.356.531</u>	<u>11.909.310</u>	<u>32.812.466</u>	<u>22.707.129.979</u>
Veränderung im nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	28.601.592	(19.328.201)	(1.166.874)	16.453.182.949
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(18.380)	(2.045)	(40)	124.106
Summe der Veränderung der nicht realisierten (Verluste)/Gewinne	<u>28.583.212</u>	<u>(19.330.246)</u>	<u>(1.166.914)</u>	<u>16.453.307.055</u>
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>656.353.195</u>	<u>(6.529.261)</u>	<u>39.205.792</u>	<u>44.899.150.041</u>
			Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Man GLG Global Emerging Markets Bond
	Man Numeric Emerging Markets Equity 31. Dezember 2021 USD	*Man Numeric Global RI Climate 31. Dezember 2021 USD	31. Dezember 2021 USD	31. Dezember 2021 USD
Zinserträge	135.273	615	3.758.613	1.089.259
Zinsaufwendungen	(3.835.081)	(1.393)	(57.781)	(1.772)
Dividendenerträge	24.736.684	435.752	-	-
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	-	-	-	-
	<u>21.036.876</u>	<u>434.974</u>	<u>3.700.832</u>	<u>1.087.487</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	110.415.960	5.109.092	(1.413.630)	(1.323.549)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(854.121)	(7.943)	42.829	(58.107)
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>109.561.839</u>	<u>5.101.149</u>	<u>(1.370.801)</u>	<u>(1.381.656)</u>
Veränderung im nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(97.528.434)	(194.192)	(6.549.869)	(2.921.530)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(34.184)	(1.561)	49	(11)
Summe der Veränderung der nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust)	<u>(97.562.618)</u>	<u>(195.753)</u>	<u>(6.549.820)</u>	<u>(2.921.541)</u>
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>33.036.097</u>	<u>5.340.370</u>	<u>(4.219.789)</u>	<u>(3.215.710)</u>

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurde der Man Numeric RI Global Equity in Man Numeric Global RI Climate umbenannt.

7. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	Man GLG Pan-European Equity Growth 31. Dezember 2021 EUR	Man GLG RI Global Sustainable Growth 31. Dezember 2021 USD	##Man Numeric Europe RI Climate 31. Dezember 2021 EUR	**Man GLG RI Sustainable European Income 31. Dezember 2021 EUR
Zinserträge	860	970	1.063	-
Zinsaufwendungen	(54.657)	(12.995)	(9.905)	(10.357)
Dividendenerträge	5.535.269	1.524.264	612.175	1.856.665
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	-	-	(8)	-
	<u>5.481.472</u>	<u>1.512.239</u>	<u>603.325</u>	<u>1.846.308</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	78.536.148	15.651.076	5.271.226	5.268.618
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(333.853)	(3.012.403)	(26.010)	5.730
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>78.202.295</u>	<u>12.638.673</u>	<u>5.245.216</u>	<u>5.274.348</u>
Veränderung im nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	14.184.780	13.921.947	708.245	1.799.543
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	39	451	1.401	(47)
Summe der Veränderung der nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust)	<u>14.184.819</u>	<u>13.922.398</u>	<u>709.646</u>	<u>1.799.496</u>
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>97.868.586</u>	<u>28.073.310</u>	<u>6.558.187</u>	<u>8.920.152</u>

Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurde der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

** Mit Wirkung vom 12. Mai 2021 wurde der Man GLG European Income Opportunities in Man GLG RI Sustainable European Income umbenannt.

	Man Numeric China A Equity 31. Dezember 2021 USD	Man GLG Strategic Bond 31. Dezember 2021 GBP	Man GLG Asia (ex Japan) Equity 31. Dezember 2021 USD	Man Numeric US High Yield 31. Dezember 2021 USD
Zinserträge	19	7.126.227	676	6.664.516
Zinsaufwendungen	(3.678)	(285.310)	(10.743)	(7.512)
Dividendenerträge	1.033.209	2.002.849	1.284.437	-
Auf leerverkaufte Wertpapiere gezahlte Dividenden	(54)	-	-	-
	<u>1.029.496</u>	<u>8.843.766</u>	<u>1.274.370</u>	<u>6.657.004</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	13.637.761	4.804.112	265.012	3.008.731
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(130.753)	(1.517.654)	691.590	-
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>13.507.008</u>	<u>3.286.458</u>	<u>956.602</u>	<u>3.008.731</u>
Veränderung im nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(7.416.931)	(10.899.497)	(2.861.144)	(2.460.130)
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(564)	6.951	633	-
Summe der Veränderung der nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust)	<u>(7.417.495)</u>	<u>(10.892.546)</u>	<u>(2.860.511)</u>	<u>(2.460.130)</u>
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>7.119.009</u>	<u>1.237.678</u>	<u>(629.539)</u>	<u>7.205.605</u>

7. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

	#Man GLG Global Investment Grade Opportunities 31. Dezember 2021 USD	#Man GLG China Equity 31. Dezember 2021 USD
Zinserträge	115.008	213
Zinsaufwendungen	(15.333)	-
Dividendenerträge	-	-
	<u>99.675</u>	<u>213</u>
<i>Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten</i>		
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(569.751)	(117.741)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	(649.683)	(2.244)
Summe realisierter Gewinn/(Verlust)	<u>(1.219.434)</u>	<u>(119.985)</u>
Veränderung im nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	807.208	50.756
Veränderung im nicht realisierten Netto(verlust)/-gewinn aus Fremdwährungen	6.566	-
Summe der Veränderung der nicht realisierten Nettogewinn/(-verlust)	<u>813.774</u>	<u>50.756</u>
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	<u>(305.985)</u>	<u>(69.016)</u>

Der Man GLG Global Investment Grade Opportunities und der Man GLG China Equity haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. November 2021 bzw. am 14. Dezember 2021 aufgenommen.

8. Gebühren und Aufwendungen

Management- und Performancegebühren

Der Fonds hat Man Asset Management (Ireland) Limited (den „Manager“) zum Manager des Fonds bestellt. Der Manager hat seine mit der Verwaltung und Eintragung von Anteilen verbundenen Aufgaben an BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (der „Administrator“) delegiert. Die Anlageverwaltungsfunktionen wurden für die Man GLG Portfolios an GLG Partners LP, für die GLG LLC Portfolios an GLG LLC und für die Man Numeric Portfolios an Numeric Investors LLC (die „Anlageverwalter“) delegiert. Der Manager hat seine mit dem Vertrieb verbundenen Aufgaben an Man Investments AG (die „Vertriebsgesellschaft“) delegiert.

Man GLG Portfolios

Der Manager erhält Managementgebühren auf jährlicher Basis, auf der Grundlage des durchschnittlichen Nettoinventarwerts jedes der Portfolios, nach Anteilsklasse gemäß der Tabellen unten und auf der nächsten Seite:

	0,20 %	0,25 %	0,30 %	0,43 %	0,49 %	0,50 %	0,60 %	0,68 %	0,75 %	bis zu 0,75 %	0,85 %
Man GLG Global Convertibles							IL,IM		I	IU	
Man GLG RI European Equity Leaders									I		
Man GLG Japan CoreAlpha Equity									I	IXX	
Man GLG Pan-European Equity Growth			IF						I		
Man GLG RI Global Sustainable Growth									I	IU	
*Man GLG RI Sustainable European Income			IF			IM			I		
Man GLG Strategic Bond	IXF			I				IV			D
Man GLG Asia (ex Japan) Equity						IF			I		
Man GLG Global Investment Grade Opportunities		IF			I						
Man GLG China Equity			IF						I		
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy			IF						I		
Man GLG Dynamic Income		IF			I						

8. Gebühren und Aufwendungen (Fortsetzung)

Management- und Performancegebühren (Fortsetzung)

Man GLG Portfolios (Fortsetzung)

	0,11 %	0,43 %	1,00 %	1,05 %	1,18 %	1,35 %	1,50 %	1,75 %
Man GLG Global Convertibles						DL	D	
Man GLG RI European Equity Leaders							D	
Man GLG Japan CoreAlpha Equity							D	
Man GLG Pan-European Equity Growth			IV	DF			D	DV
Man GLG RI Global Sustainable Growth							D	
Man GLG RI Sustainable European Income				DF			D	
Man GLG Strategic Bond					DY,DV			
Man GLG Sustainable Strategic Income	IF	I						

GLG LLC Portfolios

Der Manager erhält Managementgebühren auf jährlicher Basis, auf der Grundlage des durchschnittlichen Nettoinventarwerts jedes der Portfolios, nach Anteilsklasse gemäß der nachfolgenden Tabelle:

	0,20 %	0,50 %	0,60 %	1,25 %	1,35 %
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates			I		D
Man GLG Emerging Markets Bond	IF	I		D	

Man Numeric Portfolios

Der Manager erhält Managementgebühren auf jährlicher Basis, auf der Grundlage des durchschnittlichen Nettoinventarwerts jedes der Portfolios, nach Anteilsklasse gemäß der nachfolgenden Tabelle:

	0,50 %	0,55 %	0,65 %	0,85 %	bis zu 0,85 %	0,90 %	1,30 %	1,40 %	1,60 %	1,65 %
Man Numeric Emerging Markets Equity				I	IMU				D	
*Man Numeric Global RI Climate		I					D			
*Man Numeric Europe RI Climate			I					D		
Man Numeric China A Equity						I				D
Man Numeric US High Yield	D									

* Mit Wirkung vom 31. Januar 2022 wurden der Man Numeric RI Global Equity und der Man Numeric RI European Equity in Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate umbenannt.

Der Manager erhält für die Anteilsklassen DL und IL des Man GLG Global Convertible eine Performancegebühr. Diese beläuft sich auf 20 % des gesamten Wertzuwachses der betreffenden Anteile jedes Anlegers oberhalb der Rendite der Benchmark der Anleger für diese Anteile (diese beruht auf einem 3-Monats-LIBOR/EURIBOR-Satz der funktionalen Währung der betreffenden Anteilsklasse jedes Portfolios). Diese Performancegebühr ist nur für Anteile zahlbar, deren Nettoinventarwert je Anteil zum Ende des Performancejahres oberhalb der High Watermark liegt. Außerdem erhält der Manager für Anteile der Klasse IM des Man GLG Global Convertibles eine Performancegebühr in Höhe von 20 % des gesamten Wertzuwachses der betreffenden Anteile jedes Anlegers an der oben erwähnten Klasse oberhalb der Rendite der Benchmark der Anleger für diese Anteile (diese beruht auf dem Global Focus Hedged Sub-Index des Thomson Reuters Global Convertible Bond Index). Hierbei gilt jedoch, dass dieser Wertzuwachs durch den Betrag beschränkt wird, um den sich der Wert der Benchmark während des Wertentwicklungsjahres erhöht hat (für nähere Einzelheiten, siehe Prospekt des Fonds). Außerdem erhält der Manager für die Klasse IM des Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities) eine Performancegebühr in Höhe von 10 % des gesamten Wertzuwachses der betreffenden Anteile jedes Anlegers an der oben erwähnten Klasse oberhalb der Rendite der Benchmark der Anleger für diese Anteile (diese beruht auf dem MSCI Europe Index). Hierbei gilt jedoch, dass dieser Wertzuwachs durch den Betrag beschränkt wird, um den sich der Wert der Benchmark während des Wertentwicklungsjahres erhöht hat (für nähere Einzelheiten, siehe Prospekt des Fonds). Außerdem erhält der Manager für die Klasse IMU des Man Numeric Emerging Markets Equity eine Performancegebühr in Höhe von 20 % des gesamten Wertzuwachses der betreffenden Anteile jedes Anlegers an der oben erwähnten Klasse oberhalb der Rendite der Benchmark der Anleger für diese Anteile (diese beruht auf dem MSCI Europe Index). Hierbei gilt jedoch, dass dieser Wertzuwachs durch den Betrag beschränkt wird, um den sich der Wert der Benchmark während des Wertentwicklungsjahres erhöht hat (für nähere Einzelheiten, siehe Prospekt des Fonds).

8. Gebühren und Aufwendungen (Fortsetzung)

Management- und Performancegebühren (Fortsetzung)

Der Manager zahlt die Gebühren der Anlageverwalter und der Vertriebsgesellschaft. Der Manager kann außerdem Vertriebsgebühren, Ausgabeaufschläge und bedingt aufgeschobene Rücknahmeaufschläge erhalten.

Der Manager hat ferner Anspruch auf Erstattung aller Auslagen, die zugunsten des Fonds anfallen, einschließlich der Auslagen der Anlageverwalter, des Administrators und/oder der Vertriebsgesellschaft, die ihm in Rechnung gestellt worden sind. Der Manager zahlt die Gebühren der Anlageverwalter aus seinen Management- und Performancegebühren und die Anlageverwalter zahlen die Gebühren etwaiger Anlageberater aus ihren Gebühren.

Verwaltungsgebühren

In Bezug auf jedes Man GLG Portfolio, GLG LLC Portfolio und Man Numeric Portfolio fallen dem Fonds für die vom Administrator und den Anlageverwaltern erbrachten Verwaltungsdienste Verwaltungsgebühren an. Die Verwaltungsgebühr beträgt maximal 0,30 % pro Jahr des NIW des betreffenden Portfolios. Der jeweils dem Administrator und den Anlageverwaltern gezahlte Betrag wird von Zeit zu Zeit zwischen den Parteien vereinbart. Die Anlageverwalter erhalten nur den Teil der Verwaltungsgebühr, der sich auf die administrative Unterstützung bezieht, die sie gemäß dem Verwaltungsdienstleistungsvertrag erbringen. Ein Teil der Verwaltungsgebühr wird vom Fonds monatlich rückwirkend an den Manager (zur Weiterleitung an den Administrator) gezahlt, der verbleibende Betrag wird vom Fonds an die Anlageverwalter gezahlt. Der Fonds erstattet dem Manager zudem angemessene Auslagen, welche dem Administrator und dem Anlageverwalter angefallen sind, aus dem Vermögen des Fonds. Der Manager ist dafür verantwortlich, dem Administrator und den Anlageverwaltern diese Aufwendungen zu erstatten.

Verwahrstellengebühren

Der Fonds zahlt der Verwahrstelle eine Verwahrstellengebühr in Höhe von maximal 0,04 % pro Jahr des NIW der Man GLG Portfolios, zuzüglich der gegebenenfalls auf diese Gebühren anfallenden Mehrwertsteuer. Im Fall des Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity) und Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity) betragen die Verwahrstellengebühren maximal 0,04 % pro Jahr des NIW, zuzüglich Mehrwertsteuer. Für den Man Numeric Emerging Markets Equity betragen die gezahlten Verwahrstellengebühren maximal 60.000 USD, gegebenenfalls zuzüglich Mehrwertsteuer. Der Fonds erstattet der Verwahrstelle zudem angemessene, der Verwahrstelle angefallene Auslagen und Transaktionsgebühren sowie Gebühren (welche maximal den handelsüblichen Sätzen entsprechen) und angemessene Auslagen von Unterverwahrstellen, welche von der Verwahrstelle bestellt wurden, aus dem Vermögen des betreffenden Portfolios. Zudem kommt der Fonds für Transaktionsgebühren auf. Die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle werden monatlich rückwirkend gezahlt.

Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats

Der Fonds zahlt die Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats. Derzeit wird nicht erwartet, dass das Honorar eines einzelnen Verwaltungsratsmitglieds 15.000 EUR pro Jahr übersteigen wird. Die Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 auf 45.000 EUR (2021: 45.000 EUR). Darüber hinaus werden den Mitgliedern des Verwaltungsrats Reisekosten sowie sonstige Auslagen im Zusammenhang mit der Teilnahme an Sitzungen und anderen Angelegenheiten erstattet, darunter auch Aufwendungen im Zusammenhang mit der Erbringung von Due Diligence-Prüfungen zugunsten des Fonds.

Vertriebsgebühren

In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 bzw. zum 31. Dezember 2021 wurden dem Fonds keine Vertriebsgebühren berechnet.

Nähere Einzelheiten zu den dem Fonds während des Geschäftsjahres angefallenen Management-, Performance-, Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren sind in der Gesamterfolgsrechnung aufgeführt.

Die zum Ende des Geschäftsjahres vom Fonds noch nicht gezahlten Beträge für Management-, Performance-, Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren sind nachfolgend aufgeführt:

	2022 Kombinierter Fonds USD	2021 Kombinierter Fonds USD
Managementgebühren	2.097.977	2.417.493
Performancegebühren	219.340	2.022.857
Verwaltungsgebühren	3.677.646	3.511.584
Verwahrstellengebühren	480.029	376.899

9. Transaktionen mit verbundenen Parteien

Weder die Verwaltungsratsmitglieder noch deren Familien noch die Anlageverwalter hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 Anteile am Teilfonds. Die einzige Ausnahme hierzu bilden 29.998 Zeichneranteile, die von Man Asset Management (Ireland) Limited gehalten wurden.

Im Geschäftsjahr bezogen Samantha McConnell, Ronan Daly und Bronwyn Wright jeweils Verwaltungsrats honorare in Höhe von 15.000 EUR. John Morton hat sich entschieden, auf seine Verwaltungsratsbezüge zu verzichten, da er CEO und Verwaltungsratsmitglied von Man Asset Management (Ireland) Limited, dem Manager des Fonds, ist.

Jedes der Verwaltungsratsmitglieder ist derzeit oder möglicherweise künftig an anderen Finanzanlagen und beruflichen Aktivitäten beteiligt, die Interessenkonflikte mit der Verwaltung des Fonds hervorrufen können. Diese Aktivitäten umfassen die Führung oder Verwaltung anderer Gesellschaften (auch solcher mit ähnlichen Anlagezielen wie der Fonds oder von Strukturen, die mit den von Man Group plc gesponserten Investmentfonds verbunden sind) sowie Dienste als Verwaltungsratsmitglied, Berater und/oder Vertreter anderer Gesellschaften einschließlich Gesellschaften und Rechtsstrukturen, in die der Fonds investieren kann und/oder die in den Fonds investieren können.

9. Transaktionen mit verbundenen Parteien (Fortsetzung)

GLG Partners LP, GLG LLC und Numeric Investors LLC sind verbundene Parteien, da die Anlageverwalter, Man Asset Management (Ireland) Limited als Manager eine verbundene Partei ist und Man Investments AG als Vertriebsgesellschaft des Fonds eine verbundene Partei ist, und daher sind auch alle Tochtergesellschaften von Man Group plc verbundene Parteien.

Man Group Operations Limited zahlt bestimmte Betriebsgebühren und -kosten zentral im Namen des Fonds. Diese werden dann in regelmäßigen Abständen an den Fonds weiterberechnet. Die passiven Rechnungsabgrenzungsposten und sonstigen Verbindlichkeiten enthalten zum 31. Dezember 2022 ausstehende Umlagen in Höhe von 202.747 USD.

Die folgenden Transaktionen erfolgten zwischen dem Fonds und seinen verbundenen Parteien:

Verbundene Partei 31. Dezember 2022	Arten von Gebühren Erträgen	Gesamtgebühren/ (Erträge) USD	Verbindlichkeiten/ (Forderungen) aus Gebühren USD
Man Asset Management (Ireland) Limited	Managementgebühren	26.390.174	2.097.977
Man Asset Management (Ireland) Limited	Performancegebühren	605.803	219.340
Man Asset Management (Ireland) Limited	Verwaltungsgebühren*	12.294.207	3.677.646
Man Asset Management (Ireland) Limited	Aufwandsersatzung	(7.952.061)	(2.442.686)
Man Group Operations Limited	Operative Gebühren und Aufwendungen	-	202.747
Verwaltungsratsmitglieder	Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats	47.407	-
31. Dezember 2021 Verbundene Partei	Arten von Gebühren Erträgen	Gesamtgebühren/ (Erträge) USD	Verbindlichkeiten/ (Forderungen) aus Gebühren USD
Man Asset Management (Ireland) Limited	Managementgebühren	31.745.063	2.417.493
Man Asset Management (Ireland) Limited	Performancegebühren	1.893.524	2.022.857
Man Asset Management (Ireland) Limited	Verwaltungsgebühren*	14.257.878	3.511.584
Man Asset Management (Ireland) Limited	Aufwandsersatzung	(8.075.902)	(2.055.982)
Verwaltungsratsmitglieder	Honorare der Mitglieder des Verwaltungsrats	53.173	-

* Die Beträge, die an den Administrator und den Anlageverwalter gezahlt werden, werden von Zeit zu Zeit zwischen den Parteien vereinbart, wobei der Anlageverwalter jedoch nur den Teil der Verwaltungsgebühr erhält, der sich auf die unterstützenden Verwaltungsdienstleistungen bezieht, die er gemäß dem Verwaltungsdienstleistungsvertrag erbringt. Der Fonds zahlt einen Teil der Verwaltungsgebühr monatlich nachträglich an die Verwaltungsgesellschaft (zur Weiterleitung an den Administrator) und den verbleibenden Betrag an den Anlageverwalter.

Die Verwaltungsgebühren und Aufwandsersatzung sind in der Bilanz unter „Passive Rechnungsabgrenzungsposten und sonstige Verbindlichkeiten“ bzw. „Sonstige Aktiva“ erfasst.

Die vorstehenden Beträge sind auf Sicht zahlbar und nicht verzinslich. Ferner erfolgten die vorstehenden Transaktionen zu Bedingungen, die marktüblichen Konditionen entsprechen.

Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 besaßen mit Man Group plc verbundene Unternehmen rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile, wie im Folgenden detailliert dargelegt:

Teilfonds	Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile	
	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Man GLG Global Convertibles	74	310
Man GLG RI European Equity Leaders	235	220
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	50	80
Man Numeric Emerging Markets Equity	3.010	4.466
Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)	1.142	2.276
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	2.148	405.060
Man GLG Global Emerging Markets Bond	499	1.166
Man GLG Pan-European Equity Growth	4.318	6.950
Man GLG RI Global Sustainable Growth	4.522	4.772
Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)	130	130
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	367	744
Man Numeric China A Equity	70	90
Man GLG Strategic Bond	254.396	304.777
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	75.243	216.238
Man Numeric US High Yield	9.673	22.658
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	256	199.602
Man GLG China Equity	19.221	120.040
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy	200.208	k. A.
Man GLG Sustainable Strategic Income	40	k. A.
Man GLG Dynamic Income	200.043	k. A.

10. Anteilskapital

Das genehmigte Anteilskapital des Fonds beläuft sich auf 38.092,14 EUR und teilt sich in 30.000 Zeichneranteile im Wert von jeweils 1,269 EUR („Zeichneranteile“) und 500.000.000.000 nennwertlose Anteile, die bei erstmaliger Erfassung als nicht klassifizierte Anteile ausgewiesen sind. Der Verwaltungsrat ist befugt, zu Bedingungen, die er nach eigenem Ermessen bestimmt, bis zu 500.000.000.000 nennwertlose Anteile auszugeben, die als Anteile einer beliebigen Serie oder Klasse ausgewiesen werden können.

Zeichneranteile des Fonds

Die Zeichneranteile werden von Mitarbeitern oder ehemaligen Mitarbeitern den Anlageverwaltern und Man Asset Management (Ireland) Limited gehalten.

Die Zeichneranteile wurden bei Auflegung des Fonds vollständig ausgegeben. Sie berechtigen die Inhaber, an Hauptversammlungen des Fonds teilzunehmen und abzustimmen. Die Inhaber haben jedoch kein Anrecht auf eine Partizipation am Gewinn oder Vermögen des Fonds, mit Ausnahme einer Erstattung des Kapitals im Falle einer Auflösung. Das auf die Zeichneranteile entfallende Kapital wird vom bzw. im Namen des Managers als wirtschaftliches Eigentum gehalten.

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile

Die rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile des Fonds können auf schriftliche Anweisung des Anteilinhabers hin wöchentlich an jedem Handelstag mit einer Frist von fünf Tagen zurückgenommen werden. Der Fonds ist daher potenziell wöchentlichen Rücknahmen durch Anteilinhaber ausgesetzt. Die Exponierung gegenüber dem Liquiditätsrisiko durch Rücknahmeanträge seitens der Anteilinhaber wird verwaltet, indem die Rücknahmefrist speziell auf die von den Anlageverwaltern vereinbarte erwartete Liquidität der zugrunde liegenden Anlagen abgestimmt wird.

Der Fonds managt seine Verpflichtung zur Rücknahme der Anteile, wenn dies erforderlich ist, und sein gesamtes Liquiditätsrisiko, indem er:

- Rücknahmen nur am ersten Geschäftstag jeder Kalenderwoche erlaubt.
- vor Rücknahmen eine Kündigungsfrist von fünf Geschäftstagen fordert.

Es ist die Politik des Fonds, Rücknahmeanträge auf eine der folgenden Weisen oder wie sonst im Fondsprospekt vorgesehen zu erfüllen:

- Abhebung von Bareinlagen.
- Veräußerung von Vermögenswerten.

Alle ausgegebenen Anteile sind vollständig einbezahlt. Das Kapital des Fonds wird durch diese nennwertlosen Anteile dargestellt, die jeweils mit einer Stimme ausgestattet sind. Sie haben Anspruch auf Dividenden sowie auf die Zahlung eines anteiligen Betrags des NIW des Fonds zum Rücknahmedatum.

Für Anleger kann ein Ausgabeaufschlag in Höhe von bis zu 5 % auf eine gewünschte Zeichnung erhoben werden. Dieser ist dem Manager für jegliche Zeichnung jeglicher Anteilsklasse zu zahlen.

Zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 gestalteten sich die Anteile wie folgt:

	Anteile zum 1. Januar 2022	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2022
<i>Man GLG Global Convertibles</i>				
D USD	24.894	418	(590)	24.722
D H EUR	174.182	5.818	(19.536)	160.464
DL USD	253.500	5.291	(239.830)	18.961
DL H EUR	19.711	3.656	(6.868)	16.499
DL H GBP	2.804	-	-	2.804
I USD	107.965	137	(49.161)	58.941
I H EUR	64.166	24.866	(40.506)	48.526
IL USD	117.377	4.116	(12.454)	109.039
IL H EUR	3.229	-	(672)	2.557
IM USD	7.568	5.402	(6.240)	6.730
IM H EUR	302.743	4.194	(19.598)	287.339
IM H GBP	2.058	1.870	(2.004)	1.924
IU H EUR	383.627	87.098	(193.191)	277.534
I H GBP	47.158	1.725	(7.042)	41.841
Summe	1.510.982	144.591	(597.692)	1.057.881

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2022	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2022
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>				
D EUR	22.211	184	(18.832)	3.563
D C EUR	91.779	3.476	(34.416)	60.839
D C USD	10	-	-	10
D H GBP	150	-	(150)	-
D H USD	10.701	175	(8.253)	2.623
I EUR	3.484	-	(747)	2.737
I C EUR	1.685.006	14.689	(1.002.203)	697.492
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	271.647	-	(271.647)	-
I H USD	18.525	-	(17.985)	540
Summe	2.103.563	18.524	(1.354.233)	767.854
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>				
D EUR	14.830	11.401	(7.851)	18.380
D EUR G Dist	4.598	716	(678)	4.636
D JPY	144.643	91.977	(59.429)	177.191
D USD	18.509	1.879	(1.032)	19.356
D H CHF	15.905	1.841	(3.491)	14.255
D H EUR	169.821	178.265	(227.072)	121.014
D H GBP	20.532	1.610	(4.222)	17.920
D H USD	177.893	353.172	(348.400)	182.665
I EUR	175.408	702.524	(286.935)	590.997
I EUR Dist	520	63.741	(14.663)	49.598
I GBP	267.540	139.896	(104.644)	302.792
I JPY	2.821.087	1.627.556	(727.909)	3.720.734
I JPY Dist	734.585	88.743	(390.647)	432.681
I SEK	50	-	-	50
I USD	165.351	164.362	(127.031)	202.682
I USD Dist	7.306	6.080	(3.271)	10.115
I H CHF	42.171	1.535	(21.877)	21.829
I H EUR	206.804	1.054.476	(589.376)	671.904
I H EUR Dist	6.247	319.216	(71.602)	253.861
I H GBP	483.171	155.947	(373.604)	265.514
I H GBP Dist	140.294	20.735	(70.472)	90.557
I H USD	170.888	39.919	(121.493)	89.314
I H USD Dist	38.801	2.130	(27.762)	13.169
IXX JPY	1.862.943	293.488	(1.176.291)	980.140
IXX H EUR	1.811.855	1.812.049	(49.169)	3.574.735
IXX H EUR Dist	2.906	2.426	(2.306)	3.026
IXX H GBP Dist	5.212	2.309	(326)	7.195
IXX H CHF	-	28.988	(2.163)	26.825
IXX H USD Dist	-	2.462	-	2.462
IXX H USD	-	110.869	(3.597)	107.272
Summe	9.509.870	7.280.312	(4.817.313)	11.972.869
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>				
D CHF	1.500	-	-	1.500
D EUR	1.229	-	-	1.229
D USD	5.299	565	(1.651)	4.213
I EUR	3.556	9.608	(639)	12.525
I JPY	1.123.527	53.225	(338.262)	838.490
I SEK	50	-	-	50
I USD	1.205.954	254.138	(71.514)	1.388.578
IMU USD	2.432.661	-	(911.460)	1.521.201
I GBP	10	5	(4)	11
Summe	4.773.786	317.541	(1.323.530)	3.767.797

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2022	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2022
<i>Man Numeric Global RI Climate</i> <i>(vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>				
D EUR	9.995	2.425	(2.885)	9.535
D USD	23.579	116	(1.225)	22.470
I EUR	10	-	-	10
I SEK	50	-	-	50
I USD	105.760	46	(2.573)	103.233
I H EUR	10	-	-	10
Summe	<u>139.404</u>	<u>2.587</u>	<u>(6.683)</u>	<u>135.308</u>
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>				
D C EUR	10	-	-	10
D C USD	13	284	(39)	258
I C EUR	158.805	64.120	(62.112)	160.813
I C GBP	10	-	-	10
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	558.825	402.286	(403.014)	558.097
I C USD Dist	10	-	-	10
I H EUR Dist	10	-	-	10
I H GBP	39.030	3	(1)	39.032
Summe	<u>756.763</u>	<u>466.693</u>	<u>(465.166)</u>	<u>758.290</u>
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>				
D C EUR	12	284	(87)	209
D C USD	650	-	(640)	10
D H EUR	38.100	-	(38.100)	-
I C EUR	10	-	-	10
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	226.511	1.576	(2.223)	225.864
I H EUR	38.967	2.238	(35.849)	5.356
IF H EUR	117.450	37.801	(75.201)	80.050
Summe	<u>421.750</u>	<u>41.899</u>	<u>(152.100)</u>	<u>311.549</u>
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>				
D C EUR	40.476	3.389	(39.148)	4.717
D C USD	18.157	-	(737)	17.420
DF C EUR	2.458	314	(32)	2.740
I C CHF	533	100	-	633
I C EUR	1.419.692	77.827	(657.445)	840.074
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	34.250	3.980	(15.362)	22.868
IF C EUR	612.058	341.578	(543.399)	410.237
DV C USD	6.724	4.693	(9.018)	2.399
IV C USD	12.001	9.306	(9.750)	11.557
Summe	<u>2.146.399</u>	<u>441.187</u>	<u>(1.274.891)</u>	<u>1.312.695</u>
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>				
D C EUR	896	20	(761)	155
I USD	14.287	201	(1.010)	13.478
I C EUR	126.403	77	(118.239)	8.241
I C GBP	1.940	1.028	(211)	2.757
I C SEK	50	-	-	50
IU FH NOK	12.082.225	3.428.264	(15.510.464)	25
I H (BRL) USD	24.500	-	-	24.500
Summe	<u>12.250.301</u>	<u>3.429.590</u>	<u>(15.630.685)</u>	<u>49.206</u>

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2022	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2022
<i>Man Numeric Europe RI Climate</i> <i>(vormals Man Numeric RI European Equity)</i>				
D C EUR	2.710	30.503	(302)	32.911
I C EUR	141.807	-	(22.681)	119.126
I C SEK	100	-	-	100
I C USD	10	-	-	10
I H GBP	16.247	96.821	(96.821)	16.247
I C GBP	-	114.772	(21.202)	93.570
Summe	160.874	242.096	(141.006)	261.964
<i>Man GLG RI Sustainable European Income</i> <i>(vormals Man GLG European Income Opportunities)</i>				
D C EUR	20.366	1.012	(3.770)	17.608
DF C EUR	1.005	-	-	1.005
I C EUR	188.670	31.880	(129.089)	91.461
I C EUR Dist	10	-	-	10
I C USD	14.782	8.673	(16.643)	6.812
IF C EUR	58.311	11.082	(43.680)	25.713
IM C EUR	123.263	6.604	(52.987)	76.880
I C EUR Dist Q	23.093	6.000	(10.000)	19.093
Summe	429.500	65.251	(256.169)	238.582
<i>Man Numeric China A Equity</i>				
D C EUR	378	779	(752)	405
D H EUR	52.000	670	(1.310)	51.360
I USD	8.616	-	(10)	8.606
I C EUR	10	-	-	10
I C GBP	110.305	-	(31.548)	78.757
I C SEK	50	-	-	50
Summe	171.359	1.449	(33.620)	139.188
<i>Man GLG Strategic Bond</i>				
D GBP	2.246.999	30.159	(482.891)	1.794.267
D GBP Dist	316.715	-	-	316.715
D H CHF	42.193	100	(28.505)	13.788
D H EUR	590.444	166.325	(348.213)	408.556
D H USD	107.040	13.915	(34.772)	86.183
DY H EUR	16.996	1.223	(11.925)	6.294
I GBP	27.437.898	4.052.493	(6.602.748)	24.887.643
I GBP Dist	12.058.143	3.551.534	(5.384.873)	10.224.804
I H CHF	255	255	(255)	255
I H EUR	6.752.550	67.000	(403.187)	6.416.363
I H EUR Dist	1.457.358	-	(266.439)	1.190.919
I H JPY	1.897.808	103.676	-	2.001.484
I H USD	34.766.718	617.125	(12.650.502)	22.733.341
I H USD Dist	1.831.581	78.647	(396.469)	1.513.759
IXF GBP	10.710.499	1.869.856	(4.167.855)	8.412.500
IXF GBP Dist	41.579.331	10.637.530	(11.819.800)	40.397.061
IXF H USD	1.046.019	1	(222.165)	823.855
D H USD Dist A	757.700	-	(334.484)	423.216
DV H USD	59.172	100	(11.775)	47.497
DY H USD	8.601	507	(2.308)	6.800
I GBP Dist A	4.049	-	(330)	3.719
I H EUR Dist A	65	-	-	65
I H USD Dist A	190	-	(190)	-
IV H USD	500	-	-	500
Summe	143.688.824	21.190.446	(43.169.686)	121.709.584

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2022	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2022
<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i>				
I USD	216.208	7.699	(148.694)	75.213
I C CHF	10	-	-	10
I C EUR	10	-	-	10
I C GBP	10	46.924	-	46.934
IF C EUR	462.143	259.651	(382.438)	339.356
IF C GBP	-	80.522	(214)	80.308
Summe	678.381	394.796	(531.346)	541.831
<i>Man Numeric US High Yield</i>				
I USD	939.044	3.612	(573.574)	369.082
Summe	939.044	3.612	(573.574)	369.082
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>				
IF H EUR	116.632	1.054.694	(44.861)	1.126.465
I H EUR	10	4.890	-	4.900
I H GBP	226	4.369	-	4.595
I USD	199.356	-	(199.346)	10
I H EUR Dist	-	3.725	(3.725)	-
IF H GBP	-	71.796	(4.581)	67.215
IF H GBP Dist	-	6.429	(671)	5.758
IF EUR Dist	-	400.000	-	400.000
Summe	316.224	1.545.903	(253.184)	1.608.943
<i>Man GLG China Equity</i>				
I C EUR	10	-	-	10
I C GBP	10	-	-	10
IF C EUR	10	-	-	10
IF USD	10	-	-	10
I USD	120.000	100.819	(100.819)	120.000
Summe	120.040	100.819	(100.819)	120.040
<i>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy</i>				
I C EUR	-	10	-	10
I C GBP	-	169.760	-	169.760
I C USD	-	200.000	-	200.000
IF C EUR	-	178	-	178
IF C USD	-	10	-	10
Summe	-	369.958	-	369.958
<i>Man GLG Sustainable Strategic Income</i>				
IF H EUR	-	10	-	10
IF USD	-	10	-	10
I H EUR	-	10	-	10
I H GBP	-	182.128	(34.514)	147.614
I USD	-	10	-	10
Summe	-	182.168	(34.514)	147.654
<i>Man GLG Dynamic Income</i>				
I USD	-	200.003	-	200.003
IF H EUR	-	10	-	10
IF USD	-	10	-	10
I H EUR	-	10	-	10
I H GBP	-	1.853	-	1.853
Summe	-	201.886	-	201.886

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2021	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2021
<i>Man GLG Global Convertibles</i>				
D USD	19.029	6.017	(152)	24.894
D H EUR	98.182	87.065	(11.065)	174.182
DL USD	463.478	450	(210.428)	253.500
DL H EUR	24.785	1.426	(6.500)	19.711
DL H GBP	5.264	258	(2.718)	2.804
I USD	44.098	80.808	(16.941)	107.965
I H EUR	23.143	44.618	(3.595)	64.166
IL USD	231.089	3.738	(117.450)	117.377
IL H EUR	2.593	135.167	(134.531)	3.229
IM USD	12.299	-	(4.731)	7.568
IM H EUR	305.463	35.534	(38.254)	302.743
IM H GBP	2.143	295	(380)	2.058
IU H EUR	79.210	417.766	(113.349)	383.627
I H GBP	-	47.920	(762)	47.158
Summe	1.310.776	861.062	(660.856)	1.510.982
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>				
D EUR	24.882	3.563	(6.234)	22.211
D C EUR	115.068	48.164	(71.453)	91.779
D C USD	10	-	-	10
D H GBP	409	-	(259)	150
D H USD	11.608	15	(922)	10.701
I EUR	4.848	-	(1.364)	3.484
I C EUR	1.502.531	350.013	(167.538)	1.685.006
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	550.153	27.083	(305.589)	271.647
I H USD	18.538	-	(13)	18.525
Summe	2.228.097	428.838	(553.372)	2.103.563
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>				
D EUR	20.235	11.301	(16.706)	14.830
D EUR G Dist	3.346	2.160	(908)	4.598
D JPY	145.376	38.875	(39.608)	144.643
D USD	21.712	3.677	(6.880)	18.509
D H CHF	16.303	4.002	(4.400)	15.905
D H EUR	105.041	236.587	(171.807)	169.821
D H GBP	25.660	2.043	(7.171)	20.532
D H USD	162.935	385.520	(370.562)	177.893
I EUR	215.294	762.379	(802.265)	175.408
I EUR Dist	688	510	(678)	520
I GBP	389.935	89.411	(211.806)	267.540
I JPY	2.432.083	1.826.744	(1.437.740)	2.821.087
I JPY Dist	464.992	406.779	(137.186)	734.585
I SEK	50	-	-	50
I USD	284.799	85.867	(205.315)	165.351
I USD Dist	3.929	3.377	-	7.306
I H CHF	29.950	21.682	(9.461)	42.171
I H EUR	90.332	304.276	(187.804)	206.804
I H EUR Dist	9.325	1.787	(4.865)	6.247
I H GBP	763.710	146.348	(426.887)	483.171
I H GBP Dist	155.112	18.656	(33.474)	140.294
I H USD	173.469	115.942	(118.523)	170.888
I H USD Dist	38.110	4.214	(3.523)	38.801
IXX JPY	970.284	2.130.159	(1.237.500)	1.862.943
IXX H EUR	1.454.878	1.910.560	(1.553.583)	1.811.855
IXX H EUR Dist	27.806	4.900	(29.800)	2.906
IXX H GBP Dist	7.292	-	(2.080)	5.212
IXX H USD Dist	2.896	-	(2.896)	-
Summe	8.015.542	8.517.756	(7.023.428)	9.509.870

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2021	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2021
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>				
D CHF	1.500	-	-	1.500
D EUR	329	900	-	1.229
D USD	3.440	4.368	(2.509)	5.299
I EUR	23.939	-	(20.383)	3.556
I JPY	1.040.607	306.975	(224.055)	1.123.527
I SEK	50	-	-	50
I USD	1.334.114	16.286	(144.446)	1.205.954
I USD Dist	20.000	-	(20.000)	-
IMU USD	2.432.661	-	-	2.432.661
I GBP	-	10	-	10
Summe	4.856.640	328.539	(411.393)	4.773.786
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>				
D EUR	9.295	700	-	9.995
D USD	21.079	3.431	(931)	23.579
I EUR	10	-	-	10
I SEK	50	-	-	50
I USD	105.746	14	-	105.760
I H EUR	10	-	-	10
Summe	136.190	4.145	(931)	139.404
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>				
D C EUR	10	-	-	10
D C USD	17	2	(6)	13
I C EUR	176.841	92.508	(110.544)	158.805
I C EUR Dist	37.000	-	(37.000)	-
I C GBP	13.002	-	(12.992)	10
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	578.907	404.085	(424.167)	558.825
I C USD Dist	10	-	-	10
I H EUR Dist	10	-	-	10
I H GBP	116.430	3.969	(81.369)	39.030
Summe	922.277	500.564	(666.078)	756.763
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>				
D C EUR	10	2	-	12
D C USD	10	640	-	650
D H EUR	51.900	-	(13.800)	38.100
I C EUR	10	-	-	10
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	228.124	420	(2.033)	226.511
I H EUR	40.438	27.311	(28.782)	38.967
I H EUR Dist	39.400	-	(39.400)	-
IF H EUR	79.410	51.540	(13.500)	117.450
Summe	439.352	79.913	(97.515)	421.750
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>				
D C EUR	11.500	30.575	(1.599)	40.476
D C USD	154	18.957	(954)	18.157
DF C EUR	2.868	-	(410)	2.458
I C CHF	773	-	(240)	533
I C EUR	1.105.112	1.562.891	(1.248.311)	1.419.692
I C SEK	50	-	-	50
I C USD	26.012	17.538	(9.300)	34.250
IF C EUR	1.253.176	77.815	(718.933)	612.058
DV C USD	1	10.397	(3.674)	6.724
IV C USD	1	12.883	(883)	12.001
Summe	2.399.647	1.731.056	(1.984.304)	2.146.399

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2021	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2021
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>				
D C EUR	10	886	-	896
I USD	476	13.956	(145)	14.287
I C EUR	10	126.393	-	126.403
I C GBP	642	1.639	(341)	1.940
I C SEK	50	-	-	50
IU FH NOK	12.211.082	3.236.067	(3.364.924)	12.082.225
I H (BRL) USD	-	24.500	-	24.500
Summe	12.212.270	3.403.441	(3.365.410)	12.250.301
<i>Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)</i>				
D C EUR	10	2.700	-	2.710
I C EUR	145.798	-	(3.991)	141.807
I C SEK	100	-	-	100
I C USD	10	-	-	10
I H GBP	45.559	-	(29.312)	16.247
Summe	191.477	2.700	(33.303)	160.874
<i>Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)</i>				
D C EUR	18.080	5.530	(3.244)	20.366
DF C EUR	1.005	-	-	1.005
I C EUR	233.280	26.217	(70.827)	188.670
I C EUR Dist	10	-	-	10
I C USD	14.067	5.540	(4.825)	14.782
IF C EUR	41.611	20.885	(4.185)	58.311
IM C EUR	122.496	10.834	(10.067)	123.263
I C EUR Dist Q	-	129.583	(106.490)	23.093
Summe	430.549	198.589	(199.638)	429.500
<i>Man Numeric China A Equity</i>				
D C EUR	10	368	-	378
D H EUR	41.300	12.600	(1.900)	52.000
I USD	3.475	7.406	(2.265)	8.616
I C EUR	10	-	-	10
I C GBP	229.840	9.145	(128.680)	110.305
I C SEK	50	-	-	50
Summe	274.685	29.519	(132.845)	171.359
<i>Man GLG Strategic Bond</i>				
D GBP	3.266.779	247.965	(1.267.745)	2.246.999
D GBP Dist	682.439	-	(365.724)	316.715
D H CHF	47.002	3.041	(7.850)	42.193
D H EUR	1.172.691	-	(582.247)	590.444
D H USD	130.003	3.808	(26.771)	107.040
DY H EUR	188.636	19.383	(191.023)	16.996
I GBP	42.471.924	5.829.880	(20.863.906)	27.437.898
I GBP Dist	20.237.794	1.434.901	(9.614.552)	12.058.143
I H CHF	255	-	-	255
I H EUR	23.646.776	-	(16.894.226)	6.752.550
I H EUR Dist	2.486.091	214.097	(1.242.830)	1.457.358
I H JPY	1.845.184	252.624	(200.000)	1.897.808
I H USD	66.341.008	60.025.706	(91.599.996)	34.766.718
I H USD Dist	2.682.723	124.500	(975.642)	1.831.581
IXF GBP	22.212.856	992.946	(12.495.303)	10.710.499
IXF GBP Dist	56.048.390	3.313.653	(17.782.712)	41.579.331
IXF H USD	19.078.287	6.399	(18.038.667)	1.046.019
D H USD Dist A	889.146	-	(131.446)	757.700
DV H USD	800	58.507	(135)	59.172
DY H USD	13.613	-	(5.012)	8.601
I GBP Dist A	4.049	-	-	4.049

10. Anteilskapital (Fortsetzung)

Rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile (Fortsetzung)

	Anteile zum 1. Januar 2021	Zeichnungen	Rücknahmen	Anteile zum 31. Dezember 2021
<i>Man GLG Strategic Bond (Fortsetzung)</i>				
I H EUR Dist A	403	-	(338)	65
I H USD Dist A	280	-	(90)	190
IV H USD	500	5	(5)	500
Summe	263.447.629	72.527.415	(192.286.220)	143.688.824
<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i>				
I USD	213.387	7.110	(4.289)	216.208
I C CHF	10	-	-	10
I C EUR	10	-	-	10
I C GBP	10	-	-	10
IF C EUR	115.241	347.264	(362)	462.143
Summe	328.658	354.374	(4.651)	678.381
<i>Man Numeric US High Yield</i>				
I USD	1.011.483	236.185	(308.624)	939.044
Summe	1.011.483	236.185	(308.624)	939.044
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>				
IF H EUR	-	116.632	-	116.632
I H EUR	-	10	-	10
I H GBP	-	226	-	226
I USD	-	199.356	-	199.356
Summe	-	316.224	-	316.224
<i>Man GLG China Equity</i>				
I C EUR	-	10	-	10
I C GBP	-	10	-	10
IF C EUR	-	10	-	10
IF USD	-	10	-	10
I USD	-	120.000	-	120.000
Summe	-	120.040	-	120.040

Kapitalmanagement

Aufgrund der Möglichkeit, rücknehmbare gewinnberechtigte Anteile auszugeben, zurückzukaufen und weiterzuverkaufen, kann die Höhe des Fondskapitals in Abhängigkeit der beim Fonds eingehenden Zeichnungen und Rücknahmen schwanken. Der Fonds unterliegt keinen extern auferlegten Kapitalanforderungen und es gelten keinerlei Einschränkungen in Bezug auf die Ausgabe, die Rücknahme, den Rückkauf und den Wiederverkauf der Anteile von rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteilen mit Ausnahme derjenigen, die im Prospekt des Fonds aufgeführt sind.

Die Ziele des Fonds zur Kapitalverwaltung sind:

- das Kapital in Anlagen zu investieren, die der im Prospekt des Fonds angegebenen Beschreibung, Risikoexposition und erwarteten Rendite entsprechen;
- beständige Erträge zu erwirtschaften und gleichzeitig das Kapital durch Anlagen in diversifizierten Portfolios, Teilnahme an Derivat- und anderen hochentwickelten Kapitalmärkten und Einsatz verschiedener Anlagestrategien und Absicherungstechniken zu sichern; ausreichende Liquidität beizubehalten, um die Aufwendungen des Fonds decken und eingehende Rücknahmeanträge erfüllen zu können; und
- eine ausreichende Größe zu wahren, damit der Betrieb des Fonds kosteneffizient bleibt; und
- ausreichende Liquidität beizubehalten, um die Aufwendungen des Fonds decken und eingehende Rücknahmeanträge erfüllen zu können.

Nähere Einzelheiten zu den Richtlinien und Verfahren, die vom Fonds für die Verwaltung seines Kapitals und die Erfüllung seiner Pflicht zur Rücknahme der rücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile angewandt werden, sind dem Abschnitt „Finanzrisikomanagement“ (Erläuterung Nr. 6 unter Liquiditätsrisiko) zu entnehmen.

11. Wechselkurse

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG Global Convertibles, Man Numeric Emerging Markets Equity, Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity), Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates, Man GLG Global Emerging Markets Bond, Man GLG RI Global Sustainable Growth, Man Numeric China A Equity, Man GLG Asia (ex Japan) Equity, Man Numeric US High Yield, Man GLG Global Investment Grade Opportunities, Man GLG China Equity, Man GLG Sustainable Strategic Income und Man GLG Dynamic Income zum 31. Dezember 2022 zugrunde gelegt:

1 USD = 3,67242 AED	1 USD = 6,96864 DKK	1 USD = 1250 KRW	1 USD = 4,63607 RON
1 USD = 178,57143 ARS	1 USD = 56,17978 DOP	1 USD = 0,30605 KWD	1 USD = 72,9927 RUB
1 USD = 1,47449 AUD	1 USD = 0,93694 EUR	1 USD = 19,49318 MXN	1 USD = 3,75799 SAR
1 USD = 5,27983 BRL	1 USD = 0,83132 GBP	1 USD = 4,40529 MYR	1 USD = 10,41667 SEK
1 USD = 1,35501 CAD	1 USD = 7,8064 HKD	1 USD = 9,85222 NOK	1 USD = 1,3412 SGD
1 USD = 0,92524 CHF	1 USD = 370,37037 HUF	1 USD = 1,58103 NZD	1 USD = 34,60208 THB
1 USD = 833,33333 CLP	1 USD = 10000 IDR	1 USD = 3,81388 PEN	1 USD = 18,72659 TRY
1 USD = 6,9541 CNY	1 USD = 3,52858 ILS	1 USD = 55,86592 PHP	1 USD = 30,76923 TWD
1 USD = 5000 COP	1 USD = 82,64463 INR	1 USD = 4,38596 PLN	1 USD = 17,0068 ZAR
1 USD = 22,62443 CZK	1 USD = 131,57895 JPY	1 USD = 3,64166 QAR	

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG RI European Equity Leaders, Man GLG Pan-European Equity Growth, Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity), Man GLG RI Sustainable European Income und Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy zum 31. Dezember 2022 zugrunde gelegt:

1 EUR = 1,44621 CAD	1 EUR = 10,51532 NOK
1 EUR = 0,98751 CHF	1 EUR = 11,11776 SEK
1 EUR = 7,43766 DKK	1 EUR = 19,98697 TRY
1 EUR = 0,88727 GBP	1 EUR = 1,0673 USD
1 EUR = 8,3318 HKD	

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG Japan CoreAlpha Equity zum 31. Dezember 2022 zugrunde gelegt:

1 JPY = 0,00703 CHF	1 JPY = 0,00632 GBP	1 JPY = 0,0076 USD
1 JPY = 0,00712 EUR	1 JPY = 0,07917 SEK	

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG Strategic Bond zum 31. Dezember 2022 zugrunde gelegt:

1 GBP = 1,77367 AUD	1 GBP = 1,12705 EUR	1 GBP = 1,20290 USD
1 GBP = 1,11298 CHF	1 GBP = 158,27714 JPY	

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG Global Convertibles, Man Numeric Emerging Markets Equity, Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity), Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates, Man GLG Global Emerging Markets Bond, Man GLG RI Global Sustainable Growth, Man Numeric China A Equity, Man GLG Asia (ex Japan) Equity, Man Numeric US High Yield, Man GLG Global Investment Grade Opportunities und Man GLG China Equity zum 31. Dezember 2021 zugrunde gelegt:

1 USD = 3,67242 AED	1 USD = 0,73828 GBP	1 USD = 3,99042 PEN	1 USD = 13,28021 TRY
1 USD = 103,09278 ARS	1 USD = 7,79423 HKD	1 USD = 51,02041 PHP	1 USD = 27,70083 TWD
1 USD = 1,37533 AUD	1 USD = 322,58065 HUF	1 USD = 4,03063 PLN	1 USD = 15,94896 ZAR
1 USD = 5,57103 BRL	1 USD = 3,11236 ILS	1 USD = 3,64166 QAR	
1 USD = 1,26310 CAD	1 USD = 74,07407 INR	1 USD = 4,35161 RON	
1 USD = 0,91116 CHF	1 USD = 114,94253 JPY	1 USD = 75,18797 RUB	
1 USD = 6,37349 CNY	1 USD = 20,44990 MXN	1 USD = 3,75375 SAR	
1 USD = 21,83406 CZK	1 USD = 4,16667 MYR	1 USD = 9,04977 SEK	
1 USD = 6,54022 DKK	1 USD = 8,81834 NOK	1 USD = 1,34807 SGD	
1 USD = 0,87935 EUR	1 USD = 1,46049 NZD	1 USD = 33,44482 THB	

11. Wechselkurse (Fortsetzung)

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG RI European Equity Leaders, Man GLG Pan-European Equity Growth, Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity) and Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities) zum 31. Dezember 2021 zugrunde gelegt:

1 EUR = 1,43640 CAD	1 EUR = 10,02822 NOK
1 EUR = 1,03617 CHF	1 EUR = 10,29140 SEK
1 EUR = 7,43754 DKK	1 EUR = 15,10226 TRY
1 EUR = 0,83957 GBP	1 EUR = 1,13720 USD
1 EUR = 8,86360 HKD	

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG Japan CoreAlpha Equity zum 31. Dezember 2021 zugrunde gelegt:

1 JPY = 0,00793 CHF	1 JPY = 0,00642 GBP	1 JPY = 0,00870 USD
1 JPY = 0,00765 GBP	1 JPY = 0,07873 SEK	

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Man GLG Strategic Bond zum 31. Dezember 2021 zugrunde gelegt:

1 GBP = 1,86288 AUD	1 GBP = 1,19108 EUR	1 GBP = 1,35450 USD
1 GBP = 1,23417 CHF	1 GBP = 155,68966 JPY	

12. Vergleich der Bewertung des Nettoinventarwertes

	Umlaufende				Nettovermögen		
	Anteile zum	Nettoinventarwert je Anteil zum			zum		
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020
<i>Man GLG Global Convertibles</i>							
D USD	24.722	111,75	131,25	131,34	2.762.549	3.267.408	2.499.186
D H EUR	160.464	98,26	118,44	119,50	15.766.743	20.630.753	11.733.140
DL USD	18.961	155,76	182,66	182,46	2.953.461	46.304.320	84.568.500
DL H EUR	16.499	123,47	148,60	149,43	2.037.093	2.929.180	3.703.464
DL H GBP	2.804	112,80	133,89	133,93	316.291	375.428	705.020
I USD	58.941	120,55	140,54	139,58	7.105.283	15.173.843	6.155.343
I H EUR	48.526	103,34	123,61	123,79	5.014.661	7.931.668	2.864.843
IL USD	109.039	132,35	154,06	152,98	14.431.253	18.083.301	35.352.575
IL H EUR	2.557	110,67	132,17	132,36	283.019	426.835	343.205
IM USD	6.730	181,84	211,68	209,86	1.223.775	1.601.976	2.581.161
IM H EUR	287.339	155,01	185,17	185,23	44.541.392	56.059.985	56.582.087
IM H GBP	1.924	170,49	200,98	199,64	328.012	413.543	427.896
IU H EUR	277.534	85,58	101,98	101,76	23.750.878	39.122.695	8.060.417
I H GBP	41.841	84,93	100,24	-	3.553.660	4.727.051	-
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>							
D EUR	3.563	203,49	237,17	212,70	725.129	5.267.573	5.292.429
D C EUR	60.839	103,02	120,89	106,20	6.267.592	11.095.182	12.220.213
D C USD	10	111,84	139,96	132,55	1.118	1.400	1.325
D H GBP	-	-	196,17	174,92	-	29.393	71.493
D H USD	2.623	196,31	222,22	197,51	514.891	2.378.077	2.292.704
I EUR	2.737	145,36	168,14	149,67	397.865	585.826	725.572
I C EUR	697.492	105,49	122,87	107,12	73.577.925	207.037.819	160.957.333
I C SEK	50	152,25	164,12	139,77	7.613	8.206	6.989
I C USD	-	-	134,15	125,84	-	36.442.011	69.233.092
I H USD	540	232,08	260,82	230,09	125.436	4.831.728	4.265.370

12. Vergleich der Bewertung des Nettoinventarwertes (Fortsetzung)

	Umlaufende Anteile zum				Nettoinventarwert je Anteil zum			Nettovermögen zum	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020		
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>									
D EUR	18.380	119,66	109,69	88,58	2.199.398	1.626.612	1.792.446		
D EUR G Dist	4.636	96,71	91,31	75,96	448.303	419.835	254.175		
D JPY	177.191	24.319,00	20.610,00	16.198,00	4.309.112.153	2.981.096.225	2.354.738.639		
D USD	19.356	122,77	119,53	104,78	2.376.255	2.212.304	2.275.011		
D H CHF	14.255	259,93	222,89	177,34	3.705.444	3.545.102	2.891.129		
D H EUR	121.014	206,13	176,08	139,81	24.944.448	29.902.259	14.685.622		
D H GBP	17.920	206,51	173,98	137,50	3.700.733	3.572.024	3.528.249		
D H USD	182.665	240,04	200,13	157,52	43.847.885	35.601.975	25.665.216		
I EUR	590.997	230,28	209,48	167,91	136.096.170	36.744.580	36.148.873		
I EUR Dist	49.598	105,24	98,40	82,19	5.219.883	51.164	56.546		
I GBP	302.792	231,85	199,62	172,24	70.201.241	53.407.644	67.162.441		
I JPY	3.720.734	26.778,00	22.525,00	17.570,00	99.634.625.047	63.545.036.620	42.732.836.817		
I JPY Dist	432.681	13.275,00	11.445,00	9.123,00	5.743.861.790	8.407.119.514	4.242.243.016		
I SEK	50	179,10	150,79	118,71	8.955	7.540	5.936		
I USD	202.682	165,71	160,09	139,29	33.585.966	26.471.598	39.669.464		
I USD Dist	10.115	94,69	93,77	83,97	957.779	685.079	329.934		
I H CHF	21.829	286,82	244,14	192,79	6.261.213	10.295.784	5.774.118		
I H EUR	671.904	227,90	192,98	152,08	153.125.153	39.908.581	13.737.362		
I H EUR Dist	253.861	142,79	124,03	98,25	36.247.734	774.802	916.128		
I H GBP	265.514	237,27	198,54	155,74	62.999.773	95.929.320	118.941.434		
I H GBP Dist	90.557	150,92	129,46	103,88	13.666.722	18.162.950	16.113.689		
I H USD	89.314	268,67	222,42	173,75	23.996.456	38.008.723	30.141.107		
I H USD Dist	13.169	165,75	140,70	112,45	2.182.711	5.459.071	4.285.496		
IXX JPY	980.140	11.253	9.447,00	7.354,00	11.029.102.106	17.598.594.911	7.135.742.750		
IXX H EUR	3.574.735	106,08	89,75	70,59	379.208.528	162.617.951	102.700.410		
IXX H EUR Dist	3.026	114,07	98,87	79,69	345.135	287.282	2.215.929		
IXX H GBP Dist	7.195	123,78	105,81	84,92	890.592	551.547	619.238		
IXX H USD	107.272	83,25	-	-	8.930.168	-	-		
IXX H USD Dist	2.462	97,77	-	87,87	240.712	-	254.463		
IXX H CHF	26.825	107,21	-	-	2.875.950	-	-		
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>									
D CHF	1.500	85,11	105,09	99,44	127.658	157.635	149.155		
D EUR	1.229	131,92	155,23	140,73	162.111	190.755	46.276		
D USD	4.213	130,19	163,24	159,20	548.475	865.081	547.603		
I EUR	12.525	142,91	166,95	150,18	1.789.985	593.694	3.595.028		
I JPY	838.490	10.860,00	11.797,00	10.241,00	9.106.127.426	13.254.167.114	10.657.181.989		
I SEK	50	191,50	207,34	182,31	9.575	10.367	9.115		
I USD	1.388.578	135,01	168,02	162,66	187.472.066	202.626.343	217.001.745		
I USD Dist	-	-	-	106,25	-	-	2.124.908		
IMU USD	1.521.201	111,47	138,51	134,30	169.564.093	336.939.177	326.701.547		
I GBP	11	88,63	98,21	-	975	982	-		
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>									
D EUR	9.535	157,40	184,15	139,97	1.500.814	1.840.560	1.301.047		
D USD	22.470	149,69	186,61	152,60	3.363.576	4.400.090	3.216.556		
I EUR	10	162,13	187,87	141,57	1.621	1.879	1.416		
I SEK	50	202,26	217,31	160,03	10.113	10.865	8.002		
I USD	103.233	157,87	195,34	158,54	16.297.233	20.658.679	16.765.225		
I H EUR	10	124,02	158,43	129,78	1.240	1.584	1.298		

12. Vergleich der Bewertung des Nettoinventarwertes (Fortsetzung)

	Umlaufende Anteile zum				Nettoinventarwert je Anteil zum			Nettovermögen zum	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>									
D C EUR	10	108,92	107,55	107,19	1.089	1.076	1.072		
D C USD	258	102,63	107,31	115,20	26.476	1.345	1.930		
I C EUR	160.813	113,52	110,65	109,75	18.254.869	17.572.058	19.407.984		
I C EUR Dist	-	-	-	94,92	-	-	3.512.071		
I C GBP	10	127,83	119,34	126,23	1.278	1.193	1.641.232		
I C SEK	50	134,53	123,00	118,91	6.726	6.150	5.946		
I C USD	558.097	107,42	111,55	119,00	59.949.373	62.335.654	68.887.800		
I C USD Dist	10	91,75	98,49	108,37	917	1.021	1.123		
I H EUR Dist	10	71,95	78,93	87,78	720	789	878		
I H GBP	39.032	97,62	102,57	109,69	3.810.221	4.003.276	12.771.107		
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>									
D C EUR	209	114,77	120,58	116,24	24.013	1.409	1.185		
D C USD	10	109,75	122,30	126,50	1.097	79.494	1.265		
D H EUR	-	-	96,47	100,70	-	3.675.623	5.226.087		
I C EUR	10	120,25	125,26	119,95	1.202	1.253	1.199		
I C SEK	50	141,28	137,84	128,99	7.064	6.892	6.450		
I C USD	225.864	114,73	127,16	130,57	25.912.263	28.804.138	29.787.033		
I H EUR	5.356	94,75	107,57	111,42	507.434	4.191.566	4.505.765		
I H EUR Dist	-	-	-	105,99	-	-	4.176.026		
IF H EUR	80.050	96,44	109,20	112,76	7.719.801	12.824.966	8.954.547		
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>									
D C EUR	4.717	149,66	203,03	173,27	705.959	8.217.957	1.992.557		
D C USD	17.420	148,56	214,74	197,28	2.587.846	3.899.123	30.328		
DF C EUR	2.740	130,92	176,80	150,21	358.737	434.601	430.816		
I C CHF	633	143,30	202,48	179,02	90.755	107.983	138.439		
I C EUR	840.074	157,08	211,49	179,14	131.957.265	300.247.198	197.966.826		
I C SEK	50	177,59	221,59	183,20	8.879	11.079	9.160		
I C USD	22.868	155,79	223,55	203,71	3.562.626	7.656.759	5.298.807		
IF C EUR	410.237	156,82	210,19	177,25	64.334.241	128.651.464	222.119.875		
DV C USD	2.399	83,58	121,13	111,20	200.535	814.515	111		
IV C USD	11.557	84,78	121,96	111,17	979.833	1.463.696	111		
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>									
D C EUR	155	121,82	157,35	128,08	18.882	140.984	1.281		
I USD	13.478	172,86	236,09	205,38	2.329.748	3.373.106	97.725		
I C EUR	8.241	124,69	159,89	129,27	1.027.574	20.210.952	1.293		
I C GBP	2.757	124,01	150,45	129,74	341.939	291.910	83.312		
I C SEK	50	125,98	149,81	118,39	6.299	7.490	5.920		
IU FH NOK	25	108,66	147,18	125,99	2.717	1.778.253.219	1.538.521.987		
I H (BRL) USD	24.500	82,10	98,70	-	2.011.429	2.418.148	-		
<i>Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)</i>									
D C EUR	32.911	117,67	140,17	109,15	3.872.658	379.865	1.092		
I C EUR	119.126	123,24	145,72	112,82	14.681.168	20.663.925	16.448.476		
I C SEK	100	144,59	158,13	119,25	14.459	15.813	11.925		
I C USD	10	108,06	137,53	114,98	1.081	1.375	1.150		
I H GBP	16.247	108,17	126,60	97,63	1.757.344	2.056.788	4.447.810		
I C GBP	93.570	95,90	-	-	8.973.436	-	-		
<i>Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)</i>									
D C EUR	17.608	106,56	118,90	104,15	1.876.233	2.421.475	1.883.097		
DF C EUR	1.005	121,57	135,05	117,77	122.179	135.721	118.358		
I C EUR	91.461	110,80	122,72	106,70	10.134.037	23.153.153	24.890.180		
I C EUR Dist	10	99,48	112,83	99,90	995	1.128	999		
I C USD	6.812	99,89	117,91	110,32	680.393	1.742.880	1.551.963		
IF C EUR	25.713	111,10	122,50	106,03	2.856.841	7.142.968	4.411.943		
IM C EUR	76.880	111,49	123,17	106,74	8.571.266	15.181.763	13.075.717		
I C EUR Dist Q	19.093	98,23	112,08	-	1.875.578	2.588.202	-		

12. Vergleich der Bewertung des Nettoinventarwertes (Fortsetzung)

	Umlaufende Anteile zum				Nettovermögen zum		
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020
<i>Man Numeric China A Equity</i>							
D C EUR	405	127,97	165,83	136,32	51.796	62.727	1.363
D H EUR	51.360	82,90	116,94	104,47	4.257.729	6.081.021	4.314.388
I USD	8.606	124,24	169,78	149,05	1.069.269	1.462.853	517.940
I C EUR	10	132,04	169,87	138,45	1.320	1.699	1.385
I C GBP	78.757	136,66	165,88	144,33	10.762.925	18.297.225	33.172.019
I C SEK	50	136,92	163,59	130,05	6.846	8.180	6.503
<i>Man GLG Strategic Bond</i>							
D GBP	1.794.267	1,43	1,55	1,51	2.562.272	3.480.662	4.930.847
D GBP Dist	316.715	0,86	0,97	0,99	272.566	308.149	672.819
D H CHF	13.788	85,85	94,94	93,36	1.183.735	4.005.971	4.388.019
D H EUR	408.556	0,88	0,97	0,95	358.269	569.772	1.110.163
D H USD	86.183	110,91	119,59	116,43	9.558.390	12.800.626	15.136.224
DY H EUR	6.294	0,87	0,96	0,94	5.458	16.266	177.654
I GBP	24.887.643	1,34	1,45	1,41	33.401.808	39.777.475	59.745.652
I GBP Dist	10.224.804	0,89	1,00	1,01	9.066.005	12.041.414	20.384.411
I H CHF	255	89,65	98,66	96,64	22.861	25.158	24.642
I H EUR	6.416.363	0,94	1,03	1,01	6.037.774	6.962.209	23.825.564
I H EUR Dist	1.190.919	0,77	0,88	0,90	920.346	1.286.669	2.230.613
I H JPY	2.001.484	9.066,54	9.948,37	9.679,55	18.146.543.546	18.880.094.956	17.860.553.649
I H USD	22.733.341	1,04	1,12	1,08	23.621.412	38.814.177	71.793.612
I H USD Dist	1.513.759	0,87	0,97	0,98	1.309.601	1.774.788	2.619.456
IXF GBP	8.412.500	1,57	1,69	1,64	13.200.825	18.112.926	36.366.840
IXF GBP Dist	40.397.061	0,92	1,04	1,04	37.284.853	43.116.368	58.495.815
IXF H USD	823.855	1,45	1,56	1,51	1.198.378	1.631.342	28.779.353
DV H USD	47.497	0,96	1,04	1,02	45.823	61.783	816
IV H USD	500	0,96	1,04	1,02	478	518	510
D H USD Dist A	423.216	0,87	0,98	0,98	370.154	744.132	867.586
DY H USD	6.800	96,66	104,57	102,15	657.261	899.412	1.390.544
I GBP Dist A	3.719	78,96	88,74	88,66	293.657	359.312	358.983
I H EUR Dist A	65	73,09	83,52	83,98	4.751	5.429	33.853
I H USD Dist A	-	-	94,21	94,03	-	17.900	26.328
<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i>							
I USD	75.213	98,40	113,16	113,14	7.400.868	24.466.962	24.143.013
I C CHF	10	100,51	113,75	110,24	1.005	1.138	1.102
I C EUR	10	109,46	117,97	109,39	1.095	1.180	1.094
I C GBP	46.934	106,32	108,48	107,25	4.990.245	1.085	1.073
IF C EUR	339.356	101,50	109,28	101,31	34.444.198	50.502.798	11.675.047
IF C GBP	80.308	114,47	-	-	9.192.458	-	-
<i>Man Numeric US High Yield</i>							
I USD	369.082	99,18	111,55	105,65	36.605.492	104.753.174	106.867.236
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>							
IF H EUR	1.126.465	89,63	101,03	-	100.963.098	11.783.429	-
I H EUR	4.900	89,40	100,96	-	438.080	1.010	-
I H GBP	4.595	90,61	101,08	-	416.334	22.857	-
I USD	10	91,69	101,44	-	917	20.222.058	-
I H EUR Dist	-	-	-	-	-	-	-
IF H GBP	67.215	93,08	-	-	6.256.559	-	-
IF H GBP Dist	5.758	90,07	-	-	518.608	-	-
IF EUR Dist	400.000	100,36	-	-	40.142.601	-	-
<i>Man GLG China Equity</i>							
I C EUR	10	87,31	100,02	-	873	1.000	-
I C GBP	10	91,00	98,64	-	910	986	-
IF C EUR	10	87,73	100,04	-	877	1.000	-
IF USD	10	82,43	101,11	-	824	1.011	-
I USD	120.000	81,36	99,38	-	9.763.621	11.925.853	-

12. Vergleich der Bewertung des Nettoinventarwertes (Fortsetzung)

	Umlaufende		Nettoinventarwert je Anteil zum		Nettovermögen zum		
	Anteile zum	Nettoinventarwert je Anteil zum	Nettoinventarwert je Anteil zum	Nettoinventarwert je Anteil zum	Nettovermögen zum	Nettovermögen zum	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	30. Dez. 2020
<i>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy</i>							
I C EUR	10	92,75	-	-	927	-	-
I C GBP	169.760	97,48	-	-	16.548.656	-	-
I C USD	200.000	86,13	-	-	17.225.665	-	-
IF C EUR	178	92,97	-	-	16.585	-	-
IF C USD	10	86,21	-	-	862	-	-
<i>Man GLG Sustainable Strategic Income</i>							
IF H EUR	10	90,35	-	-	904	-	-
IF USD	10	91,21	-	-	912	-	-
I H EUR	10	90,08	-	-	901	-	-
I H GBP	147.614	90,83	-	-	13.407.231	-	-
I USD	10	91,83	-	-	918	-	-
<i>Man GLG Dynamic Income</i>							
I USD	200.003	115,91	-	-	23.182.989	-	-
IF H EUR	10	113,29	-	-	1.133	-	-
IF USD	10	114,61	-	-	1.146	-	-
I H EUR	10	113,16	-	-	1.132	-	-
I H GBP	1.853	114,10	-	-	211.390	-	-

13. Trennung der Verbindlichkeiten zwischen Portfolios

Bei einer am 22. Mai 2007 abgehaltenen außerordentlichen Hauptversammlung wurde gemäß den Bestimmungen des Investment Funds, Companies and Miscellaneous Provisions Act von 2005 eine Haftungstrennung zwischen den einzelnen Portfolios beschlossen. Der Fonds als Ganzes ist Dritten gegenüber nicht für die Verbindlichkeiten der einzelnen Portfolios haftbar.

14. Im Eigentum des Fonds befindliche Wertpapiere und verkaufte, aber noch nicht gekaufte Wertpapiere

Im Eigentum des Fonds befindliche Wertpapiere wurden zum 31. Dezember 2022 bzw. zum 31. Dezember 2021 bei großen multinationalen Broker-Dealern gehalten. Verkaufte, aber noch nicht gekaufte Wertpapiere stellen Verpflichtungen des Fonds zum Kauf der Wertpapiere zu den aktuellen Marktpreisen dar. Der Betrag, der für die zukünftige Erfüllung solcher Verpflichtungen geleistet werden muss, kann den ausgewiesenen Betrag übersteigen.

15. Besteuerung

Der Fonds ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen im Sinne von Abschnitt 739 B der Taxes (Consolidation) Acts von 1997. Seine Erträge und Kapitalgewinne unterliegen in Irland keiner Besteuerung. Eine Steuer kann bei Eintritt eines Steuertatbestands anfallen.

Ein Steuertatbestand umfasst Ausschüttungen an Anteilinhaber oder Einlösungen, Rücknahmen oder Übertragungen von Anteilen. Der Fonds ist nicht steuerpflichtig im Hinblick auf Steuertatbestände in Bezug auf:

- i. einen Anteilinhaber, der nicht in Irland ansässig ist und seinen Wohnsitz zum Zeitpunkt des Eintritts des Steuertatbestands gewöhnlich nicht in Irland unterhält, vorausgesetzt, der Fonds ist im Besitz der erforderlichen unterzeichneten gesetzlichen Erklärungen; oder
- ii. bestimmte steuerbefreite in Irland ansässige Anleger, die dem Fonds die erforderlichen, gesetzlich vorgeschriebenen unterzeichneten Erklärungen ausgehändigt haben; oder
- iii. Anteile, die in einem von der irischen Steuerbehörde anerkannten Clearingsystem gehalten werden.

Im Anschluss an eine Änderung des Finance Act von 2006 wird Anteilseigentum zum Ende eines maßgeblichen Jahres im Hinblick auf in Irland ansässige Anleger ebenfalls als Steuertatbestand eingestuft. Insoweit es bei diesen Steuertatbeständen zur steuerlichen Veranlagung kommt, wird diese Steuer als Gutschrift für fällige Steuern für die nachfolgende Einlösung, Rücknahme, Auflösung oder Übertragung der entsprechenden Anteile gewertet.

Das maßgebliche Jahr ist definiert als ein Zeitraum von acht Jahren, beginnend mit dem Erwerb eines Anteils durch einen Anteilinhaber, sowie als jeder nachfolgende Zeitraum von acht Jahren, der unmittelbar nach dem vorhergehenden maßgeblichen Jahr einsetzt.

16. Verrechnungsprovisionen

Im Einklang mit der Einführung der überarbeiteten Vorschriften für die Inanspruchnahme von Händlerprovisionen im Rahmen der Umsetzung der Richtlinie 2014/65/EU über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinie 2004/39/EG („MiFID II“) bezahlt der Anlageverwalter ab dem 3. Januar 2018 sein Investment-Research nicht mehr anhand von Händlerprovisionen. Der Anlageverwalter hat ein Research-Budget erstellt und den Portfolios ist eine Gebühr entstanden, um die Research-Leistungen unabhängig von der Handelsabwicklung zu bezahlen. Der Anlageverwalter teilt die Research-Kosten je nach Nutzung mit den Portfolios. Alle Transaktionen werden auf Basis der besten Ausführung platziert und ausgeführt.

Dem Fonds sind Transaktionskosten entstanden, darunter Provisionen für Aktienswaps, die in der Gesamtergebnisrechnung im Netto(-verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten enthalten sind.

17. Vergütung des Abschlussprüfers

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 sind dem Fonds die in der Gesamtergebnisrechnung angegebenen Prüfungsgebühren angefallen. Bei diesen Beträgen handelt es sich um eine Rückstellung. Die tatsächlichen Prüfungsgebühren beliefen sich auf 206.730 USD (2021: 158.673 USD).

Während des Geschäftsjahres wurden Gebühren für Steuerberatungs-, sonstige prüfungsnahe und nicht prüfungsbezogene Leistungen, welche von den Abschlussprüfern des Fonds erbracht wurden, in Höhe von 95.437 USD in Rechnung gestellt (2021: 25.266 USD).

18. Effizientes Portfoliomanagement

Der Fonds kann Anlagetechniken und -instrumente für ein effizientes Portfoliomanagement der Vermögenswerte jedes Portfolios einsetzen. Hierzu zählt unter anderem eine Absicherung gegen Marktschwankungen, Wechselkurs- oder Zinsrisiken. Derartige Maßnahmen erfolgen jeweils zu den Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Zentralbank im Rahmen der OGAW-Vorschriften vorgeschrieben werden und nachstehend erläutert sind.

Unter Techniken und Instrumenten, die zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden, darunter auch derivative Finanzinstrumente, die nicht für unmittelbare Anlagezwecke eingesetzt werden, sind Techniken und Instrumente zu verstehen, die folgende Kriterien erfüllen:

- i. Sie sind wirtschaftlich geeignet, da sie kostengünstig veräußert werden können.
- ii. Sie werden mit einem oder mehreren der folgenden spezifischen Ziele genutzt:
 - a) Risikominderung;
 - b) Kostensenkung;
 - c) Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für ein Portfolio bei angemessenem Risiko unter Berücksichtigung des im Verkaufsprospekt beschriebenen Risikoprofils des Portfolios, den in OGAW-Mitteilung 9 dargelegten Bestimmungen zur Diversifizierung von Risiken und den allgemeinen Bestimmungen der OGAW-Vorschriften.
- iii. Ihre Risiken werden durch die Risikomanagementverfahren des Fonds in angemessener Weise erfasst; und
- iv. Sie können nicht zu einer Änderung des erklärten Anlageziels eines Portfolios führen oder erhebliche weitere Risiken im Vergleich zur allgemeinen Risikopolitik gemäß den Verkaufsdokumenten mit sich bringen.

Der Einsatz solcher Techniken und Instrumente erfolgt zwar im besten Interesse des Fonds, einzelne Techniken können jedoch zu einem erhöhten Kontrahentenrisiko und potenziellen Interessenkonflikten führen. Nähere Einzelheiten zu den geplanten Techniken für ein effizientes Portfoliomanagement und zu den vom Fonds verabschiedeten Richtlinien bezüglich deren Nutzung durch die Portfolios sind, ebenso wie Einzelheiten zu den jeweiligen Risiken, im Prospekt dargelegt.

19. Transaktionskosten

Dem Fonds sind für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 Transaktionskosten entstanden, die in der Gesamterfolgsrechnung unter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten wie folgt ausgewiesen werden:

	31. Dezember 2022	31. Dezember 2021
Man GLG Global Convertibles	624 USD	4.499 USD
Man GLG RI European Equity Leaders	240.727 EUR	731.862 EUR
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	221.660.364 JPY	179.076.389 JPY
Man Numeric Emerging Markets Equity	1.780.555 USD	5.776.251 USD
Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)	10.254 USD	14.491 USD
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	24.124 USD	98 USD
Man GLG Pan-European Equity Growth	184.200 EUR	742.473 EUR
Man GLG RI Global Sustainable Growth	101.314 USD	130.190 USD
Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)	40.412 EUR	47.684 EUR
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	41.771 EUR	59.433 EUR
Man Numeric China A Equity	94.628 USD	201.982 USD
Man GLG Strategic Bond	53.114 GBP	50.151 GBP
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	278.277 USD	298.130 USD
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	1.629 USD	212 USD
Man GLG China Equity	30.782 USD	17.377 USD
Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy	35.451 EUR	k. A.
Man GLG Sustainable Strategic Income	1.360 USD	k. A.
Man GLG Dynamic Income	3.616 USD	k. A.

20. Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die von der Europäischen Wertpapieraufsichtsbehörde veröffentlichte Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte zielt darauf ab, die Transparenz der Wertpapierfinanzierungsmärkte zu verbessern. Angaben zu Engagements in Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind in allen veröffentlichten Berichten und Abschlüssen erforderlich.

Zum 31. Dezember 2022 waren bestimmte Portfolios an Wertpapierfinanzierungsgeschäften beteiligt; Einzelheiten hierzu finden Sie im Abschnitt „Ungeprüfte Berichtsanforderungen gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte“.

21. Bedeutende Ereignisse im Verlauf des Geschäftsjahres

Prospekt

Ein überarbeiteter Prospekt mit Datum vom 1. Januar 2022 wurde herausgegeben. Die Änderungen am Prospekt umfassen allgemeine Aktualisierungen und Aktualisierungen in Bezug auf die Benchmark-Reform und die Auswirkungen auf den LIBOR und IBOR.

Am 21. Januar 2022 wurde eine neue Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben. Die Änderung am Prospekt wurde vorgenommen, um der Auflegung des neuen Portfolios Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy Rechnung zu tragen.

Eine überarbeitete Ergänzung für die Numeric Investors LLC zum Prospekt vom 1. Januar 2022 wurde am 31. Januar 2022 herausgegeben. Die Änderungen am Prospekt spiegelten die Namensänderung des Man Numeric RI Global Equity und des Man Numeric RI European Equity zu Man Numeric Global RI Climate bzw. Man Numeric Europe RI Climate wider.

Am 28. Februar 2022 wurde eine neue Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben. Die Änderung am Prospekt wurde vorgenommen, um der Auflegung des neuen Portfolios Man GLG Sustainable Strategic Income Rechnung zu tragen.

Am 7. Juni 2022 wurde eine neue Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben. Die Änderung am Prospekt wurde vorgenommen, um der Auflegung des neuen Portfolios Man GLG Dynamic Income Rechnung zu tragen.

Am 1. September 2022 wurde eine überarbeitete Ergänzung zum Prospekt vom 1. Januar 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben.

Ein überarbeiteter Prospekt mit Datum vom 1. Dezember 2022 wurde herausgegeben. Am 1. Dezember 2022 wurde eine überarbeitete Ergänzung zum Prospekt vom 1. Dezember 2022 für die GLG Partners LP Portfolios, Numeric Investors LLC und GLG LLC Portfolios herausgegeben.

Fondsauflegungen

Der Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy, der Man GLG Sustainable Strategic Income und der Man GLG Dynamic Income haben ihre Geschäftstätigkeit am 10. Februar 2022, 23. März 2022 bzw. 30. Juni 2022 aufgenommen.

Anteilsklassen

Nachfolgend sind die Anteilsklassen aufgeführt, die im Jahr zum 31. Dezember 2022 aufgelegt wurden:

Teilfonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H CHF	10. Mai 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H USD*	6. Mai 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H USD Dist*	18. Mai 2022
Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)	Klasse I C GBP	21. März 2022
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse I H EUR Dist	9. März 2022
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF H GBP	22. Februar 2022
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF H GBP Dist	22. Februar 2022
Man GLG RI Sustainable Water and Circular Economy	Klasse I C EUR	10. Februar 2022
Man GLG RI Sustainable Water and Circular Economy	Klasse I C GBP	10. Februar 2022
Man GLG RI Sustainable Water and Circular Economy	Klasse I C USD	10. Februar 2022
Man GLG RI Sustainable Water and Circular Economy	Klasse IF C EUR	10. Februar 2022
Man GLG RI Sustainable Water and Circular Economy	Klasse IF C USD	10. Februar 2022
Man GLG Sustainable Strategic Income	Klasse IF H EUR	23. März 2022
Man GLG Sustainable Strategic Income	Klasse IF USD	23. März 2022
Man GLG Sustainable Strategic Income	Klasse I H EUR	23. März 2022
Man GLG Sustainable Strategic Income	Klasse I H GBP	23. März 2022
Man GLG Sustainable Strategic Income	Klasse I USD	23. März 2022
Man GLG Dynamic Income	Klasse I USD	30. Juni 2022
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	Klasse IF C GBP	25. Oktober 2022
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF EUR Dist	25. Oktober 2022
Man GLG Dynamic Income	Klasse IF H EUR	1. Juli 2022
Man GLG Dynamic Income	Klasse IF USD	1. Juli 2022
Man GLG Dynamic Income	Klasse I H EUR	1. Juli 2022
Man GLG Dynamic Income	Klasse I H GBP	1. Juli 2022

* Die Klassen IXX H USD und IXX H USD Dist wurden im Verlauf des Geschäftsjahres aufgelegt.

Der Verwaltungsrat, die Anlageverwalter und der Manager sind sich der aktuellen Krise in der Ukraine und aller geltenden Sanktionen gegen Russland bewusst. Der Anlageverwalter hat die im Rahmen der Strategie gehaltenen Positionen auf ein etwaiges Engagement in Russland und der Ukraine überprüft. Der jeweilige Anlageverwalter hat geeignete Maßnahmen ergriffen, um bestimmte direkte Engagements gegenüber Russland zu reduzieren oder zu beseitigen, wo dies erforderlich war. Die Situation wird laufend überprüft. Alle Engagements wurden entweder verkauft oder bis zur ersten Märzwoche 2022 auf Null herabgesetzt. Der einzige Teilfonds, bei dem ein wesentliches Engagement in russischen Beteiligungen besteht, ist der Numeric Emerging Markets Equity. Der Gesamtwert all dieser Anlagen vor der Herabsetzung auf Null entsprach 4,79 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 4. März 2022, dem Datum, an dem diese Anlagen mit Null neu bewertet wurden. Die anhaltende politische Instabilität in der Region ist ein zusätzlicher Risikofaktor, der überwacht wird und sich auf die Bewertung der Vermögenswerte des Fonds nach dem Jahresende auswirken könnte.

Darüber hinaus gab es keine weiteren bedeutenden Ereignisse während des Jahres, das am 31. Dezember 2022 endete.

22. Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Am 19. Januar 2023 wurde eine überarbeitete Ergänzung zum Prospekt vom 1. Dezember 2022 für die GLG Partners LP Portfolios herausgegeben.

Der Man GLG RI Sustainable European Income und der Man GLG RI European Equity Leaders haben ihre Geschäftstätigkeit am 20. Januar 2023 bzw. 16. Februar 2023 eingestellt.

Seit Ende des Jahres gab es keine Ereignisse, die sich auf den Fonds ausgewirkt haben und im Abschluss erwähnt werden müssen.

23. Wertpapierleihgeschäfte

Der Fonds kann sich an Wertpapierleihprogrammen beteiligen, die von allgemein anerkannten internationalen zentralen Wertpapierhinterlegungsstellen (International Central Securities Depositories Systems) organisiert sind, sofern das Programm vom Betreiber der jeweiligen Stelle garantiert wird. Zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 unterhält der Fonds ein Wertpapierleihprogramm mit Bank of New York Mellon (Niederlassung London).

Die aus Wertpapierleihgeschäften während des Geschäftsjahres erzielten Nettoerträge der Teilfonds und die an die Wertpapierleihstelle gezahlten Gebühren waren wie folgt:

	Erzielte Erträge	Gezahlte Gebühren
Man GLG Global Convertibles	84.335 USD	1.286.573 USD
Man GLG RI European Equity Leaders	41.601 EUR	37.331 EUR
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	134.582.357 JPY	14.462.047 JPY
Man GLG Pan-European Equity Growth	62.263 EUR	15.367 EUR
Man GLG Strategic Bond	0 GBP	983 GBP

24. Dividenden

Der Verwaltungsrat schlug zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 die Zahlung von Ausschüttungen gemäß der nachfolgenden Tabelle vor:

31. Dezember 2022

Teilfonds	Anteilstklasse	Dividende je Anteil	Zahlungsdatum
Man GLG Strategic Bond	Klasse D GBP Dist	0,0044 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist	0,0045 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist	0,0039 EUR	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H USD Dist	0,0044 USD	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse IXF GBP Dist	0,0047 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse D H USD Dist A	0,0379 USD	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist A	3,4844 GBP	10. Januar 2023
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist A	3,272 EUR	10. Januar 2023
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I C USD Dist	3,27 USD	11. Januar 2023
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I H EUR Dist	2,54 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse D EUR G Dist	0,18 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I EUR Dist	3,5 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H EUR Dist	4,73 GBP	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H GBP Dist	4,24 GBP	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H USD Dist	3,94 USD	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I JPY Dist	357,88 JPY	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I USD Dist	2,62 USD	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H EUR Dist	3,05 GBP	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H USD Dist	1,6 USD	11. Januar 2023
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H GBP Dist	3,51 GBP	11. Januar 2023
Man GLG RI Sustainable European Income	Klasse I C EUR Dist	3,08 EUR	11. Januar 2023
Man GLG RI Sustainable European Income	Klasse I C EUR Dist Q	0,21 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF H GBP Dist	1,73 EUR	11. Januar 2023
Man GLG Global Investment Grade Opportunities	Klasse IF EUR Dist	1,25 EUR	11. Januar 2023

24. Dividenden (Fortsetzung)

31. Dezember 2021

Teilfonds	Anteilsklasse	Dividende je Anteil	Zahlungsdatum
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I EUR Dist	2,72 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H EUR Dist	3,11 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H GBP Dist	3,24 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I H USD Dist	3,57 USD	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I JPY Dist	285,31 JPY	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse I USD Dist	2,32 USD	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H EUR Dist	2,43 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse IXX H GBP Dist	2,60 GBP	12. Januar 2022
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	Klasse D EUR G Dist	0,11 EUR	12. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse D H USD Dist A	0,0383 USD	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist A	3,4436 GBP	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist A	3,4758 EUR	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H USD Dist A	3,7506 USD	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse D GBP Dist	0,0023 GBP	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I GBP Dist	0,0024 GBP	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H EUR Dist	0,0021 EUR	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse I H USD Dist	0,0023 USD	11. Januar 2022
Man GLG Strategic Bond	Klasse IXF GBP Dist	0,0025 GBP	11. Januar 2022
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I C USD Dist	3,33 USD	11. Januar 2022
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates	Klasse I H EUR Dist	2,65 EUR	11. Januar 2022
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	Klasse I C EUR Dist	2,93 EUR	11. Januar 2022
Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)	Klasse I C EUR Dist Q	0,41 EUR	11. Januar 2022

Für die übrigen Anteilsklassen der übrigen Portfolios schlägt der Verwaltungsrat keine Dividendenausschüttung vor.

Nach dem Erlass Nr. 254 des russischen Präsidenten Wladimir Putin vom Mai 2022 wurde die Zahlung von Dividenden durch russische Gesellschaften mit beschränkter Haftung an ihre ausländischen Gesellschafter eingeschränkt. Wenn eine russische Gesellschaft mit beschränkter Haftung einen Beschluss über eine Dividendenausschüttung an ihre Gesellschafter fasste, musste eine solche Ausschüttung in Höhe von über 10 Millionen Rubel in russischen Rubeln auf ein spezielles Sperrkonto des Typs „S“ – allgemein als Konto des Typs „C“ bezeichnet – erfolgen, das in Russland eröffnet wurde. Zum 31. Dezember 2022 beliefen sich die Dividendenforderungen gegenüber russischen Unternehmen auf 244.948 USD. Aufgrund der gegenwärtigen Situation und der Art der derzeit auferlegten Beschränkung besteht Ungewissheit in Bezug auf die zu erhaltenden Dividenden, und wenn diese erhalten werden und die derzeitige Beschränkung unverändert bleibt, wird der Fonds nicht in der Lage sein, die Barmittel in irgendeiner Weise zu verwenden.

25. Eventualverbindlichkeiten und Verpflichtungen

Zum 31. Dezember 2022 lagen außer den in diesem Abschluss ausgewiesenen keine weiteren Eventualverbindlichkeiten oder -verpflichtungen vor (31. Dezember 2021: keine).

26. Genehmigung des Abschlusses

Der Verwaltungsrat hat diesen Abschluss am 19. April 2023 genehmigt.

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Bestätigungsvermerk

Wir haben den Abschluss von Man Funds plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr geprüft. Der Abschluss umfasst die Bilanz, die Aufstellung über die Entwicklung des Nettovermögens, die Gesamtergebnisrechnung, die Kapitalflussrechnung und die Erläuterungen zum Abschluss einschließlich der Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze in Erläuterung 2. Zu seiner Erstellung wurden als Finanzberichterstattungsrahmen irisches Recht und die International Financial Reporting Standards („IFRS“) in der von der Europäischen Union verabschiedeten Fassung herangezogen.

Unserer Meinung nach

- spiegelt der Abschluss ein wahres und faires Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der finanziellen Position der Gesellschaft zum 31. Dezember 2022 und ihres Verlusts für das zu diesem Stichtag endende Geschäftsjahr wider;
- wurde der Abschluss ordnungsgemäß nach den von der Europäischen Union umgesetzten IFRS erstellt; und
- wurde der Abschluss ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit den Anforderungen des Companies Act von 2014, der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 und der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 erstellt.

Grundlage für den Bestätigungsvermerk

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit den International Standards on Auditing (Ireland) (ISAs (Ireland)) und den maßgeblichen Rechtsvorschriften durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser Standards sind im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts näher ausgeführt. Wir sind im Einklang mit den für unsere Prüfung von Abschlüssen in Irland maßgeblichen ethischen Anforderungen einschließlich des Ethik-Standards der Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority (IAASA) von der Gesellschaft unabhängig und haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Einklang mit diesen Anforderungen erfüllt.

Unserer Auffassung nach sind die erhaltenen Prüfungsbelege als Grundlage für die Erteilung unseres Vermerks ausreichend und angemessen.

Schlussfolgerungen zur Unternehmensfortführung

Im Rahmen der Prüfung des Jahresabschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Erstellung des Abschlusses durch den Verwaltungsrat auf der Grundlage der Annahme der Unternehmensfortführung angemessen ist. Unsere Beurteilung der Einschätzung des Managements, dass die Gesellschaft in der Lage ist, die Rechnungslegung auf der Grundlage der Fortführung der Unternehmenstätigkeit fortzusetzen, umfasste Folgendes:

- In Verbindung mit unserer Untersuchung des Ablaufs des Finanzabschlusses der Gesellschaft haben wir unser Verständnis der Bewertung der Unternehmensfortführung durch das Management bestätigt und uns mit dem Management ausgetauscht, um sicherzustellen, dass bei der Bewertung alle Schlüsselfaktoren berücksichtigt wurden;
- Wir haben die Einschätzung des Managements zur Unternehmensfortführung eingeholt, die sich auf das Jahr ab dem Datum der Unterzeichnung dieses Prüfungsurteils bezieht. Das Management hat wichtige Kriterien wie die wirtschaftliche Tragfähigkeit der Schlüsseldienstleister, die Liquidität der Teilfonds der Gesellschaft, Ereignisse nach dem Jahresende und die Zukunftspläne für die Gesellschaft berücksichtigt.
- Wir haben die Angemessenheit der Schlüsselfaktoren, die das Management bei seiner Einschätzung der Unternehmensfortführung berücksichtigt hat, geprüft und bewertet, einschließlich der Berücksichtigung der zukünftigen Kapitalaktivitäten in der Gesellschaft und der Verfügbarkeit von liquiden Mitteln zur Deckung der laufenden Betriebskosten. Bei der Bewertung haben wir die Liquiditätsbedingungen, die die Gesellschaft Anlegern anbietet, ermittelt und mit der Liquidität verglichen, die der Gesellschaft aus ihren Teilfonds zur Verfügung steht. Wir haben auch die Kapitalaktivitäten sowie andere Ereignisse nach dem Jahresende überprüft. Wir haben die im Jahresbericht enthaltenen Angaben zur Unternehmensfortführung überprüft, um zu beurteilen, ob die Angaben angemessen sind und mit den Rechnungslegungsstandards übereinstimmen.

Schlussfolgerung

Auf der Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Umstände identifiziert, die einzeln oder insgesamt erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung ihrer Geschäftstätigkeit für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Freigabe des Abschlusses zur Veröffentlichung aufwerfen könnten.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats in Bezug auf die Unternehmensfortführung sind in den entsprechenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben. Da jedoch nicht alle zukünftigen Ereignisse oder Umstände vorhergesagt werden können, stellt diese Erklärung keine Garantie hinsichtlich der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung der Geschäftstätigkeit dar.

Wichtige Prüfungssachverhalte

Wichtige Prüfungssachverhalte sind diejenigen, die unserem fachlichen Urteil nach bei der Prüfung des Jahresabschlusses von höchster Bedeutung waren und die von uns festgestellten bedeutsamsten Risiken einer wesentlichen falschen Darstellung (sei es aufgrund von Betrug oder nicht) umfassen, einschließlich derjenigen mit der größten Auswirkung auf die Strategie der Prüfung insgesamt, den Einsatz der Mittel im Rahmen der Prüfung sowie die Steuerung der Arbeit des Mandatsteams. Diese Sachverhalte wurden im Rahmen unserer Prüfung des Jahresabschlusses insgesamt und bei der Erstellung unseres Prüfungsurteils behandelt, weshalb wir hierzu kein gesondertes Urteil abgeben.

Risiken	Wie wir diese Risiken behandelt haben	Wichtige Feststellungen, die dem Verwaltungsrat mitgeteilt wurden
<p>Bewertung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Aktien, verzinsliche Wertpapiere und Derivate in Höhe von insgesamt 3.622.760.043 USD und Derivate in Höhe von (41.523.360 USD) (2021: 4.181.293.579 USD bzw. (23.123.823 USD))) .</p> <p>Einzelheiten dazu finden Sie in Erläuterung 2 (g) (Seite 84) zu den Rechnungslegungsgrundsätzen und in Erläuterung 4 des Abschlusses (Seiten 88 bis 110).</p> <p>Die Bewertung der Anlagen der Teilfonds ist der wichtigste Faktor für die Wertentwicklung und den Nettoinventarwert der Teilfonds. Eine unrichtige Bewertung der von den Teilfonds gehaltenen Anlagen könnte erhebliche Auswirkungen auf den Nettoinventarwert und damit auf die für die Anteilinhaber erzielten Erträge haben.</p>	<p>Um ausreichende Prüfungsnachweise zu erhalten, haben wir die Auflistung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 31. Dezember 2022 eingeholt und die Angemessenheit der Bewertung wie folgt beurteilt:</p> <p>Wir haben den Service Organisation Controls („SOC1“)-Bericht des Verwalters des Teilfonds eingeholt, um die Ausgestaltung, Umsetzung und operative Wirksamkeit wichtiger Kontrollen während der Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verstehen und bewerten zu können. Wir haben den Wert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten anhand von Stichproben von Positionen geprüft, indem wir unabhängige Marktanbieter herangezogen und die Preise mit dem Anlageportfolio verglichen haben oder den beizulegenden Zeitwert unter Verwendung von branchenüblichen Modellen neu berechnet haben, und wir haben die Angemessenheit der Annahmen und Dateneingaben geprüft, die der Verwaltungsrat zur Bewertung dieser erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten verwendet hat.</p>	<p>Unsere geplanten Prüfungshandlungen wurden ausnahmslos abgeschlossen</p>

Unsere Umsetzung des Grundsatzes der Wesentlichkeit

Wir legen bei der Planung und Durchführung der Prüfungsarbeiten, bei der Bewertung der Auswirkungen festgestellter falscher Darstellungen auf die Prüfung und bei der Bildung unseres Prüfungsurteils das Konzept der Wesentlichkeit zugrunde.

Wesentlichkeit

Das Ausmaß einer Auslassung oder falschen Darstellung, von der einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie die wirtschaftlichen Entscheidungen der Leser des Abschlusses beeinflusst. Die Wesentlichkeit ist die Grundlage für die Festlegung von Art und Umfang unserer Prüfungshandlungen.

Wir haben die Wesentlichkeit für die Gesellschaft auf 0,5 % (2021: 0,5 %) des Nettoinventarwerts der einzelnen Teilfonds festgelegt. Der Nettovermögenswert ist nach unserer Auffassung die am besten geeignete Grundlage für die Wesentlichkeit, da er die Erwartungen der Leser dieses Abschlusses und das allgemeine Geschäftsumfeld berücksichtigt. Wir haben im Laufe unserer Prüfung die ursprüngliche Wesentlichkeit neu bewertet und keine Änderungen vorgenommen.

Toleranzwesentlichkeit

Die Anwendung der Wesentlichkeit auf der Ebene der einzelnen Konten oder Salden. Sie wird so bemessen, dass die Wahrscheinlichkeit, dass die Summe der nicht berichtigten und unentdeckten falschen Darstellungen die Wesentlichkeit überschreitet, auf ein angemessenes Maß reduziert wird.

Auf der Grundlage unserer Risikobewertungen und unserer Bewertung des gesamten Prüfungsumfelds der Gesellschaft kamen wir zu dem Schluss, dass die Toleranzwesentlichkeit 75 % (2021: 75 %) der Wesentlichkeit unserer Planung beträgt. Wir haben diesen Prozentsatz der Toleranzwesentlichkeit aufgrund unserer Kenntnis der Gesellschaft und der Branche sowie unserer bisherigen Erfahrungen mit der Gesellschaft festgelegt. Die Effektivität des Kontrollumfelds und unsere Einschätzung der mit dem Mandat verbundenen Risiken.

Schwellenwert

Ein Betrag, bei dessen Unterschreitung festgestellte falsche Darstellung als eindeutig geringfügig eingestuft werden.

Wir vereinbarten mit dem Verwaltungsrat, dass wir ihm alle nicht korrigierten Prüfungsdifferenzen, die über 5 % der geplanten Wesentlichkeitsschwelle liegen, sowie Differenzen unterhalb dieser Schwelle, die unserer Ansicht nach aus qualitativen Gründen ausgewiesen werden sollten, melden würden.

Wir bewerten alle nicht berichtigten falsche Darstellungen sowohl anhand der vorstehend dargelegten quantitativen Maßstäbe für die Wesentlichkeit als auch unter Berücksichtigung anderer einschlägiger qualitativer Erwägungen, die wir bei der Bildung unseres Prüfungsurteils berücksichtigen.

Ein Überblick über den Prüfungsgegenstand unseres Berichts

Ausrichtung des Prüfungsgegenstands

Der Prüfungsumfang für die Gesellschaft wird durch unsere Einschätzung des Prüfungsrisikos, unsere Bewertung der Wesentlichkeit und unsere Zuordnung der Toleranzwesentlichkeit bestimmt. Dadurch können wir uns ein Urteil über den Abschluss bilden. Bei der Planung des Umfangs der durchzuführenden Prüfhandlungen berücksichtigen wir die Größe, das Risikoprofil, die Organisation der Gesellschaft und die Effektivität der Kontrollen, einschließlich der Kontrollen und Veränderungen im Geschäftsumfeld. Alle Prüfungsarbeiten wurden unmittelbar von dem Mandatsteam durchgeführt.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Bei den sonstigen Informationen handelt es sich um Informationen, die im Jahresbericht enthalten sind, mit Ausnahme des Abschlusses und unseres Abschlussprüferberichts dazu. Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss schließt die sonstigen Informationen nicht mit ein, sofern dies in unserem Bericht nicht ausdrücklich angegeben ist, und wir äußern diesbezüglich keine Schlussfolgerungen.

Wir sind dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss, oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir solche wesentliche Widersprüche oder augenscheinliche erhebliche falsche Darstellungen identifizieren, sind wir verpflichtet, zu bestimmen, ob eine wesentliche Falschdarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Falschdarstellung der sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir basierend auf der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Falschdarstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten.

Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Stellungnahme zu sonstigen Angelegenheiten gemäß dem Companies Act von 2014

Nach unserer Beurteilung können wir ausschließlich auf der Grundlage der im Rahmen der Prüfung durchgeführten Arbeit Folgendes berichten:

- Die im Bericht des Verwaltungsrats für das abgeschlossene Geschäftsjahr, für das der Abschluss erstellt wurde, enthaltenen Informationen stimmen mit dem Abschluss überein; und
- der Bericht des Verwaltungsrats wurde in Übereinstimmung mit den geltenden rechtlichen Anforderungen erstellt.

Wir waren im Besitz sämtlicher Informationen und Erklärungen, die nach unserem besten Wissen und Gewissen für die Zwecke unserer Prüfung erforderlich sind.

Nach unserer Ansicht waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine schnelle und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen, und der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

Angelegenheiten, über die wir ausnahmsweise Bericht erstatten müssen

Auf der Grundlage der Kenntnis und des Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir im Rahmen der Prüfung gewonnen haben, haben wir im Bericht des Verwaltungsrats keine erheblichen falschen Darstellungen identifiziert.

Der Companies Act von 2014 schreibt vor, dass wir Sie informieren, wenn die Gesellschaft nach unserer Einschätzung die in Abschnitt 305 bis 312 dieses Act dargelegten Angaben über die Vergütung und Geschäfte der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht hat. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Jeweilige Verantwortungsbereiche

Verantwortung des Verwaltungsrats für den Abschluss

Wie in der Erklärung zur Verantwortung des Verwaltungsrats auf Seite 40 näher erklärt, ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, den Abschluss im Einklang mit dem anwendbaren Rahmen der Finanzberichterstattung zu erstellen und muss dafür sorgen, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt. Er ist außerdem für alle internen Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die ihm notwendig erscheinen, um die Erstellung eines Abschlusses zu ermöglichen, der frei von erheblichen falschen Darstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum ist.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung ihrer Geschäftstätigkeit zu beurteilen, wobei sie gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Annahme der Unternehmensfortführung offenlegen muss, sofern das Management nicht die Auflösung der Gesellschaft oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Abschlusses

Unser Ziel ist das Erreichen einer angemessenen Überzeugung davon, ob der Abschluss als Ganzes frei von erheblichen falschen Darstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum ist, und das Ausstellen eines Abschlussprüferberichts einschließlich unseres Bestätigungsvermerks. Eine angemessene Überzeugung ist ein hohes Maß an Überzeugung, es besteht jedoch keine Garantie dafür, dass eine im Einklang mit den ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung alle eventuell bestehenden erheblichen Falschdarstellungen aufdeckt. Falschdarstellungen können durch Betrug oder Irrtum entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Erläuterung, in welchem Umfang die Prüfung als geeignet angesehen wurde, Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken

Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, sind Fälle von Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften. Wir entwickeln Verfahren in Übereinstimmung mit unseren oben beschriebenen Pflichten, um Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken, von denen angenommen werden kann, dass sie einen wesentlichen Einfluss auf den Jahresabschluss haben. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von Betrug nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass sie aufgrund von Irrtümern nicht aufgedeckt werden, da Betrug eine vorsätzliche Verdeckung beinhalten kann, z. B. durch Fälschungen, vorsätzliche falsche Darstellungen oder durch betrügerische Absprachen. Außerdem ist es umso unwahrscheinlicher, dass unsere Verfahren Verstöße aufdecken, je weiter sie von den Ereignissen und Vorgängen entfernt sind, die in den Jahresabschlüssen dargestellt werden. Inwieweit unsere Verfahren in der Lage sind, Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken, wird im Folgenden erläutert. Dennoch liegt die Hauptverantwortung für die Verhinderung und Aufdeckung von Betrug sowohl bei den für die Leitung der Gesellschaft Verantwortlichen und beim Management.

Unsere Vorgehensweise bei dieser Prüfung:

- Wir haben uns ein Verständnis der rechtlichen und regulatorischen Rahmenbedingungen für die Gesellschaft verschafft und festgestellt, dass die International Financial Reporting Standards (IFRS), wie sie von der Europäischen Union übernommen wurden, der Companies Act 2014, die European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011, und der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 die wichtigsten sind.
- Wir haben uns anhand des internen Kontrollsystems von Man Funds Plc ein Verständnis darüber verschafft, wie Man Funds Plc diese Rahmenvorgaben einhält, und haben das Management und Vertreter der Dienstleister der Gesellschaft befragt. Wir haben unsere Erkundigungen durch die Prüfung von Protokollen des Verwaltungsrats und der Korrespondenz mit den Aufsichtsbehörden belegt.
- Wir überprüften die Wahrscheinlichkeit wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresabschlüssen der Gesellschaft, einschließlich der Frage, wie es zu Betrug kommen könnte, indem wir das Management befragten, ob es Kenntnis von tatsächlichen, vermuteten oder angeblichen Betrugsfällen hat, die die Organisation betreffen. Wir haben Prüfungshandlungen durchgeführt, um festgestellte Betrugsrisiken zu berücksichtigen. Diese Prüfungsvorgänge umfassten auch die Untersuchung manuell geführter Geschäftsbücher und sollten hinreichende Gewähr dafür bieten, dass der Abschluss frei von Betrug oder Irrtümern ist.
- Auf der Grundlage dieses Verständnisses haben wir unsere Prüfungshandlungen geplant, um Verstöße gegen diese Gesetze und Vorschriften aufzudecken. Unsere Prüfungshandlungen umfassten das Lesen von Verwaltungsratsprotokollen, um Verstöße gegen Gesetze und Vorschriften festzustellen, eine Überprüfung der Berichterstattung an den Prüfungsausschuss über die Einhaltung von Vorschriften sowie Befragungen des Managements.

Eine detailliertere Beschreibung unserer Verantwortung für die Prüfung des Abschlusses ist auf der Website der IAASA zu finden: http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf. Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Abschlussprüferberichts.

Andere Angelegenheiten, zu denen wir Bericht erstatten müssen

Der Verwaltungsrat hat uns mit der Prüfung des Abschlusses beauftragt, bevor die Gesellschaft an der Börse notiert wurde. Dies ist das letzte Jahr, in dem wir nach den Rotationsregeln als Prüfer zugelassen sind.

Die nach dem Ethischen Standard der IAASA verbotenen prüfungsfremden Leistungen wurden für die Gesellschaft nicht erbracht und wir bleiben bei der Durchführung unserer Prüfung unabhängig von der Gesellschaft.

Unser Prüfurteil stimmt mit dem ergänzenden Bericht des Verwaltungsrates überein.

Zweck unserer Prüfungsarbeit und Begünstigter unserer Verantwortlichkeiten

Unser Bericht ist gemäß Section 391 des Companies Act von 2014 ausschließlich für die Gesellschafter der Gesellschaft in ihrer Gesamtheit bestimmt. Unsere Prüfung wurde vorgenommen, damit wir die Gesellschafter der Gesellschaft über die Belange informieren können, über die wir in einem Bericht des Abschlussprüfers informieren müssen, und aus keinem anderen Grund. Soweit dies gesetzlich zulässig ist, übernehmen wir für unsere Prüfungsarbeit, diesen Bericht oder unser Testat keine Verantwortung gegenüber anderen Personen als der Gesellschaft und den Gesellschaftern der Gesellschaft als Organ.

Vincent Bergin
Für und im Namen von
Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit Firm

Dublin

26. April 2023

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens	
	ASCOTs (b)				Wandelanleihen (Fortsetzung)			
	Japan				Italien			
10.000.000	Ascot Seino 0 % 31.03.2026	1.577	0,00	600.000	DiaSorin SpA 0 % 05.05.2028	562.861	0,43	
150.000.000	Mitsubishi Chemical Holdings 0 % 29.03.2024	6.025	0,01	700.000	Pirelli & C SpA 0 % 22.12.2025	702.549	0,53	
40.000.000	Warrant Mitchm 0 % 15.03.2023	-	0,00	1.000.000	Prysman SpA 0 % 02.02.2026	1.111.194	0,85	
		7.602	0,01			2.376.604	1,81	
	Summe ASCOTs	7.602	0,01		Japan			
	Wandelanleihen			30.000.000	CyberAgent Inc 0 % 17.02.2023 #	227.440	0,17	
	Australien			30.000.000	CyberAgent Inc 0 % 19.02.2025 #	237.829	0,18	
700.000	DEXUS Finance Pty Limited 2,3 % 19.06.2026	454.487	0,35	40.000.000	CyberAgent Inc 0 % 16.11.2029 #	318.110	0,24	
400.000	Flight Centre Travel Group Limited 1,625 % 01.11.2028	212.265	0,16	40.000.000	Digital Garage Inc 0 % 14.09.2023 #	308.441	0,24	
500.000	Seven Group Holdings 2,2 % 05.03.2025	340.052	0,26	50.000.000	DMG Mori Company Limited 0 % 16.07.2024	382.966	0,29	
		1.006.804	0,77	10.000.000	HIS Company Limited 0 % 15.11.2024 #	62.952	0,05	
	Österreich				Koei Tecmo Holdings Company Limited 0 %			
1.100.000	A-Tec Industries AG 8,75 % 27.10.2014	2.054	0,00	60.000.000	20.12.2024 #	487.874	0,37	
	Belgien			30.000.000	Kyoritsu Maintenance Company Limited 0 % 29.01.2026	300.733	0,23	
200.000	Groupe Bruxelles Lambert NV 2,13 % 29.11.2025	217.874	0,16	10.000.000	Menicon Company Limited 0 % 29.01.2025 #	79.205	0,06	
400.000	Umicore SA 0 % 23.06.2025	390.338	0,30	30.000.000	MERCAR 0 % 14.07.2028	148.943	0,11	
		608.212	0,46	60.000.000	Nipro Corporation 0 % 25.09.2026 #	455.510	0,35	
	Britische Jungferinseln			30.000.000	Relo Group Inc 0 % 17.12.2027 #	219.913	0,17	
400.000	ADM AG Holding Limited 0 % 26.08.2023	395.018	0,30	60.000.000	Rohm Company Limited 0 % 05.12.2024	473.256	0,36	
152.000	Strategic International Group Limited 0 % 29.06.2025	166.500	0,13	40.000.000	Ship Healthcare Holdings Inc 0 % 13.12.2023 #	329.645	0,25	
	Viva Biotech Investment Management Limited 1 %			40.000.000	Sossi Group Corporation 0,25 % 27.07.2026	349.729	0,27	
400.000	30.12.2025	251.136	0,19	20.000.000	Sumitomo Metal Mining Company Limited 0 % 15.03.2023	151.434	0,12	
		812.654	0,62			4.533.980	3,46	
	Kanada				Liberia			
344.000	Shopify Inc 0,125 % 01.11.2025 *	293.177	0,22	598.000	Royal Caribbean Group SR CV NT 4,25 % 15.06.2023 *	595.602	0,46	
	Kaimaninseln				Luxemburg			
8.000.000	Cathay 2,75 % 05.02.2026	1.108.553	0,85	7.000.000	Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0 %			
	China				25.07.2024	857.324	0,66	
5.000.000	China Conch Venture Holdings International Limited 0 %	690.546	0,53		Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA 0,5 %			
3.060.000	05.09.2023	1.266.228	0,97		04.08.2023	423.749	0,32	
2.878.000	China Medical Technologies Inc 15.12.2016 *	1.190.916	0,91		400.000	Lagfin SCA 2 % 07.02.2025	462.602	0,35
	China Medical Technologies Inc 4,00 % 15.08.2013 *				500.000	Oliver Capital Sarl 0 % 29.12.2023	559.722	0,43
	Hansoh Pharmaceutical Group Company Limited 0 %					2.303.397	1,76	
285.000	22.01.2026	264.243	0,20		Malaysia			
341.000	Huazhu Group Limited 3 % 01.05.2026 *	420.613	0,32	564.000	Cindai Capital Limited 0 % 08.02.2023	560.309	0,43	
3.000.000	Kingsoft Corporation Limited 0,63 % 29.04.2025	403.111	0,31		Niederlande			
765.000	Lenovo Group Limited 3,375 % 24.01.2024	863.237	0,66	300.000	America Movil BV 0 % 02.03.2024	325.618	0,25	
765.000	Li Auto Inc 0,25 % 01.05.2028 *	774.054	0,59	400.000	ELM BV for Swiss Re Limited 3,25 % 13.06.2024	413.536	0,32	
856.000	Trip.com Group Limited 1,5 % 01.07.2027 *	1.014.103	0,77	400.000	Just Eat Takeaway.com NV 0 % 09.08.2025	358.754	0,27	
6.000.000	Zhongsheng Group Holdings Limited 0 % 21.05.2025	871.743	0,66			1.097.908	0,84	
300.000	ZJEXPR 0 % 20.01.2026	324.198	0,25		Singapur			
967.000	ZTO 1,50 % 01.09.2027 *	1.028.748	0,78	1.250.000	Sea Limited 2,375 % 01.12.2025 *	1.239.219	0,94	
		9.111.740	6,95	600.000	SGXSP 0 % 01.03.2024	623.653	0,48	
	Dänemark			1.000.000	SIASP 1,63 % 03.12.2025	787.653	0,60	
507.000	ASND 2,25 % 01.04.2028 *	516.646	0,39			2.650.525	2,02	
	Frankreich				Südkorea			
8.400	Accor SA 0,7 % 07.12.2027	373.043	0,28	1.200.000	POSCO Holdings 0 % 01.09.2026	1.208.225	0,92	
400.000	BNP Paribas SA 0 % 13.05.2025	485.492	0,37		Spanien			
400.000	Carrefour SA 0 % 27.03.2024	382.564	0,29	200.000	AMSSM 1,5 % 09.04.2025	237.697	0,18	
4.885	Edenred 0 % 06.09.2024	321.830	0,25	200.000	Cellnex Telecom SA 0,50 % 05.07.2028	211.637	0,16	
4.100	Edenred 0 % 14.06.2028	288.109	0,22	200.000	Cellnex Telecom SA 1,50 % 16.01.2026	249.799	0,19	
1.700	Schneider Electric SE 0 % 15.06.2026	333.822	0,25	1.900.000	CLNXSM 0,75 % 20.11.2031	1.473.229	1,13	
1.960	Soitec SA 0 % 01.10.2025	399.435	0,31			2.172.362	1,66	
400.000	Ubisoft Entertainment SA 2,67 % 15.11.2028	443.176	0,34		Schweden			
6.400	Veolia Environnement SA 0 % 01.01.2025	208.918	0,16	400.000	GEELZ 0 % 19.06.2024	512.792	0,39	
		3.236.389	2,47		Schweiz			
	Deutschland			1.040.000	Sika AG 0,15 % 05.06.2025	1.415.584	1,08	
200.000	Delivery Hero SE 0 % 15.07.2025	173.002	0,13	400.000	STMicroelectronics NV 0 % 04.08.2027	415.300	0,32	
400.000	Deutsche Lufthansa AG 2 % 17.11.2025	456.860	0,35	170.000	Swiss Prime Site AG 0,325 % 16.01.2025	176.331	0,13	
200.000	RAG-Stiftung 1,875 % 16.11.2029	215.891	0,17			2.007.215	1,53	
		845.753	0,65		Taiwan			
	Hongkong			400.000	Globalwafers Company Limited 0 % 01.06.2026	342.414	0,26	
1.200.000	Anlian Capital Limited 0 % 05.02.2025	1.505.015	1,15		Hon Hai Precision Industry Company Limited 0 %			
547.000	ESR Cayman Limited 1,5 % 30.09.2025	520.449	0,40	900.000	05.08.2026	764.964	0,58	
390.000	Far East Horizon Limited 2,5 % 08.07.2025	385.137	0,29	1.000.000	Taiwan Cement Corporation 0 % 07.12.2026	874.825	0,67	
200.000	Xiaomi Best Time International Limited 0 % 17.12.2027	162.431	0,12	500.000	United Microelectronics Corporation 0 % 07.07.2026	426.180	0,33	
		2.573.032	1,96	500.000	Zhen Ding Technology Holding Limited 0 % 30.06.2025	487.245	0,37	
	Indien					2.895.628	2,21	
885.000	Bharti Airtel Limited 1,5 % 17.02.2025	1.177.572	0,90		Vereinigte Arabische Emirate			
	Irland			1.400.000	Abu Dhabi National Oil Company 0,7 % 04.06.2024	1.324.372	1,01	
608.000	Jazz Investments I Limited 1,50 % 15.06.2026 *	726.882	0,55		Vereinigtes Königreich			
1.600.000	Jazz Investments I Limited 1,50 % 15.08.2024 *	1.582.104	1,21	400.000	Barclays Bank plc 0 % 24.01.2025	424.701	0,32	
		2.308.986	1,76	400.000	BP Capital Markets PLC 1 % 28.04.2023	518.659	0,40	
	Israel			300.000	OCDDLN 0,75 % 18.01.2027	241.346	0,18	
600.000	Cyberark Software Limited 0 % 15.11.2024 *	638.643	0,49	300.000	Srnwhln 1,63 % 07.05.2026	321.734	0,25	
500.000	Nice Limited 0 % 15.09.2025 *	470.773	0,36			1.506.440	1,15	
824.000	SolarEdge Technologies Inc 0 % 15.09.2025 *	1.025.991	0,78		USA			
		2.135.407	1,63	749.000	AAL 6,50 % 01.07.2025 *	792.281	0,60	
				326.000	Airbnb Inc 0 % 15.03.2026 *	270.076	0,21	
				921.000	Akamai Technologies Inc 0,125 % 01.05.2025 *	973.732	0,74	
				550.000	ALNY 1 % 15.09.2027 *	597.743	0,46	
				100.000	Asahi Refining USA Inc 0 % 16.03.2026	88.340	0,07	

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert		Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert		
		USD	% des Nettöver- mögens			USD	% des Nettöver- mögens	
Wandelanleihen (Fortsetzung)				Unternehmensanleihen				
USA (Fortsetzung)				Kaimaninseln				
984.000	Bentley Systems Inc 0,38 % 01.07.2027 *	801.955	0,61	429.000	Billbill Inc 1,38 % 01.04.2026 *	503.142	0,39	
1.050.000	BILL.COM Holding Inc 0 % 01.12.2025 *	1.080.839	0,82	208.000	JOYY Inc 0,75 % 15.06.2025 *	199.916	0,15	
1.409.000	BioMarin Pharmaceutical Inc 0,599 % 08.01.2024 *	1.497.901	1,14	<hr/>				
493.000	Booking Holdings Inc 0,75 % 01.05.2025 *	662.488	0,51	<hr/>				
251.000	BURL 2,25 % 15.04.2025 *	290.283	0,22	<hr/>				
842.000	Carnival Corporation 5,75 % 01.10.2024 *	931.252	0,71	USA				
190.000	Cinemark Holdings Inc SR Conv NT 4,5 % 15.08.2025 *	181.927	0,14	2.120.000	Akamai Technologies Inc 0,38 % 01.09.2027 *	2.058.987	1,57	
1.099.000	CNMD 2,25 % 15.06.2027 *	1.003.931	0,77	865.000	Datadog Inc 0,13 % 15.06.2025 *	946.950	0,72	
201.000	Coinbase Global Inc 0,5 % 01.06.2026 *	115.304	0,09	198.000	Etsy Inc 0,13 % 01.10.2026 *	305.928	0,23	
461.000	Cytokinetics Inc 3,5 % 01.07.2027 *	531.319	0,41	480.000	Five9 Inc SR NT 0,5 % 01.06.2025 *	441.590	0,34	
1.300.000	Dexcom Inc SR Global Cocco 0,25 % 15.11.2025 *	1.418.086	1,08	520.000	Integra Lifescienc 0,5 % 15.08.2025 *	506.067	0,39	
1.977.000	DISH Network Corporation 0 % 15/12/2025 *	1.268.532	0,97	115.000	Ionis Pharmaceuticals Inc SR BD 0,125 % 15.12.2024 *	104.541	0,08	
127.000	DISH Network Corporation 3,375 % 15/08/2026 *	79.953	0,06	2.170.000	James River Coal Company 10 % 01.06.2018 # ^	-	0,00	
1.650.000	Dropbox Inc 0 % 01.03.2026 *	1.502.135	1,15	1.010.000	Mongob Inc SR NT 0,25 % 15.01.2026 *	1.177.529	0,90	
550.000	Dropbox Inc 0 % 01.03.2028 *	493.323	0,38	182.000	Okta Inc 0,375 % 16.06.2026 *	153.938	0,12	
1.098.000	Enphase Energy Inc SR Conv BD 0 % 01.03.2026 *	1.241.262	0,95	622.000	Silicon Laboratories Inc SR NT 0,625 % 15.06.2025 *	781.182	0,59	
392.000	Ernstnet Inc 0,75 % 15.08.2025 *	355.875	0,27	1.591.000	Square Inc SR NT 0,125 % 01.03.2025 *	1.517.472	1,16	
1.189.000	ETSY 0,13 % 01.09.2027 *	1.193.607	0,91	1.275.000	Sunedison Inc 0,25 % 15.01.2020 #	17.232	0,01	
80.000	EVBG 0,13 % 15.12.2024 *	72.213	0,06	<hr/>				
413.000	Exact Sciences Corporation 0,375 % 15.03.2027 *	342.451	0,26	<hr/>				
2.706.000	Ford Motor Co 0 % 15.03.2026 *	2.562.027	1,95	Summe Unternehmensanleihen				
432.000	Halozyme Therapeutics Inc 0,25 % 01.03.2027 *	421.133	0,32	<hr/>				
1.062.000	Halozyme Therapeutics Inc 1 % 15.08.2028 *	1.253.495	0,96	Aktien				
1.035.000	IAC Financoco 2 Inc 0,875 % 15.06.2026 *	921.181	0,70	Kaimaninseln				
649.000	IAC Financoco 3 Inc 2 % 15.01.2030 *	563.134	0,43	74.896	Emerald Plantation Holdings Limited	824	0,00	
585.000	Insmed Inc 0,75 % 01.06.2028 *	482.660	0,37	<hr/>				
378.000	Insulet Global Sr Global Cocco 0,375 % 01.09.2026 *	534.942	0,41	Vereinigtes Königreich				
500.000	IONS 0 % 01.04.2026 *	464.255	0,35	56.296.761	Max Petroleum plc ^^	-	0,00	
808.000	j2 Global Inc 1,75 % 01.11.2026 *	810.561	0,62	<hr/>				
600.000	JP Morgan 0 % 29.04.2025	661.430	0,50	Summe Aktien				
300.000	JPMorgan Chase Bank NA 0 % 10.06.2024	340.005	0,26	<hr/>				
500.000	JPMorgan Chase Bank NA 0 % 18.02.2024	544.332	0,42	Total Return Swap (b)				
400.000	JPMorgan Chase Bank NA 0 % 28.12.2023	381.032	0,29	Frankreich				
	JPMorgan Chase Financial Company LLC 0,25 % 01.05.2023 *	617.856	0,47	600.000	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1.196	0,00	
	38.000	LCI Industries 1,125 % 15.05.2026 *	32.140	0,02	<hr/>			
1.372.000	Liberty Media Corporation 2,75 % 01.12.2049 *	1.270.369	0,97	Deutschland				
964.000	Liberty Media Corporation 1,375 % 15.10.2023 *	1.197.871	0,91	300.000	Delivery Hero AG	8.778	0,01	
428.000	Lumentum Holdings Inc 0,5 % 15.06.2028 *	328.618	0,25	<hr/>				
2.114.000	Lumentum Holdings Inc 0,5 % 15.12.2026 *	1.824.023	1,39	Japan				
	MACOM Technology Solutions Holdings Inc 0,25 % 15.03.2026 *	416.648	0,32	150.000.000	ANA Holdings INC	105.669	0,08	
420.000	Mariott Vacations Worldwide Corporation SR Conv NT 0 % 15.01.2026 *	537.573	0,41	330.000.000	Nippon Steel Corporation	80.383	0,06	
812.000	MIDD 1 % 01.09.2025 *	956.471	0,73	<hr/>				
869.000	MP Materials Corporation 0,25 % 01.04.2026 *	766.949	0,59	Niederlande				
600.000	MTN 0 % 01.01.2026 *	561.561	0,43	2.400.000	American Movil BV	30.225	0,02	
1.100.000	NCLH 1,13 % 15.02.2027 *	752.180	0,57	1.000.000	Qiagen NV 0,50 % 13.09.2023	130.645	0,10	
142.000	NCLH 5,38 % 01.08.2025 *	144.979	0,11	<hr/>				
900.000	NextEra Energy Partners LP 0 % 15.11.2025 *	894.884	0,68	Spanien				
541.000	Northern Oil and Gas Inc 3,63 % 15.04.2029 *	583.858	0,45	800.000	Cellnex Telecom SA	56.944	0,04	
1.038.000	Omnicell Inc 0,25 % 15.09.2025 *	907.004	0,69	<hr/>				
682.000	ON Semiconductor Corporation 0 % 01.05.2027 *	905.488	0,69	Schweiz				
299.000	Lumen Technologies Inc 2,50 % 15.07.2027 *	350.341	0,27	1.200.000	STMicroelectronics NV 0 % 04.08.2025	56.872	0,04	
700.000	Pebblebrook Hotel Trust 1,75 % 15.12.2026 *	580.353	0,44	<hr/>				
721.000	Post Holdings Inc 2,50 % 15.08.2027 *	761.034	0,58	Vereinigtes Königreich				
700.000	Pure Storage Inc 0,125 % 15.04.2023 *	757.418	0,58	200.000	JET2 PLC	7.561	0,01	
898.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 6 % 15.08.2025 *	1.129.877	0,86	<hr/>				
1.202.000	Sarepta Therapeutics Inc 1,25 % 15.09.2027 *	1.389.722	1,06	Summe Total Return Swaps				
	Sasol Financing USA Limited Liability Company 4,50 % 08.11.2027	628.509	0,48	<hr/>				
450.000	Shift4 Payments Inc 0 % 15.12.2025 *	447.602	0,34	<hr/>				
47.000	Shift4 Payments Inc 0,50 % 01.08.2027 *	39.691	0,03	<hr/>				
156.000	SNAP Inc 0,75 % 01.08.2026 *	132.976	0,10	<hr/>				
2.017.000	Southwest Airlines Company 1,25 % 01.05.2025 *	2.439.158	1,86	<hr/>				
89.000	Splunk Inc 0,50 % 15.09.2023 *	86.023	0,07	<hr/>				
174.000	Splunk Inc 1,125 % 15.06.2027 *	147.975	0,11	<hr/>				
1.856.000	Splunk Inc 1,125 % 15.09.2025 *	1.759.525	1,34	<hr/>				
411.000	Square Inc 0,50 % 15.05.2023 *	429.361	0,33	<hr/>				
2.578.000	SunEdison Inc 2,38 % 15.04.2022 #	34.842	0,03	<hr/>				
851.000	Sunnova Energy International Inc 0,25 % 01.12.2026 *	661.525	0,50	<hr/>				
549.000	Sunnova Energy International Inc 2,63 % 15.02.2028 *	445.909	0,34	<hr/>				
444.000	Tyler Technologies Inc 0,25 % 15.03.2026 *	415.076	0,32	<hr/>				
480.000	Vishay Intertechnology Inc 2,25 % 15.06.2025 *	466.651	0,36	<hr/>				
539.000	Wayfair Inc 1 % 15.08.2026 *	310.577	0,24	<hr/>				
524.000	Wayfair Inc 1,125 % 01.11.2024 *	444.648	0,34	<hr/>				
348.000	Wayfair Inc 3,25 % 15.09.2027 *	268.044	0,20	<hr/>				
1.116.000	Wolfspeed Inc 0,25 % 15.02.2028 *	961.540	0,73	<hr/>				
429.000	Zillow Group Inc 0,75 % 01.09.2024 *	445.926	0,34	<hr/>				
385.000	Zillow Group Inc 1,375 % 01.09.2026 *	391.480	0,30	<hr/>				
203.000	Zillow Group Inc 2,75 % 15.05.2025 *	194.228	0,15	<hr/>				
1.226.000	SNAP Inc 0,13 % 01.07.2025 *	1.290.481	0,98	<hr/>				
		57.835.959	44,13	<hr/>				
Vietnam								
600.000	Vingroup JSC 3 % 20.04.2026	458.547	0,35					
400.000	Vinpearl JSC 3,25 % 21.09.2026	289.838	0,22					
		748.385	0,57					
<hr/>				<hr/>				
Summe Wandelanleihen		110.066.682	83,98					

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Convertibles (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
95.003.797 EUR	100.650.364 USD	6. Januar 2023	18	792.933	0,60
7 USD	7 GBP	6. Januar 2023	1	-	0,00
80.908 USD	66.594 GBP	6. Januar 2023	3	786	0,00
1.249.037 USD	1.016.152 GBP	12. Januar 2023	2	26.269	0,02
4.345.380 USD	33.826.618 HKD	12. Januar 2023	1	9.927	0,01
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				829.915	0,63
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				120.097.770	91,63

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Convertibles (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Aktien swaps			
Frankreich			
4.399	Carrefour SA	(1.221)	(0,00)
Summe Aktien swaps		(1.221)	(0,00)
Total Return Swaps			
Australien			
600.000	Flight Centre Limited	(31.792)	(0,02)
Belgien			
600.000	SAGERPAR TRS	(32.719)	(0,03)
800.000	Umicore SA	(65.525)	(0,05)
		(98.244)	(0,08)
Frankreich			
23.100	Cathay 2,75 % 05.02.2026	(65.532)	(0,05)
3.460	Schneider Electric SE	(60.182)	(0,05)
400.000	Selena SARL	(33.576)	(0,03)
6.200	Worldline SA	(4.913)	(0,00)
		(164.203)	(0,13)
Deutschland			
1.300.000	Deutsche Post AG	(199.149)	(0,15)
600.000	Leg Immobilien SE	(43.292)	(0,03)
800.000	RAG-Stiftung	(149.500)	(0,12)
300.000	TAG Immobilien AG	(62.758)	(0,05)
		(454.699)	(0,35)
Italien			
1.000.000	Nexi SPA	(81.554)	(0,06)
Japan			
70.000.000	Nagoya Railroad	(9.979)	(0,01)
190.000.000	SBI Holdings INC	(17.798)	(0,01)
		(27.777)	(0,02)
Niederlande			
400.000	DUFFRY ONE BV	(12.495)	(0,01)
Spanien			
700.000	Amadeus IT Group SA	(124.616)	(0,09)
700.000	Cellnex Telecom SA	(180.714)	(0,14)
		(305.330)	(0,23)
Schweiz			
800.000	IDORSIA Limited	(117.488)	(0,09)
Vereinigtes Königreich			
900.000	International Consolidated Airlines Group SA	(27.311)	(0,02)
Summe Total Return Swaps		(1.320.893)	(1,01)

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
4.303.835 GBP	5.223.044 USD	6. Januar 2023	3	(45.001)	(0,03)
1.020.254 USD	1.505.702 AUD	12. Januar 2023	1	(1.390)	(0,00)
1.373.463 USD	1.282.305 CHF	12. Januar 2023	1	(14.514)	(0,01)
2.859.185 USD	2.688.384 EUR	6. Januar 2023	18	(11.423)	(0,01)
16.787.704 USD	15.880.248 EUR	12. Januar 2023	6	(176.082)	(0,13)
3.830.841 USD	524.802.286 JPY	12. Januar 2023	2	(153.596)	(0,12)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(402.006)	(0,30)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(1.724.120)	(1,31)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				120.097.770	91,63
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(1.724.120)	(1,31)
Sonstiges Nettovermögen				12.692.419	9,68
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				131.066.069	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

^ Notleidende Position. Der unabhängige Preisausschuss hat sich im April 2016 darauf geeinigt, den Wert auf Null zu setzen, da keine Beitreibung zu erwarten ist.

^^ Wertpapier im März 2015 aufgrund der Ungewissheit um die finanzielle Lage des Unternehmens ausgesetzt. Der unabhängige Preisausschuss hat sich im März 2016 darauf geeinigt, den Wert auf Null zu setzen, da keine Beitreibung zu erwarten ist.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben

Sonstiges Umlaufvermögen

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	28,63
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	0,96
Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben	2,02
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	55,73
Sonstiges Umlaufvermögen	12,66
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI European Equity Leaders



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
26.154.586 DKK	3.516.274 EUR	9. Januar 2023	11	1.095	0,00
20.611 EUR	20.304 CHF	9. Januar 2023	9	42	0,00
115 EUR	854 DKK	9. Januar 2023	5	-	0,00
248.465 EUR	218.677 GBP	9. Januar 2023	14	2.101	0,01
12.390 EUR	129.801 NOK	9. Januar 2023	8	46	0,00
55.578 EUR	616.908 SEK	9. Januar 2023	10	107	0,00
69.368 EUR	73.719 USD	6. Januar 2023	2	329	0,00
2.137 EUR	2.271 USD	9. Januar 2023	9	10	0,00
10.540.461 NOK	1.000.825 EUR	9. Januar 2023	7	1.456	0,00
18 SEK	2 EUR	9. Januar 2023	2	-	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				5.186	0,01
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				5.186	0,01

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI European Equity Leaders (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettover- mögens
	Aktien swaps		
554.765	Europäische Union MSCI Europe	(1.038.374)	(1,27)
	Summe Aktien swaps	(1.038.374)	(1,27)

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
12.914.483 CHF	13.094.132 EUR	9. Januar 2023	11	(10.038)	(0,01)
147.543 EUR	145.678 CHF	9. Januar 2023	5	(47)	(0,00)
45.041 EUR	334.951 DKK	9. Januar 2023	7	(5)	(0,00)
669 EUR	7.039 NOK	9. Januar 2023	3	(1)	(0,00)
1.089 EUR	12.169 SEK	9. Januar 2023	2	(5)	(0,00)
16.887.204 GBP	19.347.913 EUR	9. Januar 2023	11	(322.620)	(0,39)
166.276 NOK	15.991 EUR	9. Januar 2023	4	(180)	(0,00)
48.625.145 SEK	4.412.589 EUR	9. Januar 2023	9	(40.377)	(0,06)
723.577 USD	682.964 EUR	6. Januar 2023	4	(5.319)	(0,01)
176.265 USD	166.333 EUR	9. Januar 2023	6	(1.293)	(0,00)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(379.885)	(0,47)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(1.418.259)	(1,74)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				5.186	0,01
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(1.418.259)	(1,74)
Sonstiges Nettovermögen				82.983.295	101,73
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				81.570.222	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Sonstiges Umlaufvermögen

% des Gesamtvermögens

0,01

99,99

100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert JPY	% des Nettöver- mögens
	Aktien		
	Japan		
1.306.900	Asin Corporation	4.613.357.000	1,74
724.900	Asahi Group Holdings Limited	2.985.863.100	1,12
6.064.000	Asahi Kasei Corporation	5.708.649.600	2,15
1.355.100	Dai-ichi Life Holdings Inc	4.057.169.400	1,53
2.630.400	Daiwa House Industry Company Limited	7.993.785.600	3,01
10.108.500	Eneos Holdings Inc	4.528.608.000	1,70
2.298.500	Honda Motor Company Limited	6.969.052.000	2,62
3.215.300	JFE Holdings Inc	4.938.700.800	1,86
2.593.600	Komatsu Limited	7.459.193.600	2,81
2.474.700	Kubota Corporation	4.496.529.900	1,69
669.400	Kyocera Corporation	4.385.908.800	1,65
770.700	Lawson Inc	3.876.621.000	1,46
2.658.000	Makita Corporation	8.186.640.000	3,08
1.162.100	Mitsubishi Corporation	4.977.274.300	1,87
5.877.400	Mitsubishi Electric Corporation	7.719.964.900	2,91
8.254.800	Mitsubishi Estate Company Limited	14.123.962.800	5,31
14.673.744	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	13.044.958.416	4,91
1.804.700	Mitsui Fudosan Company Limited	4.361.959.900	1,64
5.460.900	Mizuho Financial Group Inc	10.135.430.400	3,81
2.221.800	Nippon Steel Corporation	5.092.365.600	1,92
22.182.500	Nissan Motor Company Limited	9.274.503.250	3,49
421.600	Nitto Denko Corporation	3.225.240.000	1,21
11.087.800	Nomura Holdings Inc	5.417.499.080	2,04
6.991.100	NSK Limited	4.900.761.100	1,84
2.587.400	Obayashi Corporation	2.582.225.200	0,97
9.721.500	Panasonic Corporation	10.795.725.750	4,06
8.796.600	Resona Holdings Inc	6.361.701.120	2,39
2.118.200	Resonac Holdings Corporation	4.278.764.000	1,61
239.700	Shin-Etsu Chemical Company Limited	3.889.132.500	1,46
1.834.800	Subaru Corporation	3.720.057.000	1,40
2.082.200	Sumco Corporation	3.658.425.400	1,38
16.056.900	Sumitomo Chemical Company Limited	7.610.970.600	2,86
2.245.600	Sumitomo Corporation	4.931.337.600	1,86
4.455.000	Sumitomo Electric Industries Limited	6.702.547.500	2,52
1.371.700	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	7.264.523.200	2,73
901.554	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	4.136.329.752	1,56
1.622.800	Sumitomo Realty & Development Company Limited	5.064.758.800	1,91
4.395.800	T&D Holdings Inc	8.360.811.600	3,15
571.800	Taisei Corporation	2.430.150.000	0,91
1.541.400	Takeda Pharmaceutical Company Limited	6.336.695.400	2,38
2.225.000	Teijin Limited	2.865.800.000	1,08
1.197.300	THK Company Limited	3.011.209.500	1,13
9.253.600	Toray Industries Inc	6.816.201.760	2,56
689.700	Toyota Industries Corporation	4.993.428.000	1,88
1.443.500	Yamato Holdings Company Limited	3.012.584.500	1,13
		261.297.377.728	98,30
	Summe Aktien	261.297.377.728	98,30

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn JPY	% des Nettovermögens
120.663 CHF	17.195.024 JPY	4. Januar 2023	3	10.590	0,00
95 CHF	13.522 JPY	5. Januar 2023	1	24	0,00
598.329.710 EUR	83.947.322.083 JPY	4. Januar 2023	12	281.170.728	0,11
71.007 EUR	9.991.733 JPY	10. Januar 2023	6	147	0,00
1.857.039.117 JPY	12.878.919 CHF	4. Januar 2023	3	20.609.470	0,00
1.865.043.897 JPY	12.905.781 CHF	5. Januar 2023	5	24.837.008	0,01
14.930.478 JPY	103.550 CHF	10. Januar 2023	8	166.988	0,00
85.098.657.939 JPY	597.960.964 EUR	4. Januar 2023	12	922.074.863	0,35
84.805.886.608 JPY	595.823.550 EUR	5. Januar 2023	9	935.624.159	0,36
728.913.899 JPY	5.138.092 EUR	10. Januar 2023	11	5.891.368	0,00
13.199.910.981 JPY	81.768.723 GBP	4. Januar 2023	20	228.952.068	0,08
13.104.560.314 JPY	81.426.932 GBP	5. Januar 2023	8	189.232.810	0,07
108.592.416 JPY	676.933 GBP	10. Januar 2023	11	1.279.714	0,00
11.316.547.250 JPY	84.637.873 USD	4. Januar 2023	19	156.589.339	0,06
10.903.983.327 JPY	81.509.304 USD	5. Januar 2023	6	158.004.051	0,06
244.628.602 JPY	1.849.644 USD	10. Januar 2023	6	941.197	0,00
2.871 USD	378.427 JPY	4. Januar 2023	1	78	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				2.925.384.602	1,10
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				264.222.762.330	99,40

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust JPY	% des Nettovermögens
12.834.934 CHF	1.830.745.296 JPY	4. Januar 2023	3	(587.659)	(0,00)
12.905.687 CHF	1.861.315.411 JPY	5. Januar 2023	6	(21.122.069)	(0,00)
12.944.354 CHF	1.870.653.871 JPY	10. Januar 2023	9	(25.142.852)	(0,01)
13.225 EUR	1.864.891 JPY	4. Januar 2023	2	(3.128)	(0,00)
595.823.550 EUR	84.813.435.818 JPY	5. Januar 2023	14	(943.173.369)	(0,36)
598.852.121 EUR	85.213.512.560 JPY	10. Januar 2023	17	(944.177.905)	(0,36)
81.768.723 GBP	13.033.750.005 JPY	4. Januar 2023	15	(62.791.096)	(0,02)
81.426.930 GBP	13.146.610.361 JPY	5. Januar 2023	12	(231.282.862)	(0,09)
81.918.614 GBP	13.177.381.477 JPY	10. Januar 2023	24	(191.002.436)	(0,07)
10.923.536 JPY	76.678 CHF	4. Januar 2023	7	(10.068)	(0,00)
53.618.561 JPY	381.973 EUR	4. Januar 2023	11	(152.937)	(0,00)
84.635.002 USD	11.166.288.870 JPY	4. Januar 2023	12	(6.709.465)	(0,00)
81.509.304 USD	10.904.149.758 JPY	5. Januar 2023	12	(158.170.485)	(0,06)
81.030.842 USD	10.832.707.414 JPY	10. Januar 2023	21	(157.027.828)	(0,06)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(2.741.354.159)	(1,03)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(2.835.478.019)	(1,06)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				264.222.762.330	99,40
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(2.835.478.019)	(1,06)
Sonstiges Nettovermögen				4.422.644.849	1,66
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				<u>265.809.929.160</u>	<u>100,00</u>

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Sonstiges Umlaufvermögen

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	95,82
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	1,07
Sonstiges Umlaufvermögen	3,11
	<u>100,00</u>

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
Nennwert	Beschreibung	Nennwert	Beschreibung
	Aktien		Aktien (Fortsetzung)
	Brasilien		Hongkong (Fortsetzung)
9.424	Embraer SA	103.004	0,02
562.339	Gerdau SA	3.115.358	0,73
533.219	Petroleo Brasileiro SA	5.339.652	1,24
179.330	Vale SA	3.043.230	0,71
		11.601.244	2,70
	Chile		
2.944.199	Banco de Chile	304.114	0,07
543.116	Cencosud SA	889.309	0,21
24.042	Sociedad Quimica y Minera De Chile SA	1.919.513	0,45
		3.112.936	0,73
	China		
1.447.500	3SBio Inc	1.539.312	0,36
374.000	AK Medical Holdings Limited	469.120	0,11
138.133	Alibaba Group Holding Limited	12.168.136	2,84
2.445.500	BAIC Motor Corporation Limited	648.587	0,15
2.200	Baidu Inc	251.636	0,06
4.244.000	Bank of China Limited	1.544.271	0,36
44.500	BYD Company Limited	1.098.111	0,26
2.279.000	China Aoyuan Group Limited	68.911	0,02
5.558.000	China CITIC Bank Corporation Limited	2.463.908	0,58
896.000	China Coal Energy Company Limited	728.973	0,17
5.978.000	China Construction Bank Corporation	3.745.369	0,87
642.000	China Datang Corporation Renewable Power Company Limited	190.010	0,04
1.306.000	China Feihe Limited	1.111.069	0,26
1.761.500	China Galaxy Securities Company Limited	859.879	0,20
155.350	China International Marine Containers Group Company Limited	117.832	0,03
1.034.000	China Medical System Holdings Limited	1.626.855	0,38
90.000	China Merchants Bank Company Limited	503.334	0,12
299.000	China Risun Group Limited	116.843	0,03
79.000	China Shenhua Energy Company Limited	228.246	0,05
1.386.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	1.029.962	0,24
4.258.000	China Yuhua Education Corporation Limited	605.562	0,14
918.000	Chongqing Rural Commercial Bank Company Limited	314.039	0,07
48.561	Daqo New Energy Corporation	1.874.940	0,44
400.000	Dongfeng Motor Group Company Limited	229.598	0,05
113.472	Finvolution Group	562.821	0,13
1.712.000	Fufeng Group Limited	1.041.903	0,24
202.400	Fuyao Glass Industry Group Company Limited	849.282	0,20
152.000	Geely Automobile Holdings Limited	222.013	0,05
556.500	Greentown China Holdings Limited	812.830	0,19
113.200	Haier Smart Home Company Limited - Klasse H	385.796	0,09
354.875	Hello Group Inc	3.186.778	0,74
365.000	Hengan International Group Company Limited	1.938.417	0,45
2.576.000	Industrial & Commercial Bank of China Limited	1.326.789	0,31
104.650	JD Health International Inc	956.672	0,22
95.419	JD.com Inc	5.355.869	1,25
19.299	JOYY Inc	609.655	0,14
394.500	Legend Holdings Corporation	422.050	0,10
406.000	Lenovo Group Limited	333.437	0,08
248.900	Meituan	5.571.186	1,30
44.601	NetEase Inc	3.239.371	0,76
2.446.000	People's Insurance Company Group of China Limited	811.682	0,19
2.078.000	PetroChina Company Limited	950.481	0,22
888.000	PICC Property & Casualty Company Limited	843.065	0,20
48.400	Pinduoduo Inc	3.947.020	0,92
271.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.796.677	0,42
171.500	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Company Limited	549.331	0,13
803.000	Sinopec Engineering Group Company Limited	352.890	0,08
1.970.000	Sunac China Holdings Limited	231.202	0,05
359.600	Tencent Holdings Limited	15.388.491	3,59
155.566	Tencent Music Entertainment Group	1.288.087	0,30
708.000	Tianneng Power International Limited	747.464	0,17
67.634	Trip.com Group Limited	2.326.610	0,54
207.530	Vipshop Holdings Limited	2.830.709	0,66
112.000	WuXi AppTec Company Limited	1.183.147	0,28
414.500	Wuxi Biologics Cayman Inc	3.178.473	0,74
486.500	Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Company Limited	553.510	0,13
888.000	Yadea Group Holdings Limited	1.485.888	0,35
152.000	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	270.700	0,06
212.000	Yankuang Energy Group Company Limited	646.462	0,15
302.000	Yihai International Holding Limited	1.067.938	0,25
153.200	ZTE Corporation	337.611	0,08
49.780	Zto Express Cayman Inc	1.337.589	0,31
		102.474.399	23,90
	Kolumbien		
18.695	Bancolombia SA	533.555	0,12
	Griechenland		
214.652	Eurobank Ergasias SA	241.687	0,06
27.278	Hellenic Telecommunications Organization SA	424.751	0,10
21.872	Opap SA	308.827	0,07
		975.265	0,23
	Hongkong		
518.000	Alibaba Health Information Technology Limited	441.348	0,10
557.000	BOE Varitronix Limited	1.059.056	0,25
694.000	Brilliance China Automotive Holdings Limited	388.571	0,09
715.000	China Overseas Property Holdings Limited	744.777	0,17
2.385.600	CSPC Pharmaceutical Group Limited	2.506.348	0,59
360.500	Kingboard Holdings Limited	1.147.788	0,27
796.000	Kunlun Energy Company Limited	568.065	0,13
143.500	NetDragon Websoft Inc	308.146	0,07
1.686.000	Shougang Fushan Resources Group Limited	537.882	0,13
805.000	Sino Biopharmaceutical Limited	471.348	0,11
		8.173.329	1,91
	Ungarn		
90.136	MOL Hungarian Oil & Gas plc	625.062	0,15
14.117	Richter Gedeon Nyrt	312.276	0,07
		937.338	0,22
	Indien		
54.500	Infosys Limited	981.545	0,23
	Indonesien		
1.545.400	Adaro Energy Indonesia Tbk PT	382.193	0,09
2.778.300	AKR Corporindo Tbk PT	249.855	0,06
1.140.600	Astra International Tbk PT	417.628	0,10
2.868.100	Bank Central Asia Tbk	1.575.221	0,36
5.101.800	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.618.943	0,38
37.300	Perusahaan Perkebunan London Sumatra Indonesia Tbk PT	2.432	0,00
		4.246.272	0,99
	Jersey		
31.744	WNS Holdings Limited	2.539.203	0,59
	Malaysia		
4.402.200	Bumi Armada Berhad	479.695	0,11
1.126.000	Public Bank Berhad	1.104.272	0,26
		1.583.967	0,37
	Mexiko		
9.389	Fomento Economico Mexicano SAB De CV	733.469	0,17
89.088	Vista Oil & Gas SAB De CV	1.395.118	0,33
		2.128.587	0,50
	Peru		
13.492	Credicorp Limited	1.830.325	0,43
	Katar		
78.220	Industries Qatar QSC	275.142	0,06
403.407	Cooredo QSC	1.019.110	0,24
182.358	Qatar National Bank SAQ	901.337	0,21
190.044	Qatar Navigation	529.676	0,12
		2.725.265	0,63
	Russland		
272.500	Gazprom OAO	-	0,00
2.581.611	Inter RAO UES	-	0,00
13.940	Rosneft OAO	-	0,00
1.409.600	Surgutneftegas OAO	-	0,00
369.819	Tatneft OAO	-	0,00
		-	0,00
	Saudi-Arabien		
94.645	Al Hammadi Development and Investment Company	1.009.916	0,24
89.886	Al Rajhi Bank	1.798.685	0,42
95.868	Alinma Bank	830.363	0,19
25.428	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Company	1.492.660	0,35
23.797	Ethad Etisalat Company	220.049	0,05
14.602	Sabic Agri-Nutrients Company	568.071	0,13
1	Saudi Arabian Oil Company	6	0,00
65.512	Saudi Basic Industries Corporation	1.558.481	0,36
12.427	Saudi Electricity Company	76.387	0,02
82.341	Saudi Industrial Services Company	444.790	0,10
163.541	Saudi International Petrochemical Company	1.477.439	0,35
30.511	The Saudi National Bank	410.007	0,10
		9.886.854	2,31
	Südafrika		
39.481	Absa Group Limited	449.919	0,10
15.971	African Rainbow Minerals Limited	270.329	0,06
11.842	Anglo American Platinum Limited	991.680	0,23
63.766	Exaro Resources Limited	814.398	0,19
395.140	FirstRand Limited	1.442.615	0,34
73.750	Impala Platinum Holdings Limited	923.836	0,22
35.340	Northam Platinum Holdings Limited	388.771	0,09
53.107	Standard Bank Group Limited	523.704	0,12
64.329	Thungela Resources Limited	1.083.782	0,25
39.373	Truworths International Limited	127.271	0,03
61.963	Woolworths Holdings Limited/South Africa	241.916	0,06
		7.258.221	1,69
	Südkorea		
24.338	BNK Financial Group Inc	125.106	0,03
2.966	Celltrion Inc	376.478	0,09
24.662	Cheil Worldwide Inc	449.553	0,11
107.168	Daeduck Electronics Company Limited	1.601.799	0,37
53.033	DGB Financial Group Inc	293.160	0,07
27.865	Dongbu Hannong Chemical Company Limited	818.651	0,19

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Aktienswaps (b) (Fortsetzung)			
Polen (continued)			
118.764	Powszechny Zakład Ubezpieczeń	19.862	0,01
		145.836	0,04
	Summe Aktienswaps	5.098.153	1,19
Staatsanleihen			
USA			
11.475.000	United States Treasury Bill 0 % 02.02.2023 #	11.439.070	2,67
12.335.000	United States Treasury Bill 0 % 02.03.2023 #	12.250.407	2,85
16.675.000	United States Treasury Bill 0 % 04.05.2023 #	16.426.577	3,83
18.950.000	United States Treasury Bill 0 % 16.03.2023 #	18.790.046	4,38
16.125.000	United States Treasury Bill 0 % 23.02.2023 #	16.028.535	3,74
12.000.000	United States Treasury Bill 0 % 26.01.2023 #	11.971.526	2,79
		86.906.161	20,26
	Summe Staatsanleihen	86.906.161	20,26
Vorzugsaktien			
Russland			
487	AK Transneft OAO	-	0,00
1.112.260	Sberbank of Russia PJSC	-	0,00
4.447.500	Surgutneftegas OJSC	-	0,00
130.031	Tatneft OAO	-	0,00
		-	0,00
	Summe Vorzugsaktien	-	0,00
Bezugsrechte			
Taiwan			
89.891	TAISHIN FINANCIAL HOLDING RTS	-	0,00
	Summe Bezugsrechte	-	0,00
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel		389.635.028	90,86

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens	
Nettvermögen	Beschreibung			
	Aktien swaps			
	Brasilien			
154.987	Camil Alimentos SA	(8.393)	(0,00)	
310.453	Cia Brasileira De Distribuicao	(85.451)	(0,02)	
1.325.580	Cia Energetica De Minas Gerais	(18.008)	(0,01)	
375.641	Cia Saneamento Minas Gerais	(4.496)	(0,00)	
11.000	Engie Brasil SA	(1.019)	(0,00)	
38.700	Kepler Weber SA	(2.470)	(0,00)	
190.500	Suzano SA	(26.430)	(0,01)	
118.300	WEG Industries	(10.020)	(0,00)	
		<u>(156.287)</u>	<u>(0,04)</u>	
	China			
395.721	Anhui Guangxin Agrochemical Company Limited	(60.397)	(0,02)	
49.200	Bear Electric Appliance Company	(1.433)	(0,00)	
251.040	China Railway Tielong Cont	(1.551)	(0,00)	
166.900	Fuyao Group Glass Industr	(10.673)	(0,00)	
77.300	Henan Shenhua Coal & Power	(11.448)	(0,00)	
528.600	Huaibei Mining Holdings Company	(32.433)	(0,01)	
429.375	Joincare Pharmaceutical Gr	(1.576)	(0,00)	
947.823	Meihua Holdings Group Company	(77.204)	(0,02)	
54.800	Nari Technology Company Limited	(2.903)	(0,00)	
171.000	Qianhe Condiment And Food	(4.772)	(0,00)	
125.900	Shanxi Luan Environmental	(14.080)	(0,00)	
127.500	Tongwei Company Limited	(23.091)	(0,01)	
269.200	Xian Longi Silicon Materia	(96.142)	(0,02)	
1	Zhejiang Orient Gene Biote	-	(0,00)	
		<u>(337.703)</u>	<u>(0,08)</u>	
	Indien			
643.090	Ashok Leyland Limited	(73.426)	(0,02)	
55.147	Asian Paints Limited	(293.755)	(0,07)	
10.315	Bajaj Auto Limited	(72.223)	(0,02)	
5.252	Bajaj Finance Limited	(74.042)	(0,02)	
5.499	Blue Dart Express Limited	(78.162)	(0,02)	
168.456	Cipla Limited	(137.497)	(0,03)	
164.018	DLF Limited	(85.975)	(0,02)	
20.856	Eicher Motors Limited	(34.338)	(0,01)	
26.849	Havells India Limited	(67.480)	(0,02)	
228.055	HCL Technologies Limited	(338.133)	(0,08)	
803.817	ITC Limited	(42.316)	(0,01)	
33.088	JK Paper Limited	(2.320)	(0,00)	
13.226	Kotak Mahindra Bank Limited	(3.009)	(0,00)	
9.238	Maruti Suzuki India Limited	(99.129)	(0,02)	
7.026	Polycab India Limited	(16.507)	(0,00)	
34.826	Polyplex Corporation Limited	(314.303)	(0,07)	
895.013	Power Grid Corporation of India Limited	(177.703)	(0,04)	
19.843	Siemens Limited	(9.336)	(0,00)	
44.956	Tata Chemicals Limited	(101.529)	(0,02)	
121.127	Tata Company Consultancy Services Limited	(358.510)	(0,08)	
49.739	UPI Limited	(26.176)	(0,01)	
		<u>(2.405.869)</u>	<u>(0,56)</u>	
	Kuwait			
1	KUWAIT INTERNATIONAL BANK EQS	-	(0,00)	
663.553	National Bank of Kuwait	(2.321)	(0,00)	
		<u>(2.321)</u>	<u>(0,00)</u>	
	Mexiko			
296.209	Asea Sab De CV	(535)	(0,00)	
341.448	Arca Continental Sab De CV	(72.061)	(0,02)	
110.300	Banco Del Bajio SA	(676)	(0,00)	
70.400	Gentera Sab De CV	(1.680)	(0,00)	
12.550	Grupo Aeroport Del Pacific	(6.079)	(0,00)	
22.814	Grupo Aeroport Del Sureste	(16.171)	(0,00)	
457.200	Grupo Financiero Banorte	(127.717)	(0,03)	
170.600	Orbia Advance Corporation Sab De CV	(4.232)	(0,00)	
771.740	Trust Fibra Uno	(33.600)	(0,01)	
		<u>(262.751)</u>	<u>(0,06)</u>	
	Polen			
823.406	Tauron Polska Energia SA	(702)	(0,00)	
	Summe Aktien swaps	<u>(3.165.633)</u>	<u>(0,74)</u>	
	Futures-Kontrakte			
	USA			
233	MSCI EMGMKT März 2023	(181.366)	(0,04)	
	Summe Futures-Kontrakte	<u>(181.366)</u>	<u>(0,04)</u>	
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel	<u>(3.346.999)</u>	<u>(0,78)</u>	
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel	389.635.028	90,86	
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel	(3.346.999)	(0,78)	
	Sonstiges Nettovermögen	42.534.618	9,92	
	Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	<u>428.822.647</u>	<u>100,00</u>	

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Neuwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens	Neuwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
Australien				Schweiz (Fortsetzung)			
34.893	Brambles Limited	285.609	1,34	324	Geberit AG	152.510	0,72
Kanada				918	Kuehne + Nagel International AG	213.525	1,00
4.100	Arc Resources Limited	55.223	0,26	603	Roche Holding AG	189.334	0,89
1.500	Canadian Tire Corporation Limited	156.648	0,74	574	Sonova Holding AG	136.055	0,64
2.700	Magna International Inc	151.564	0,71	1.700	TE Connectivity Limited	195.160	0,92
7.400	Open Text Corporation	219.114	1,03			1.303.094	6,13
4.400	Rogers Communications Inc	205.785	0,97	Vereinigtes Königreich			
4.600	Sun Life Financial Inc	213.373	1,00	29.285	Barratt Developments plc	139.780	0,66
1.200	The Toronto-Dominion Bank	77.644	0,37	9.580	Burberry Group plc	233.933	1,10
		1.079.351	5,08	940	Glaxosmithkline plc	16.255	0,08
Dänemark				3.310	Intertek Group plc	160.618	0,76
2.310	Novo Nordisk AS	310.968	1,46	33.800	Kingfisher plc	95.994	0,45
2.086	Pandora AS	146.125	0,69	10.070	Mondi plc	170.736	0,80
		457.093	2,15	167	Spirax-Sarco Engineering plc	21.324	0,10
Finnland						838.640	3,95
650	Neste OYJ	29.844	0,14	USA			
Frankreich				1.900	Abbott Laboratories	208.601	0,98
312	Kering	158.333	0,74	1.300	Abbvie Inc	210.093	0,99
2.230	Legrand SA	178.069	0,84	630	Adobe Systems Inc	212.014	1,00
1.161	Schneider Electric SE	161.972	0,76	1.800	Agilent Technologies Inc	269.370	1,27
		498.374	2,34	2.660	Alphabet Inc	234.692	1,10
Deutschland				1.000	Amgen Inc	262.640	1,23
500	Allianz SE	107.205	0,50	600	Analog Devices Inc	98.418	0,46
2.570	Brenntag AG	163.802	0,77	530	Anthem Inc	271.874	1,28
1.399	Covestro AG	54.572	0,26	2.000	Applied Materials Inc	194.760	0,92
3.590	Deutsche Post AG	134.790	0,63	1.000	Becton Dickinson and Company	254.300	1,20
5.350	Infineon Technologies AG	162.329	0,76	870	Biogen Inc	240.920	1,13
2.410	Knorr-Bremse AG	131.279	0,62	2.900	Bristol-Myers Squibb Company	208.655	0,98
2.291	SAP SE	235.680	1,11	1.500	Cadence Design Systems Inc	240.960	1,13
6.540	Siemens Energy AG	122.670	0,58	2.296	CBRE Group Inc	176.700	0,83
910	Symrise AG	98.722	0,46	1.070	Cigna Corporation	354.534	1,67
5.900	Telefonica Deutschland Holding AG	14.501	0,07	4.200	Cisco Systems Inc	200.088	0,94
		1.225.550	5,76	1.500	Citigroup Inc	67.845	0,32
Irland				3.100	Citizens Financial Group Inc	122.047	0,57
690	Accenture plc	184.120	0,87	1.360	Cummins Inc	329.514	1,55
2.500	Medtronic plc	194.300	0,91	600	Ecolab Inc	87.336	0,41
		378.420	1,78	1.700	Edwards Lifesciences Corporation	126.837	0,60
Italien				974	Electronic Arts Inc	119.003	0,56
19.400	Enel SpA	104.144	0,49	420	Gartner Inc	141.179	0,66
3.140	Moncler SpA	165.883	0,78	2.900	Hasbro Inc	176.929	0,83
		270.027	1,27	1.700	Hologic Inc	127.177	0,60
Japan				6.700	HP Inc	180.029	0,85
2.200	Advantest Corporation	141.392	0,67	567	Humana Inc	290.412	1,37
26.300	Asahi Kasei Corporation	187.645	0,88	5.500	Intel Corporation	145.365	0,68
7.600	Astellas Pharma Inc	115.574	0,54	440	Intuit Inc	171.257	0,81
1.600	Fujitsu Limited	213.604	1,00	1.900	Johnson & Johnson	335.635	1,58
1.400	NEC Corporation	49.180	0,23	1.300	Keysight Technologies Inc	222.391	1,05
1.200	Nitto Denko Corporation	69.574	0,33	460	Lam Research Corporation	193.338	0,91
8.600	Sekisui House Limited	152.094	0,72	630	Mastercard Inc	219.070	1,03
400	Tokyo Electron Limited	117.867	0,55	900	Merck & Company Inc	99.855	0,47
		1.046.930	4,92	110	Mettler-Toledo International Inc	159.000	0,75
Niederlande				2.900	Micron Technology Inc	144.942	0,68
2.420	Akzo Nobel NV	161.577	0,76	1.420	Microsoft Corporation	340.544	1,60
405	ASML Holding NV	217.761	1,02	2.600	Owens Corning	221.780	1,04
1.540	Koninklijke DSM NV	187.859	0,88	300	Paypal Holdings Inc	21.366	0,10
7.370	Koninklijke Philips NV	110.150	0,52	1.300	PPG Industries Inc	163.462	0,77
4.357	NN Group NV	177.444	0,84	1.600	Qorvo Inc	145.024	0,68
200	NXP Semiconductors NV	31.606	0,15	1.400	Qualcomm Inc	153.916	0,72
1.600	Shell plc	44.767	0,21	800	Salesforce.com Inc	106.072	0,50
490	Wolters Kluwer NV	51.124	0,24	300	Skyworks Solutions Inc	27.339	0,13
		982.288	4,62	700	Synchrony Financial	23.002	0,11
Neuseeland				1.200	Tetra Tech Inc	174.228	0,82
65.379	Meridian Energy Limited	216.669	1,02	1.600	Texas Instruments Inc	264.352	1,24
Norwegen				290	Thermo Fisher Scientific Inc	159.700	0,75
11.384	Aker BP ASA	351.424	1,65	1.300	Trane Technologies plc	218.517	1,03
8.400	Equinor ASA	299.982	1,41	1.100	Vmware Inc	135.036	0,63
24.000	Norsk Hydro ASA	178.630	0,84	700	Waters Corporation	239.806	1,13
		630.036	3,90	230	West Pharmaceutical Services Inc	54.131	0,25
Portugal				420	WW Grainger Inc	233.625	1,10
8.580	Galp Energia SGPS SA	115.470	0,54	2.100	Xylem Inc	232.197	1,09
Spanien				450	Zebra Technologies Corporation	115.385	0,54
5.840	Red Electrica Corporation SA	101.344	0,48			10.127.262	47,62
Schweden				Summe Aktien			
4.923	Boliden AB	184.858	0,87			20.377.328	95,82
9.810	SKF AB	149.840	0,70				
17.717	Tele2 AB	144.701	0,68				
19.150	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	111.928	0,53				
		591.327	2,78				
Schweiz							
6.620	ABB Limited	200.775	0,94				
9.090	Coca-Cola HBC AG	215.735	1,02				



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
1.245 EUR	1.319 USD	6. Januar 2023	1	10	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				10	0,00
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				20.377.338	95,82

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	Futures-Kontrakte USA		
2	MSCI EAFE März 2023	(3.595)	(0,02)
2	S&P500 EMINI FUT März 2023	(10.715)	(0,05)
		<u>(14.310)</u>	<u>(0,07)</u>
	Summe Futures-Kontrakte	<u>(14.310)</u>	<u>(0,07)</u>
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel	<u>(14.310)</u>	<u>(0,07)</u>
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel	20.377.338	95,82
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel	(14.310)	(0,07)
	Sonstiges Nettovermögen	903.550	4,25
	Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	<u>21.266.578</u>	<u>100,00</u>

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

- (a) Börsengehandelte Derivate
(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	95,17
Sonstiges Umlaufvermögen	4,83
	<u>100,00</u>

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
Staatsanleihen			
Brasilien			
83.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10 % 01.01.2023 *	157.204	0,19
13.400	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10 % 01.01.2025	2.425.875	2,89
1.690.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10 % 01.01.2031	279.246	0,33
		<u>2.862.325</u>	<u>3,41</u>
Chile			
2.095.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,5 % 01.03.2026	2.352.318	2,80
160.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 6 % 01.01.2043	208.152	0,25
		<u>2.560.470</u>	<u>3,05</u>
Tschechische Republik			
12.100.000	Czech Republic 1,20 % 13.03.2031	400.115	0,48
62.800.000	Czech Republic 1,25 % 14.02.2025	2.547.199	3,03
100.000.000	Czech Republic Government Bond 0,45 % 25.10.2023	4.213.061	5,01
24.770.000	Czech Republic Government Bond 0,95 % 15.05.2030	824.616	0,98
		<u>7.984.991</u>	<u>9,50</u>
Dominikanische Republik			
1.200.000	Dominican Republic 8 % 11.06.2028	17.889	0,02
Ungarn			
1.259.500.000	Hungary Government Bond 3 % 27.10.2027	2.439.031	2,90
Indonesien			
1.183.000.000	Indonesia Government 8,75 % 15.02.2044	86.144	0,10
20.911.000.000	Indonesia Treasury Bond 5,625 % 15.05.2023	1.345.631	1,60
29.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 7 % 15.05.2027	1.941.400	2,31
56.343.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25 % 15.05.2036	3.946.815	4,70
1.200.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375 % 15.03.2034	84.638	0,10
		<u>7.404.628</u>	<u>8,81</u>
Malaysia			
16.090.000	Malaysia Government 3,73 % 15.06.2028 #	3.610.662	4,30
10.260.000	Malaysia Government Bond 3,582 % 15.07.2032 #	2.246.486	2,67
		<u>5.857.148</u>	<u>6,97</u>
Mexiko			
444.667	Mexican Bonos 5,75 % 05.03.2026	2.063.635	2,45
214.740	Mexican Bonos 7,5 % 03.06.2027	1.038.589	1,24
701.429	Mexican Bonos 7,75 % 13.11.2042	3.149.497	3,75
514.000	Mexican Bonos 8 % 07.11.2047	2.356.550	2,80
		<u>8.608.271</u>	<u>10,24</u>
Peru			
4.150.000	Peruvian Government International Bond 6,9 % 12.08.2037 #	979.274	1,17
4.575.000	Peruvian Government International Bond 8,2 % 12.08.2026 #	1.256.454	1,49
		<u>2.235.728</u>	<u>2,66</u>
Polen			
30.010.000	Republic of Poland Government Bond 2,5 % 25.07.2026	5.912.714	7,03
Rumänien			
260.000	Romania Government Bond 4,75 % 11.10.2034	41.514	0,05
7.190.000	Romania Government Bond 5,8 % 26.07.2027	1.440.869	1,72
4.700.000	Romania Government Bond 5,85 % 26.04.2023	1.010.763	1,20
		<u>2.493.146</u>	<u>2,97</u>
Südafrika			
63.541.000	Republic of South Africa Government Bond 8,5 % 31.01.2037	2.964.911	3,53
38.680.000	South Africa Government Bond 6,5 % 28.02.2041	1.423.185	1,69
		<u>4.388.096</u>	<u>5,22</u>
Thailand			
11.400.000	Thailand Government Bond 2,125 % 17.12.2026 #	333.342	0,40
21.400.000	Thailand Government Bond 3,4 % 17.06.2036 #	642.315	0,76
		<u>975.657</u>	<u>1,16</u>
USA			
925.000	United States Treasury Bill 0 % 02.11.2023 #	890.318	1,06
3.840.000	United States Treasury Bill 0 % 05.10.2023 #	3.712.271	4,42
625.000	United States Treasury Bill 0 % 07.09.2023 #	606.571	0,72
2.200.000	United States Treasury Bill 0 % 08.10.2023 #	2.141.572	2,55
2.815.000	United States Treasury Bill 0 % 13.07.2023 #	2.749.118	3,27
560.000	United States Treasury Bill 0 % 15.06.2023 #	548.827	0,65
12.415.000	United States Treasury Bill 0 % 18.05.2023 #	12.206.512	14,52
3.810.000	United States Treasury Bill 0 % 20.04.2023 #	3.761.341	4,48
35.000	United States Treasury Bill 0 % 23.02.2023 #	34.791	0,04
200.000	United States Treasury Bill 0 % 23.03.2023 #	198.156	0,24
200.000	United States Treasury Bill 0 % 26.01.2023 #	199.525	0,24
530.000	United States Treasury Bill 0 % 30.11.2023 #	508.318	0,60
		<u>27.557.320</u>	<u>32,79</u>
	Summe Staatsanleihen	<u>81.297.414</u>	<u>96,73</u>

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
16.679.270 BRL	3.044.907 USD	4. April 2023	1	57.008	0,07
58.231.505 CNY	8.113.664 USD	9. Februar 2023	2	336.250	0,41
1.731.437 CZK	74.000 USD	3. April 2023	1	2.122	0,00
716 EUR	759 USD	6. Januar 2023	1	6	0,00
260.978 EUR	259.116 USD	11. Januar 2023	1	19.649	0,02
5 GBP	6 USD	6. Januar 2023	1	-	0,00
3.951.196.959 IDR	248.341 USD	7. März 2023	1	7.082	0,01
8.457.291 PHP	146.701 USD	17. März 2023	1	4.752	0,01
12.077.238 PLN	2.454.458 USD	7. März 2023	1	283.208	0,34
1.557.599 RON	306.136 USD	13. Februar 2023	1	28.974	0,03
5.621.349 SGD	4.118.902 USD	3. April 2023	2	79.093	0,09
264.823.764 THB	7.164.234 USD	13. Februar 2023	1	516.500	0,61
82.000 USD	1.594.076 MXN	7. März 2023	1	1.199	0,00
66.536.669 ZAR	3.867.413 USD	3. April 2023	1	12.051	0,01
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				1.347.894	1,60
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				82.645.308	98,33

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Zinsswaps		
	Brasilien		
	Receivable BRL 12,41 % Vs BRL CDI O/N 0BP 2.		
24.000.000	Januar 2025	(35.498)	(0,04)
	Receivable BRL 12,3125 % Vs BRL CDI O/N 0BP 2.		
5.000.000	Januar 2025	(9.190)	(0,01)
		(44.688)	(0,05)
	Summe Zinsswaps	(44.688)	(0,05)

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
791.907 BRL	149.000 USD	4. April 2023	1	(1.726)	(0,00)
3.789.172 GBP	4.598.460 USD	6. Januar 2023	1	(39.620)	(0,05)
5.356.207.200 IDR	348.000 USD	7. März 2023	1	(1.751)	(0,00)
9.499.394 PEN	2.498.000 USD	17. Januar 2023	1	(11.957)	(0,02)
3.107.150 USD	2.741.008.403 CLP	17. Januar 2023	2	(104.497)	(0,12)
3.370.329 USD	79.910.495 CZK	3. April 2023	1	(142.927)	(0,17)
33.000 USD	31.370 EUR	11. Januar 2023	1	(509)	(0,00)
94.978 USD	38.659.708 HUF	3. April 2023	1	(5.330)	(0,01)
1.665.000 USD	2.175.156.000 USD	17. Januar 2023	1	(64.091)	(0,08)
3.088.162 USD	62.275.080 MXN	7. März 2023	1	(68.475)	(0,08)
271.688 USD	1.059.854 PEN	17. Januar 2023	1	(5.682)	(0,01)
2.543.000 USD	11.888.418 PLN	7. März 2023	2	(151.864)	(0,18)
116.000 USD	547.171 RON	13. Februar 2023	1	(1.721)	(0,00)
323.000 USD	11.175.961 THB	13. Februar 2023	1	(1.138)	(0,00)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(601.288)	(0,72)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(645.976)	(0,77)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				82.645.308	98,33
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(645.976)	(0,77)
Sonstiges Nettovermögen				2.047.373	2,44
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				84.046.705	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei HSBC Bank Plc und The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben

Sonstiges Umlaufvermögen

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	52,01
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	1,57
Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben	42,79
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	0,18
Sonstiges Umlaufvermögen	3,45
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens	
	Unternehmensanleihen				Staatsanleihen (Fortsetzung)			
	Mexiko				Panama			
2.000.000	Petroleos Mexicanos 5,95 % 28.01.2031	1.517.000	4,37		Panama Government International Bond 3,16 %			
596.000	Petroleos Mexicanos 6,75 % 21.09.2047	381.071	1,09	700.000	23.01.2030	603.417	1,74	
400.000	Petroleos Mexicanos 6,875 % 04.08.2026 *	381.200	1,10		Panama Government International Bond 3,875 %			
		2.279.271	6,56	1.000.000	17.03.2028	945.605	2,72	
				500.000	Republic of Panama 2,25 % 29.09.2032	371.700	1,07	
						1.920.722	5,53	
	Summe Unternehmensanleihen	2.279.271	6,56		Paraguay			
	Staatsanleihen				Paraguay Government International Bond 4,7 %			
	Argentinien			350.000	27.03.2027	344.596	0,99	
1.532.000	Argentine Republic Government International Bond	418.236	1,20	200.000	Republic of Paraguay 2,74 % 29.01.2033	160.780	0,47	
	0,125 % 09.07.2030					505.376	1,46	
1.300.000	Republic of Argentina 0,13 % 09.07.2046	335.796	0,97		Peru			
217.770	Republic of Argentina 1 % 09.07.2029	58.253	0,17		Peruvian Government International Bond 2,844 %			
		812.285	2,34	740.000	20.06.2030	627.596	1,81	
				950.000	Republic of Peru 2,78 % 23.01.2031	788.006	2,27	
	Bolivien					1.415.602	4,08	
200.000	Bolivian Government International Bond 4,5 %	161.532	0,46		Philippinen			
	20.03.2028				Philippine Government International Bond 3 %			
	Brasilien			1.200.000	01.02.2028	1.123.500	3,24	
700.000	Brazilian Government International Bond 5 %	519.914	1,50		Philippine Government International Bond 3,95 %			
	27.01.2045			200.000	20.01.2040	171.500	0,49	
	Chile					1.295.000	3,73	
1.500.000	Chile Government International Bond 3,24 % 06.02.2028	1.393.736	4,02		Katar			
500.000	Republic of Chile 2,55 % 27.01.2032	410.491	1,18	600.000	Qatar Government International Bond 4 % 14.03.2029	590.902	1,70	
		1.804.227	5,20		Qatar Government International Bond 4,625 %			
	Elfenbeinküste			200.000	02.06.2046	189.246	0,54	
500.000	Ivory Coast Government International Bond 6,375 %	488.125	1,41	400.000	State of Qatar 3,75 % 16.04.2030	387.842	1,12	
	03.03.2028					1.167.990	3,36	
	Dominikanische Republik				Rumänien			
490.000	Dominican Republic 4,88 % 23.09.2032	407.359	1,17		Romanian Government International Bond			
450.000	Dominican Republic International Bond 4,5 %	383.698	1,11	750.000	3 % 14.02.2031	593.147	1,71	
	30.01.2030				Saudi-Arabien			
200.000	Dominican Republic International Bond 6,85 %	173.845	0,50	200.000	Saudi Government International Bond 3,75 %	157.786	0,46	
	27.01.2045	964.902	2,78		21.01.2055			
	Ecuador			800.000	Saudi Government International Bond 4,00 %	792.000	2,28	
600.000	Ecuador Government International Bond 0 %	235.474	0,68		17.04.2025			
	31.07.2030			400.000	Saudi Government International Bond 4,625 %	358.248	1,03	
200.000	Ecuador Government International Bond 0,5 %	82.025	0,23		04.10.2047	1.308.034	3,77	
	31.07.2040	317.499	0,91		Südafrika			
	Ägypten			200.000	Republic of South Africa Government International Bond			
900.000	Egypt Government International Bond 7,052 %	660.330	1,90		5,65 % 27.09.2047	149.000	0,43	
	15.01.2032			580.000	South Africa Government International Bond 4,3 %			
	Ghana				12.10.2028	518.777	1,49	
500.000	Ghana Government International Bond 8,625 %	182.566	0,53			667.777	1,92	
	07.04.2034				Sri Lanka			
	Ungarn			400.000	Sri Lanka Government International Bond 7,55 %	122.020	0,35	
400.000	Ungarn 2,13 % 22.09.2031	296.601	0,86		28.03.2030			
400.000	Ungarn 5,25 % 16.06.2029	383.193	1,10		Ukraine			
		679.794	1,96	500.000	Ukraine Government International Bond 6,876 %	98.590	0,28	
	Indonesien				21.05.2029			
650.000	Indonesia 2,85 % 14.02.2030	583.741	1,68		Vereinigte Arabische Emirate			
1.850.000	Indonesia Government International Bond 2,95 %	1.847.780	5,32	500.000	Abu Dhabi Government International Bond 1,70 %	414.395	1,19	
	11.01.2023 *				02.03.2031			
600.000	Indonesia Government International Bond 3,5 %	570.790	1,65	550.000	Abu Dhabi Government International Bond 2,5 %	494.046	1,42	
	11.01.2028				30.09.2029			
500.000	Indonesia Government International Bond 4,625 %	458.750	1,32	1.300.000	Abu Dhabi Government International Bond 3,125 %	1.243.937	3,58	
	15.04.2043				11.10.2027			
400.000	Indonesia Government International Bond 4,75 %	365.500	1,05	300.000	Abu Dhabi Government International Bond 4,125 %	265.243	0,77	
	18.07.2047	3.826.561	11,02	200.000	Abu Dhabi Government INTL 1,63 % 02.06.2028	175.856	0,51	
	Kenia					2.593.477	7,47	
200.000	Kenya Government International Bond 8 % 22.05.2032	172.500	0,50		USA			
	Libanon			1.805.000	United States Treasury Bill 0 % 02.11.2023 #	1.737.322	5,00	
600.000	Lebanon Government International Bond 6,75 %	36.788	0,11		05.10.2023 #	913.567	2,63	
	29.11.2027			1.400.000	United States Treasury Bill 0 % 07.09.2023 #	1.358.720	3,91	
	Mexiko				55.000	United States Treasury Bill 0 % 13.07.2023 #	53.713	0,16
400.000	Mexico Government International Bond 3,25 %	348.952	1,00		45.000	United States Treasury Bill 0 % 26.01.2023 #	44.893	0,13
	16.04.2030			2.375.000	United States Treasury Bill 0 % 30.11.2023 #	2.277.841	6,56	
400.000	Mexico Government International Bond 4,35 %	300.864	0,87			6.386.056	18,39	
	15.01.2047				Uruguay			
1.120.000	Mexico Government International Bond 4,6 %	873.580	2,51	200.000	Uruguay Government International Bond 4,375 %	199.600	0,57	
	23.01.2046				23.01.2031			
200.000	Mexico Government International Bond 4,75 %	161.874	0,47		Summe Staatsanleihen	31.634.844	91,11	
	08.03.2044	1.685.270	4,85					
	Oman							
900.000	Oman Government International Bond 6 % 01.08.2029	904.160	2,60					
	Pakistan							
400.000	Pakistan Government International Bond 7,375 %	145.000	0,42					
	08.04.2031							

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
8.372.138 EUR	8.869.642 USD	6. Januar 2023	2	69.972	0,20
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				69.972	0,20
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				33.984.087	97,87

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022 (Fortsetzung) Man GLG Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
89.474 USD	83.963 EUR	6. Januar 2023	2	(180)	(0,00)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(180)	(0,00)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(180)	(0,00)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				33.984.087	97,87
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(180)	(0,00)
Sonstiges Nettovermögen				738.627	2,13
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				34.722.534	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben

Sonstiges Umlaufvermögen

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	73,35
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	0,20
Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben	18,24
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	5,28
Sonstiges Umlaufvermögen	2,93
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Pan-European Equity Growth



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettöver- mögens
Aktien			
Dänemark			
106.622	CHR Hansen Holding AS	7.164.588	3,51
154.025	Novo Nordisk AS	19.428.045	9,51
		<u>26.592.633</u>	<u>13,02</u>
Frankreich			
46.566	EssilorLuxottica	7.878.967	3,86
1.698	Hermes International	2.453.610	1,20
47.633	L'Oreal SA	15.890.369	7,78
24.288	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	16.513.411	8,08
17.580	Remy Cointreau SA	2.770.608	1,35
		<u>45.506.965</u>	<u>22,27</u>
Deutschland			
146.047	Delivery Hero SE	6.539.985	3,20
131.146	Puma SE	7.435.978	3,64
3.667	Rational AG	2.035.185	0,99
86.012	SAP SE	8.290.697	4,06
		<u>24.301.845</u>	<u>11,89</u>
Irland			
60.183	Kingspan Group plc	3.044.056	1,49
725.984	Ryanair Holdings plc	8.864.265	4,34
		<u>11.908.321</u>	<u>5,83</u>
Italien			
45.190	Ferrari NV	9.047.038	4,43
185.506	Moncler SpA	9.182.547	4,49
		<u>18.229.585</u>	<u>8,92</u>
Niederlande			
5.350	Adyen NV	6.892.940	3,38
17.087	ASML Holding NV	8.608.430	4,21
		<u>15.501.370</u>	<u>7,59</u>
Schweden			
105.182	Assa AB loy AB	2.115.896	1,03
265.474	Vitrolife AB	4.445.173	2,18
		<u>6.561.069</u>	<u>3,21</u>
Schweiz			
53.050	Logitech International SA	3.065.599	1,50
121.225	Nestle SA	13.153.622	6,44
3.442	Partners Group Holding AG	2.847.245	1,39
15.522	Roche Holding AG	4.566.590	2,24
		<u>23.632.956</u>	<u>11,57</u>
Vereinigtes Königreich			
718.757	Abcam plc-Spon	10.479.137	5,13
60.023	AstraZeneca plc	7.589.209	3,71
2.042.481	Dr. Martens plc	4.387.774	2,15
310.910	Patisserie Holdings plc ^	-	0,00
677.997	The Watches of Switzerland Group plc	6.270.031	3,07
		<u>28.726.151</u>	<u>14,06</u>
	Summe Aktien	<u>200.960.895</u>	<u>98,36</u>

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Pan-European Equity Growth (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
1.265.000 EUR	1.245.415 CHF	12. Januar 2023	2	3.057	0,00
1.096.110 EUR	953.213 GBP	12. Januar 2023	2	22.345	0,01
270.926 EUR	2.954.550 SEK	12. Januar 2023	1	5.271	0,00
99.701 EUR	105.402 USD	12. Januar 2023	2	1.032	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				31.705	0,01
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				200.992.600	98,37

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
9.788.877 CHF	9.934.868 EUR	12. Januar 2023	2	(16.087)	(0,01)
473.306 EUR	467.154 CHF	12. Januar 2023	2	(46)	(0,00)
17.491.910 EUR	130.138.328 DKK	12. Januar 2023	4	(10.092)	(0,00)
18.640.003 GBP	21.692.126 EUR	12. Januar 2023	3	(694.722)	(0,34)
29.906.280 NOK	2.848.461 EUR	12. Januar 2023	1	(4.947)	(0,00)
51.866.886 SEK	4.770.108 EUR	12. Januar 2023	2	(106.565)	(0,06)
569.840 USD	535.000 EUR	12. Januar 2023	1	(1.558)	(0,00)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(834.017)	(0,41)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(834.017)	(0,41)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				200.992.600	98,37
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(834.017)	(0,41)
Sonstiges Nettovermögen				4.159.235	2,04
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				204.317.818	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

^ Das Wertpapier wurde im Oktober 2018 ausgesetzt, nachdem eine wesentliche Falschdarstellung in der Bilanzierung aufgrund von betrügerischen Aktivitäten entdeckt wurde. Der unabhängige Preisausschuss hat sich im Januar 2019 darauf geeinigt, den Wert auf Null zu setzen.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Sonstiges Umlaufvermögen

% des Gesamtvermögens

97,74

0,02

2,24

100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Aktien			
Dänemark			
2.067	CHR Hansen Holding AS	148.235	2,53
3.721	Novo Nordisk AS	500.915	8,53
		<u>649.150</u>	<u>11,06</u>
Frankreich			
1.189	EssilorLuxottica	214.708	3,66
947	L'Oreal SA	337.165	5,74
358	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	259.773	4,43
400	Schneider Electric SE	55.804	0,95
		<u>867.450</u>	<u>14,78</u>
Deutschland			
3.921	Delivery Hero SE	187.390	3,19
3.133	SAP SE	322.299	5,49
		<u>509.689</u>	<u>8,68</u>
Irland			
2.590	Kingspan Group plc	139.812	2,38
Italien			
2.972	Moncler SpA	157.007	2,67
Niederlande			
106	Adyen NV	145.755	2,48
504	ASML Holding NV	270.991	4,62
		<u>416.746</u>	<u>7,10</u>
Schweden			
4.924	Vitrolife AB	87.994	1,50
Schweiz			
2.715	Nestle SA	314.402	5,36
398	Sika AG	95.370	1,62
		<u>409.772</u>	<u>6,98</u>
Vereinigtes Königreich			
15.407	Abcam plc-Spon	239.733	4,08
1.922	AstraZeneca plc	259.357	4,42
		<u>499.090</u>	<u>8,50</u>
USA			
385	Adobe Systems Inc	129.564	2,21
824	ANSYS Inc	199.070	3,39
195	Cooper Companies Inc	64.481	1,10
1.343	Edwards Lifesciences Corporation	100.201	1,71
335	IDEXX Laboratories Inc	136.667	2,33
1.071	Microsoft Corporation	256.847	4,37
912	Nike Inc	106.713	1,82
753	S&P Global Inc	252.210	4,29
213	Thermo Fisher Scientific Inc	117.297	2,00
1.655	Visa Inc	343.843	5,86
1.085	Zoetis Inc	159.007	2,71
		<u>1.865.900</u>	<u>31,79</u>
	Summe Aktien	<u>5.602.610</u>	<u>95,44</u>

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
205.921 AUD	139.531 USD	12. Januar 2023	1	190	0,00
10.685.084 BRL	2.005.918 USD	6. Januar 2023	1	14.749	0,25
273.655 CAD	201.007 USD	12. Januar 2023	1	972	0,02
15.730 CHF	17.000 USD	12. Januar 2023	1	26	0,00
795.246 DKK	113.143 USD	12. Januar 2023	2	1.106	0,02
417.571 EUR	442.527 USD	12. Januar 2023	5	3.535	0,06
71 JPY	6 NOK	10. Januar 2023	3	-	0,00
47.797.569 JPY	348.611 USD	12. Januar 2023	1	14.281	0,24
1 NOK	0 AUD	10. Januar 2023	1	-	0,00
3 NOK	0 CAD	10. Januar 2023	2	-	0,00
81 NOK	7 CHF	10. Januar 2023	2	-	0,00
250 NOK	23 EUR	10. Januar 2023	3	-	0,00
120 NOK	10 EUR	10. Januar 2023	3	-	0,00
5 NOK	67 JPY	10. Januar 2023	2	-	0,00
28 NOK	28 SEK	10. Januar 2023	2	-	0,00
1.952 NOK	197 USD	10. Januar 2023	3	2	0,00
44.803 SGD	33.076 USD	12. Januar 2023	1	339	0,01
24.128 USD	125.485 BRL	6. Januar 2023	1	397	0,01
266.605 USD	217.031 GBP	12. Januar 2023	2	5.446	0,09
2 USD	19 NOK	10. Januar 2023	1	-	0,00
40.130 USD	417.532 SEK	12. Januar 2023	2	27	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				41.070	0,70
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				5.643.680	96,14

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI Global Sustainable Growth (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
405.026 BRL	78.040 USD	6. Januar 2023	2	(1.445)	(0,02)
359.038 HKD	46.122 USD	12. Januar 2023	1	(105)	(0,00)
61 NOK	9 AUD	10. Januar 2023	2	-	(0,00)
98 NOK	14 CAD	10. Januar 2023	1	-	(0,00)
1 NOK	0 CHF	10. Januar 2023	1	-	(0,00)
167 NOK	2.295 JPY	10. Januar 2023	1	(1)	(0,00)
132.583 SEK	12.865 USD	12. Januar 2023	1	(130)	(0,00)
259.758 USD	242.518 CHF	12. Januar 2023	1	(2.745)	(0,05)
698.499 USD	4.920.825 DKK	12. Januar 2023	4	(8.446)	(0,15)
2.025.960 USD	1.918.244 EUR	12. Januar 2023	4	(23.169)	(0,39)
4 USD	40 NOK	10. Januar 2023	2	-	(0,00)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(36.041)	(0,61)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(36.041)	(0,61)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				5.643.680	96,14
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(36.041)	(0,61)
Sonstiges Nettovermögen				262.570	4,47
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				5.870.209	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Sonstiges Umlaufvermögen

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	92,94
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	0,68
Sonstiges Umlaufvermögen	6,38
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettöver- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettöver- mögens
	Aktien				Aktien (Fortsetzung)		
	Österreich				Schweden (Fortsetzung)		
2.150	Ormv AG	103.415	0,34	8.200	Nibe Industrier AB Klasse B	71.601	0,23
2.739	Raiffeisen Bank International AG	42.044	0,13	16.390	Sandvik AB	277.681	0,91
		145.459	0,47	16.720	SKF AB	239.293	0,78
	Belgien			22.570	Swedish Orphan Biovitrum AB	437.793	1,43
4.990	KBC Groep NV	299.799	0,98	22.130	Tele2 AB	169.355	0,55
12.360	Umicore SA	424.195	1,38	45.620	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	249.839	0,81
		723.994	2,36	106.700	Telia Company AB	255.806	0,83
	Dänemark			16.310	Volvo AB	276.443	0,90
2.840	CHR Hansen Holding AS	190.837	0,62			3.657.451	11,93
3.137	Coloplast AS	342.535	1,12		Schweiz		
5.649	Novo Nordisk AS	712.540	2,33	14.440	ABB Limited	410.349	1,34
4.121	Pandora AS	270.487	0,88	3.240	Cie Financiere Richemont SA	393.425	1,28
		1.516.399	4,95	18.006	Coca-Cola HBC AG	400.413	1,31
	Finnland			785	Geberit AG	346.223	1,13
19.490	Kesko OYJ	401.884	1,31	72	Givaudan SA	206.575	0,67
11.300	Neste OYJ	486.126	1,58	1.832	Kuehne + Nagel International AG	399.269	1,30
85.600	Nokia OYJ	370.391	1,21	5.810	Novartis International AG	491.845	1,61
42.000	Wartsila OYJ ABP	330.456	1,08	1.490	Roche Holding AG	438.360	1,43
		1.588.857	5,18	141	SGS SA	307.012	1,00
	Frankreich			1.313	Sika AG	294.801	0,96
2.843	Biomerieux	278.387	0,91	994	Sonova Holding AG	220.761	0,72
5.620	Dassault Systemes SE	188.242	0,62	10.600	STMicroelectronics NV	349.747	1,14
28	Hermes International	40.460	0,13	5.070	Swiss Re AG	444.040	1,45
775	Kering	368.512	1,20	878	Swisscom AG	450.462	1,47
5.300	Legrand SA	396.546	1,30	518	Zurich Insurance Group AG	232.030	0,76
1.186	L'Oreal SA	395.650	1,29			5.385.312	17,57
4.370	Sanofi	392.601	1,28		Vereinigtes Königreich		
3.028	Schneider Electric SE	395.820	1,29	2.100	AstraZeneca plc	265.521	0,87
5.229	Total Energies SE	306.681	1,00	82.149	Barratt Developments plc	367.398	1,20
13.990	Valeo SA	233.633	0,76	51.000	BP plc	272.983	0,89
		2.996.532	9,78	19.490	Burberry Group plc	445.935	1,45
	Deutschland			6.370	Compass Group plc	137.670	0,45
1.699	Adidas AG	216.555	0,71	2.530	Diageo plc	104.082	0,34
800	Bayer AG	38.660	0,13	24.272	Glaxosmithkline plc	393.285	1,28
11.190	Deutsche Post AG	393.664	1,28	20.540	Haleon plc	75.784	0,25
27.380	E.ON SE	255.565	0,83	5.390	Intertek Group plc	245.069	0,80
14.920	Infineon Technologies AG	424.176	1,38	16.810	Johnson Matthey plc	402.994	1,31
3.800	Knorr-Bremse AG	193.952	0,63	10.249	Kingfisher plc	27.274	0,09
2.267	Merck KGaA	410.100	1,34	5.237	Mondi plc	83.198	0,27
4.722	SAP SE	455.154	1,48	17.120	Ralph plc	441.492	1,44
3.805	Siemens AG	493.280	1,61	400	Rio Tinto plc	26.140	0,09
5.880	Siemens Energy AG	103.341	0,34	2.688	Spirax-Sarco Engineering plc	321.597	1,05
1.378	Symrise AG	140.074	0,46			3.610.422	11,78
164.500	Telefonica Deutschland Holding AG	378.843	1,24		Summe Aktien	29.443.872	96,06
		3.503.364	11,43				
	Irland						
12.320	Experian plc	390.610	1,27				
	Italien						
66.300	Enel SpA	333.489	1,09				
8.080	Moncler SpA	399.960	1,30				
		733.449	2,39				
	Niederlande						
4.316	Akzo Nobel NV	270.009	0,88				
912	ASML Holding NV	459.466	1,50				
2.731	Koninklijke DSM NV	312.153	1,02				
15.930	Koninklijke Philips NV	223.084	0,73				
2.542	NN Group NV	97.003	0,32				
3.870	Wolters Kluwer NV	378.331	1,23				
		1.740.046	5,68				
	Norwegen						
13.596	Aker BP ASA	393.261	1,28				
14.625	Equinor ASA	489.379	1,60				
6.030	Nordic Semiconductor ASA	94.005	0,31				
41.300	Norsk Hydro ASA	288.022	0,94				
59.135	Orkla ASA	399.015	1,30				
37.527	Telenor ASA	326.959	1,07				
		1.990.641	6,50				
	Portugal						
38.590	Galp Energia SGPS SA	486.620	1,59				
20.830	Jeronimo Martins SGPS SA	420.349	1,37				
		906.969	2,96				
	Spanien						
19.050	Industria De Diseno Textil SA	473.392	1,55				
4.980	Red Electrica Corporation SA	80.975	0,26				
		554.367	1,81				
	Schweden						
10.070	Alfa Laval AB	272.664	0,89				
3.472	Alleima AB	11.996	0,04				
22.380	Atlas Copco AB Klasse A	247.745	0,81				
12.580	Axfood AB	323.431	1,06				
10.980	Boliden AB	386.317	1,26				
11.600	Getinge AB	225.632	0,74				
11.160	Indutrade AB	211.855	0,69				



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
23.167 EUR	20.433 GBP	6. Januar 2023	1	144	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				144	0,00
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				29.444.016	96,06

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettöver- mögens
	Futures-Kontrakte Deutschland		
27	MSCI Europe März 2023	(21.681)	(0,07)
	Summe Futures-Kontrakte	(21.681)	(0,07)

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
1.782.318 GBP	2.042.355 EUR	6. Januar 2023	2	(34.128)	(0,11)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(34.128)	(0,11)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(55.809)	(0,18)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				29.444.016	96,06
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(55.809)	(0,18)
Sonstiges Nettovermögen				1.262.617	4,12
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				30.650.824	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

Sonstiges Umlaufvermögen

% des Gesamtvermögens

95,16

4,84

100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable European Income



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettover- mögens
Aktien			
Kanada			
55.000	Lundin Mining Corporation	316.343	1,21
Dänemark			
5.000	Novo Nordisk AS	630.678	2,42
27.000	Tryg AS	600.348	2,30
		1.231.026	4,72
Finnland			
30.000	Fortum OYJ	466.200	1,79
17.500	Kone OYJ	845.250	3,24
		1.311.450	5,03
Frankreich			
6.512	Air Liquide SA	862.189	3,30
25.000	Cie De Saint-Gobain	1.141.250	4,38
15.000	Imerys SA	545.100	2,09
1.200	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	815.880	3,13
50.000	Rubis SCA	1.230.000	4,72
3.650	Teleperformance	812.855	3,12
12.250	Total Energies SE	718.462	2,75
10.500	Vinci SA	979.545	3,76
		7.105.281	27,25
Deutschland			
5.500	Allianz SE	1.104.950	4,24
2.000	Deutsche Börse AG	322.800	1,24
20.000	Deutsche Post AG	703.600	2,70
55.000	Vonovia SE	1.211.100	4,64
		3.342.450	12,82
Italien			
187.900	Enel SpA	945.137	3,62
350.000	Intesa Sanpaolo SpA	727.300	2,79
		1.672.437	6,41
Niederlande			
57.500	Koninklijke Vopak NV	1.595.625	6,12
Norwegen			
10.000	Aker BP ASA	289.248	1,11
Spanien			
22.500	Amadeus IT Group SA	1.092.375	4,19
52.500	Iberdrola SA	573.825	2,20
		1.666.200	6,39
Schweiz			
10.000	Nestle SA	1.085.050	4,16
2.750	Roche Holding AG	809.053	3,10
300	SGS SA	653.218	2,51
35.000	SIG Combibloc Group AG	716.008	2,75
		3.263.329	12,52
Vereinigtes Königreich			
12.500	Anglo American Plc	455.983	1,75
25.000	Diageo plc	1.028.481	3,94
150.000	EasyJet Plc	548.786	2,11
60.124	Smith & Nephew Plc	751.863	2,88
400.000	SSP Group Plc	1.032.426	3,96
		3.817.539	14,64
Summe Aktien		25.610.928	98,22
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel		25.610.928	98,22
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel		25.610.928	98,22
Sonstiges Nettovermögen		463.720	1,78
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen		26.074.648	100,00

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	97,79
Sonstiges Umlaufvermögen	2,21
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Aktien				Aktien (Fortsetzung)		
	China				China (Fortsetzung)		
1.611	Advanced Micro Fabrication	22.713	0,12	3.300	Jiangsu Pacific Quartz Company Limited *	62.338	0,34
7.500	Aima Technology Group Company Limited	49.488	0,27	5.000	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Company Limited	115.439	0,62
102.600	Anhui Expressway Company Limited	107.888	0,58	1.700	Jiangsu Yangnong Chemical Company Limited	25.408	0,14
23.360	Anhui Guangxin Agrochemical Company Limited	98.794	0,53		Jiangsu Zhanjiangang Rural Commercial Bank Company Limited		
1.200	Anhui Gujing Distillery Company Limited	46.072	0,25	71.400	Limited	47.349	0,25
	Anhui Hengyuan Coal Industry And Electricity Power Company Limited	26.882	0,14	18.900	Jiangsu Zhongtian Technology Company Limited	43.908	0,24
14.100	Anhui Jinhe Industrial Company Limited	65.919	0,35	13.980	Jiangxi Ganfeng Lithium Company Limited	139.786	0,75
476	Anji Microelectronics Tech - Klasse A	12.325	0,07	42.000	Jiangzhong Pharmaceutical Company Limited	87.302	0,47
	Asynchem Laboratories Tianjin Company Limited	21.290	0,11	51.600	Jizhong Energy Resources Company Limited	47.208	0,25
30.700	Avary Holding Shenzhen Company Limited *	121.180	0,65	80.428	Joincare Pharmaceutical Group Industry Company Limited	130.620	0,70
84.954	Bank Of Changsha Company Limited	82.611	0,44		Jonjee High-Tech Industrial And Commercial Holding Company Limited		
9.300	Bank of Chengdu Company Limited	20.468	0,11	3.000	Company Limited	15.911	0,09
47.600	Bank of Hangzhou Company Limited	89.562	0,48	4.409	Kweichow Moutai Company Limited	1.095.321	5,88
245.600	Bank of Jiangsu Company Limited	257.552	1,38	17.400	Lepu Medical Technology Company Limited	57.494	0,31
45.224	Bank of Nanjing Company Limited	67.787	0,36	38.300	Lier Chemical Company Limited	98.950	0,53
3.000	Bear Electric Appliance Company - Klasse A	26.031	0,14	7.500	Lizvon Pharmaceutical Group Inc	35.042	0,19
306	Beijing Kingsoft Office So - Klasse A	11.718	0,06	43.772	Luxshare Precision Industry Company Limited	199.917	1,07
3.500	Beijing United Information Technology Company Limited	44.527	0,24	8.091	Luzhou Laojiao Company Limited	261.037	1,40
	Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Company Limited			165.800	Materials Industry Zhongda Group Company Limited	114.720	0,62
2.625	Limited	47.843	0,26	10.500	Mayinglong Pharmaceutical Group Company Limited	34.136	0,18
6.900	BYD Company Limited	255.059	1,37	62.727	Meihua Holdings Group Company Limited	91.857	0,49
	Changchun Faway Automobile Components Company Limited			22.278	Muyuan Foodstuff Company Limited	156.228	0,84
44.983	Limited	54.096	0,29	22.900	NARI Technology Company Limited	80.377	0,43
4.300	Changchun High & New Technology Industries Inc	102.958	0,55	2.900	NAURA Technology Group Company Limited	93.987	0,51
41.000	Chengdu Hongqi Chain Company Limited	33.205	0,18	1.500	Ningbo Deye Technology Company Limited	71.465	0,38
32.400	China Coal Energy Company Limited	40.176	0,22	18.000	Ningbo Huaxiang Electronic Company Limited	35.991	0,19
64.530	China COSCO Holdings Company Limited	95.518	0,51	12.400	Ningbo Joyson Electronic Corporation	25.062	0,13
85.400	China Galaxy Securities Company Limited	114.125	0,61	3.800	Ningbo Tuopu Group Company Limited	32.022	0,17
75.950	China International Marine Containers Company Limited	76.915	0,41	144.900	Offshore Oil Engineering Company Limited	126.314	0,68
78.700	China Merchants Bank Company Limited	421.819	2,27	108.600	People's Insurance Company Group of China Limited	81.547	0,44
71.700	China Molybdenum Company Limited	46.929	0,25	8.200	Perfect World Company Limited/China	15.004	0,08
16.700	China National Accord Medicines Corporation Limited	79.011	0,42	219.766	PetroChina Company Limited	157.118	0,84
28.700	China Oilfield Services Limited	68.450	0,37	116.200	Ping An Bank Company Limited	219.974	1,18
25.200	China Pacific Insurance Group Company Limited	88.885	0,48	65.200	Ping an Insurance Group Company of China Limited	440.813	2,37
	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Company Limited			3.800	Proya Cosmetics Company Limited	91.549	0,49
7.100	Limited	47.809	0,26	1.467	Pylon Technologies Company Limited	66.611	0,36
24.400	China Shenhua Energy Company Limited	96.944	0,52	11.350	Qianhe Condiment And Food Company Limited	31.797	0,16
	China State Construction Engineering Corporation Limited			3.600	Qiaqia Food Company Limited	25.893	0,14
88.300	Limited	68.971	0,37	28.400	Qingdao Haier Company Limited	99.927	0,54
7.400	China Tourism Group Duty Free	229.961	1,24	13.300	Qinghai Salt Lake Industry Company Limited	43.411	0,23
28.400	China Vanke Company Limited	74.353	0,40	28.500	Risesun Real Estate Development Company Limited	8.896	0,05
54.653	China Yangtze Power Company Limited	165.098	0,89	16.677	Sansure Biotech Inc	52.658	0,28
	China Zhenhua Group Science & Technology Company Limited			17.500	SF Holding Company Limited	145.403	0,78
1.000	Limited	16.432	0,09	64.400	Shaanxi Coal Industry Company Limited	172.124	0,92
3.600	Chongqing Brewery Company	65.965	0,35	10.400	Shandong Buchang Pharmaceuticals Company Limited	31.432	0,17
	Chongqing Zongshen Power Machinery Company Limited				Shandong Himile Mechanical Science & Technology Company Limited		
85.600	Limited	73.142	0,39	17.500	Company Limited	58.277	0,31
55.805	CITIC Securities Company Limited	159.828	0,86	159.200	Shandong Nanshan Aluminum Company Limited	74.886	0,40
8.500	Contemporary Amperex Technology Company Limited	481.044	2,58		Shandong Shanda Wit Science & Tech Company Limited		
37.100	CTS International Logistics Corporation Limited	57.318	0,31	11.600	Limited	75.924	0,41
7.080	Da An Gene Company Limited of Sun Yat-Sen University	15.847	0,09	14.300	Shanghai Aiko Solar Energy Company Limited *	77.798	0,42
70.100	Daqin Railway Company Limited	67.360	0,36		Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Company Limited		
18.900	Dong E E. Jiao Company Limited	110.654	0,59	3.400	Limited	17.235	0,09
10.400	Enn Natural Gas Company Limited	24.086	0,13		Shanghai Fudan Microelectronics Group Company Limited		
19.000	First Tractor Company Limited	30.885	0,17	4.486	Limited	45.049	0,24
43.500	Foxconn Industrial Internet Company Limited	57.443	0,31	7.200	Shanghai Hanbell Precise -A	24.805	0,13
26.700	Fuyao Glass Industry Group Company Limited	134.696	0,72		Shanghai Jinjiang International Hotels Development Company Limited		
160.600	Gd Power Development Company Limited	98.647	0,53	10.100	Company Limited	84.776	0,46
25.000	Gemdale Corporation	36.790	0,20	3.300	Shanghai Maling Aquarius Company Limited	3.774	0,02
2.700	Ginlong Technologies Company Limited	69.930	0,38	35.400	Shanghai Pudong Development Bank Company Limited	37.072	0,20
52.000	Greentown Holdings Limited	23.413	0,13	126.189	Shanghai Rural Commercial Bank Company Limited	106.735	0,57
17.900	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	83.221	0,45	21.800	Shanghai Tunnel Engineering Company Limited	16.526	0,09
41.000	Guanghui Energy Company Limited	53.198	0,29		Shanxi Lu'An Environmental Energy Development Company Limited		
16.600	Guangzhou Restaurant Group Company Limited	61.656	0,33	39.300	Company Limited	95.258	0,51
34.000	Heilongjiang Agriculture Company Limited	67.299	0,36	5.791	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Company Limited	237.406	1,28
14.300	Henan Lingrui Pharmaceutical Company	26.824	0,14		Shanxi Xishan Coal & Electricity Power Company Limited		
29.900	Henan Shenhua Coal & Power Company Limited	64.345	0,35	7.300	Limited	12.234	0,07
	Henan Shuanghui Investment & Development Company Limited			15.500	Shenzhen Inovance Technology Company Limited	154.962	0,83
15.200	Limited	56.696	0,30		Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited		
29.300	Hengdian Group Dmeqc Magnetics Company Limited	78.985	0,42	7.898	Limited	358.981	1,93
11.900	Hexing Electrical Company Limited	30.128	0,16	5.400	Shenzhen Sc New Energy Technology Corporation	88.569	0,48
7.100	Hisense Kelon Electrical Holdings Company Limited	13.451	0,07		Shenzhen Woer Heat-Shrinkable Material Company Limited		
61.100	Huaibei Mining Holdings Company Limited	112.502	0,60	69.000	Limited	64.020	0,34
79.200	Huapont Life Sciences Company Limited	58.104	0,31	40.400	Sichuan Kelun Pharmaceutical Company Limited	154.645	0,83
29.568	Huayu Automotive Systems Company Limited	73.711	0,40	12.500	Sichuan Yahua Industrial Group Company Limited	41.806	0,22
2.900	Hubei Feilihu Quartz Glas - Klasse A	22.944	0,12	4.100	Sinosol Holding Company Limited	22.948	0,12
30.500	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Company Limited	119.225	0,64	400	Starpower Semiconductor Limited - Klasse A	18.948	0,10
9.400	Hundsun Technologies Inc	54.710	0,29	35.100	Sunflower Pharmaceutical Group Company Limited	117.039	0,63
93.800	Industrial Bank Company Limited	237.344	1,28	4.000	Sungrow Power Supply Company Limited	64.330	0,35
17.980	Inner Mongolia Eerduosi Resources Company Limited	39.288	0,21		Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Company Limited		
	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Company Limited			29.700	Limited	105.655	0,57
75.900	Limited	43.564	0,23	1.400	Suzhou Maxwell Technologies Company Limited	82.940	0,45
19.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	84.727	0,46	279.610	Tangshan Port Group Company Limited	110.208	0,59
8.840	JA Solar Technology Company Limited *	76.412	0,41	54.500	TBEA Company Limited	157.423	0,85
442	Jiangsu Bioperfectus Tech - Klasse A	5.577	0,03	139.000	Tian Di Science & Technology Company Limited	103.975	0,56
	Jiangsu Changjiang Electronics Technology Company Limited			24.400	Tianjin Zhonghuan Semiconductor Company Limited	132.184	0,71
21.700	Limited	71.951	0,39	5.400	Tianqi Lithium Industries Inc	61.359	0,33
739	Jiangsu Goodwe Power Suppl - Klasse A	34.346	0,18	45.400	Tongwei Company Limited	251.957	1,35
4.600	Jiangsu Hengrui Medicine Company Limited	25.496	0,14	7.718	Trina Solar Company Limited	70.788	0,38
	Jiangsu Jianguin Rural Commercial Bank Company Limited			2.400	Tsingtao Brewery Company Limited	37.113	0,20
33.200	Limited	18.960	0,10		Universal Scientific Industrial Shanghai Company Limited		
4.800	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Limited	35.145	0,19	31.700	Limited	74.009	0,40
				2.319	Wanhua Chemical Group Company Limited	30.907	0,17
				12.900	Weichai Power Company Limited	18.891	0,10

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Aktien (Fortsetzung)		
	China (Fortsetzung)		
5.700	Weihai Guangwei Composites Company Limited	59.241	0,32
1.020	Western Superconducting Te - Klasse A	13.894	0,08
1.739	Wuhan Easydiagnosis Biomedicine Company Limited	14.326	0,08
	Wuhu Shunrong Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Company Limited	51.808	0,28
17.416	Wuliangye Yibin Company Limited	452.680	2,43
6.848	WuXi Aptec Company Limited	79.792	0,43
3.000	Wuxi Lead Intelligent Company Limited	17.370	0,09
1.800	Wuxi Shangji Automation Company Limited	27.408	0,15
30.400	Xiamen Xiangyu Company Limited	44.911	0,24
53.818	Xi'an LONGi Silicon Materials Corporation	327.164	1,76
	Xinhua Winshare Publishing and Media Company Limited	53.512	0,29
4.900	Xinxiang Richful Lube Addi - Klasse A	86.917	0,47
5.200	Xj Electric Company Limited	14.938	0,08
600	Yangling Metron New Materi - Klasse A	4.243	0,02
2.300	Yankershop Food Company Limited	35.828	0,19
9.600	Yantai Jereh Oilfield Services Group Company Limited	38.543	0,21
22.500	Yanzhou Coal Mining Company Limited	108.686	0,58
3.700	Yifeng Pharmacy Chain Company Limited	33.978	0,18
1.900	Yongxing Special Materials Class Company Limited	25.191	0,14
11.700	Yunnan Copper Company Limited	19.776	0,11
2.400	Yunnan Energy New Material	45.326	0,24
	Yunnan Hongxiang Yixintang Pharmaceutical Company Limited	105.159	0,57
30.100	Yunnan Tin Company Limited	61.051	0,33
4.000	Zhejiang Cfmoto Power Company	64.744	0,35
28.200	Zhejiang Crystal-Optech Company Limited	47.827	0,26
11.900	Zhejiang Dahua Technology Company Limited	19.361	0,10
2.900	Zhejiang Dian Diagnostics Company Limited	10.483	0,06
	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Company Limited	17.458	0,09
12.900	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Company Limited	117.946	0,63
9.800	Zhejiang Qianjiang Motor - Klasse A	26.052	0,14
7.500	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Company Limited	22.894	0,12
59.600	Zhejiang Wanfeng Auto Wheel Company Limited	51.012	0,27
	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Company Limited	15.893	0,09
3.400	Zhongji Innolight Company Limited	13.220	0,07
90.300	Zijin Mining Group Company Limited	129.896	0,70
41.000	ZTE Corporation	152.518	0,82
		17.245.778	92,63
	Summe Aktien	17.245.778	92,63
	Futures-Kontrakte (a)		
	Singapur		
102	FTSE China A50 Januar 2023	12.138	0,07
	Summe Futures-Kontrakte	12.138	0,07
	Staatsanleihen		
	USA		
415.000	United States Treasury Bill 0 % 02.03.2023 #	412.154	2,21
405.000	United States Treasury Bill 0 % 05.11.2023 #	398.493	2,14
		810.647	4,35
	Summe Staatsanleihen	810.647	4,35

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man Numeric China A Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
4.386.840 EUR	4.647.522 USD	6. Januar 2023	1	36.664	0,20
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				36.664	0,20
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				18.105.227	97,25

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man Numeric China A Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
69.974 EUR	74.895 USD	6. Januar 2023	1	(179)	(0,00)
240.182 USD	225.710 EUR	6. Januar 2023	4	(825)	(0,01)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(1.004)	(0,01)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(1.004)	(0,01)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				18.105.227	97,25
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(1.004)	(0,01)
Sonstiges Nettovermögen				513.179	2,76
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				<u>18.617.402</u>	<u>100,00</u>

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (a) oben beschriebene börsengehandelte Finanzderivate

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben

Sonstiges Umlaufvermögen

% des Gesamtvermögens

89,65

0,06

0,19

4,30

1,79

4,01

100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	% des Nettover- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert GBP	% des Nettover- mögens
	Unternehmensanleihen				Unternehmensanleihen (Fortsetzung)		
	Kanada				USA (Fortsetzung)		
1.600.000	Glencore Finance Canada Limited 6,9 % 15.11.2037 *	1.409.151	0,57	3.000.000	KLA Corporation 5,25 % 15.07.2062 *	2.433.398	0,98
	China			3.490.000	Macy's Retail Holdings Inc 5,125 % 15.01.2042	1.860.522	0,75
3.590.000	Lenovo Group Limited 6,536 % 27.07.2032	2.883.964	1,16	3.810.000	Magallanes Inc 5,391 % 15.03.2026 *	2.341.398	0,94
	Frankreich				Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Limited 6,5 % 20.06.2027 *	236.413	0,09
5.165.000	ACAFP Perpetual 7,5 % 31.12.2100	5.019.915	2,02	4.728.418	Mileage Plus Holdings LLC 6,5 % 20.06.2027 *	3.896.949	1,57
2.958.000	BNP PERP 4,75 % 01.01.2100	1.905.125	0,77	3.220.000	Occidental Petroleum Corporation 7,95 % 15.06.2039 *	2.893.694	1,16
360.000	Electricite de France SA 6 % 22.01.2114 *	267.499	0,11	5.300.000	Oracle Corporation 6,9 % 09.11.2052	4.782.705	1,92
3.700.000	Electricite De France SA 4 % 04.10.2024	3.086.416	1,24	2.480.000	Verizon Communications Inc 7,75 % 01.12.2030	2.395.538	0,96
1.100.000	Electricite de France SA 5 % 22.01.2026	894.054	0,36			33.964.990	13,66
4.600.000	Electricite De France SA 6 % 23.01.2114	4.275.331	1,72		Summe Unternehmensanleihen	173.952.534	69,97
3.500.000	Electricite De France SA 6 % 29.07.2168	3.145.625	1,26		Futures-Kontrakte (a)		
2.000.000	Lagardere SA 1,75 % 07.10.2027	1.647.395	0,66		USA		
		20.241.360	8,14	(349)	US 10 Year Note (CBT) März 2023	46.444	0,02
	Deutschland			(92)	US Ultra Bond CBT März 2023	38.573	0,01
6.400.000	Deutsche Bank AG 4 % 24.06.2032	5.039.159	2,03			85.017	0,03
	Guernsey				Summe Futures-Kontrakte	85.017	0,03
750.000	Pershing Square Holdings Limited 3,25 % 15.11.2030 *	488.487	0,20		Staatsanleihen		
	Hongkong				USA		
4.521.000	Geely Automobile Holdings Limited 4 % 31.12.2049	3.454.872	1,39	23.707.400	United States Treasury Note/Bond 2 % 31.05.2024	18.986.788	7,64
	Irland			23.233.200	United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15.11.2023	18.984.684	7,64
3.049.000	BKIR Perpetual 7,5 % 19.11.2170	2.639.714	1,06	23.525.100	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 30.04.2025	18.922.461	7,61
	Italien					56.893.933	22,89
4.359.000	Eni SpA 3,375 % 31.12.2049	3.216.048	1,29		Summe Staatsanleihen	56.893.933	22,89
2.860.000	Intesa Sanpaolo SpA 8,24 % 21.11.2033 *	2.418.832	0,97		Hypothekenbesicherte Wertpapiere		
6.870.000	UniCredit SpA 2,731 % 15.01.2032	5.140.543	2,07		Vereinigtes Königreich		
		10.775.423	4,33	1.452	Y CMBS 6,46 % 22.07.2030	1.484	0,00
	Jersey				Summe Hypothekenbesicherte Wertpapiere	1.484	0,00
6.108.000	AA Bond Company Limited 6,269 % 31.07.2025	5.813.153	2,34		Vorzugsaktien		
850.000	AABOND 7,38 % 31.07.2029	730.800	0,29		Vereinigtes Königreich		
		6.543.953	2,63	290.806	Aviva plc	367.870	0,15
	Luxemburg			4.008.333	Aviva plc 8,3750 %	4.830.041	1,94
8.400.000	Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	6.033.965	2,43	4.299.685	General Accident plc	4.999.133	2,01
	Mexiko			835.530	RSA Insurance Group plc	864.773	0,35
4.230.000	Petroleos Mexicanos 4,75 % 26.02.2029	2.930.271	1,18			11.061.817	4,45
	Niederlande				Summe Vorzugsaktien	11.061.817	4,45
5.810.000	Enel Finance International NV 7,75 % 14.10.2052 *	5.225.021	2,10				
8.273.000	INTNED Perpetual 3,75 % 16.11.2169	5.046.987	2,03				
		10.272.008	4,13				
	Südafrika						
900.000	Investec plc 6,75 % 31.12.2099	819.000	0,33				
	Spanien						
3.700.000	Banco de Sabadell SA 2,5 % 15.04.2031	2.859.139	1,15				
6.400.000	Banco Santander SA 3,625 % 01.01.2100 Perpetual	3.946.305	1,59				
		6.805.444	2,74				
	Schweiz						
4.932.000	Credit Suisse Group AG 6,25 % 12.08.2024	3.195.415	1,28				
	Vereinigtes Königreich						
1.030.000	BACR Perpetual 9 % 31.12.2049	1.069.588	0,43				
3.393.000	Barclays plc 1,125 % 22.03.2031	2.565.351	1,03				
8.009.000	Brit Insurance Holdings Limited 6 % 29.01.2026	6.004.828	2,42				
3.900.000	British Telecommunications plc 8,875 % 15.12.2030	3.895.996	1,57				
1.450.000	Burford Capital plc 6,125 % 26.10.2024	1.402.048	0,56				
	Canary Wharf Group Investment Holdings plc 3,375 % 23.04.2028	1.515.521	0,61				
2.141.000	Co-Operative Group Limited 11 % 20.12.2025	8.246.642	3,32				
1.623.000	CWHARF 1,75 % 07.04.2026	1.104.569	0,44				
2.780.000	HSBC Holdings PLC 8,11 % 11.03.2033	2.452.051	0,99				
991.000	Just Group plc 7 % 15.04.2031	961.518	0,39				
	Lloyds Banking Group plc 11,75 % 31.12.2049 Perpetual	1.729.945	0,70				
1.150.000	Marks & Spencer PLC 4,5 % 07.10.2027	2.339.965	0,94				
2.730.000	Marks & Spencer plc 7,125 % 01.12.2037	2.368.034	0,95				
3.240.000	MGNLN 5,63 % 20.10.2051	3.112.829	1,25				
3.419.000	Nationwide Building Society 10,25 % 20.06.2066	5.401.625	2,17				
1.330.000	Phoenix Group Holdings plc 4,375 % 24.01.2029	1.101.561	0,44				
2.334.000	Phoenix Group Holdings plc London 4,75 % 04.09.2031	1.788.450	0,72				
5.868.000	Standard Chartered PLC 4,75 % 14.10.2031	3.738.224	1,50				
4.050.000	Tesco plc 6,15 % 15.11.2037	3.243.330	1,31				
4.110.000	Vodafone Group PLC 5,125 % 04.06.2081 *	2.413.283	0,97				
		56.455.358	22,71				
	USA						
3.800.000	AT&T Inc 2,875 % 31.12.2049	3.031.058	1,22				
	Dell International LLC/EMC Corporation 8,35 % 15.07.2046 *	3.308.821	1,33				
3.460.000	Energy Transfer Operating LP 7,5 % 01.07.2038	3.593.984	1,45				
4.030.000	General Electric Capital Corporation 6,875 % 01.10.2039	288.691	0,12				
313.000	General Electric Company 5 % 31.12.2068 *	1.030.977	0,41				
1.249.000	Global Payments Inc 5,95 % 15.08.2052	1.135.315	0,46				
1.500.000	Hewlett Packard Enterprise Company 6,35 % 15.10.2045	735.527	0,30				
879.000							

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Strategic Bond (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn GBP	% des Nettovermögens
1.645.000 AUD	1.116.922 USD	3. Januar 2023	1	1.474	0,00
10.310.371 AUD	6.956.173 USD	5. Januar 2023	2	46.543	0,02
3.472.000 AUD	2.345.957 USD	6. Januar 2023	2	12.863	0,00
8.761.263 CAD	6.419.580 USD	5. Januar 2023	1	48.922	0,02
1.221.595 CHF	1.077.244 GBP	6. Januar 2023	2	23.205	0,01
31.955.911 CHF	34.519.133 USD	5. Januar 2023	3	116.242	0,05
1.009.803 CHF	1.092.000 USD	6. Januar 2023	1	2.775	0,00
7.429.163 EUR	6.471.177 GBP	6. Januar 2023	6	119.263	0,05
1.748.000 EUR	1.516.764 GBP	12. Januar 2023	2	34.291	0,02
29.243.701 EUR	31.092.699 USD	5. Januar 2023	10	118.448	0,05
798.000 EUR	850.252 USD	6. Januar 2023	1	1.790	0,00
1.207.551 GBP	1.453.776 USD	6. Januar 2023	1	216	0,00
18.441.494.108 JPY	111.191.249 GBP	6. Januar 2023	1	5.164.793	2,08
3.071.472.951 JPY	22.896.573 USD	5. Januar 2023	2	361.547	0,15
145.024.489 JPY	1.090.000 USD	6. Januar 2023	1	9.802	0,01
3.892.005 USD	5.255.160 CAD	5. Januar 2023	1	5.062	0,00
34.515.985 USD	28.339.739 GBP	5. Januar 2023	10	325.914	0,12
37.613.698 USD	30.843.686 GBP	6. Januar 2023	10	393.816	0,16
3.873.000 USD	3.202.683 GBP	12. Januar 2023	3	13.234	0,00
124.696 USD	1.213.828 NOK	5. Januar 2023	1	1.062	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				6.801.262	2,74
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				248.796.047	100,08

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust GBP	% des Nettovermögens
5.239.224 CAD	3.879.000 USD	3. Januar 2023	2	(4.078)	(0,00)
16.944 GBP	18.863 CHF	6. Januar 2023	2	(50)	(0,00)
112.752 GBP	127.487 EUR	6. Januar 2023	5	(342)	(0,00)
1.279.197 GBP	204.106.816 JPY	6. Januar 2023	1	(8.608)	(0,01)
2.437.000 GBP	2.945.870 USD	3. Januar 2023	2	(9.684)	(0,00)
212.497.798 GBP	263.152.805 USD	5. Januar 2023	6	(6.051.576)	(2,44)
1.873.780 GBP	2.259.178 USD	6. Januar 2023	11	(2.427)	(0,00)
1.247.310 GBP	1.542.000 USD	12. Januar 2023	1	(33.078)	(0,01)
34.235.750 NOK	3.489.000 USD	3. Januar 2023	2	(6.944)	(0,00)
41.724.912 NOK	4.252.399 USD	5. Januar 2023	1	(8.300)	(0,00)
3.984.079 USD	5.863.000 AUD	5. Januar 2023	1	(2.843)	(0,00)
6.765.289 USD	9.189.223 CAD	5. Januar 2023	2	(24.625)	(0,01)
3.669.000 USD	3.401.020 CHF	3. Januar 2023	2	(15.718)	(0,01)
19.830.042 USD	18.447.352 CHF	5. Januar 2023	1	(147.658)	(0,06)
5.571.085 USD	5.230.000 EUR	3. Januar 2023	3	(11.884)	(0,00)
88.855.875 USD	83.348.432 EUR	5. Januar 2023	7	(140.305)	(0,05)
421.886 USD	350.393 GBP	5. Januar 2023	1	(15)	(0,00)
8.770.000 USD	1.172.722.966 JPY	4. Januar 2023	5	(113.926)	(0,05)
5.700.001 USD	774.628.897 USD	5. Januar 2023	2	(153.088)	(0,07)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(6.735.149)	(2,71)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(6.735.149)	(2,71)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				248.796.047	100,08
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(6.735.149)	(2,71)
Sonstiges Nettovermögen				6.547.243	2,63
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				248.608.141	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei HSBC Bank Plc und The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	74,65
In Klassifizierung (a) oben beschriebene börsengehandelte Finanzderivate	0,03
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	2,38
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	9,92
Sonstiges Umlaufvermögen	13,02
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
Aktien			
China			
32.000	Airtac International Group	969.303	1,58
405.140	East Money Information Company Limited	1.130.618	1,85
15.572	Iray Technology Company Limited - Klasse A	1.025.664	1,68
73.284	Nio Inc	714.519	1,17
205.300	Pharmaron Beijing Company Limited	1.424.352	2,33
26.023	Pinduoduo Inc	2.122.176	3,47
428.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.832.331	4,63
67.927	Shanghai MicroPort MedBot Group Company Limited	276.757	0,45
	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	1.031.765	1,68
91.897	Tencent Holdings Limited	3.918.719	6,40
67.219	Trip.com Group Limited	2.312.333	3,78
144.000	Tsingtao Brewery Company Limited	1.422.482	2,32
95.446	Wuxi Lead Intelligent Company Limited	552.628	0,90
74.600	Yifeng Pharmacy Chain Company Limited	685.079	1,12
19.443	Zai Lab Limited	596.900	0,97
		21.015.626	34,33
Hongkong			
316.060	AIA Group Limited	3.514.950	5,74
377.740	China Resources Gas Group Limited	1.418.046	2,32
45.349	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	1.959.229	3,20
670.000	Nine Dragons Paper Holdings Limited	611.202	1,00
		7.503.427	12,26
Indien			
99.916	ICICI Bank Limited	2.187.161	3,57
91.416	Infosys Limited	1.646.402	2,69
		3.833.563	6,26
Indonesien			
2.659.162	Bank Central Asia TBK	1.460.468	2,39
2.924.417	Bank Mandiri Persero TBK	1.864.451	3,04
		3.324.919	5,43
Macau			
610.800	Sands China Limited	2.026.883	3,31
Philippinen			
666.796	Bdo Unibank Inc	1.264.732	2,07
Südkorea			
1.784	LG Energy Solution	614.418	1,00
2.071	Samsung Biologics Company Limited	1.344.635	2,20
30.577	SK Hynix Inc	1.813.582	2,96
		3.772.635	6,16
Taiwan			
190.000	Challease Holding Company Limited	1.341.445	2,19
452.290	Hon Hai Precision Industry Company Limited	1.470.084	2,40
265.460	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.873.658	6,33
		6.685.187	10,92
Thailand			
1.523.500	Bangkok Dusit Medical Services Public Company Limited	1.286.628	2,10
3.201.466	Thai Beverage PCL	1.635.106	2,67
		2.921.734	4,77
USA			
31.766	Yum China Holdings Inc	1.736.012	2,83
		54.084.718	88,34
Summe Aktien			
Aktien swaps (b)			
Indien			
179.928	Bharti Airtel Limited	174.369	0,29
90.605	Hdfc Bank Limited	63.412	0,10
		237.781	0,39
		237.781	0,39
Summe Aktien swaps			
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel		54.322.499	88,73

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Aktien swaps		
	Indien		
20.163	Avenue Supermarts Limited	(8.014)	(0,02)
116.681	Mahindra & Mahindra Limited	(154.760)	(0,25)
		<hr/>	<hr/>
		(162.774)	(0,27)
		<hr/>	<hr/>
	Summe Aktien swaps	(162.774)	(0,27)

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Asia (ex Japan) Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
2.691 USD	150.029 PHP	4. Januar 2023	1	(9)	(0,00)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(9)	(0,00)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(162.783)	(0,27)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				54.322.499	88,73
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(162.783)	(0,27)
Sonstiges Nettovermögen				7.064.351	11,54
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				61.224.067	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate
(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Sonstiges Umlaufvermögen

	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	87,12
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	0,38
Sonstiges Umlaufvermögen	12,50
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	Unternehmensanleihen				Unternehmensanleihen (Fortsetzung)		
	Kanada				USA (Fortsetzung)		
220.000	Bombardier Inc 7,875 % 15.04.2027 *	214.424	0,59	650.000	Graham Packaging Company Inc 7,125 % 15.08.2028 *	544.255	1,49
50.000	Ensign Drilling Inc 9,25 % 15.04.2024 *	47.689	0,13	500.000	Group 1 Automotive Inc 4 % 15.08.2028 *	426.222	1,16
400.000	Mercer International Inc 5,125 % 01.02.2029 *	334.606	0,91	150.000	Guitar Center Inc 8,50 % 15.01.2026 *	124.346	0,34
150.000	NGDCN 7,5 % 15.07.2027 *	132.391	0,36	300.000	GYP Holdings III Corporation 4,625 % 01.05.2029 *	247.333	0,68
150.000	Vermilion Energy Inc 6,875 % 01.05.2030 *	137.811	0,38	100.000	H&E Equipment Services Inc 3,875 % 15.12.2028 *	85.330	0,23
		866.921	2,37	50.000	Herc Holdings Inc 5,5 % 15.07.2027 *	46.677	0,13
					Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corporation 5 % 01.02.2028 *	183.510	0,50
	Finnland			250.000	Hospitality Properties Trust 4,95 % 15.02.2027 *	197.316	0,54
150.000	Nokia OYJ 6,625 % 15.05.2039	144.285	0,39	600.000	Hughes Satellite Systems Corporation 6,625 % 01.08.2026 *	562.140	1,54
	USA			100.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5,25 % 15.05.2027 *	91.850	0,25
350.000	Abercrombie & Fitch Management Company 8,75 % 15.07.2025 *	346.761	0,95	100.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6,25 % 15.05.2026 *	96.925	0,26
450.000	Albertsons Companies Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 3,5 % 15.03.2029 *	377.685	1,03	50.000	Iron Mountain Inc 4,5 % 15.02.2031 *	41.251	0,11
100.000	Albertsons LP / Albertsons LLC 4,625 % 15.01.2027 *	93.193	0,25	45.000	Iron Mountain Inc 5,25 % 15.07.2030 *	39.112	0,11
370.000	Albertsons Companies Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 4,875 % 15.02.2030 *	330.549	0,90	100.000	Kennedy-Wilson Inc 4,75 % 01.02.2030 *	76.540	0,21
585.000	Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corporation 7,5 % 01.05.2025 *	581.551	1,59	650.000	Korn Ferry 4,625 % 15.12.2027 *	599.001	1,64
100.000	Alta Equipment Group Inc 5,625 % 15.04.2026 *	90.862	0,25	250.000	L Brands Inc 6,75 % 01.07.2036	219.737	0,60
50.000	American Airlines Inc/Advantage Loyalty IP Limited 5,5 % 20.04.2026 *	48.147	0,13	500.000	L Brands Inc 6,875 % 01.11.2035	445.357	1,22
350.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,5 % 20.05.2025	336.759	0,92	60.000	Laredo Petroleum Inc 9,5 % 15.01.2025	59.634	0,16
50.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,875 % 20.08.2026	47.701	0,13	50.000	Level 3 Financing Inc 4,25 % 01.07.2028 *	39.424	0,11
599.000	Amkor Technology Inc 6,625 % 15.09.2027 *	596.382	1,63	300.000	LSB Industries Inc 6,25 % 15.10.2028 *	273.727	0,75
100.000	AMN Healthcare Inc 4,625 % 10.01.2027 *	92.284	0,25	150.000	Macy'S Retail Holdings LLC 6,125 % 15.03.2032 *	126.443	0,35
200.000	AMN Healthcare Inc 4 % 15.04.2029 *	173.344	0,47	120.000	Midax OpCo Holdings LLC 5,625 % 15.08.2029 *	99.005	0,27
100.000	Apache Corporation 4,75 % 15.04.2043 *	75.521	0,21	350.000	Molina Healthcare Inc 3,875 % 15.05.2032 *	291.399	0,80
450.000	APX Group Inc 5,75 % 15.07.2029 *	374.686	1,02	250.000	Molina Healthcare Inc 3,875 % 15.11.2030 *	212.561	0,58
435.000	Arko Corporation 5,125 % 15.11.2029 *	341.686	0,93	400.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corporation 5 % 15.10.2027	337.204	0,92
150.000	Atkore Inc 4,25 % 01.06.2031 *	130.721	0,36	100.000	Murphy Oil Corporation 5,875 % 01.12.2042	78.898	0,22
50.000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc 5,375 % 30.01.2029 *	43.019	0,12	225.000	Murphy Oil USA Inc 3,75 % 15.02.2031 *	187.931	0,51
50.000	B&G Foods Inc 5,25 % 01.04.2025	44.116	0,12	100.000	Nabors Industries Inc 5,75 % 01.02.2025 *	95.925	0,26
370.000	Bluelinx Holdings Inc 6 % 15.11.2029 *	309.934	0,85	200.000	Nabors Industries Limited 7,25 % 15.01.2026 *	189.663	0,52
500.000	Boise Cascade Company 4,875 % 01.07.2030 *	437.587	1,20	50.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc 5,125 % 15.12.2030 *	38.759	0,11
100.000	Bonanza Creek Energy Inc 5 % 15.10.2026 *	92.363	0,25	525.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc 5,5 % 15.08.2028 *	431.844	1,18
200.000	Brookfield Property REIT Inc 4,5 % 01.04.2027 *	169.324	0,46	150.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc 5,75 % 15.11.2031 *	116.957	0,32
250.000	Builders Firstsource Inc 4,25 % 01.02.2032 *	203.763	0,56	250.000	NCL Corporation Limited 5,875 % 15.03.2026 *	197.204	0,54
100.000	Callon Petroleum Company 7,5 % 15.06.2030 *	91.994	0,25	100.000	NCL Corporation Limited 7,75 % 15.02.2029 *	75.453	0,21
250.000	Carnival Corporation 10,50 % 01.06.2030 *	204.833	0,56	500.000	Necessity Retail REIT Inc/The / American Finance Operating Partner LP 4,5 % 30.09.2028 *	74.214	0,20
50.000	Cars.com Inc 6,375 % 01.11.2028 *	44.640	0,12	150.000	New Residential Investment Corporation 6,25 % 15.10.2025 *	494.134	1,35
90.000	CCO Holdings Capital Corporation 4,75 % 01.03.2030 *	77.823	0,21	150.000	Nordstrom Inc 4,375 % 01.04.2030	112.935	0,31
300.000	CCO Holdings Capital Corporation 5,125 % 01.05.2027 *	280.180	0,77	450.000	Northern Oil and Gas Inc 8,125 % 01.03.2028 *	432.135	1,18
350.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corporation 4,25 % 15.01.2034 *	259.056	0,71	400.000	NRG Energy Inc 3,625 % 15.02.2031 *	306.912	0,84
350.000	Centene Corporation 2,5 % 01.03.2031	274.391	0,75	200.000	NRG Energy Inc 3,875 % 15.02.2032 *	151.231	0,41
350.000	Centene Corporation 3 % 15.10.2030	287.222	0,78	200.000	NRG Energy Inc 5,25 % 15.06.2029 *	177.029	0,48
200.000	CF Industries Inc 4,95 % 01.06.2043	171.329	0,47	50.000	OAS 6,38 % 01.06.2026 *	48.619	0,13
200.000	CF Industries Inc 5,375 % 15.03.2044	179.979	0,49	400.000	Occidental Petroleum Corporation 6,45 % 15.09.2036 *	408.740	1,12
50.000	Cinemark USA Inc 5,25 % 15.07.2028 *	37.197	0,10	100.000	Occidental Petroleum Corporation 6,6 % 15.03.2046 *	103.051	0,28
50.000	Cinemark USA Inc 5,875 % 15.03.2026 *	41.684	0,11	85.000	Occidental Petroleum Corporation 6,625 % 01.09.2030	87.911	0,24
400.000	CommScope Inc 7,125 % 01.07.2028 *	288.596	0,79	500.000	ON Semiconductor Corporation 3,875 % 01.09.2028 *	439.495	1,20
500.000	CommScope Inc 8,25 % 01.03.2027 *	392.092	1,07	650.000	Organon Finance 1 LLC 5,125 % 30.04.2031 *	564.213	1,54
100.000	Comstock Resources Inc 6,75 % 01.03.2029 *	90.370	0,25	150.000	Ovintiv Inc 6,625 % 15.08.2037	151.682	0,41
50.000	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc 6 % 01.11.2029 *	41.076	0,11	200.000	Park-Ohio Industries Inc 6,625 % 15.04.2027 *	130.871	0,36
100.000	CVR Energy Inc 5,25 % 15.02.2025 *	92.121	0,25	175.000	Patrick Industries Inc 7,5 % 15.10.2027 *	170.819	0,47
100.000	Dana Inc 4,25 % 01.09.2030	80.724	0,22	250.000	PBF Holding Company LLC / PBF Finance Corporation 7,25 % 15.06.2025	246.849	0,67
500.000	Darling Ingredients Inc 5,25 % 15.04.2027 *	489.735	1,34	550.000	Penn Virginia Escrow LLC 9,25 % 15.08.2026 *	551.353	1,51
300.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corporation 7,125 % 01.06.2028 *	270.960	0,74	100.000	PennyMac Financial Services Inc 5,375 % 15.10.2025 *	91.086	0,25
700.000	Directv Holdings LLC / Directv Financing Company Inc 5,875 % 15.08.2027 *	628.687	1,72	200.000	PennyMac Financial Services Inc 5,75 % 15.09.2031 *	162.199	0,44
50.000	DISH DBS Corporation 5,25 % 01.12.2026 *	42.218	0,12	100.000	PG&E Corporation 5 % 01.07.2028	91.588	0,25
300.000	DISH DBS Corporation 5,875 % 15.11.2024 *	280.477	0,77	575.000	PG&E Corporation 5,25 % 01.07.2030	523.911	1,43
350.000	DISH DBS Corporation 7,75 % 01.07.2026 *	282.957	0,77	350.000	Photo Holdings Merger Sub Inc 8,5 % 01.10.2026 *	202.290	0,55
100.000	DISH DBS Corporation 5,75 % 01.12.2081 *	79.971	0,22	100.000	Pilgrim's Pride Corporation 5,875 % 30.09.2027 *	98.174	0,27
75.000	EnLink Midstream LLC 5,375 % 01.06.2029	69.804	0,19	350.000	Post Holdings Inc 4,5 % 15.09.2031 *	296.033	0,81
100.000	Enlink Midstream Partners LP 5,45 % 01.06.2047	80.411	0,22	250.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc 6,25 % 15.01.2028 *	228.477	0,62
200.000	Enova International Inc 8,5 % 01.09.2024 *	192.030	0,52	250.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc 4,50 % 15.09.2026 *	184.018	0,50
100.000	Enstar Finance LLC 5,5 % 11.15.2042 *	80.497	0,22	350.000	Resorts World Las Vegas Llc / Resorts World Las Vegas Capital Inc 4,625 % 06.04.2031	235.998	0,64
50.000	EQM Midstream Partners LP 6,5 % 15.07.2048	37.778	0,10	200.000	Roblox Corporation 3,875 % 01.05.2030 *	157.665	0,43
100.000	Everi Holdings Inc 5 % 15.07.2029 *	86.802	0,24	100.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5,625 % 01.12.2025 *	96.866	0,26
400.000	Forestar Group Inc 3,85 % 15.05.2026 *	355.974	0,97	620.000	Scientific Games International Inc 8,625 % 01.07.2025 *	634.818	1,73
150.000	Freedom Mortgage Corp 6,625 % 15.01.2027 *	117.383	0,32	100.000	Seaworld Parks & Entertainment Inc 5,25 % 15.08.2029 *	87.335	0,24
150.000	Freedom Mortgage Corp 7,625 % 01.05.2026 *	126.984	0,35	400.000	Service Properties Trust 4,375 % 15.02.2030 *	268.872	0,73
400.000	Frontier Communications Corporation 6,75 % 01.05.2029 *	331.186	0,90	150.000	Service Properties Trust 4,75 % 01.10.2026 *	119.505	0,33
200.000	Frontier Communications Holdings LLC 5,875 % 01.11.2029 *	155.556	0,42	100.000	Service Properties Trust 4,95 % 01.10.2029 *	70.132	0,19
200.000	Frontier Communications Holdings LLC 6 % 15.01.2030 *	157.935	0,43	50.000	Sinclair Television Group Inc 5,5 % 01.03.2030 *	35.062	0,10
420.000	FXI Holdings Inc 7,875 % 01.11.2024 *	348.938	0,95	100.000	Sonic Automotive Inc 4,875 % 15.11.2031 *	78.811	0,22
100.000	Gen Digital Inc 7,125 % 30.09.2030 *	98.629	0,27	50.000	Spirit Aerosystems Inc 7,5 % 15.04.2025 *	49.489	0,14
200.000	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc 3,3 % 15.02.2026	175.899	0,48	650.000	Staples Inc 10,75 % 15.04.2027 *	325.048	0,89
300.000	Genworth Mortgage Holdings Inc 6,5 % 15.08.2025 *	295.683	0,81	300.000	Suncoke Energy Inc 4,875 % 30.06.2029 *	555.467	1,52
350.000	GEO Group Inc/The 10,50 % 30.06.2028 *	356.216	0,97	500.000	Talos Production Inc 12 % 15.01.2026 *	316.807	0,87
320.000	Graham Holdings Company 5,75 % 01.06.2026 *	314.582	0,86	500.000	Tenet Healthcare Corporation 6,125 % 01.10.2028 *	449.212	1,23
				50.000	Terrier Media Buyer Inc 8,875 % 15.12.2027 *	37.679	0,10
				150.000	Transocean Inc 11,5 % 30.01.2027 *	151.170	0,41
				98.000	Triumph Group Inc 8,875 % 01.06.2024 *	99.911	0,27
				200.000	Tronox Inc 4,625 % 15.03.2029 *	166.375	0,45

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (Fortsetzung)			
USA (Fortsetzung)			
100.000	United Airlines Inc 4,625 % 15.04.2029 *	87.448	0,24
145.000	United States Steel Corporation 6,875 % 01.03.2029	141.387	0,39
150.000	Uniti Group LP 6,5 % 15.02.2029 *	99.548	0,27
520.000	Vector Group Limited 10,5 % 01.11.2026 *	518.365	1,42
200.000	Vector Group Limited 5,75 % 01.02.2029 *	173.781	0,47
300.000	Vista Outdoor Inc 4,5 % 15.03.2029 *	221.479	0,61
100.000	Vistra Operations Co LLC 4,375 % 01.05.2029 *	86.569	0,24
550.000	Vistra Operations Company LLC 5,625 % 15.02.2027 *	526.391	1,44
350.000	Wabash National Corporation 4,5 % 15.10.2028 *	297.640	0,81
655.000	Warrior Met Coal Inc 7,875 % 01.12.2028 *	648.191	1,77
500.000	Western Midstream Operating LP 4,05 % 01.02.2030	438.737	1,20
200.000	Western Midstream Operating LP 5,25 % 01.02.2050	165.944	0,45
100.000	Wyndham Destinations Inc 6,625 % 31.07.2026 *	98.111	0,27
150.000	ZipRecruiter Inc 5 % 15.11.2030 *	123.679	0,34
		34.702.931	94,80
	Summe Unternehmensanleihen	35.714.137	97,56
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel	35.714.137	97,56
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel	35.714.137	97,56
	Sonstiges Nettovermögen	891.355	2,44
	Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	36.605.492	100,00

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	13,86
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	83,34
Sonstiges Umlaufvermögen	2,80
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens	Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	Wandelanleihen				Unternehmensanleihen (Fortsetzung)		
	China				Polen		
2.504.000	Momo Inc 1,25 % 07.01.2025 *	2.406.898	1,51	1.300.000	MBank SA 0,966 % 21.09.2027	1.069.515	0,67
	Irland				Portugal		
1.300.000	COPNSW 2,5 % 05.12.2023	1.330.196	0,83	1.700.000	Novo Banco SA 8,5 % 06.07.2028	1.729.877	1,08
	Jersey				Rumänien		
500.000	Cornwall Jersey Limited 0,75 % 16.04.2026	353.653	0,22	2.965.000	Globalworth Real Estate Investments Limited 2,95 % 29.07.2026_Barac	2.520.549	1,58
	Niederlande			1.886.000	Globalworth Real Estate Investments Limited 2,95 % 29.07.2026_BNYM	1.603.290	1,01
3.700.000	Pharming Group NV 3 % 21.01.2025	3.587.508	2,25	500.000	Gwlin 3 % 29.03.2025	468.315	0,29
	Summe Wandelanleihen	7.678.255	4,81			4.592.154	2,88
	Unternehmensanleihen				Slowenien		
	Australien			3.700.000	Nova Ljubljanska Banka dd 10,75 % 28.11.2032	4.009.439	2,51
3.300.000	NCIG Holdings Pty Limited 12,5 % 26.08.2031 *	3.217.500	2,01		Südafrika		
1.135.000	Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Limited 4,7 % 12.05.2031 *	871.729	0,55	5.500.000	Intersec PLC 9,125 % 06.03.2033	6.725.747	4,21
800.000	Port of Newcastle Investments Financing Pty Limited 5,9 % 24.11.2031 *	663.252	0,42		Schweden		
	Österreich			2.500.000	Betsson AB 6,318 % 23.06.2025	2.715.097	1,70
1.800.000	Raiffeisen Bank International AG 6 % 31.12.2032	1.569.162	0,98	800.000	Ored Holding AB 8,5 % 22.04.2025 #	849.531	0,53
300.000	Raiffeisen Bank International AG 7,375 % 20.12.2032	318.115	0,20	209.000	Samhallsbyggnadsbolaget I Norden AB 1 % 12.08.2027	155.986	0,10
		1.887.277	1,18			3.720.614	2,33
	Belgien				Schweiz		
3.100.000	VGP NV 1,5 % 08.04.2029	2.188.315	1,37	4.366.000	Credit Suisse Group AG 6,537 % 12.08.2033 *	3.853.555	2,41
2.700.000	VGP NV 2,25 % 17.01.2030	1.907.058	1,19	349.000	Credit Suisse Group AG 7,375 % 07.09.2033	383.318	0,24
600.000	VGPBB 1,63 % 17.01.2027	488.054	0,31	2.150.000	Credit Suisse Group AG 7,75 % 01.03.2029	2.286.166	1,43
		4.583.427	2,87			6.523.039	4,08
	Bermuda				Vereinigtes Königreich		
900.000	Sirius International Group Limited 4,6 % 01.11.2026	776.529	0,49	150.000	Berkeley Group plc 2,5 % 11.08.2031	121.115	0,08
	Chile			300.000	Bracken MidCo1 plc 6,75 % 01.11.2027	292.936	0,18
3.039.000	Inversiones La Construccion SA 4,75 % 07.02.2032 *	2.479.735	1,55	6.210.000	Chesnara plc 4,75 % 04.08.2032	5.502.265	3,45
	Zypern			7.109.000	IG Group Holdings plc 3,125 % 18.11.2028	6.493.903	4,07
2.506.000	Gunvor Group Limited 6,25 % 30.09.2026	2.267.429	1,42	2.800.000	Intermediate Capital Group plc 2,5 % 28.01.2030_Barac	1.982.686	1,24
	Estland			7.317.000	Intermediate Capital Group plc 2,5 % 28.01.2030_BNYM	5.579.735	3,49
1.315.000	Lumino 5 % 29.08.2024	1.393.677	0,87	3.087.000	International Personal Finance plc 9,75 % 12.11.2025_Barac	2.767.781	1,73
	Frankreich				International Personal Finance plc 9,75 % 12.11.2025_BNYM	224.148	0,14
200.000	Electricite De France SA 6 % 23.01.2114	223.944	0,14	250.000	Intersec Bank PLC 4,25 % 24.07.2080	227.540	0,14
	Deutschland			191.000	Lancashire Holdings Limited 5,625 % 18.09.2041	1.729.816	1,08
4.000.000	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,5 % 25.01.2027_Barac	3.200.363	2,00	2.196.000	Marex Group plc 13,25 % 31.12.2032	4.165.485	2,61
4.200.000	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,5 % 25.01.2027_BNYM	3.360.381	2,11	167.788	Mitchells & Butlers Finance plc 0,566 % 15.12.2030	155.506	0,10
3.200.000	Sirius Real Estate Limited 1,125 % 22.06.2026	2.672.169	1,67	2.264.000	Mirhom Float 15.05.2028	1.801.566	1,13
7.000.000	Sirius Real Estate Limited 1,75 % 24.11.2028	5.140.586	3,22	2.243.000	Provident Financial plc 8,875 % 13.01.2032	2.415.726	1,51
		14.373.499	9,00	3.260.000	SBRYBK 10,5 % 03.12.2033_Barac	4.107.723	2,57
	Guernsey			2.000.000	SBRYBK 10,5 % 03.12.2033_BNYM	2.520.075	1,58
530.000	Summit Properties Limited 2 % 31.01.2025	489.185	0,31	3.215.000	Shawbrook Group PLC 12,10 % 08.06.2171	3.575.824	2,24
	Ungarn			2.108.000	Shawbrook Group plc 9 % 10.10.2030	2.459.680	1,54
4.200.000	Raiffeisen Bank zrt 8,75 % 22.11.2025	4.606.883	2,88	400.000	Swan Housing Capital plc 3,625 % 05.03.2048	345.094	0,22
	Irland			2.200.000	TP ICAP Finance PLC 2,625 % 18.11.2028	1.950.668	1,22
3.500.000	Bank of Cyprus Holdings plc 12,5 % Perpetual	3.656.977	2,29	4.779.000	Utmost Group plc 4 % 15.12.2031	4.280.676	2,68
750.000	IPMID 13,75 % PERP 19.10.2032	864.420	0,54	1.920.000	Utmost Group plc 6,125 % 31.12.2032	1.887.783	1,18
		4.521.397	2,83			54.587.281	34,18
	Luxemburg				USA		
2.100.000	ADVZCN 6,25 % 01.04.2028	2.065.142	1,29	400.000	Blackstone Private Credit Fund 4,875 % 14.04.2026	432.564	0,27
2.500.000	CPI Property Group SA 5,8 % 31.12.2049	915.972	0,57		Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5,125 % 01.07.2049 *		
5.194.000	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2,125 % 19.11.2025	4.545.503	2,85	1.200.000	Drawbridge Special Opportunities Fund LP 3,875 % 15.02.2026 *	917.465	0,57
1.293.530	FEL Energy VI Sarl 5,75 % 01.12.2040_Barac *	1.110.689	0,70	800.000	MPW 3,692 % 06.05.2028	722.690	0,45
4.649.316	FEL Energy VI Sarl 5,75 % 01.12.2040_BNYM *	3.992.135	2,50	2.743.000	PETROFAC Limited SR SEC REGS NT26 9,75 % 15.11.2026 *	2.422.229	1,52
4.279.000	GTC Aurora Luxembourg SA 2,25 % 23.06.2026_Barac	3.362.279	2,11	1.483.000	Prospect Capital Corporation 3,437 % 15.10.2028 *	840.001	0,53
5.976.000	GTC Aurora Luxembourg SA 2,25 % 23.06.2026_BNYM	4.695.719	2,94	2.710.000		2.083.233	1,30
7.600.000	Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	6.569.991	4,11			7.418.182	4,64
		27.257.430	17,07		Summe Unternehmensanleihen	176.556.028	110,54
	Malaysia				Credit Default Swaps (b)		
351.000	Genm Capital Labuan Limited 3,882 % 19.04.2031	263.273	0,16		Europäische Union		
	Malta				Energias de Portugal SA 500 Bp 20. Dezember 2026 GS	78.233	0,05
5.100.000	Bovmv 10 % 12.06.2027	5.542.636	3,47	(500.000)			
	Niederlande			(1.660.000)	Iberdrola SA 100 Bp 20. Dezember 2026 JPM	28.965	0,02
3.267.000	CTP NV 1,5 % 27.09.2031	2.096.166	1,31			107.198	0,07
2.531.000	NE Property BV 2 % 20.01.2030	1.875.520	1,18		USA		
620.000	WIZZLN 1,35 % 19.01.2024	629.662	0,39	7.500.000	LAMB Weston Holding Inc 100 Bp 20. Dezember 2027 Jp Morgan Securities	76.729	0,05
		4.601.348	2,88	802.710	Yuml Brands Inc 100 Bp 20. Juni 2027 BNP Paribas	3.391	0,00
	Norwegen			1.568.000	Yuml Brands Inc 113 Bp 20. Dezember 2027 BNP Paribas	14.212	0,01
1.750.000	Athomstart Invest 585 AS 11,75 % 29.09.2026	1.723.055	1,08			94.332	0,06
2.900.000	Nordlig Rutite AS 12,5 % 09.11.2027	2.639.203	1,65		Summe Credit Default Swaps	201.530	0,13
		4.362.258	2,73				
	Peru						
1.882.596	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal Del Peru 6,375 % 01.06.2028 *	1.797.772	1,13				

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Zinsswaps (b)		
	Vereinigtes Königreich		
(200.000)	Payable GBP 0,539 % VS SONIA O/N GBP - 9. Dezember 2051	125.411	0,08
	Summe Zinsswaps	125.411	0,08

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
1.924.747 EUR	2.045.652 USD	12. Januar 2023	2	10.424	0,00
102.981.111 EUR	107.468.721 USD	31. Januar 2023	34	2.685.683	1,68
72.667 GBP	87.029 USD	31. Januar 2023	3	462	0,00
44.887.166 USD	36.511.660 GBP	12. Januar 2023	2	951.540	0,60
185.701 USD	152.799 GBP	31. Januar 2023	31	1.735	0,00
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				3.649.844	2,28
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				188.211.068	117,84

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
Credit Default Swaps			
Europäische Union			
1.476.168	Accor SA 100 87 Bp 20. Juni 2023 BARC plc	(1.664)	(0,00)
(300.000)	ENEL SPA 100 61 Bp 20. Dezember 2026 BARC plc	(1.240)	(0,00)
(650.000)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 100 Bp 20. Dezember 2026 JPM	(21.776)	(0,01)
(2.744.000)	TUI AG 500 0 Bp 20. Dezember 2027 JP Morgan Securities Limited Liability Company	(551.459)	(0,35)
		<u>(576.139)</u>	<u>(0,36)</u>
USA			
(800.000)	Alibaba Group Holding Limited 100 Bp 20. Dezember 2026 GS	(5.084)	(0,01)
(200.000)	Alibaba Group Holding Limited 100 Bp 20. Dezember 2026 GS	(1.271)	(0,00)
(300.000)	Alibaba Group Holding Limited 100 Bp 20. Dezember 2026 MS	(1.907)	(0,00)
700.000	AVIS Budget Group Inc 500 Bp 20. Dezember 2024 MS	(34.075)	(0,02)
521.269	BALL Corporation 100 Bp 20. Juni 2023 JP Morgan Securities	(840)	(0,00)
1.100.000	United Rentals NA Inc 500 70 Bp 20. Dezember 2024 Bnp Paribas	(83.863)	(0,05)
2.300.000	United Rentals NA Inc 500 Bp 20. Dezember 2023 JPM	(97.258)	(0,06)
715.000	United Rentals Na Inc 500 Bp 20. Juni 2024 JPM	(42.556)	(0,03)
1.118.000	YUM! BRANDS INC 100 20. Juni 2023 JP Morgan Securities Limited Liability	(3.613)	(0,00)
2.055.000	Yum! Brands Inc 100 Bp 20. Juni 2024 JPM	(15.349)	(0,01)
		<u>(285.816)</u>	<u>(0,18)</u>
		<u>(861.955)</u>	<u>(0,54)</u>
Summe Credit Default Swaps			
Futures-Kontrakte			
USA			
26	US Long Bond (CBT) März 2023	(29.437)	(0,02)
94	US Ultra Bond CBT März 2023	(135.125)	(0,08)
		<u>(164.562)</u>	<u>(0,10)</u>
		<u>(164.562)</u>	<u>(0,10)</u>
Summe Futures-Kontrakte			
Zinsswaps			
Europäische Union			
580.000	Receivable EUR 1,0928 % VS EURIBOR 6 Months OBP 23. März 2032	(103.369)	(0,06)
600.000	Receivable EUR 1,1348 % Vs EURIBOR 6 Months OBP 28. März 2032	(104.928)	(0,07)
		<u>(208.297)</u>	<u>(0,13)</u>
Vereinigtes Königreich			
1.600.000	Receivable GBP 1,6715 % Vs SONIA O/N OBP 8. März 2027	(181.974)	(0,11)
2.400.000	Receivable GBP 1,7738 % Vs SONIA O/N OBP 9. März 2027	(262.012)	(0,17)
		<u>(443.986)</u>	<u>(0,28)</u>
		<u>(652.283)</u>	<u>(0,41)</u>
Summe Zinsswaps			

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Global Investment Grade Opportunities (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
1.100.000 GBP	1.366.498 USD	12. Januar 2023	1	(42.834)	(0,03)
7.280.765 GBP	8.815.543 USD	31. Januar 2023	40	(49.616)	(0,02)
75.945.515 USD	71.931.435 EUR	12. Januar 2023	8	(893.930)	(0,56)
1.459.922 USD	1.371.838 EUR	31. Januar 2023	6	(7.473)	(0,01)
1.633.254 USD	2.212.308 SGD	12. Januar 2023	1	(16.746)	(0,01)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(1.010.599)	(0,63)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(2.689.399)	(1,68)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				188.211.068	117,84
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(2.689.399)	(1,68)
Sonstige Nettoverbindlichkeiten				(25.807.498)	(16,16)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				159.714.171	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben

Sonstiges Umlaufvermögen

% des Gesamtvermögens

72,56

1,82

0,39

11,43

13,80

100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG China Equity



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Aktien		
	China		
13.000	Airtac International Group	393.779	4,03
533.000	China Datang Corporation Renewable Power Company Limited	157.750	1,62
29.500	East Money Information Company Limited	82.325	0,84
212.232	Great Wall Motor Company Limited	276.270	2,83
29.930	Hithink Royalfush Information Network Company Limited	424.558	4,35
2.991	Iray Technology Company Limited - Klasse A	197.005	2,02
21.434	Nio Inc	208.982	2,14
65.100	Pharmaron Beijing Company Limited	451.658	4,62
8.387	Pinduoduo Inc	683.960	7,00
139.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	919.846	9,42
51.000	Shanghai MicroPort MedBot Group Company Limited	207.791	2,13
2.700	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	122.721	1,26
11.645	Tencent Holdings Limited	497.312	5,09
20.210	Trip.com Group Limited	695.224	7,12
46.000	Tsingtao Brewery Company Limited	454.404	4,65
38.200	Wuxi Lead Intelligent Company Limited	221.176	2,26
30.900	Yifeng Pharmacy Chain Company Limited	283.766	2,91
8.317	Zai Lab Limited	255.332	2,61
		6.533.859	66,90
	Hongkong		
55.000	AIA Group Limited	611.663	6,26
112.000	China Resources Gas Group Limited	420.451	4,31
33.000	Galaxy Entertainment Group Limited	218.169	2,23
100.000	Nine Dragons Paper Holdings Limited	91.224	0,94
		1.341.507	13,74
	Macau		
145.100	Sands China Limited	481.501	4,93
	Taiwan		
44.000	Chailase Holding Company Limited	310.651	3,18
	USA		
7.388	Yum China Holdings Inc	403.754	4,13
	Summe Aktien	9.071.272	92,88
	Aktienwaps (b)		
	Taiwan		
18.000	Chailase Holding Company Limited	9.791	0,10
	Summe Aktienswaps	9.791	0,10
	Staatsanleihen		
	USA		
250.000	United States Treasury Bill 0 % 13.04.2023 #	247.187	2,53
300.000	United States Treasury Bill 0 % 23.03.2023 #	297.235	3,04
150.000	United States Treasury Bill 0 % 27.04.2023 #	147.914	1,52
		692.336	7,09
	Summe Staatsanleihen	692.336	7,09

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG China Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
507.657 CNY	73.000 USD	12. Januar 2023	2	453	0,00
226.968 USD	1.768.872 HKD	12. Januar 2023	5	256	0,00
898.214 USD	27.408.303 TWD	12. Januar 2023	3	5.374	0,06
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				6.083	0,06
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				9.779.482	100,13

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG China Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
	Aktien swaps		
	China		
94.840	East Money Information Company Limited	(211.127)	(2,16)
5.800	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	(74.793)	(0,77)
		<u>(285.920)</u>	<u>(2,93)</u>
	Summe Aktien swaps	<u>(285.920)</u>	<u>(2,93)</u>

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG China Equity (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
14.944.813 HKD	1.919.756 USD	12. Januar 2023	7	(4.324)	(0,04)
1.989.475 TWD	65.000 USD	12. Januar 2023	1	(192)	(0,00)
630.537 USD	4.387.630 CNY	12. Januar 2023	3	(4.311)	(0,05)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(8.827)	(0,09)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(294.747)	(3,02)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				9.779.482	100,13
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(294.747)	(3,02)
Sonstiges Nettovermögen				282.676	2,89
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				9.767.411	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere

In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate

Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben

Sonstiges Umlaufvermögen

% des Gesamtvermögens

87,67

0,15

6,69

5,49

100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert EUR	% des Nettover- mögens
	Aktien		
	Kanada		
22.753	Stantec Inc	1.020.846	2,93
9.231	Waste Connections Inc	1.145.712	3,29
		<u>2.166.558</u>	<u>6,22</u>
	Finnland		
61.798	Metso Outotec OYJ	594.002	1,71
	Frankreich		
67.217	Veolia Environnement SA	1.613.208	4,63
	Deutschland		
566	Aurubis AG	43.220	0,13
18.138	GEA Group AG	692.872	1,99
		<u>736.092</u>	<u>2,12</u>
	Japan		
14.000	Kurita Water Industries Limited	542.827	1,56
	Niederlande		
25.001	Aalberts Industries NV	905.786	2,60
	Schweiz		
15.203	Georg Fischer	871.453	2,50
39.775	SIG Combibloc Group AG	813.691	2,34
2.568	Sika AG	576.579	1,66
		<u>2.261.723</u>	<u>6,50</u>
	Vereinigtes Königreich		
5.346	Ferguson plc	636.010	1,83
120.859	Pennon Group plc	1.210.319	3,48
39.662	Severn Trent plc	1.185.080	3,40
66.775	United Utilities Group plc	746.150	2,14
		<u>3.777.559</u>	<u>10,85</u>
	USA		
5.320	Advanced Drainage Systems Inc	408.602	1,17
7.547	Agilent Technologies Inc	1.058.242	3,04
14.036	American Water Works Company Inc	2.004.560	5,76
1.523	ANSYS Inc	344.757	0,99
9.971	Clean Harbors Inc	1.066.189	3,06
7.811	Danaher Corporation	1.942.559	5,58
4.524	Ecolab Inc	617.019	1,77
31.215	Essential Utilities Inc	1.396.010	4,01
6.521	Fortune Brands Home & Security Inc	348.948	1,00
7.133	Franklin Electric Company Inc	533.012	1,53
6.277	IDEX Corporation	1.342.916	3,86
7.399	Masco Corporation	323.552	0,93
1.222	Pool Corporation	346.167	1,00
11.203	PTC Inc	1.260.069	3,62
12.309	Republic Services Inc	1.487.691	4,27
2.624	Roper Technologies Inc	1.062.360	3,05
6.297	Tetra Tech Inc	856.652	2,46
3.378	Thermo Fisher Scientific Inc	1.743.013	5,01
7.832	Trimble Inc	371.034	1,07
4.352	Valmont Industries Inc	1.348.396	3,87
4.173	Watts Water Technologies Inc	571.766	1,64
23.617	Zurn Elkay Water Solutions Cor	468.025	1,35
		<u>20.901.539</u>	<u>60,04</u>
	Summe Aktien	<u>33.499.294</u>	<u>96,23</u>
	Vorzugsaktien		
	Deutschland		
1.374	Sartorius AG	507.556	1,46
	Summe Vorzugsaktien	<u>507.556</u>	<u>1,46</u>
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel	<u>34.006.850</u>	<u>97,69</u>
	Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel	<u>34.006.850</u>	<u>97,69</u>
	Sonstiges Nettovermögen	<u>803.734</u>	<u>2,31</u>
	Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen	<u>34.810.584</u>	<u>100,00</u>

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	97,32
Sonstiges Umlaufvermögen	2,68
	<u>100,00</u>

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen			
Kanada			
520.000	Brookfield Finance Inc 2,724 % 15.04.2031	416.806	2,58
China			
390.000	Lenovo Group Limited 6,536 % 27.07.2032	377.017	2,34
Frankreich			
270.000	ACAFF Perpetual 7,5 % 31.12.2100	315.342	1,96
400.000	Electricite de France SA 4,75 % 10.12.2034	422.458	2,62
300.000	Electricite De France SA 6 % 29.07.2168	326.080	2,02
		1.063.880	6,60
Deutschland			
500.000	Deutsche Bank AG 3,25 % 24.05.2028	492.803	3,06
600.000	ZF Finance GmbH 2,25 % 03.05.2028	502.086	3,11
		994.889	6,17
Irland			
500.000	BKIR 7,594 % 06.12.2032	598.199	3,71
620.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 3 % 19.04.2051	476.389	2,95
		1.074.588	6,66
Italien			
295.000	Eni SpA 3,375 % 31.12.2049	262.080	1,62
Niederlande			
400.000	Enel Finance International NV 5,5 % 15.06.2052 *	336.204	2,08
200.000	Enel Finance International NV 7,75 % 14.10.2052 *	216.505	1,34
600.000	Iberdrola International BV 1,825 % 31.12.2049	489.909	3,04
		1.042.618	6,46
Portugal			
600.000	EDP - Energias de Portugal SA 1,875 % 02.08.2081	549.241	3,41
Südafrika			
200.000	Investec plc 6,75 % 31.12.2099	218.145	1,35
Vereinigtes Königreich			
500.000	Atlantica Sustainable Infrastructure plc 4,125 % 15.06.2028 *	445.713	2,76
526.000	Canary Wharf Group Investment Holdings plc 3,375 % 23.04.2028	445.034	2,76
240.000	Co-Operative Group Limited 11 % 20.12.2025	306.511	1,90
200.000	Co-Operative Group Limited 5,125 % 17.05.2024	229.068	1,42
300.000	HSBC Holdings PLC 8,11 % 11.03.2033	318.381	1,97
330.000	Just Group plc 7 % 15.04.2031	384.296	2,38
380.000	Legal & General Group plc 5,25 % 21.03.2047	354.073	2,20
500.000	Lloyds 2,707 % 12.03.2035	447.743	2,78
290.000	Nationwide Building Society 4,302 % 08.03.2029	261.213	1,62
700.000	NatWest Group plc 2,057 % 09.11.2028	703.634	4,36
390.000	Prudential plc 4,875 % 31.12.2027	323.587	2,01
		4.219.253	26,16
USA			
400.000	AT&T Inc 2,875 % 31.12.2049	384.110	2,38
300.000	Dell International LLC / Emc Corporation 8,1 % 15.07.2036 *	336.924	2,09
500.000	Hewlett Packard Enterprise Company 6,35 % 15.10.2045	501.237	3,11
460.000	Magallanes Inc 5,391 % 15.03.2062 *	338.277	2,10
1.260.000	MidAmerican Energy Company 4,25 % 15.07.2049	1.086.334	6,73
	Nextera Energy Capital Holdings Inc 5,65 % 01.05.2079*	330.496	2,05
400.000	PepsiColinc 3,90 % 18.07.2032 *	378.590	2,34
800.000	Verizon Communications Inc 3,875 % 01.03.2052	611.144	3,79
500.000	Walmart Inc 1,8 % 22.09.2031	408.118	2,53
		4.375.230	27,12
Summe Unternehmensanleihen		14.593.747	90,47
Futures-Kontrakte (a)			
USA			
(13)	US 10 Year Note (CBT) März 2023	1.734	0,01
(6)	US Ultra Bond CBT März 2023	4.594	0,03
		6.328	0,04
Summe Futures-Kontrakte		6.328	0,04
Staatsanleihen			
Deutschland			
200.000	Bundesrepublik Deutschland 1,75 % 15.02.2024	211.795	1,31
Italien			
500.000	Buoni Poliennali Del Tes 1,50 % 30.04.2045	297.539	1,85
Vereinigtes Königreich			
400.000	United Kingdom Gilt 0,88 % 31.07.2033	359.277	2,23
Summe Staatsanleihen		868.611	5,39

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Sustainable Strategic Income (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
1.634.476 EUR	1.734.586 USD	5. Januar 2023	4	10.552	0,06
1.833 EUR	1.941 USD	6. Januar 2023	2	16	0,00
25 USD	24 EUR	6. Januar 2023	2	-	0,00
4.546.636 USD	3.696.331 GBP	5. Januar 2023	3	99.613	0,62
1.788.963 USD	1.475.015 GBP	6. Januar 2023	2	14.338	0,09
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				124.519	0,77
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				15.593.205	96,67

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Sustainable Strategic Income (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
14.919.600 GBP	18.106.113 USD	6. Januar 2023	1	(155.999)	(0,97)
5.503.463 USD	5.209.037 EUR	5. Januar 2023	4	(58.254)	(0,36)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(214.253)	(1,33)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(214.253)	(1,33)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				15.593.205	96,67
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(214.253)	(1,33)
Sonstiges Nettovermögen				752.362	4,66
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				16.131.314	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate

(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	74,57
In Klassifizierung (a) oben beschriebene börsengehandelte Finanzderivate	0,04
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	0,71
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	13,59
Sonstiges Umlaufvermögen	11,09
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Wandelanleihen			
China			
762.000	Momo Inc 1,25 % 07.01.2025 *	730.026	3,11
Irland			
400.000	COPNSW 2,5 % 05.12.2023	409.771	1,75
Niederlande			
1.000.000	Pharming Group NV 3 % 21.01.2025	969.597	4,14
Summe Wandelanleihen		2.109.394	9,00
Unternehmensanleihen			
Australien			
900.000	NCIG Holdings Pty Limited 12,5 % 26.08.2031 *	882.675	3,77
250.000	Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Limited 4,7 % 12.05.2031 *	192.098	0,82
700.000	PMBROV 10 % 21.12.2028	673.071	2,87
		1.747.844	7,46
Österreich			
800.000	Raiffeisen Bank International AG 6 % 31.12.2032	696.910	2,97
Belgien			
200.000	VGPBB 1,63 % 17.01.2027	161.899	0,69
Chile			
372.943	Empresa Electrica Cochrane SPA 5,5 % 09.11.2027 *	345.511	1,47
Zypern			
700.000	Bank of Cyprus Holdings plc 6,625 % 23.10.2031	643.157	2,75
597.000	Gunvor Group Limited 6,25 % 30.09.2026	539.882	2,30
		1.183.039	5,05
Deutschland			
1.400.000	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,5 % 25.01.2027	1.113.314	4,75
300.000	Sirius Real Estate Limited 1,125 % 22.06.2026	250.010	1,07
1.000.000	Sirius Real Estate Limited 1,75 % 24.11.2028	731.461	3,12
		2.094.785	8,94
Guernsey			
486.000	Summit Properties Limited 2 % 31.01.2025	450.809	1,92
Ungarn			
100.000	Raiffeisen Bank zrt 8,75 % 22.11.2025	109.688	0,47
Irland			
200.000	Bank of Cyprus Holdings plc 12,5 % 31.12.2049 Perpetual	209.042	0,89
218.000	IPMID 13,75 % PERP 19.10.2032	251.258	1,07
		460.300	1,96
Insel Man			
600.000	MAS Real Estate Inc 4,25 % 19.05.2026	505.345	2,16
Luxemburg			
775.000	ADVZCN 6,25 % 01.04.2028	761.245	3,25
1.018.000	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2,125 % 19.11.2025	890.898	3,80
1.525.000	GTC Aurora Luxembourg SA 2,25 % 23.06.2026	1.198.288	5,11
1.300.000	Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	1.123.814	4,79
		3.974.245	16,95
Malta			
800.000	Bovmv 10 % 12.06.2027	869.433	3,71
Niederlande			
600.000	CTP NV 1,5 % 27.09.2031	385.667	1,64
Norwegen			
750.000	Athomstart Invest 585 AS 11,75 % 29.09.2026	740.543	3,16
700.000	Nordlig Rutile AS 12,5 % 09.11.2027	637.049	2,72
		1.377.592	5,88
Portugal			
200.000	NOVBNC 4,25 % 15.09.2023	211.298	0,90
500.000	Novo Banco SA 8,5 % 06.07.2028	509.025	2,17
		720.323	3,07
Rumänien			
598.000	Gwln 3 % 29.03.2025	559.265	2,39
Singapur			
588.000	Trafigura Group Pte Limited 7,5 % 31.07.2034	631.321	2,69
Slowenien			
700.000	Nova Ljubljanska Banka dd 10,75 % 28.11.2032	758.543	3,24
Südafrika			
800.000	Investec PLC 9,125 % 06.03.2033	978.290	4,17
Schweden			
700.000	Betsson AB 6,318 % 23.06.2025	760.227	3,24
200.000	Ored Holding AB 8,5 % 22.04.2025 #	212.473	0,91
		972.700	4,15
Schweiz			
650.000	Credit Suisse Group AG 7,75 % 01.03.2029	690.560	2,95

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettöver- mögens
Unternehmensanleihen (Fortsetzung)			
Vereinigtes Königreich			
784.000	BATSLN 3,75 % 22.09.2031 Perpetual_Barc	603.763	2,58
200.000	BATSLN 3,75 % 22.09.2031 Perpetual_BNYM	154.021	0,66
550.000	Chesnara plc 4,75 % 04.08.2032	486.563	2,08
275.000	IG Group Holdings plc 3,125 % 18.11.2028	251.550	1,07
975.000	Intermediate Capital Group plc 2,5 % 28.01.2030	740.510	3,16
890.000	International Personal Finance plc 9,75 % 12.11.2025	793.303	3,38
100.000	Investec Bank PLC 4,25 % 24.07.2080	119.151	0,51
449.000	Jerrold Finco plc 5,25 % 15.01.2027	450.564	1,92
470.000	Lancashire Holdings Limited 5,625 % 18.09.2041	372.428	1,59
1.000.000	Marex Group plc 13,25 % 31.12.2032	1.018.830	4,35
583.000	Mlrhom Float 15.05.2028	461.989	1,97
630.000	Provident Financial plc 8,875 % 13.01.2032	680.442	2,90
940.000	SBRYBK 10,5 % 03.12.2033	1.184.435	5,05
809.000	Shawbrook Group plc 9 % 10.10.2030	945.786	4,03
1.000.000	Utmost Group plc 6,125 % 31.12.2032	981.194	4,19
		9.244.529	39,44
USA			
383.000	MPW 3,692 % 06.05.2028	338.682	1,45
375.000	PETROFAC Limited SR SEC REGS NT26 9,75 % 15.11.2026 *	214.116	0,91
		552.798	2,36
Summe Unternehmensanleihen		29.471.396	125,73
Futures-Kontrakte (a)			
Deutschland			
(1)	Euro Bund Future März 2023	9.029	0,04
USA			
(2)	US 10 Year Note (CBT) März 2023	1.218	0,00
Summe Futures-Kontrakte		10.247	0,04

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Dynamic Income (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**(b)

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn USD	% des Nettovermögens
148.000 EUR	157.496 USD	12. Januar 2023	1	602	0,00
2.262 EUR	2.360 USD	31. Januar 2023	8	59	0,00
2.668 GBP	3.196 USD	31. Januar 2023	1	17	0,00
5.157.679 USD	4.195.460 GBP	12. Januar 2023	2	109.151	0,47
Summe nicht realisierter Gewinne aus Devisenterminkontrakten				109.829	0,47
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				31.700.866	135,24

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Dynamic Income (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten

Nennwert	Beschreibung	Beizulegender Zeitwert USD	% des Nettover- mögens
	Credit Default Swaps		
	Europäische Union		
	TUI AG 500 0 Bp 20. Dezember 2027 JP Morgan		
(250.500)	Securities Limited Liability Company	(50.343)	(0,21)
	TUI AG 500 0 Bp 20. Juni 2027 JP Morgan Securities		
(490.000)	Limited Liability Company	(92.669)	(0,40)
		(143.012)	(0,61)
	Summe Credit Default Swaps	(143.012)	(0,61)

Man Funds plc

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2022

(Fortsetzung)

Man GLG Dynamic Income (Fortsetzung)



Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Erläuterung 4)**

Forderung	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust USD	% des Nettovermögens
500.000 EUR	602.707 USD	12. Januar 2023	1	(1.041)	(0,01)
208.249 GBP	251.886 USD	31. Januar 2023	3	(1.157)	(0,01)
11.286.764 USD	10.690.880 EUR	12. Januar 2023	5	(133.575)	(0,56)
Summe nicht realisierter Verluste aus Devisenterminkontrakten				(135.773)	(0,58)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(278.785)	(1,19)
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Vermögenswerte - Handel				31.700.866	135,24
Summe erfolgswirksam zum Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten - Handel				(278.785)	(1,19)
Sonstige Nettverbindlichkeiten				(7.981.249)	(34,05)
Den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuordnendes Nettovermögen				23.440.832	100,00

**Die Devisenterminkontrakte werden bei The Bank of New York Mellon gehalten.

(a) Börsengehandelte Derivate
(b) OTC-Finanzderivat

* An einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere

#Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die an einer offiziellen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Alle anderen zum Jahresende gehaltenen Anlagen sind übertragbare Wertpapiere, die an einer offiziellen Börse notiert sind

Zusammensetzung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere	70,82
In Klassifizierung (a) oben beschriebene börsengehandelte Finanzderivate	0,03
In Klassifizierung (b) oben beschriebene OTC-Finanzderivate	0,27
Übertragbare Wertpapiere gemäß Beschreibung in # oben	0,52
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden gemäß Beschreibung unter * oben	5,77
Sonstiges Umlaufvermögen	22,59
	100,00

Gemäß OGAW-Mitteilung 8.2, Anhang B ist eine Analyse des Gesamtvermögens anstelle des Nettovermögens erforderlich.

Man Funds plc

Man GLG Global Convertibles

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
Electricite de France SA 0 % 14.09.2024	445.300	6.188.302
STMicroelectronics NV 0 % 04.08.2025	5.200.000	5.854.292
America Movil BV 0 % 02.03.2024	4.100.000	4.439.434
SAFFP 0,88 % 15.05.2027	26.070	3.659.122
LUV 0,25 % 01.05.2025	2.267.000	2.851.650
CLNXSM 0,75 % 20.11.2031	3.400.000	2.800.241
Ford Motor Company	2.090.000	2.689.354
QIAGEN NV 0,50 % 13.09.2023	2.200.000	2.520.580
Lumentum Holdings Inc 0,50 % 15.12.2026	2.314.000	2.475.588
SEALTD 2,38 % 01.12.2025	1.900.000	2.221.019
Cerah Capital Limited 0 % 08.08.2024	2.232.000	2.202.672
AMSSM 1,5 % 09.04.2025	1.500.000	2.152.878
ANAIK 0 % 10.12.2031	250.000.000	2.107.375
Royal Caribbean Group SR CV NT 4,25 % 15.06.2023	1.865.000	2.060.465
Delivery Hero SE 0,25 % 23.01.2024	1.900.000	2.058.574
ZALGR 0,63 % 06.08.2027	2.000.000	2.046.877
Square Inc SR NT 0,125 % 01.03.2025	1.845.000	1.923.867
Splunk Inc 1,125 % 15.09.2025	1.833.000	1.908.572
Etsy Inc 0,125 % 01.09.2027	1.797.000	1.868.200
Li Auto Inc 0,25 % 01.05.2028	1.650.000	1.867.777

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
United States Treasury Bill 0 % 10.02.2022	(20.000.000)	(20.000.000)
United States Treasury Bill 0 % 21.04.2022	(20.000.000)	(19.992.749)
United States Treasury Bill 0 % 05.05.2022	(20.000.000)	(19.988.642)
Electricite de France SA 0 % 14.09.2024	(526.300)	(7.535.996)
STMicroelectronics NV 0 % 04.08.2024	(5.200.000)	(5.806.274)
SAFFP 0,88 % 15.05.2027	(27.970)	(3.837.898)
QIAGEN NV 0,50 % 13.09.2023	(3.000.000)	(3.548.172)
Meituan 0 % 27.04.2027	(4.300.000)	(3.512.560)
Total SA 0,5 % 02.12.2022	(3.400.000)	(3.492.070)
DISH Network Corporation 3,375 % 15.08.2026	(4.296.000)	(3.380.328)
America Movil BV 0 % 02.03.2024	(2.700.000)	(3.121.928)
CLNXSM 0,75 % 20.11.2031	(3.500.000)	(3.120.489)
MLFP 0 % 10.11.2023	(2.600.000)	(2.622.506)
NIPSTL 0 % 05.10.2026	(330.000.000)	(2.620.035)
LG Display Company Limited 1,5 % 22.08.2024	(2.400.000)	(2.408.400)
SBI Holdings Inc 0 % 13.09.2023	(290.000.000)	(2.398.701)
Carrefour SA 0 % 27.03.2024	(2.200.000)	(2.352.596)
Iberdrola International BV 0 % 11.11.2022	(1.700.000)	(2.280.228)
Link 2019 CB Limited 1,6 % 03.04.2024	(18.000.000)	(2.275.845)
Cerah Capital Limited 0 % 08.08.2024	(2.232.000)	(2.202.672)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG RI European Equity Leaders

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten EUR
France Treasury Bill BTF 0 % 01.02.2023	25.000.000	24.939.790
France Treasury Bill BTF 0 % 08.02.2028	25.000.000	24.931.632
France Treasury Bill BTF 0 % 11.01.2023	20.000.000	19.973.424
France Treasury Bill BTF 0 % 18.01.2023	20.000.000	19.970.303
France Treasury Bill BTF 0 % 04.01.2023	15.000.000	14.982.823
France Discount Treasury Bill 0 % 25.01.2023	15.000.000	14.977.824
EssilorLuxottica	54.705	9.245.375
Genmab AS	29.307	9.016.306
Cie de Saint-Gobain	140.102	8.917.373
Teleperformance	27.697	8.568.744
Lonza Group AG	13.856	8.045.175
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	5.741	3.937.601
EDP - Energias de Portugal SA	865.076	3.694.432
Vivendi SE	294.656	3.532.784
Vestas Wind Systems AS	148.164	3.497.269
Carlsberg AS	20.041	2.639.567
Experian plc	84.102	2.513.695
SIG Combibloc Group AG	123.814	2.411.724
Roche Holding AG	7.037	2.349.352
AstraZeneca plc	23.465	2.338.262

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse EUR
AstraZeneca plc	(123.382)	(14.941.328)
EDP - Energias de Portugal SA	(3.129.867)	(14.319.640)
TotalEnergies SE	(246.749)	(12.980.130)
London Stock Exchange Group plc	(136.144)	(12.037.062)
Vestas Wind Systems AS	(471.965)	(12.028.847)
UBS Group AG	(720.787)	(12.012.382)
Lloyds Banking Group plc	(21.669.067)	(11.866.023)
Roche Holding AG	(37.102)	(11.793.366)
Genmab AS	(29.307)	(11.108.410)
Credit Agricole SA	(947.992)	(10.589.765)
Barclays plc	(5.208.994)	(10.199.740)
Reckitt Benckiser Group plc	(138.650)	(9.865.923)
ASML Holding NV	(15.935)	(9.165.207)
Sanofi	(99.781)	(8.881.091)
EssilorLuxottica	(54.705)	(8.745.777)
SIG Combibloc Group AG	(393.129)	(8.383.461)
Schneider Electric SE	(58.345)	(8.352.419)
SAP SE	(75.898)	(7.931.252)
Carlsberg AS	(58.111)	(7.669.846)
Neste OYJ	(165.898)	(7.437.257)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten JPY
Panasonic Holdings Corporation	9.342.000	10.857.284.579
Nissan Motor Company Limited	19.028.900	9.231.337.619
Mitsubishi Estate Company Limited	5.131.500	9.149.790.627
Mizuho Financial Group Inc	5.460.900	9.135.698.696
Makita Corporation	2.845.400	8.725.918.770
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	11.539.800	8.163.287.021
Sumitomo Chemical Company Limited	13.083.600	6.742.356.755
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	1.634.100	6.679.590.052
Asahi Kasei Corporation	6.144.500	6.439.558.585
Daiwa House Industry Company Limited	1.996.700	6.242.474.715
Mitsubishi Electric Corporation	4.441.500	6.048.506.308
Honda Motor Company Limited	1.699.800	5.731.391.552
Komatsu Limited	1.958.900	5.499.367.831
Sumitomo Realty & Development Company Limited	1.622.800	5.488.853.619
Resona Holdings Inc	10.417.700	5.351.744.065
Toyota Industries Corporation	689.700	5.299.722.319
Toray Industries Inc	7.914.700	5.222.115.609
Kao Corporation	1.014.800	5.061.198.202
Kubota Corporation	2.474.700	4.986.387.460
T&D Holdings Inc	3.176.300	4.856.391.884

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse JPY
Toyota Motor Corporation	(6.162.890)	(12.593.303.163)
Mitsubishi Heavy Industries Limited	(2.417.300)	(10.475.498.360)
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	(1.984.000)	(9.219.971.246)
Kirin Holdings Corporation Limited	(4.056.300)	(8.967.170.349)
Nippon Telegraph & Telephone Corporation	(2.192.300)	(8.398.515.567)
Resona Holdings Inc	(13.517.200)	(7.821.200.922)
MS&AD Insurance Group Holdings Inc	(1.484.600)	(6.158.472.204)
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	(7.817.800)	(6.141.435.820)
Kao Corporation	(1.014.800)	(6.049.748.894)
Mazda Motor Corporation	(5.487.000)	(6.040.826.824)
Subaru Corporation	(2.533.200)	(6.040.225.049)
Honda Motor Company Limited	(1.733.000)	(5.869.015.855)
Nomura Holdings Inc	(10.759.900)	(5.367.818.557)
Kawasaki Heavy Industries Ltd	(1.893.700)	(5.317.610.600)
Mitsui & Company Limited	(1.221.300)	(4.362.310.646)
T&D Holdings Inc	(2.416.900)	(4.247.044.514)
KDDI Corporation	(968.500)	(4.208.067.674)
Mitsubishi Estate Company Limited	(2.218.300)	(4.201.941.152)
Inpex Corporation	(3.031.100)	(4.115.199.612)
Nippon Steel Corporation	(1.757.600)	(3.806.278.188)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man Numeric Emerging Markets Equity
Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)
Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
United States Treasury Bill 0 % 16.03.2023	18.950.000	18.609.691
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	182.400	17.780.642
United States Treasury Bill 0 % 04.05.2023	16.675.000	16.318.138
Petroleo Brasileiro SA	1.238.890	16.035.224
United States Treasury Bill 0 % 23.02.2023	16.125.000	15.874.626
United States Treasury Bill 0 % 18.08.2023	15.000.000	14.952.798
United States Treasury Bill 0 % 22.09.2022	15.000.000	14.933.631
United States Treasury Bill 0 % 25.08.2022	14.260.000	14.214.077
United States Treasury Bill 0 % 01.09.2022	14.225.000	14.174.422
United States Treasury Bill 0 % 08.09.2022	13.670.000	13.622.301
United States Treasury Bill 0 % 22.03.2023	12.335.000	12.139.348
United States Treasury Bill 0 % 26.01.2023	12.000.000	11.851.301
United States Treasury Bill 0 % 02.02.2023	11.475.000	11.314.159
United States Treasury Bill 0 % 29.12.2022	10.275.000	10.153.127
United States Treasury Bill 0 % 10.11.2022	10.085.000	10.015.637
United States Treasury Bill 0 % 15.09.2022	10.000.000	9.958.917
United States Treasury Bill 0 % 11.08.2022	9.970.000	9.940.680
Vale SA	492.004	7.874.224
Alibaba Group Holding Limited	78.500	6.975.352
Samsung Electronics Company Limited	108.918	5.984.131

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
United States Treasury Bill 0 % 31.03.2022	(38.340.000)	(38.340.000)
United States Treasury Bill 0 % 24.03.2022	(32.085.000)	(32.084.397)
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	(238.600)	(22.190.384)
Petroleo Brasileiro SA	(1.350.191)	(18.087.574)
United States Treasury Bill 0 % 06.01.2022	(16.000.000)	(16.000.000)
United States Treasury Bill 0 % 22.09.2022	(15.000.000)	(15.000.000)
United States Treasury Bill 0 % 18.08.2022	(15.000.000)	(14.974.672)
United States Treasury Bill 0 % 02.06.2022	(14.900.000)	(14.895.383)
United States Treasury Bill 0 % 25.08.2022	(14.260.000)	(14.234.345)
United States Treasury Bill 0 % 01.09.2022	(14.225.000)	(14.225.000)
United States Treasury Bill 0 % 08.09.2022	(13.670.000)	(13.669.464)
United States Treasury Bill 0 % 17.03.2022	(13.580.000)	(13.580.000)
Samsung Electronics Company Limited	(264.568)	(12.828.491)
United States Treasury Bill 0 % 24.02.2022	(12.010.000)	(12.010.000)
United States Treasury Bill 0 % 29.12.2022	(10.275.000)	(10.275.000)
United States Treasury Bill 0 % 10.11.2022	(10.085.000)	(10.085.000)
United States Treasury Bill 0 % 15.09.2022	(10.000.000)	(10.000.000)
United States Treasury Bill 0 % 11.08.2022	(9.970.000)	(9.962.422)
Alibaba Group Holding Limited	(90.860)	(8.506.725)
SK Hynix Inc	(108.015)	(8.197.763)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
Aker BP ASA	13.174	453.255
Open Text Corporation	7.400	303.533
Koninklijke DSM NV	1.540	271.433
Sonova Holding AG	779	269.542
Applied Materials Inc	2.000	268.328
Micron Technology Inc	3.400	268.317
Lam Research Corporation	460	262.254
Medtronic plc	2.500	257.905
Mondi plc	10.070	256.311
Kuehne + Nagel International AG	918	253.657
Becton Dickinson and Company	1.000	253.233
BOLIDEN AB	6.510	249.919
Asahi Kasei Corporation	26.300	249.154
Akzo Nobel NV	2.420	248.834
Cigna Corporation	1.100	248.218
Bristol-Myers Squibb Corporation	3.800	247.732
Norsk Hydro ASA	31.000	247.601
WW Grainger Inc	500	246.436
Mastercard Inc	630	246.409
AbbVie Inc	1.800	246.052

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
Microsoft Corporation	(2.730)	(842.904)
Vertex Pharmaceuticals Inc	(2.020)	(489.810)
Walmart Inc	(3.400)	(479.083)
Target Corporation	(1.890)	(412.180)
Apple Inc	(2.310)	(403.099)
CSX Corporation	(11.600)	(400.881)
United States Treasury Bill 0 % 10.03.2022	(390.000)	(389.999)
Alphabet Inc	(143)	(388.121)
Manulife Financial Corporation	(17.100)	(358.022)
NVIDIA Corporation	(1.726)	(325.898)
ServiceNow Inc	(510)	(299.133)
Booking Holdings Inc	(118)	(289.715)
Merck KGaA	(1.148)	(253.801)
EOG Resources Inc	(2.200)	(247.264)
Nintendo Company Limited	(500)	(244.646)
Synopsys Inc	(780)	(243.216)
Repsol SA	(17.912)	(229.360)
United States Treasury Bill 0 % 31.03.2022	(225.000)	(224.968)
Barclays plc	(81.725)	(221.240)
Illumina Inc	(830)	(208.550)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
United States Treasury Bill 0 % 18.05.2023	12.415.000	12.163.749
United States Treasury Bill 0 % 09.06.2022	8.800.000	8.794.843
United States Treasury Bill 0 % 23.02.2023	7.575.000	7.471.307
United States Treasury Bill 0 % 06.10.2022	7.170.000	7.130.766
United States Treasury Bill 0 % 20.04.2023	6.900.000	6.766.577
United States Treasury Bill 0 % 15.09.2022	6.590.000	6.562.450
Republic of Poland Government Bond 2,5 % 25.07.2026	30.010.000	5.945.633
United States Treasury Bill 0 % 23.03.2023	5.970.000	5.873.584
United States Treasury Bill 0 % 05.10.2023	3.840.000	3.679.167
United States Treasury Bill 0 % 13.07.2023	3.555.000	3.458.921
United States Treasury Bill 0 % 28.07.2022	3.255.000	3.247.958
United States Treasury Bill 0 % 18.08.2022	3.250.000	3.240.631
Mexican Bonos 7,75 % 13.11.2042	695.000	2.991.832
Hungary Government Bond 3 % 27.10.2027	1.259.500.000	2.968.652
Republic of South Africa Government Bond 8,5 % 27.10.2027	44.050.000	2.340.509
Mexican Bonos 8 % 07.11.2047	514.000	2.308.733
MGS 3,582 % 15.07.2032	10.260.000	2.220.718
United States Treasury Bill 0 % 10.08.2023	2.200.000	2.130.746
Indonesia Treasury Bond 5,625 % 15.05.2023	20.911.000.000	1.434.621
United States Treasury Bill 0 % 21.07.2022	1.075.000	1.072.985

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
United States Treasury Bill 0 % 06.01.2022	(8.800.000)	(8.800.000)
United States Treasury Bill 0 % 09.06.2022	(8.800.000)	(8.792.147)
United States Treasury Bill 0 % 23.02.2023	(7.540.000)	(7.437.995)
United States Treasury Bill 0 % 24.03.2022	(7.170.000)	(7.169.971)
United States Treasury Bill 0 % 06.10.2022	(7.170.000)	(7.137.713)
United States Treasury Bill 0 % 15.09.2022	(6.590.000)	(6.562.014)
United States Treasury Bill 0 % 10.03.2022	(6.485.000)	(6.484.961)
United States Treasury Bill 0 % 23.03.2023	(5.770.000)	(5.674.045)
United States Treasury Bill 0 % 12.05.2022	(3.575.000)	(3.574.521)
United States Treasury Bill 0 % 28.07.2022	(3.255.000)	(3.254.867)
United States Treasury Bill 0 % 18.08.2022	(3.250.000)	(3.239.400)
United States Treasury Bill 0 % 20.04.2023	(3.090.000)	(3.031.885)
United States Treasury Bill 0 % 24.02.2022	(2.795.000)	(2.795.000)
Peruvian Government International Bond 6,9 % 12.08.2037	(9.130.000)	(2.354.470)
Czech Republic Government Bond 0,45 % 25.10.2023	(54.510.000)	(2.064.393)
Colombian TES 7,5 % 26.08.2026	(9.053.400.000)	(1.495.056)
United States Treasury Bill 0 % 23.06.2022	(1.210.000)	(1.208.889)
United States Treasury Bill 0 % 02.06.2022	(1.190.000)	(1.189.390)
United States Treasury Bill 0 % 27.01.2022	(1.150.000)	(1.150.000)
United States Treasury Bill 0 % 21.07.2022	(1.075.000)	(1.072.926)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
United States Treasury Bill 0 % 07.09.2023	3.780.000	3.641.347
United States Treasury Bill 2,75 % 15.08.2032	3.800.000	3.487.273
United States Treasury Bill 0 % 20.04.2023	3.395.000	3.327.897
United States Treasury Bill 0 % 30.11.2023	2.375.000	2.269.483
United States Treasury Bill 0 % 15.06.2023	1.790.000	1.741.013
United States Treasury Bill 0 % 02.11.2023	1.805.000	1.726.776
United States Treasury Bill 0 % 05.10.2023	1.630.000	1.560.977
Petroleos Mexicanos 5,95 % 28.01.2031	2.000.000	1.540.310
United States Treasury Note/Bond 2,38 % 31.03.2029	1.600.000	1.538.569
United States Treasury Note/Bond 15.05.2032	1.300.000	1.243.633
United States Treasury Bill 0 % 10.08.2023	1.195.000	1.157.552
United States Treasury Bill 0 % 18.05.2023	1.065.000	1.042.690
United States Treasury Bill 0 % 08.09.2022	950.000	946.492
United States Treasury Bill 0 % 26.01.2023	950.000	939.120
Republic of Turkey 5,88 % 26.06.2031	1.100.000	873.070
Romania 3 % 14.02.2031	1.100.000	864.723
Argentine Republic Government International Bond 0,125 % 09.07.2030	2.750.000	845.668
Saudi International Bond 4 % 17.04.2025	800.000	842.400
Mexico Government International Bond 3,6 % 30.01.2025	800.000	826.495
Arab Republic of Egypt 7,63 % 29.05.2032	900.000	651.825

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
United States Treasury Bill 0 % 07.07.2022	(3.605.000)	(3.598.780)
United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15.08.2032	(3.800.000)	(3.517.047)
United States Treasury Bill 0 % 20.04.2023	(3.395.000)	(3.324.502)
United States Treasury Bill 0 % 03.03.2022	(3.145.000)	(3.144.835)
United States Treasury Bill 0 % 07.09.2023	(2.380.000)	(2.293.241)
INDON 2,85 % 14.02.2030	(1.950.000)	(1.826.221)
Mexico Government International Bond 3,25 % 16.04.2030	(2.000.000)	(1.818.621)
United States Treasury Bill 0 % 15.06.2023	(1.790.000)	(1.742.827)
United Mexican States 2,66 % 24.05.2031	(1.850.000)	(1.637.018)
Colombia Government International Bond 3 % 30.01.2030	(2.000.000)	(1.561.680)
United States Treasury Note/Bond 2,38 % 31.03.2029	(1.600.000)	(1.538.494)
United States Treasury Bill 0 % 28.04.2022	(1.365.000)	(1.364.737)
United States Treasury Note/Bond 2,88 % 15.05.2032	(1.300.000)	(1.270.544)
United States Treasury Bill 0 % 10.08.2023	(1.195.000)	(1.154.945)
Abu Dhabi Government International Bond 2,5 % 30.09.2029	(1.150.000)	(1.115.486)
United States Treasury Bill 0 % 18.05.2023	(1.065.000)	(1.039.529)
United States Treasury Note/Bond 0,88 % 15.11.2030	(1.200.000)	(1.035.335)
Peruvian Government International Bond 2,844 % 20.06.2030	(1.000.000)	(963.428)
Angolan Government International Bond 8,25 % 09.05.2028	(1.130.000)	(950.025)
United States Treasury Bill 0 % 02.06.2022	(950.000)	(949.284)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG Pan-European Equity Growth
Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)
Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten EUR
Abcam plc	1.524.242	22.937.631
Kingspan Group plc	49.582	4.277.484
Nestle SA	34.834	3.912.497
Ryanair Holdings plc	253.266	3.180.869
L'Oreal SA	9.000	3.159.372
Remy Cointreau SA	15.851	2.973.141
Roche Holding AG	7.119	2.762.357
Assa Abloy AB	122.195	2.629.242
AstraZeneca plc	19.894	2.595.631
Hermes International	1.810	2.323.380
ASML Holding NV	3.781	2.006.310
Delivery Hero SE	32.251	1.901.448
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.469	1.652.126
Novo Nordisk AS	13.142	1.445.661
Sika AG	4.100	1.180.544
SAP SE	11.430	1.114.311
EssilorLuxottica	6.257	998.420
Dr. Martens plc	250.493	991.145
Puma SE	14.030	911.442
Adyen NV	513	835.616

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse EUR
Abcam plc	(1.694.386)	(25.461.083)
Novo Nordisk AS	(190.137)	(18.807.349)
ASML Holding NV	(26.124)	(13.470.824)
Ferrari NV	(68.732)	(13.121.022)
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	(18.613)	(11.977.807)
Puma SE	(138.191)	(10.979.421)
L'Oreal SA	(31.007)	(10.801.544)
Ryanair Holdings plc	(713.918)	(10.285.225)
Logitech International SA	(181.213)	(9.878.153)
Chr Hansen Holding AS	(134.654)	(9.253.891)
Nestle SA	(76.269)	(8.572.501)
EssilorLuxottica	(34.401)	(5.565.009)
Moncler SpA	(110.310)	(5.213.695)
SAP SE	(48.455)	(4.801.178)
Adyen NV	(3.135)	(4.766.216)
AstraZeneca plc	(36.545)	(4.325.831)
Cherry AG	(234.637)	(4.113.028)
Partners Group Holding AG	(4.090)	(4.013.463)
The Watches of Switzerland Group plc	(293.961)	(3.571.977)
Delivery Hero SE	(82.341)	-3467169,28

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG RI Global Sustainable Growth
Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)
Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
SAP SE	39.765	4.678.916
Delivery Hero SE	61.445	4.431.094
ASML Holding NV	6.388	4.125.760
Microsoft Corporation	13.503	4.033.587
Thermo Fisher Scientific Inc	6.821	4.007.836
Novo Nordisk AS	27.319	2.834.848
S&P Global Inc	6.799	2.776.589
Abcam plc	159.781	2.718.443
Estee Lauder Cos Inc	10.310	2.713.670
Nestle SA	21.385	2.701.631
Adobe Inc	5.309	2.502.554
Schneider Electric SE	13.033	2.162.155
AstraZeneca plc	17.484	2.120.821
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.829	2.092.962
Adyen NV	872	1.784.170
L'Oreal SA	4.286	1.653.523
IDEXX Laboratories Inc	3.101	1.639.158
EssilorLuxottica	8.525	1.490.271
Visa Inc	6.658	1.470.898
Nike Inc	9.953	1.388.072

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
Novo Nordisk AS	(141.337)	(15.302.134)
Microsoft Corporation	(54.511)	(14.500.769)
Nestle SA	(107.045)	(12.651.790)
Visa Inc	(50.793)	(10.454.204)
S&P Global Inc	(25.563)	(9.268.852)
ASML Holding NV	(17.927)	(9.268.339)
NIKE Inc	(79.398)	(9.156.894)
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	(13.364)	(8.885.427)
Adobe Inc	(21.863)	(8.582.332)
L'Oreal SA	(23.911)	(8.491.214)
SAP SE	(87.858)	(8.018.938)
EssilorLuxottica	(43.319)	(6.949.746)
Edwards Lifesciences Corporation	(66.045)	(6.724.083)
Delivery Hero SE	(135.439)	(6.457.203)
ANSYS Inc	(22.854)	(6.015.387)
Chr Hansen Holding AS	(97.462)	(5.801.051)
Adyen NV	(3.671)	(5.715.559)
Illumina Inc	(22.012)	(5.608.747)
Moncler SpA	(114.769)	(5.565.831)
AstraZeneca plc	(45.254)	(5.534.561)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man Numeric Europe RI Climate

(vormals Man Numeric RI European Equity)

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten EUR
German Treasury Bill 0 % 20.07.2022	6.300.000	6.321.180
German Treasury Bill 0 % 22.06.2022	6.300.000	6.317.271
Aker BP ASA	21.216	674.697
Enel SpA	106.700	618.037
Boliden AB	16.840	613.742
GSK plc	32.592	602.149
Deutsche Post AG	11.190	546.350
Siemens AG	3.805	517.067
TotalEnergies SE	9.380	480.245
Swiss Re AG	5.070	477.476
Swisscom AG	937	476.324
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	45.620	473.181
Relx plc	17.120	470.632
Experian plc	12.320	462.306
DNB Bank ASA	21.150	460.290
Neste OYJ	11.300	459.903
Kesko OYJ	17.700	457.572
Geberit AG	785	457.342
Wartsila OYJ ABP	42.000	454.545
Galp Energia SGPS SA	45.170	450.475

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse EUR
German Treasury Bill 0 % 20.07.2022	(6.300.000)	(6.320.112)
German Treasury Bill 0 % 22.06.2022	(6.300.000)	(6.316.316)
Deutsche Börse AG	(2.836)	(470.550)
Diageo plc	(10.010)	(453.353)
Vodafone Group plc	(291.322)	(447.733)
ASR Nederland NV	(10.581)	(443.013)
DNB Bank ASA	(21.150)	(438.162)
Repsol SA	(37.755)	(429.973)
3i Group plc	(25.473)	(426.809)
ASML Holding NV	(702)	(421.596)
Covestro AG	(10.528)	(415.423)
Koninklijke KPN NV	(142.500)	(410.305)
Allianz SE	(2.003)	(407.878)
Leg Immobilien SE	(3.492)	(404.607)
Svenska Handelsbanken AB	(43.887)	(401.737)
Barclays plc	(162.511)	(390.673)
Vestas Wind Systems AS	(14.080)	(379.697)
Lundin Energy MergerCo AB	(11.679)	(373.864)
Nibe Industrier AB Klasse B	(38.400)	(366.772)
Norsk Hydro ASA	(45.400)	(353.434)

Die Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG RI Sustainable European Income
(vormals Man GLG European Income Opportunities)

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten EUR
EasyJet plc	289.240	2.065.561
Nordea Bank ABP	210.000	2.064.378
Vonovia SE	55.000	1.587.120
Rubis SCA	52.550	1.498.065
SSP Group Plc	420.886	1.371.499
Cie de Saint-Gobain	25.000	1.199.614
Erste Group Bank AG	30.000	967.524
Nestle SA	7.488	863.910
Deutsche Post AG	20.542	798.073
Teleperformance	3.650	783.574
Holcim Limited	15.814	764.295
Orron Energy AB	20.000	739.386
Credit Agricole SA	62.500	679.915
Intesa Sanpaolo SpA	315.000	671.380
Fortum OYJ	60.000	655.616
Koninklijke Vopak NV	20.673	590.678
Allianz SE	2.750	552.289
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2.000	504.261
Kone OYJ	10.431	502.384
Diageo plc	10.484	464.053

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse EUR
Iberdrola SA	(209.352)	(2.190.386)
Credit Agricole SA	(192.500)	(2.076.910)
Nordea Bank ABP	(210.000)	(2.039.840)
Sanofi	(22.000)	(2.023.539)
Allianz SE	(9.250)	(1.962.232)
Grifols SA	(180.000)	(1.787.112)
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	(7.000)	(1.732.157)
Intesa Sanpaolo SpA	(750.000)	(1.539.845)
Experian plc	(45.000)	(1.527.740)
SAP SE	(15.324)	(1.479.759)
Danone SA	(25.000)	(1.371.566)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	(132.500)	(1.353.813)
Tryg AS	(63.000)	(1.304.040)
SIG Combibloc Group AG	(57.484)	(1.286.902)
Vinci SA	(13.500)	(1.273.297)
Deutsche Börse AG	(7.750)	(1.240.670)
Essity AB	(50.000)	(1.230.601)
Anglo American plc	(27.500)	(1.211.790)
Roche Holding AG	(3.413)	(1.155.505)
Nestle SA	(9.488)	(1.099.751)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man Numeric China A Equity

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
United States Treasury Bill 0 % 25.08.2022	1.981.700	1.974.838
United States Treasury Bill 0 % 01.09.2022	1.981.600	1.974.437
United States Treasury Bill 0 % 08.09.2022	1.981.700	1.974.046
United States Treasury Bill 0 % 02.03.2023	415.000	408.417
United States Treasury Bill 0 % 11.05.2023	405.000	396.478
Zijin Mining Group Company Limited	256.100	383.991
Kweichow Moutai Company Limited	1.400	373.796
Ping an Insurance Group Company of China Limited	54.300	357.360
China Merchants Bank Company Limited	60.700	356.491
Changchun High & New Technology Industries Inc	12.000	316.075
Zhejiang Orient Gene Biote	8.329	298.741
Hubei Jumpcan Pharmaceutical Company Limited	73.700	287.468
Eastern Air Logistics Company	86.900	271.398
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	5.900	266.553
Fuyao Glass Industry Group Company Limited	40.300	263.971
China State Construction Engineering Corporation Limited	323.400	261.523
Anhui Jinhe Industrial Company Limited	42.800	256.288
Postal Savings Bank of China Company Limited	287.600	255.709
BOE Technology Group Company Limited	467.899	248.405
Ping an Bank Company Limited	121.700	246.595

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
United States Treasury Bill 0 % 08.09.2022	(1.981.700)	(1.975.444)
United States Treasury Bill 0 % 25.08.2022	(1.981.700)	(1.974.469)
United States Treasury Bill 0 % 01.09.2022	(1.981.600)	(1.973.851)
Kweichow Moutai Company Limited	(2.900)	(726.929)
China Yangtze Power Company Limited	(212.100)	(680.619)
China State Construction Engineering Corporation Limited	(589.700)	(495.324)
China Petroleum & Chemical Corporation	(766.600)	(480.259)
BOE Technology Group Company Limited	(894.599)	(479.179)
Wanhua Chemical Group Company Limited	(34.300)	(430.573)
Shaanxi Coal Industry Company Limited	(157.500)	(410.222)
Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Company Limited	(8.800)	(404.443)
Zhejiang Orient Gene Biote	(13.736)	(382.239)
Contemporary Ampere Technology Company Limited	(5.000)	(361.842)
Hongfa Technology Company Limited	(54.305)	(339.678)
Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	(66.800)	(332.602)
Bank of Nanjing Company Limited	(210.800)	(323.254)
Guotai Junan Securities Company Limited	(128.300)	(321.127)
BYD Company Limited	(8.900)	(318.844)
CITIC Securities Company Limited	(99.200)	(312.990)
China Coal Energy Company Limited	(252.200)	(305.314)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG Strategic Bond

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten GBP
United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15.11.2023	235.363.200	191.673.034
United States Treasury Note/Bond 3 % 15.08.2052	159.570.100	121.278.570
United States Treasury Note/Bond 2 % 31.05.2024	128.783.400	102.282.605
United States Treasury Note/Bond 1,88 % 15.02.2032	104.260.000	77.904.118
UNITED KINGDOM GILT 1,25 % 31.07.2051	67.500.000	44.823.238
United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15.08.2032	49.135.000	38.797.046
United States Treasury Note/Bond 2,875 % 30.04.2025	36.185.100	29.690.827
United States Treasury Note/Bond 1,88 % 15.11.2051	44.310.800	29.179.983
United Kingdom Gilt 1,625 % 22.10.2071	25.351.300	28.326.385
TSY INFL IX Note/Bond 0,13 % 15.01.2032	25.865.977	21.822.766
United States Treasury Note/Bond 2,625 % 30.06.2023	26.000.000	20.133.598
United States Treasury Note/Bond 2,38 % 15.02.2042	26.507.000	18.492.921
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,75 % 15.01.2028	19.589.432	17.585.808
United Kingdom Gilt 3,5 % 22.07.2068	9.373.860	16.246.571
United Kingdom Gilt 4,25 % 06.07.2032	12.605.000	14.732.923
United States Treasury Note/Bond 2,88 % 15.05.2052	17.200.000	13.275.273
Buoni Poliennali DEL TES 2,50 % 01.12.2032	15.998.000	12.171.458
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65 % 01.03.2032	13.370.000	11.200.947
United States Treasury Note/Bond 1,63 % 15.05.2031	12.000.000	8.588.663
HSBC Holdings plc 5,875 %	7.744.000	7.819.540

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse GBP
United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15.11.2023	(236.297.000)	(192.402.960)
United States Treasury Note/Bond 3 % 15.08.2052	(159.570.100)	(118.678.960)
United States Treasury Note/Bond 2 % 31.05.2024	(116.726.000)	(93.215.519)
United States Treasury Note/Bond 1,88 % 15.02.2032	(117.922.000)	(88.344.350)
United Kingdom Gilt 1 % 31.07.2051	(67.500.000)	(44.517.929)
United States Treasury Note/Bond 1,88 % 15.11.2051	(64.803.800)	(42.281.318)
United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15.08.2032	(49.135.000)	(37.626.743)
United Kingdom Gilt 1,625 % 22.10.2071	(25.351.300)	(27.517.790)
United States Treasury Note/Bond 2,625 % 30.06.2023	(26.000.000)	(20.122.619)
United States Treasury Note/Bond 2,38 % 15.02.2042	(26.507.000)	(18.719.295)
United States Treasury Note/Bond 1,63 % 15.05.2031	(24.920.000)	(18.336.467)
TSY INFL IX Note/Bond 0,13 % 15.01.2032	(22.128.040)	(17.924.043)
Australian Government 1 % 21.12.2030	(33.552.000)	(16.538.112)
United Kingdom Gilt 3,25 % 22.07.2068	(9.373.860)	(16.489.816)
United Kingdom Gilt 4,25 % 06.07.2032	(12.605.000)	(13.541.687)
United States Treasury Note/Bond 2,88 % 15.05.2052	(17.200.000)	(13.195.200)
Buoni Poliennali DEL TES 2,50 % 01.12.2032	(15.998.000)	(11.961.219)
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65 % 01.03.2032	(13.370.000)	(10.989.403)
United States Treasury Note/Bond 2,875 % 30.04.2025	(12.660.000)	(10.879.404)
Santander UK plc	(6.063.000)	(10.280.788)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG Asia (ex Japan) Equity

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
Ping an Insurance Group Company of China Limited	515.500	2.993.001
Bank Mandiri Persero Tbk PT	4.640.423	2.540.306
BOC Hong Kong Holdings Limited	638.434	2.427.473
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	118.000	2.265.218
Bangkok Dusit Medical Services PCL	2.868.900	2.157.923
Pinduoduo Inc	34.703	2.123.187
Singapore Telecommunication	1.056.100	2.008.847
Trip.com Group Limited	72.278	1.966.476
Samsung Biologics Company Limited	2.951	1.940.492
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	48.749	1.917.615
Kweichow Moutai Company Limited	6.900	1.820.854
Chunghwa Telecom Company Limited	414.000	1.819.023
Yum China Holdings Inc	34.157	1.584.782
East Money Information Company Limited	450.100	1.575.415
Tsingtao Brewery Company Limited	178.000	1.572.585
Tencent Holdings Limited	36.737	1.570.423
Sands China Limited	704.400	1.559.616
Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	237.568	1.337.548
Chailease Holding Company Limited	204.000	1.328.186
Great Wall Motor Company Limited	664.500	1.308.637

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	(161.000)	(3.157.580)
WUXI Biologics Cayman Inc	(351.273)	(2.908.957)
DBS Group Holdings Limited	(104.546)	(2.622.267)
BOC Hong Kong Holdings Limited	(638.434)	(2.321.837)
Woori Financial Group Inc	(190.374)	(2.287.907)
China Mengniu Dairy Company Limited	(395.720)	(2.211.531)
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	(39.193)	(2.183.247)
Great Wall Motor Company Limited	(1.159.200)	(2.130.847)
NetEase Inc	(129.122)	(2.050.340)
Singapore Telecommunication	(1.056.100)	(2.008.217)
ICICI Bank Limited	(92.295)	(1.835.410)
Hongkong Land Holdings Limited	(401.333)	(1.818.166)
Chailease Holding Company Limited	(185.642)	(1.739.861)
Wiwynn Corporation	(52.500)	(1.720.921)
Infosys Limited	(86.368)	(1.719.376)
Bank Central Asia Tbk PT	(3.118.501)	(1.684.577)
XPENG Inc	(109.364)	(1.621.743)
Sands China Limited	(650.768)	(1.605.512)
Chunghwa Telecom Company Limited	(414.000)	(1.593.733)
Petronas Chemicals Group Berhad	(788.395)	(1.568.568)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
Bausch Health Companies Inc 5,25 % 30.01.2030	1.650.000	1.433.468
Warrior Met Coal Inc 7,875 % 01.12.2028	1.150.000	1.192.478
CenturyLink Inc 7,6 % 15.09.2039	1.000.000	979.537
Centene Corporation 3 % 15.10.2030	1.000.000	967.500
CenturyLink Inc 7,65 % 15.03.2042	950.000	939.118
PBF Holding Company LLC / PBF Finance Corporation 9,25 % 15.05.2025	750.000	746.875
Centene Corporation 2,5 % 01.03.2031	800.000	738.000
DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Company Inc 5,875 % 15.08.2027	700.000	617.994
IAMGOLD Corporation 5,75 % 15.10.2028	685.000	606.700
MPH Acquisition Holdings LLC 5,75 % 01.11.2028	700.000	584.320
Sylvamo Corporation 7 % 01.09.2029	550.000	574.750
Hughes Satellite Systems Corporation 6,625 % 01.08.2026	600.000	567.638
Graham Packaging Company Inc 7,125 % 15.08.2028	650.000	529.312
SeaWorld Parks & Entertainment Inc 5,25 % 15.08.2029	550.000	526.719
Primo Water Holdings Inc 4,375 % 30.04.2029	550.000	521.244
New Residential Investment Corporation 6,25 % 15.10.2025	550.000	516.900
PG&E Corporation 5,25 % 01.07.2030	575.000	515.104
Nordstrom Inc 4,375 % 01.04.2030	550.000	485.701
L Brands Inc 6,875 % 01.11.2035	535.000	476.066
CommScope Inc 8,25 % 01.03.2027	500.000	445.510

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
Atkore Inc 4,25 % 01.06.2031	(1.750.000)	(1.694.315)
Providence Service Corporation 5,875 % 15.11.2025	(1.600.000)	(1.617.383)
Iron Mountain Inc 4,50 % 15.02.2031	(1.800.000)	(1.613.056)
Louisiana-Pacific Corporation 3,625 % 15.03.2029	(1.700.000)	(1.600.612)
Bombardier Inc 7,875 % 15.04.2027	(1.630.000)	(1.556.767)
Tenet Healthcare Corporation 6,125 % 01.10.2028	(1.450.000)	(1.458.699)
Vista Outdoor Inc 4,5 % 15.03.2029	(1.550.000)	(1.447.738)
Frontier Communications Holdings LLC 5,875 % 01.11.2029	(1.550.000)	(1.423.251)
EnLink Midstream LLC 5,375 % 01.06.2029	(1.425.000)	(1.414.649)
BrightSphere Investment Group Inc 4,80 % 27.07.2026	(1.400.000)	(1.357.282)
Ford Motor Company 4,75 % 15.01.2043	(1.375.000)	(1.323.593)
TEGNA Inc 5 % 15.09.2029	(1.300.000)	(1.294.029)
News Corporation 3,875 % 15.05.2029	(1.350.000)	(1.271.855)
CenturyLink Inc 7,6 % 15.09.2039	(1.450.000)	(1.262.861)
World Acceptance Corporation 7 % 01.11.2026	(1.550.000)	(1.254.949)
Enova International Inc 8,5 % 01.09.2024	(1.250.000)	(1.218.025)
Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corporation 7,5 % 01.05.2025	(1.215.000)	(1.215.610)
VICI Properties LP / VICI Note Company Inc 4,25 % 01.12.2026	(1.200.000)	(1.202.774)
Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC 6,5 % 15.02.2029	(1.400.000)	(1.198.297)
Everi Holdings Inc 5 % 15.07.2029	(1.250.000)	(1.189.049)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	15.700.000	13.491.809
OWL Rock Core Income Corporation 3,125 % 23.09.2026	11.866.000	9.884.592
Chesnara plc 4,75 % 04.08.2032	9.185.000	9.509.624
FEL Energy VI Sarl 5,75 % 01.12.2040	12.385.011	9.062.656
Intermediate Capital Group plc 2,50 % 28.01.2030	9.917.000	8.414.438
Inversiones La Construccion SA 4,75 % 07.02.2032	12.156.000	8.272.151
GTCAPIW 2,75 % 23.06.2026	10.255.000	8.075.667
DVIVER 2,5 % 25.01.2027	8.200.000	7.335.454
IG Group Holdings plc 3,125 % 18.11.2028	8.217.000	7.159.367
NEPSJ 2 % 20.01.2030	10.502.000	6.939.924
Marex Group plc 13,25 %	7.454.000	6.754.447
EnQuest plc 7 % 15.10.2023	7.410.000	6.683.722
Investec plc 9,125 % 06.03.2033	5.500.000	6.550.594
SBRYBK 10,5 % 12.03.2033	5.260.000	6.302.957
Prospect Capital Corporation 3,437 % 15.10.2028	7.550.000	5.945.529
mBank SA 0,966 % 21.09.2027	6.600.000	5.423.974
BOVMV 10 % 06.12.2027	5.100.000	5.281.815
Sirius Real Estate Limited 1,75 % 24.11.2028	7.000.000	5.191.450
Pharming Group NV 3 % 21.01.2025	6.500.000	5.028.170
Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal Del Peruoracion 6,375 % 01.06.2028	5.751.132	4.905.337

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
OWL Rock Core Income Corporation 3,125 % 23.09.2026	(10.562.000)	(8.644.175)
Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	(6.900.000)	(5.990.578)
Inversiones La Construccion SA 4,75 % 07.02.2032	(9.117.000)	(5.951.049)
FEL Energy VI Sarl 5,75 % 01.12.2040	(7.069.293)	(4.933.523)
EnQuest plc 7 % 15.10.2023	(4.980.000)	(4.771.497)
Ceska sportelna AS 6,693 % 14.11.2025	(4.300.000)	(4.578.263)
Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal Del Perpctual 6,375 % 01.06.2028	(4.998.976)	(4.205.719)
Prospect Capital Corporation 3,437 % 15.10.2028	(5.420.000)	(4.077.749)
Sainsbury's Bank plc 23.11.2027	(3.594.000)	(3.828.345)
Raiffeisen Bank International AG 7,375 % 20.12.2032	(3.300.000)	(3.486.343)
Cromwell SPV Finance Pty Limited 2,5 % 29.03.2025	(3.200.000)	(3.287.360)
NEPSJ 2 % 20.01.2030	(5.314.000)	(3.245.291)
Genm Capital Labuan Limited 3,882 % 19.04.2031	(3.749.000)	(2.848.893)
Chesnara plc 4,75 % 04.08.2032	(2.975.000)	(2.813.654)
Marex Group plc 13,25 %	(3.400.000)	(2.695.215)
Citycon Treasury BV 2,375 % 15.01.2027	(3.370.000)	(2.690.319)
SBIOIN 0 % 29.06.2025	(2.430.000)	(2.558.543)
WIZZLN 1,35 % 19.01.2024	(2.453.000)	(2.521.732)
GUNVOR 6,75 % 30.09.2026	(3.341.000)	(2.330.967)
Shawbrook Group plc 7,875 %	(1.815.000)	(2.023.069)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG China Equity

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
Ping an Insurance Group Company of China Limited	147.500	840.608
Tencent Holdings Limited	12.100	675.887
Kweichow Moutai Company Limited	2.500	675.510
Pinduoduo Inc	9.521	574.009
Trip.com Group Limited	20.633	546.524
CSPC Pharmaceutical Group Limited	514.944	530.313
Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	85.799	484.914
Wuxi Lead Intelligent Equipment Company Limited	52.300	424.514
Hithink RoyalFlush Information Network Company Limited	30.630	421.186
Tencent Holdings Limited	9.164	415.962
United States Treasury Bill 0 % 06.10.2022	400.000	398.030
Pharmaron Beijing Company Limited	65.100	374.658
Zai Lab Limited	11.550	372.067
Airtac International Group	13.000	364.708
Yum China Holdings Inc	8.342	362.397
IRAY Technology Company Limited	4.884	358.944
Shenzhou International Group Holdings Limited	18.500	354.977
Sands China Limited	145.100	337.867
United States Treasury Bill 0 % 25.11.2022	300.000	297.756
United States Treasury Bill 0 % 23.03.2023	300.000	294.891

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
Tencent Holdings Limited	(20.000)	(1.091.050)
Wuxi Biologics Cayman Inc	(98.500)	(791.410)
CSPC Pharmaceutical Group Limited	(514.944)	(568.353)
China Mengniu Dairy Company Limited	(97.000)	(524.576)
Anhui Conch Cement Company Limited	(100.000)	(498.440)
Kweichow Moutai Company Limited	(2.500)	(487.515)
NETEASE Inc	(35.700)	(468.321)
Sands China Limited	(189.600)	(451.469)
TRIP.COM Group Limited	(19.000)	(448.222)
XPENG Inc	(32.700)	(446.848)
United States Treasury Bill 0 % 06.10.2022	(400.000)	(399.898)
Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	(85.799)	(350.498)
AK Medical Holdings Limited	(330.000)	(315.478)
United States Treasury Bill 0 % 25.11.2022	(300.000)	(297.512)
Leader Harmonious Drive SY	(71.922)	(271.533)
Shenzhou International Group Holdings Limited	(18.500)	(260.121)
Great Wall Motor Company Limited	(144.768)	(255.859)
United States Treasury Bill 0 % 21.04.2022	(250.000)	(250.000)
United States Treasury Bill 0 % 19.05.2022	(250.000)	(250.000)
United States Treasury Bill 0 % 28.04.2022	(250.000)	(250.000)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten EUR
American Water Works Company Inc	24.942	3.483.559
Veolia Environnement SA	101.635	2.681.765
Core & Main Inc	114.023	2.381.652
Danaher Corporation	8.998	2.214.308
Advanced Drainage Systems Inc	18.974	1.965.613
Thermo Fisher Scientific Inc	3.378	1.732.010
Republic Services Inc	15.153	1.673.988
Pennon Group plc	120.859	1.496.977
Clean Harbors Inc	16.823	1.458.461
Aalberts Industries NV	30.365	1.390.725
Essential Utilities Inc	31.215	1.377.570
Severn Trent plc	39.662	1.342.904
PTC Inc	12.646	1.304.934
Waste Connections Inc	11.848	1.289.262
Watts Water Technologies Inc	9.531	1.264.038
Valmont Industries Inc	4.352	1.190.210
Pool Corporation	2.841	1.123.969
Tetra Tech Inc	8.637	1.123.601
Avantor Inc	34.251	1.118.926
Agilent Technologies Inc	9.052	1.118.229

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse EUR
Core & Main Inc	(114.023)	(2.343.601)
American Water Works Company Inc	(10.906)	(1.527.002)
Advanced Drainage Systems Inc	(13.654)	(1.299.291)
Veolia Environnement SA	(34.418)	(783.761)
Clean Harbors Inc	(6.852)	(753.923)
Avantor Inc	(34.251)	(750.916)
Watts Water Technologies Inc	(5.358)	(747.886)
Rotork plc	(213.421)	(715.757)
Trimble Inc	(10.619)	(655.316)
Zebra Technologies Corporation	(2.343)	(646.333)
Masco Corporation	(13.007)	(608.257)
Sulzer AG	(9.168)	(606.535)
Autodesk Inc	(2.650)	(506.927)
Pool Corporation	(1.619)	(490.812)
Entegris Inc	(4.851)	(470.990)
Ebara Corporation	(12.600)	(462.132)
Republic Services Inc	(2.844)	(360.514)
Tetra Tech Inc	(2.340)	(360.466)
Arcadis NV	(9.656)	(355.977)
Hera SpA	(108.171)	(355.720)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG Sustainable Strategic Income
Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)
Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
United Kingdom GILT 0,875 % 31.07.2033	6.490.000	6.527.630
United Kingdom GILT 1,50 % 31.07.2053	2.230.000	2.037.710
Buoni Poliennali DEL TES 1,50 % 30.04.2045	1.530.000	1.266.473
MidAmerican Energy Company 4,25 % 15.07.2049	1.260.000	1.152.715
Bonos Y Oblig DEL Estado 1 % 30.07.2042	1.010.000	964.913
France (Government of) 1,75 % 25.06.2039	800.000	962.367
Bundesrepub.Deutschland 0 % 15.08.2031	900.000	951.304
Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV 2,75 % 20.02.2024	800.000	792.800
Bundesrepub.Deutschland 0 % 15.08.2050	1.270.000	743.321
NatWest Group plc 2,057 % 09.11.2028	700.000	645.468
Canary Wharf Group Investment Holdings plc 3,375 % 23.04.2028	526.000	609.651
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22.03.2068	417.045	599.516
Verizon Communications Inc 3,875 % 01.03.2052	800.000	571.104
Iberdrola International BV 1,825 %	600.000	564.638
ZF Finance GmbH 2,25 % 03.05.2028	600.000	558.840
EDP - Energias de Portugal SA 1,875 % 02.08.2081	600.000	550.154
Volkswagen International Finance NV 3,75 % 28.09.2027	500.000	525.827
Bundesrepublik Deutschland 1,75 % 15.02.2024	500.000	522.607
United Kingdom Gilt 2,75 % 07.09.2024	470.000	522.061
Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 3 % 19.04.2051	620.000	515.880

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft) Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
United Kingdom Gilt 0,875 % 31.07.2033	(6.090.000)	(5.927.479)
United Kingdom Gilt 1,50 % 31.07.2053	(2.230.000)	(1.710.268)
France (Government of) 1,75 % 25.06.2039	(800.000)	(957.707)
Bundesrepub.Deutschland 0 % 15.08.2031	(900.000)	(941.545)
Bonos Y Oblig DEL Estado 1 % 30.07.2042	(1.010.000)	(850.010)
Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV 2,75 % 20.02.2024	(800.000)	(785.946)
Buoni Poliennali DE TES 1,50 % 30.04.2045	(1.030.000)	(782.720)
Bundesrepub.Deutschland 0 % 15.08.2050	(1.270.000)	(701.821)
United Kingdom GILT Inflation Linked 0,125 % 22.03.2068	(418.721)	(565.693)
United Kingdom GILT 2,75 % 07.09.2024	(470.000)	(530.323)
TenneT Holding BV 4,75 % 28.10.2042	(500.000)	(515.798)
Volkswagen International Finance NV 3,75 % 28.09.2027	(500.000)	(493.160)
Barclays plc 1,125 % 22.03.2031	(520.000)	(471.621)
Deutsche Bank AG 1,686 % 19.03.2026	(520.000)	(470.392)
MidAmerican Energy Company 3,10 % 01.05.2027	(480.000)	(469.810)
BNP Paribas SA 1,675 % 30.06.2027	(530.000)	(468.615)
Hyundai Capital Services Inc 2,5 % 24.01.2027	(500.000)	(467.000)
ING Groep NV 4,625 % 06.01.2026	(460.000)	(463.100)
Fibria Overseas Finance Limited 5,50 % 17.01.2027	(450.000)	(448.625)
Vmed O2 UK Financing I plc 4,5 % 15.07.2031	(400.000)	(431.883)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Man Funds plc

Man GLG Dynamic Income

Aufstellung wesentlicher Käufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Wertpapier	Nennwert	Kosten USD
EnQuest plc 7 % 15.10.2023	3.300.000	2.728.272
Marex Group plc 13,25 %	3.000.000	2.555.940
Jerrold Finco plc 4,875 % 15.01.2026	2.743.000	2.472.378
Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	2.600.000	2.237.605
Inversiones La Construccion SA 4,75 % 07.02.2032	3.220.000	2.137.004
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2,125 % 19.11.2025	2.818.000	2.085.231
DVIVER 2,5 % 25.01.2027	2.500.000	2.029.272
GUNVOR 6,75 % 30.09.2026	2.697.000	1.922.471
GTCAW 2,75 % 23.06.2026	2.545.000	1.868.165
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4,375 % 09.05.2030	2.287.000	1.818.291
SHAWLN 9 % 10.10.2030	1.618.000	1.691.868
FEL Energy VI Sarl 5,75 % 01.12.2040	2.260.532	1.539.554
Pharming Group NV 3 % 21.01.2025	1.900.000	1.497.290
Hanesbrands Finance Luxembourg SCA 3,5 % 15.06.2024	1.600.000	1.462.367
IPD 3 BV 5,5 % 01.12.2025	1.716.000	1.450.334
Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal Del Peru 6,375 % 01.06.2028	1.740.400	1.441.902
Credit Suisse Group AG 7,375 % 07.09.2033	1.271.000	1.392.149
Sainsbury's Bank plc 6 % 23.11.2027	1.255.000	1.365.435
Minejesa Capital BV 4,625 % 08.10.2030	1.800.000	1.317.093
Credit Suisse Group AG 7,750 % 01.03.2029	1.300.000	1.273.411

Aufstellung wesentlicher Verkäufe (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Wertpapier	Nennwert	Erlöse USD
EnQuest plc 7 % 15.10.2023	(2.200.000)	(1.869.306)
Marex Group plc 13,25 %	(2.000.000)	(1.548.390)
IPD 3 BV 5,5 % 01.12.2025	(1.716.000)	(1.444.514)
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl 2,125 % 19.11.2025	(1.800.000)	(1.377.967)
Inversiones La Construccion SA 4,75 % 07.02.2032	(1.860.000)	(1.310.683)
Sainsbury's Bank plc 6 % 23.11.2027	(1.147.000)	(1.216.236)
Nexi SpA 2,125 % 30.04.2029	(1.620.000)	(1.176.957)
Vivion Investments Sarl 3,5 % 01.11.2025	(1.400.000)	(1.153.723)
Vivion Investments Sarl 3 % 08.08.2024	(1.300.000)	(1.103.147)
Jerrold Finco plc 4,875 % 15.01.2026	(1.095.000)	(1.093.236)
Braskem Idesa SAPI 6,99 % 20.02.2032	(1.468.000)	(1.052.363)
Victoria plc 3,75 % 15.03.2028	(1.400.000)	(1.039.760)
GUNVOR 6,75 % 30.09.2026	(1.380.000)	(1.038.267)
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4,375 % 09.05.2030	(1.072.000)	(932.827)
Investec Bank Plc 4,25 % 24.07.2028	(746.000)	(920.885)
FEL Energy VI Sarl 5,75 % 01.12.2040	(1.130.266)	(906.730)
Minejesa Capital BV 4,625 % 08.10.2030	(1.000.000)	(870.000)
DVIVER 2,5 % 25.01.2027	(1.100.000)	(864.926)
Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal Del Perpetual 6,375 % 01.06.2028	(870.200)	(825.820)
Banjay Group SAS 6,5 % 01.03.2026	(886.000)	(818.875)

Die Aufstellung wesentlicher Käufe und Verkäufe enthält die gesamten Käufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwertes der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die gesamten Verkäufe, die ein Prozent des Gesamtwertes der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe aufgeführt werden, bzw. alle Käufe oder Verkäufe, wenn deren Zahl unter 20 liegt.

Gemeinsamer Meldestandard – Datenschutzmitteilung

Der Fonds übermittelt hiermit allen Anteilhabern des Fonds zum oder seit dem 31. Dezember 2015 die folgende Datenschutzmitteilung.

Zur Klarstellung: Diese Mitteilung gilt auch für alle Anteilhaber, die ihre Beteiligungen an Anteilen des Fonds seit dem 1. Januar 2016 abgegeben haben. Darüber hinaus ist zu beachten, dass diese Mitteilung für beherrschende Personen bestimmter Anteilhaber gilt. Der Fonds bestätigt hiermit, dass er beabsichtigt, alle erforderlichen Maßnahmen zu ergreifen, um sämtliche Verpflichtungen zu erfüllen, die sich aus (i) dem Standard der OECD für den automatischen Austausch von Finanzinformationen in Steuersachen („der Standard“), der den gemeinsamen Meldestandard (Common Reporting Standard, „CRS“) umfasst, in der in Irland im Wege des maßgeblichen internationalen rechtlichen Rahmenwerks und des irischen Steuerrechts geltenden Form und (ii) der Richtlinie des EU-Rates 2014/107/EU zur Änderung der Richtlinie 2011/16/EU bezüglich der Verpflichtung zum automatischen Austausch von Informationen im Bereich der Besteuerung („DAC2“), die in Irland über das maßgebliche Steuerrecht zur Anwendung kommt, ergeben, um die Konformität bzw. mutmaßliche Konformität mit dem Standard/CRS und DAC2 ab dem 1. Januar 2016 sicherzustellen. Diesbezüglich ist der Anlageverwalter für den Fonds gemäß Section 891F und Section 891G des Irish Taxes Consolidation Act 1997 (in der jeweils geltenden Fassung) sowie gemäß im Rahmen dieser Bestimmungen verabschiedeter Verordnungen verpflichtet, bestimmte Informationen zur steuerlichen Behandlung der Anteilhaber einzuholen (und auch Informationen in Bezug auf maßgebliche beherrschende Personen bestimmter Anteilhaber einzuholen).

Unter bestimmten Umständen ist der Anlageverwalter für den Fonds eventuell rechtlich dazu verpflichtet, diese Informationen und sonstige Finanzinformationen in Bezug auf die Beteiligung eines Anteilhabers an dem Fonds an die Irish Revenue Commissioners weiterzugeben (und in bestimmten Situationen kann er auch dazu verpflichtet sein, Informationen in Bezug auf maßgebliche beherrschende Personen bestimmter Anteilhaber weiterzugeben). Sofern das Konto als meldepflichtiges Konto identifiziert wurde, werden die Irish Revenue Commissioners diese Informationen wiederum an das Land weitergeben, in dem die meldepflichtige(n) Person(en) in Bezug auf das meldepflichtige Konto ansässig ist bzw. sind.

Bei den Informationen, die in Bezug auf einen Anteilhaber (und gegebenenfalls maßgebliche beherrschende Personen) gemeldet werden können, kann es sich unter anderem um den Namen, die Adresse, das Geburtsdatum, den Geburtsort, die Kontonummer, den Kontostand oder den Wert zum Jahresende (oder falls das Konto im Laufe dieses Jahres geschlossen wurde, den Kontostand oder den Wert zum Datum der Schließung des Kontos), im Kalenderjahr in Bezug auf das Konto vorgenommene Zahlungen (einschließlich Rücknahme- und Dividenden-/Zinszahlungen), Angaben zur steuerlichen Ansässigkeit und zu Steueridentifikationsnummern handeln.

Bericht über die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder (ungeprüft)

Die Verwaltungsratsmitglieder des Fonds, welche auch Mitarbeiter der Man Group plc und der Gesellschaften innerhalb der Konzernstruktur („Man Group“) sind, erhalten keine Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglieder des Fonds. Die anderen Verwaltungsratsmitglieder erhalten eine feste Vergütung für ihre Tätigkeit, deren Höhe vom gesamten Verwaltungsrat festgelegt wird und die nicht performanceabhängig ist. Dies ist in Erläuterung 8 zu diesem Abschluss näher ausgeführt. Keines der Verwaltungsratsmitglieder erhält derzeit eine variable Vergütung für seine Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglied des Fonds und keines der Verwaltungsratsmitglieder erhält derzeit eine Pension aus dem Fonds. Der Fonds hat Man Asset Management (Ireland) Limited zur OGAW-Verwaltungsgesellschaft bestellt. Die Bestimmungen von Artikel 14b der Richtlinie 2009/65/EG in Bezug auf die Vergütung gelten daher nicht für den Fonds. Sie gelten jedoch für Man Asset Management (Ireland) Limited, die eine Vergütungspolitik eingeführt hat, um die Einhaltung der Bestimmungen sicherzustellen.

Die Anlageverwalter können im Namen der einzelnen Teilfonds und vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Financial Conduct Authority und dem Prospekt festgelegt wurden, Techniken und Instrumente in Bezug auf übertragbare Wertpapiere verwenden, darunter Anlagen in außerbörslichen Finanzderivaten („FDI“), vorausgesetzt, diese Techniken und Instrumente werden für ein effizientes Portfoliomanagement oder zum Schutz vor Wechselkursrisiken oder für direkte Anlagezwecke eingesetzt.

Der Fonds hat im Berichtszeitraum für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen und in Aktienswaps angelegt.

Wertpapierleihgeschäfte

Alle von den Teilfonds getätigten Wertpapierleihgeschäfte unterstehen einer schriftlichen rechtlichen Vereinbarung zwischen den Teilfonds The Bank of New York Mellon (Niederlassung London) (die „Wertpapierleihstelle“) sowie separat davon zwischen der Wertpapierleihstelle und der genehmigten Gegenpartei. Im Tausch gegen verliehene Wertpapiere erhaltene Sicherheiten werden auf einem Konto im Namen der Verwahrstelle im Namen der Teilfonds hinterlegt. Erhaltene Sicherheiten werden getrennt von den Vermögenswerten gehalten, welche der Verwahrstelle der Teilfonds oder der Wertpapierleihstelle gehören.

Die mit Wertpapierleihgeschäften erzielten Gesamterträge werden zwischen den jeweiligen Teilfonds und der Wertpapierleihstelle aufgeteilt. Die Teilfonds erhalten mindestens 80 %, während die Wertpapierleihstelle bis zu 20 % dieser Erträge erhält, wobei alle Betriebskosten aus dem Anteil der Wertpapierleihstelle bestritten werden. Die Erträge, die die einzelnen Teilfonds im Berichtszeitraum mit Wertpapierleihgeschäften erzielt haben, sind in der Gesamtergebnisrechnung als sonstige Erträge ausgewiesen.

Die folgende Tabelle enthält detaillierte Angaben zum Wert der verliehenen Wertpapiere, deren Laufzeit jeweils offen ist, da sie täglich abrufbar oder kündbar sind. Außerdem enthält sie eine Analyse der Laufzeit der damit verbundenen erhaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2022 auf der Grundlage des vertraglichen Fälligkeitsdatums der jeweiligen Transaktion, aufgeteilt nach entleihenden Gegenparteien, wobei das Eintragungsland der Gegenpartei in Klammern angegeben ist:

Man GLG Global Convertibles

Entleihende Gegenpartei und Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere USD Tsd.	Laufzeitprofil der Sicherheiten					
		Weniger als 1 Tag	31 bis 90 Tage	91 bis 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Offen	Summe Sicherheiten
		USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.
BNP Paribas (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	1.155	-	157	409	648	-	1.214
Goldman Sachs International (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	475	-	-	-	504	-	504
Merrill Lynch International (im Vereinigten Königreich konstituiert) Unternehmensanleihen	357	-	-	206	170	-	376
JP Morgan Securities, Plc. (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	1.580	-	-	298	1.363	-	1.661
UBS AG (gegründet im Vereinigten Königreich) Erhaltene Sicherheiten: USD in bar	487	596	-	-	-	-	596
	4.054	596	157	913	2.685	-	4.351

Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Man GLG Japan CoreAlpha Equity

Entleihende Gegenpartei und Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere USD Tsd.	Laufzeitprofil der Sicherheiten					Summe Sicherheiten USD Tsd.
		Weniger als 1 Tag	31 bis 90 Tage	91 bis 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Offen	
		USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	
Barclays Capital Securities Ltd. (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	35.438	-	37.350	-	-	-	37.350
BNP Paribas Arbitrage (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	3.639	-	4.135	-	-	-	4.135
Citigroup Global Markets Limited (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	2.110	-	2.329	-	-	-	2.329
JP Morgan Securities, Plc. (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	35.173	-	38.724	-	-	-	38.724
Macquarie Bank Limited (Mit Sitz im Vereinigten Königreich) Aktien	795	-	876	-	-	-	876
Morgan Stanley & Co. PLC (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	2.476	-	2.653	-	-	-	2.653
MUFG Securities EMEA plc (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	5.289	-	5.818	-	-	-	5.818
Natixis (gegründet in den USA) Aktien	24.545	-	29.742	-	-	-	29.742
Societe Generale (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	47.405	-	51.381	-	-	-	51.381
The Bank of Nova Scotia (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	769	-	846	-	-	-	846
UBS AG (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	25.109	-	27.900	-	-	-	27.900
	182.748	-	201.754	-	-	-	201.754

Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Man GLG Pan-European Equity Growth

Entleihende Gegenpartei und Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere USD Tsd.	Laufzeitprofil der Sicherheiten					Summe Sicherheiten USD Tsd.
		Weniger als 1 Tag	31 bis 90 Tage	91 bis 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Offen	
		USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	
JP Morgan Securities, Plc. (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	4.315	-	4.751	-	-	-	4.751
Merrill Lynch International (gegründet im Vereinigten Königreich) Erhaltene Sicherheiten: Nicht auf USD lautende Barmittel Aktien	3.146	3.257	-	-	-	-	3.257
The Bank of Nova Scotia (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	7.259	-	7.991	-	-	-	7.991
UBS AG (gegründet im Vereinigten Königreich) Aktien	681	-	759	-	-	-	759
	15.401	3.257	13.549	-	-	-	16.806

Man GLG Strategic Bond

Entleihende Gegenpartei und Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere USD Tsd.	Laufzeitprofil der Sicherheiten					Summe Sicherheiten USD Tsd.
		Weniger als 1 Tag	31 bis 90 Tage	91 bis 365 Tage	Mehr als 365 Tage	Offen	
		USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	USD Tsd.	
Barclays Bank plc (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	286	-	-	-	292	-	292
BNP Paribas (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	935	-	-	-	955	-	955
Citigroup Global Markets Limited (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	545	-	-	-	570	-	570
JP Morgan Securities, Plc. (gegründet im Vereinigten Königreich) Unternehmensanleihen	1.054	-	-	-	1.144	-	1.144
RBC Europe Limited (gegründet im Vereinigten Königreich) Staatliche Schuldtitel	262	-	262	-	-	-	262
	3.082	-	262	-	2.961	-	3.223

Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Der Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere als prozentualer Anteil des Nettoinventarwertes des Fonds zum Bilanzstichtag ist wie folgt:

	% des Nettovermögens
Man GLG Global Convertibles	3,09 %
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	9,05 %
Man GLG Pan-European Equity Growth	7,06 %
Man GLG Strategic Bond	1,03 %

	Marktwert der verliehen Wertpapiere	% der verleihbaren Vermögenswerte
Man GLG Global Convertibles	4.054.012 USD	3,57 %
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	24.045.618.200 JPY	9,44 %
Man GLG Pan-European Equity Growth	14.429.698 EUR	7,39 %
Man GLG Strategic Bond	2.562.051 GBP	7,55 %

Der Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere als Anteil der gesamten verleihbaren Vermögenswerte des Fonds zum Bilanzstichtag ist wie folgt:

Die gesamten verleihbaren Vermögenswerte repräsentieren den Gesamtwert der Arten von Vermögenswerten, die Teil des Wertpapierleihprogramms des Fonds sind.

Die im Geschäftsjahr von den Teilfonds durch Wertpapierleihen erzielten Nettoerträge und die an den Wertpapierleihbeauftragten gezahlten Gebühren waren wie folgt:

	Erzielte Erträge	Gezahlte Gebühren
Man GLG Global Convertibles	84.335 USD	1.286.573 USD
Man GLG RI European Equity Leaders	41.601 EUR	37.331 EUR
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	134.582.357 JPY	14.462.047 JPY
Man GLG Pan-European Equity Growth	62.263 EUR	15.367 EUR
Man GLG Strategic Bond	0 EUR	983 EUR

In der folgenden Tabelle sind alle Emittenten nach dem Wert der vom Fonds in Form der Vollrechtsübertragung erhaltenen unbaren Sicherheiten für alle Wertpapierleihgeschäfte zum Bilanzstichtag aufgelistet:

Emittent von unbaren Sicherheiten

	Wert	% des Nettovermögens
<u>Man GLG Global Convertibles</u>		
	USD	
BNP Paribas	1.154.528	0,88 %
Goldman Sachs International	475.142	0,36 %
JP Morgan Securities Plc.	1.579.802	1,21 %
Merrill Lynch International	357.073	0,27 %
<u>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</u>		
	JPY	
Barclays Capital Securities Ltd.	4.662.886.292	1,75 %
BNP Paribas Arbitrage	478.810.086	0,18 %
Citigroup Global Markets Limited	277.646.641	0,10 %
JP Morgan Securities Plc.	4.628.060.420	1,74 %
Macquarie Bank Limited	104.540.203	0,04 %
MUFG Securities EMEA plc	695.884.484	0,26 %
Morgan Stanley & Co. International PLC	325.796.288	0,12 %
Natixis	3.229.553.288	1,21 %
Societe Generale	6.237.517.949	2,35 %
The Bank of Nova Scotia	101.122.884	0,04 %
UBS AG	3.303.799.666	1,24 %
<u>Man GLG Pan-European Equity Growth</u>		
	EUR	
JP Morgan Securities Plc.	4.043.066	1,98 %
The Bank of Nova Scotia	6.801.297	3,33 %
UBS AG	638.168	0,31 %
Merrill Lynch International	41.725	0,02 %

Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Emittent von unbaren Sicherheiten

<u>Man GLG Strategic Bond</u>	Wert GBP	% des Nettovermögens
Barclays Bank plc	237.580	0,10 %
BNP Paribas	777.398	0,31 %
Citigroup Global Markets Limited	453.257	0,18 %
JP Morgan Securities Plc.	876.390	0,35 %
RBC Europe Limited	217.424	0,09 %

Zum Bilanzstichtag wurden alle für Wertpapierleihgeschäfte erhaltenen Barsicherheiten in von verschiedenen Gegenparteien verwaltete Pensionsgeschäfte reinvestiert, wie nachstehend angegeben:

	Marktwert der verliehen Wertpapiere	% des Nettovermögens
Man GLG Global Convertibles	599.434 USD	0,46 %
Man GLG Pan-European Equity Growth	3.073.115 EUR	1,50 %

Im Rahmen von Sicherungsübereignungsarrangements für Wertpapierleihgeschäfte und außerbörsliche Derivategeschäfte erhaltene unbare Sicherheiten können nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.

Die vom Fonds mit der Wiederanlage von Barsicherheiten in Wertpapierleihgeschäfte erzielten Erträge sind, abzüglich der an die Gegenpartei zu zahlenden Zinsen, nachfolgend für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 angegeben und werden als sonstige Erträge in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

	Erzielte Erträge
Man GLG Global Convertibles	39.675 USD
Man GLG RI European Equity Leaders	9.117 EUR
Man GLG Japan CoreAlpha Equity	327.493 JPY
Man GLG Pan-European Equity Growth	13.446 EUR
Man GLG Strategic Bond	3.184 GBP

Alle vom Fonds erhaltenen unbaren Sicherheiten wurden zum 31. Dezember 2022 von der Wertpapierleihstelle auf der Grundlage einer Abwicklung über drei Parteien verwahrt.

100 % der Barsicherheiten werden in einem separaten Konto bei der Verwahrstelle geführt. 100 % der unbaren Sicherheiten werden in Sammelkonten geführt.

Portfolioswaps

Außerbörsliche Derivategeschäfte werden vom Fonds im Rahmen eines Rahmenvertrags der International Swaps and Derivatives Association, Inc. („ISDA-Rahmenvertrag“) oder einer ähnlichen Vereinbarung abgeschlossen. Ein ISDA-Rahmenvertrag ist ein bilateraler Vertrag zwischen dem Fonds und einer Gegenpartei, der von den Parteien abgeschlossene außerbörsliche Derivategeschäfte (einschließlich von Total Return Swaps und Portfolioswaps) regelt. Alle im Rahmen eines ISDA-Rahmenvertrags abgeschlossenen außerbörslichen Derivategeschäfte werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet. Daher beziehen sich die nachstehenden/an anderer Stelle im Bericht gemachten Angaben zu den Sicherheiten auf alle vom Fonds im Rahmen des ISDA-Rahmenvertrags abgeschlossenen außerbörslichen Derivategeschäfte und nicht nur auf Portfolioswaps.

Die auf der nächsten Seite angegebenen Zahlen zu den Sicherheiten beziehen sich auf zur Unterstützung bestimmter Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gehaltene Sicherheiten, zur Unterstützung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften bei Brokern gehaltene sonstige Barmittel und sonstige bei Brokern gehaltene Derivategeschäfte, wo Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt werden.

Die nachstehende Tabelle zeigt den Wert von Portfolioswaps als Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds zum 31. Dezember 2022:

	Portfolioswaps % des Nettovermögens
Man GLG Global Convertibles	(0,64 %)
Man GLG RI European Equity Leaders	(1,27 %)
Man GLG China Equity	(2,83 %)
Man GLG Asia (ex Japan) Equity	0,12 %
Man Numeric Emerging Markets Equity	0,45 %

Portfolioswaps (Fortsetzung)

Sämtliche Renditen und Kosten aus der Wertpapierleihe aus außerbörslichen Transaktionen fielen dem Fonds zu und unterlagen keinen Ertragsteilungsvereinbarungen mit den Anlageverwaltern des Fonds oder sonstigen Dritten.

Die nachstehende Tabelle zeigt den Wert von Portfolioswaps, aufgeschlüsselt nach Gegenpartei, zum 31. Dezember 2022:

Gegenpartei	Eintragungsland der Gegenpartei	Marktwert des Portfolioswaps
Man GLG Global Convertibles		
Citibank N.A.	Vereinigtes Königreich	USD (850.181)
Morgan Stanley & Co. International Plc	Vereinigtes Königreich	6.340
Man GLG RI European Equity Leaders		
Morgan Stanley & Co. International Plc	Vereinigtes Königreich	EUR (1.038.374)
Man Numeric Emerging Markets Equity		
Morgan Stanley & Co. International Plc	Vereinigtes Königreich	USD 1.932.520
Man GLG Asia (ex Japan) Equity		
Societe Generale	Vereinigtes Königreich	USD 75.007
Man GLG China Equity		
Morgan Stanley & Co. International Plc	Vereinigtes Königreich	USD (276.129)

Alle Portfolioswaps haben eine offene Laufzeit, da sie täglich abrufbar oder kündbar sind.

Sicherheiten

Der Fonds schließt Geschäfte ab, die möglicherweise bei einer Gegenpartei zu hinterlegende Sicherheiten („hinterlegte Sicherheiten“) verlangen.

Gegenpartei	Währung	Gestellte Sicherheiten
Man GLG Global Convertibles		
Bank of New York Mellon	USD	USD (3.351.195)
Citibank N.A.	USD	4.499.209
Credit Suisse Securities Europe Limited	USD	(48)
Morgan Stanley & Co. International Plc	USD	485.727
Nomura Holdings	USD	5.072
Man GLG RI European Equity Leaders		
Bank of New York Mellon	EUR	EUR 346.459
Morgan Stanley & Co. International Plc	EUR	4.690.820
Man Numeric Emerging Markets Equity		
Goldman Sachs International	USD	USD 494.208
Morgan Stanley & Co. International Plc	USD	9.997.874
Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)		
Goldman Sachs International	USD	USD 55.592
Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates		
Goldman Sachs International	USD	USD 502.764
HSBC Bank plc	USD	(679.246)
Man GLG Global Emerging Markets Bond		
Bank of New York Mellon	USD	USD (120.296)
Man GLG Pan-European Equity Growth		
Bank of New York Mellon	EUR	EUR 440.078

Man Funds plc

Ungeprüfte Berichtsanforderungen gemäß der Verordnung
über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte
Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022



Sicherheiten (Fortsetzung)

Gegenpartei	Währung	Gestellte Sicherheiten
<u>Man Numeric Europe RI Climate</u> <u>(vormals Man Numeric RI European Equity)</u>		EUR
Goldman Sachs International	EUR	89.731
<u>Man Numeric China A Equity</u>		USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	USD	103.671
<u>Man GLG Strategic Bond</u>		GBP
Bank of New York Mellon	GBP	(619.607)
HSBC Bank plc	GBP	(14.559.999)
JP Morgan Securities Plc	GBP	99.846
<u>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</u>		USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	USD	926.153
Societe Generale	USD	521.259
<u>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</u>		USD
Bank of New York Mellon	USD	(2.680.000)
Barclays Plc	USD	1.182.884
JP Morgan Securities Plc	USD	4.711.563
Morgan Stanley & Co. International Plc	USD	6.850
<u>Man GLG China Equity</u>		USD
Morgan Stanley & Co. International Plc	USD	148.525
<u>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy</u>		EUR
Morgan Stanley & Co. International Plc	EUR	115.939
<u>Man GLG Sustainable Strategic Income</u>		USD
Bank of New York Mellon	USD	90.000
JP Morgan Securities Plc	USD	258.507
<u>Man GLG Dynamic Income</u>		USD
Barclays Capital Plc	USD	(220.010)
JP Morgan Securities Plc	USD	855.287

Alle gestellten Barsicherheiten haben eine offene Laufzeit, da sie keinem vertraglichen Fälligkeitsdatum unterliegen.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Global Convertibles (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300DLK758CIER2L98

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,40 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- die Verwendung von Rohstoffen
- Reduzierung von Abfall,
- Kreislaufwirtschaft

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Bekämpfung von Ungleichheit
- Arbeitsbeziehungen

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals „SDG“).¹ Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Die Verwendung von Rohstoffen	Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	16,87 %
2.	Reduzierung der Abfallerzeugung	Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11)	12,80 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	16,87 %
3.	Kreislaufwirtschaft	Industrie, Innovation und Infrastruktur (SDG 9)	12,33 %
		Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11)	12,80 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	16,87 %
Soziales			
4.	Bekämpfung von Ungleichheit	Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)	48,25 %
		Weniger Ungleichheiten (SDG 10)	24,56 %
5.	Arbeitsbeziehungen	Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	24,63 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5);
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8);
- Industrie, Innovation und Infrastruktur (SDG 9)
- Weniger Ungleichheiten (SDG 10);
- Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11) und
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12).

Beiden wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen in den Prozess seiner sorgfältigen Prüfung (Due-Diligence) für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis obligatorischer und zusätzlicher PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.

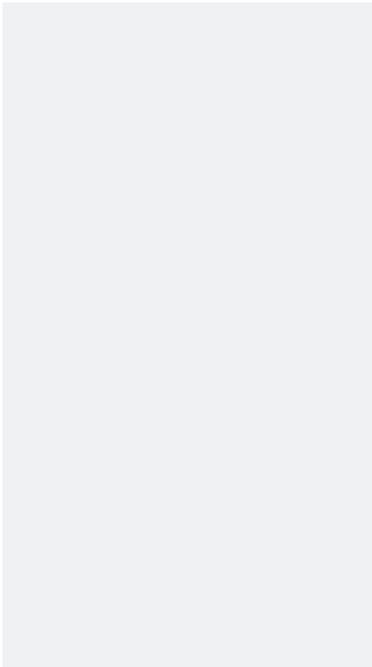


Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
CELLNEX TELECOM, S.A.	Kommunikationsdienstleistungen	2,81 %	Spanien
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC.	Informationstechnologie	2,33 %	USA
KONINKLIJKE KPN N.V.	Kommunikationsdienstleistungen	2,23 %	Niederlande
NIPPON STEEL CORPORATION	Grundstoffe	2,08 %	Japan
FORD MOTOR COMPANY	Zyklische Konsumgüter	1,96 %	USA
CHINA MEDICAL TECHNOLOGIES, INC.	Gesundheitswesen	1,88 %	China
SOUTHWEST AIRLINES CO.	Industrieunternehmen	1,88 %	USA

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022



JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	Gesundheitswesen	1,77 %	USA
LUMENTUM HOLDINGS INC.	Informationstechnologie	1,65 %	USA
DROPBOX, INC.	Informationstechnologie	1,53 %	USA
SPLUNK INC	Informationstechnologie	1,53 %	USA
BLOCK INC	Informationstechnologie	1,50 %	USA
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	Zyklische Konsumgüter	1,32 %	USA
STMICROELECTRONICS NV	Informationstechnologie	1,29 %	Schweiz
HALOZYME THERAPEUTICS INC	Gesundheitswesen	1,28 %	USA

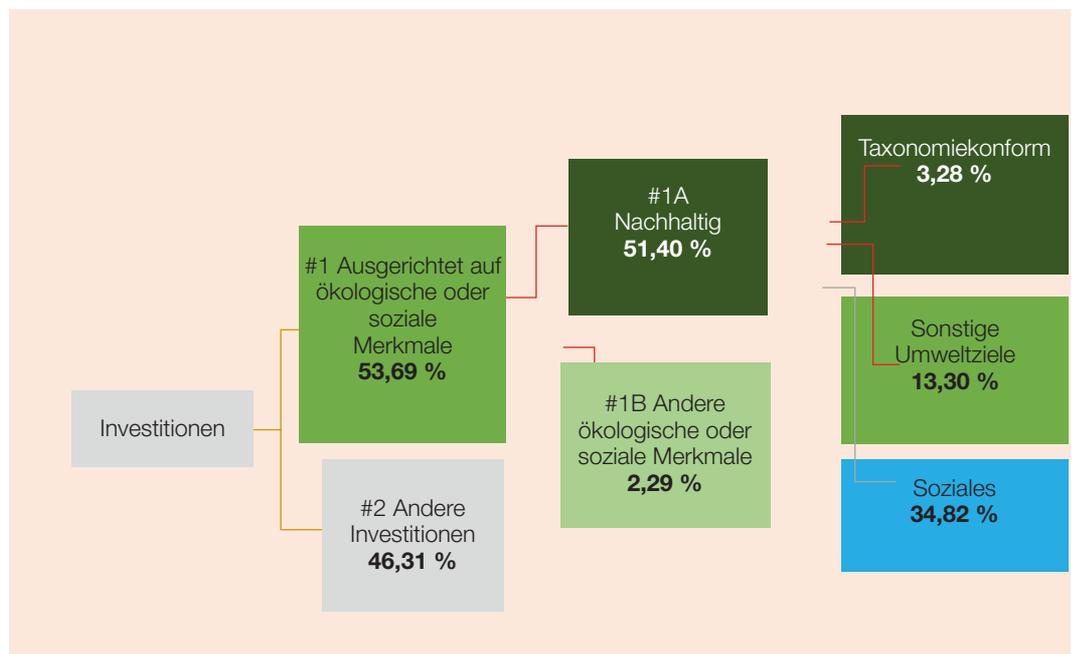


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.²



² Obwohl im Prospekt des Teilfonds erwähnt wird, dass sich der Anlageverwalter verpflichtet hat, einen Mindestanteil des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren, sei darauf hingewiesen, dass der Teilfonds im Rahmen seiner Anlagestrategie möglicherweise Hebeleffekte eingesetzt hat und daher von Zeit zu Zeit ein Gesamtengagement hatte, das größer war als sein Nettoinventarwert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen.³⁴

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	14,80 %
Zyklische Konsumgüter	17,15 %
Basiskonsumgüter	1,95 %
Energy	0,84 %
Finanzwerte	4,29 %
Gesundheitswesen	16,09 %
Industrieunternehmen	13,14 %
Informationstechnologie	27,16 %
Grundstoffe	8,77 %
Immobilien	4,15 %
Versorger	2,53 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

⁴ Für die Zwecke dieses Abschnitts sei darauf hingewiesen, dass der Teilfonds Hebeleffekte einsetzt und mitunter zu mehr als 100 % investiert sein kann. Die Tabelle in diesem Abschnitt beinhaltet den tatsächlichen Prozentsatz des investierten Kapitals in den einzelnen Sektoren, daher betragen die aufgeführten Prozentsätze insgesamt mehr als 100 %.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

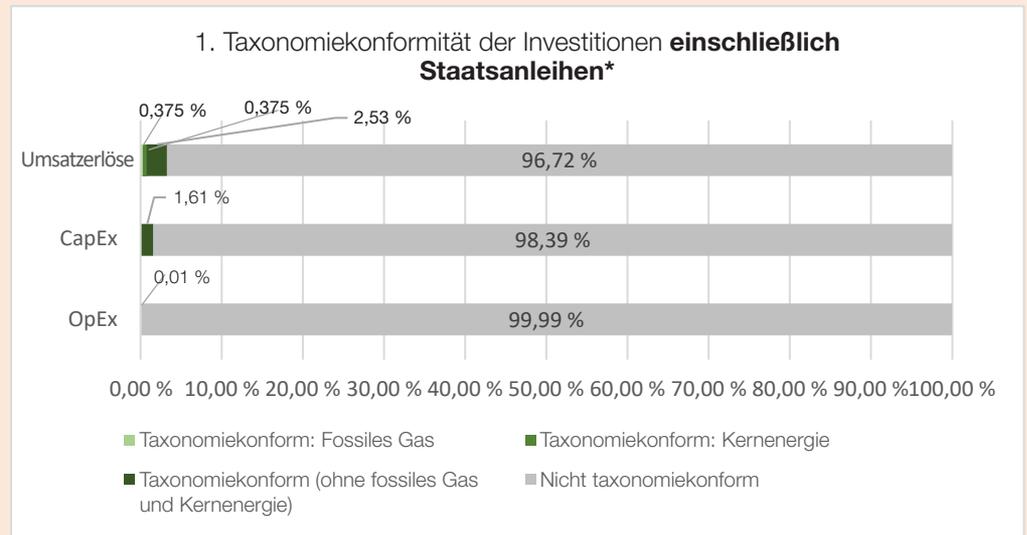
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁵ investiert?

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

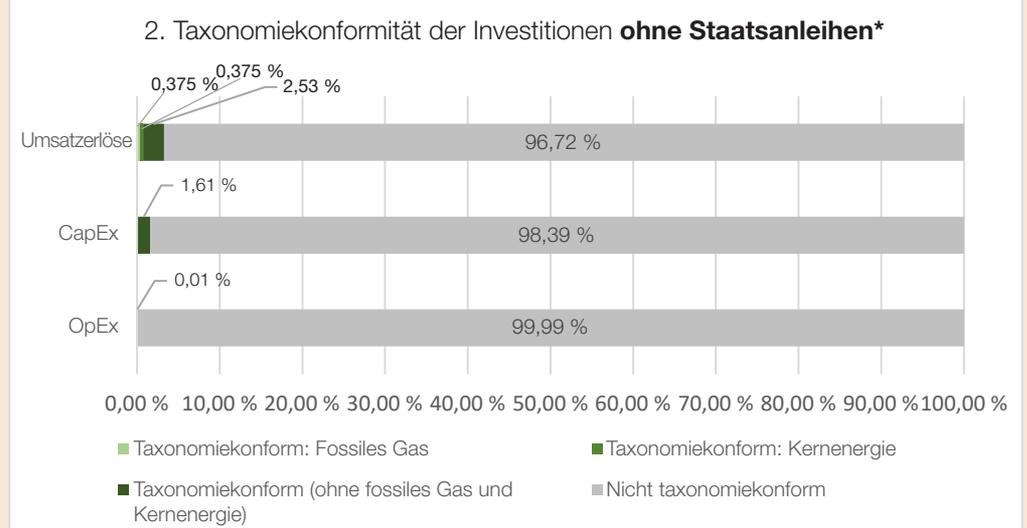
Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



⁵ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds hat insgesamt 0,75 % seiner Investitionen in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie angelegt, die mit der EU-Taxonomie konform sind (ausgedrückt als Anteil der Einnahmen). Diese 0,75 % sind die Summe der Positionen in den Bereichen fossiles Gas und Kernenergie. Der Anlageverwalter hat für die Zwecke der grafischen Darstellung eine 50/50 Aufteilung zwischen fossilem Gas und Kernenergie geschätzt und daher in der Grafik 0,375 % für jede der beiden Aktivitäten ausgewiesen. Der Anlageverwalter weist darauf hin, dass bei dieser Aufteilung um eine Schätzung handelt, die er aufgrund fehlender relevanter Daten vornehmen musste. Insbesondere unterscheiden die verfügbaren Daten derzeit im Rahmen der Berichterstattung zur Taxonomiekonformität in Bezug auf die relevanten NACE-Sektorklassifizierungen nicht zwischen fossilem Gas und Kernenergie.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

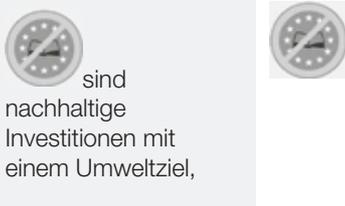
Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 13,3 %.



die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 34,82 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Japan CoreAlpha Equity (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300ZVTTLI6REZB645

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 73,61 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- die Nutzung von Energie
- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“)
- Produkte des Unternehmens, die auf eine geringere Umweltbelastung abzielen

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Investitionen in Humankapital

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“)) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principle Adverse Impact („PAI“)) (weitere Informationen zu den SDG finden Sie weiter unten). Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 50 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 50 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung der Beiträge zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.²

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

² Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Die Nutzung von Energie	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	33,99 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	23,78 %
2.	Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	33,99 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	23,78 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3)	139,12 Tonnen CO ₂ e / Mio. USD
3.	Produkte des Unternehmens, die auf eine geringere Umweltbelastung abzielen	Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11)	33,45 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	38,50 %
Soziales			
4.	Investitionen in Humankapital,	Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)	31,21 %
		Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	51,00 %
		Weniger Ungleichheiten (SDG 10),	59,92 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5);
- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7),

- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8);
- Weniger Ungleichheiten (SDG 10)
- Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11),
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12) und
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13).

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) in seinen Due-Diligence-Prozess für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis obligatorischer und zusätzlicher PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO ₂ -Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.

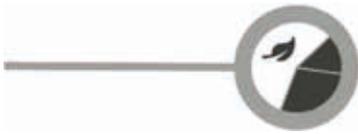


Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MITSUBISHI ESTATE CO LTD	Immobilien	5,28 %	Japan
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP, INC.	Finanzwerte	4,87 %	Japan
PANASONIC HOLDINGS CORPORATION	Zyklische Konsumgüter	4,03 %	Japan
MIZUHO FINANCIAL GROUP, INC.	Finanzwerte	3,79 %	Japan
NISSAN MOTOR CO LTD	Zyklische Konsumgüter	3,46 %	Japan
T&D HOLDINGS INC	Finanzwerte	3,12 %	Japan
MAKITA CORPORATION	Industrieunternehmen	3,06 %	Japan
DAIWA HOUSE INDUSTRY CO., LTD.	Immobilien	2,99 %	Japan
MITSUBISHI ELECTRIC CORPORATION	Industrieunternehmen	2,88 %	Japan
SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	Grundstoffe	2,84 %	Japan
KOMATSU LTD	Industrieunternehmen	2,79 %	Japan
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP, INC.	Finanzwerte	2,71 %	Japan
HONDA MOTOR CO LTD	Zyklische Konsumgüter	2,60 %	Japan
TORAY INDUSTRIES INC	Grundstoffe	2,55 %	Japan
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES, LTD.	Zyklische Konsumgüter	2,50 %	Japan

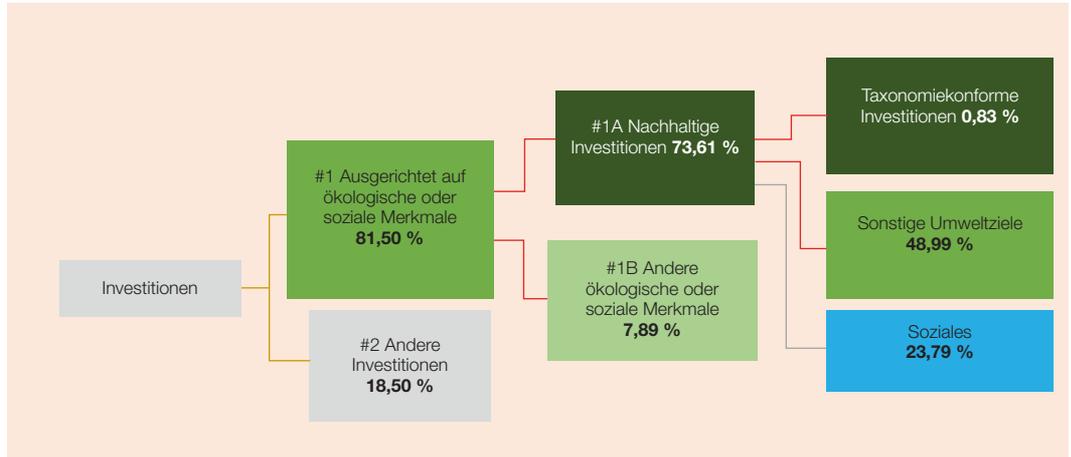


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Zyklische Konsumgüter	15,72 %
Basiskonsumgüter	2,56 %
Energy	1,69 %
Finanzwerte	21,96 %
Gesundheitswesen	2,37 %
Industrieunternehmen	21,93 %
Informationstechnologie	3,00 %
Grundstoffe	16,59 %
Immobilien	11,78 %
Nicht klassifiziert	1,50 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

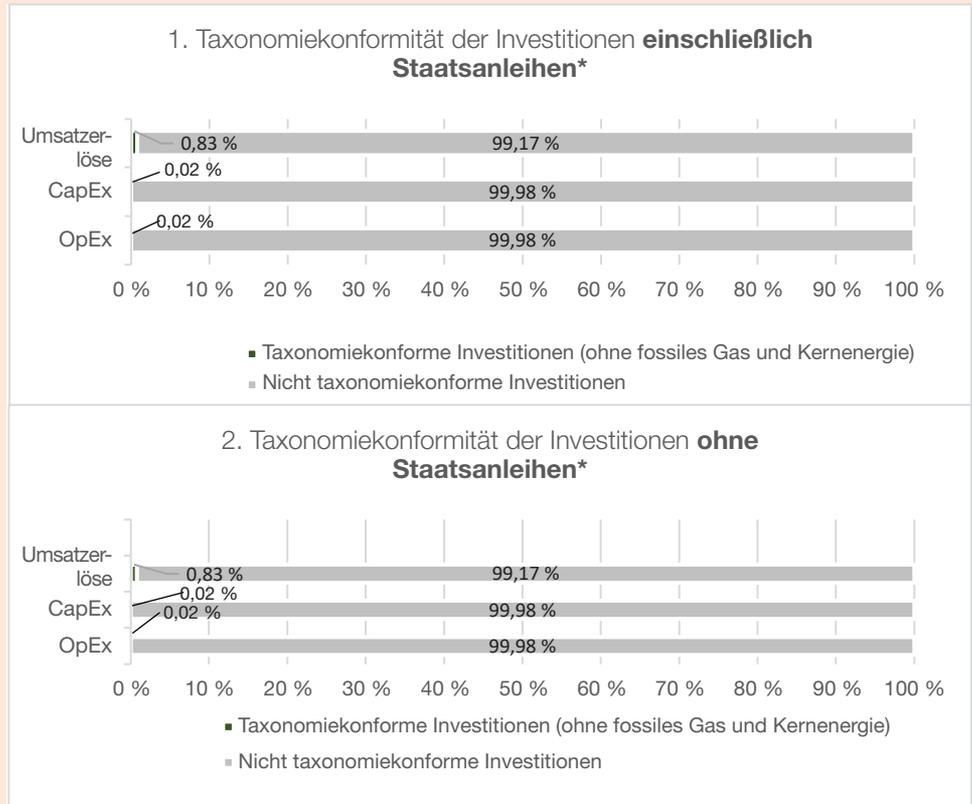
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



s i n d nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 48,99 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 23,79 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden.

Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, möglicherweise Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;

- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Man Funds plc - Man Numeric Global RI Climate (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300Q043HPCDLEU076

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%

Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 80.12 % an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%

Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Einsatz erneuerbarer Energien; und
- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“).

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals „SDG“)¹. Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 50 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und sicherzustellen, dass alle Unternehmen des Anlageuniversums die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Einsatz erneuerbarer Energien	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	46,32 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	50,25 %
2.		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	50,25 %

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen	Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3) ²	17,14 %
		Angleichung des Teilfonds an das Temperaturziel des Pariser Abkommens (Zeithorizont von 2012 bis 2030)	1,64 Grad Celsius

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) in seinen Due-Diligence-Prozess für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt.

Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Der Anlageverwalter führt für die Zwecke der DNSH ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt. Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die negativen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft. Der Anlageverwalter berücksichtigt die folgenden Indikatoren. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

² Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar. Die wesentlichen negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden von der Verwaltungsgesellschaft und dem Anlageverwalter in Bezug auf den Teilfonds nicht berücksichtigt, da der Anlageverwalter ausschließlich quantitative Anlagestrategien anwendet, die derzeit nicht mit einer Prüfung der einzelnen Positionen in Bezug auf derartige negative Auswirkungen vereinbar sind.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SP 500 INDEX	Nicht klassifiziert	1,81 %	USA
CIGNA CORPORATION	Gesundheitswesen	1,67 %	USA
AKER BP ASA	Energy	1,65 %	Norway
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	1,60 %	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitswesen	1,58 %	USA
CUMMINS INC.	Industrieunternehmen	1,55 %	USA
NOVO NORDISK AS	Gesundheitswesen	1,46 %	Denmark
EQUINOR ASA	Energy	1,41 %	Norway
HUMANA INC.	Gesundheitswesen	1,36 %	USA
BRAMBLES LIMITED	Industrieunternehmen	1,34 %	Australien
ELEVANCE HEALTH INC	Gesundheitswesen	1,28 %	USA
AGILENT TECHNOLOGIES, INC.	Gesundheitswesen	1,27 %	USA
TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	Informationstechnologie	1,24 %	USA
AMGEN INC.	Gesundheitswesen	1,23 %	USA
BECTON, DICKINSON AND COMPANY	Gesundheitswesen	1,19 %	USA

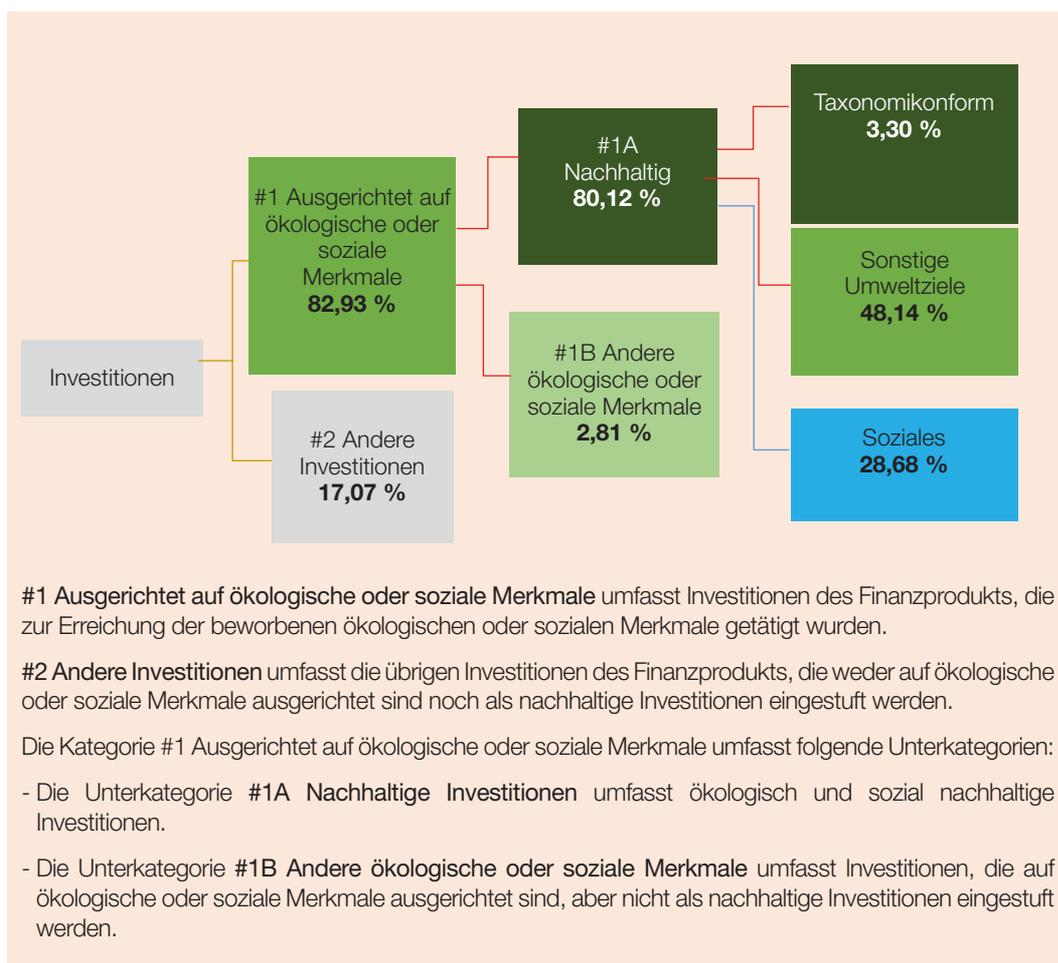


Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	3,38 %
Zyklische Konsumgüter	7,41 %
Basiskonsumgüter	1,01 %
Energy	4,21 %
Finanzwerte	3,70 %
Gesundheitswesen	23,23 %
Industrieunternehmen	16,62 %

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

Informationstechnologie	26,08 %
Grundstoffe	7,26 %
Immobilien	0,83 %
Nicht klassifiziert	2,73 %
Versorger	1,98 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

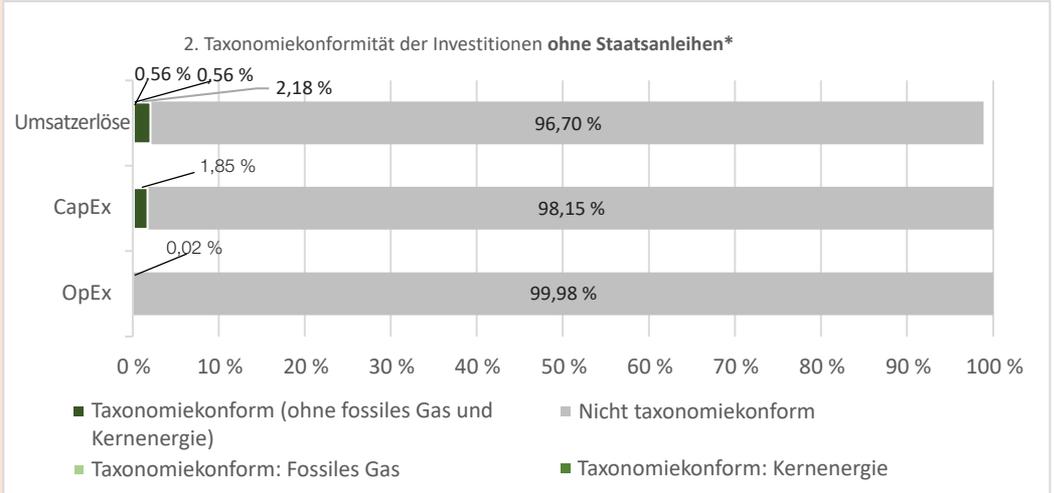
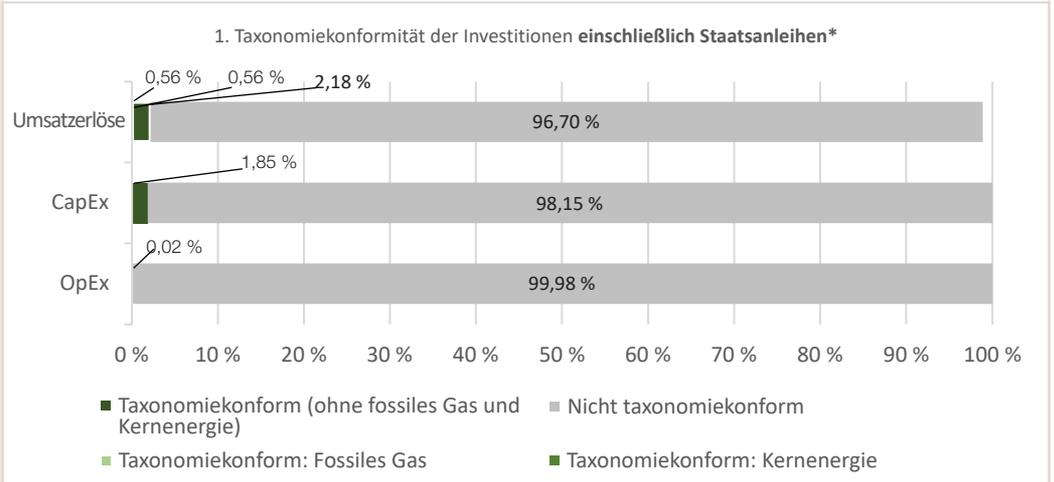
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds hat insgesamt 1,12 % seiner Investitionen in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie angelegt, die mit der EU-Taxonomie konform sind (ausgedrückt als Anteil der Einnahmen). Diese 1,12 % sind die Summe der Positionen in den Bereichen fossiles Gas und Kernenergie. Der Anlageverwalter hat für die Zwecke der grafischen Darstellung eine 50/50 Aufteilung zwischen fossilem Gas und Kernenergie geschätzt und daher in der Grafik 0,56 % für jede der beiden Aktivitäten ausgewiesen. Der Anlageverwalter weist darauf hin, dass bei dieser Aufteilung um eine Schätzung handelt, die er aufgrund fehlender relevanter Daten vornehmen musste. Insbesondere unterscheiden die verfügbaren Daten derzeit im Rahmen der Berichterstattung zur Taxonomiekonformität in Bezug auf die relevanten NACE-Sektorklassifizierungen nicht zwischen fossilem Gas und Kernenergie.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 48,14 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 28,68 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements bzw. zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;

- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Global Emerging Markets Bnd (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300BQ6KFML0LD8E87

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,11% an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |
|--|---|



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- der Einsatz erneuerbarer Energien;
- Einsatz von Wasser und,

- die Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“), sowie

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Förderung des sozialen Zusammenhalts
- Förderung der sozialen Integration
- Investitionen in Humankapital und
- Investitionen zugunsten wirtschaftlich oder sozial benachteiligter Bevölkerungsgruppen.

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um ökologische und soziale Risikoeinstufungen von Ländern und den Prozentsatz der Investitionen in Schwellenländern: Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen.

Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den Nachhaltigkeitsindikatoren als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel.

Unternehmensmittelen: Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“) (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Staatliche Emittenten: Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „Sovereign Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines staatlichen Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Bei diesem Ansatz werden zunächst die Kriterien der einzelnen Länder zum Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) bewertet. Der Sovereign Framework bewertet dann die ökologischen und sozialen Daten von zwei Dienstleistern.

Zu den Faktoren gehören Kategorien wie Energieintensität, Nutzung erneuerbarer Energien, Stress und Schutz von Wasser und Land (ökologische Merkmale) sowie Zugang zu Wasser, Land, Nahrung und Gesundheitswesen, Bildung und Lebenserwartung (soziale Merkmale). Die Einstufungen konzentrieren sich darauf, wie die Länder ihre vorhandenen Ressourcen verwalten (d.h. Management-Scores), und nicht auf das absolute Niveau ihrer Ressourcen.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist eine Liste von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.²

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Ausrichtung [(in % des NIW)]
Umwelt			
1.	Einsatz erneuerbarer Energien	Einstufung des Energieverbrauchs aus erneuerbaren Energiequellen des Landes	39,26
2.	Nutzung von Wasser,	Einstufung des Wasserstress des Landes	42,76
3.	Die Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“), Luftschadstoffen	Einstufung der Luftverschmutzung des Landes	52,76
		Einstufung der Kohlenstoffintensität des Landes	46,86
Soziales			
4.	Förderung des sozialen Zusammenhalts	Einstufung der Arbeitslosigkeit des Landes	55,38
		Einstufung der Lebensmittelsicherheit des Landes	54,92
5.	Förderung der sozialen Integration	Einstufung der Geschlechtergleichstellung des Landes	55,16
6.	Investitionen in Humankapital,	Einstufung der Sekundarbildung des Landes	54,44
7.	Investitionen in wirtschaftlich oder sozial benachteiligte Gemeinden	Anteil der Investitionen in Schwellenländern	80,43 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

²Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren, nämlich:

- Einstufung des Energieverbrauchs aus erneuerbaren Energiequellen des Landes
- Einstufung des Wasserstress des Landes;
- Einstufung der Luftverschmutzung des Landes;
- Einstufung der Kohlenstoffintensität des Landes;
- Einstufung der Arbeitslosigkeit des Landes;
- Einstufung der Lebensmittelsicherheit des Landes;
- Einstufung der Geschlechtergleichstellung des Landes;
- Einstufung der Sekundarbildung des Landes;
- Anteil der Investitionen in Schwellenländern.

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen in den Prozess seiner sorgfältigen Prüfung (Due-Diligence) für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteilige Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „*Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen

11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/ NIW des Teilfonds.

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	Staatsanleihe	7,51 %	Vereinigte Arabische Emirate
PETROLEOS MEXICANOS	Energy	6,77 %	Mexiko
INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	Staatsanleihe	5,78 %	Indonesien
REPUBLIC OF PANAMA	Staatsanleihe	5,59 %	Panama
Republik Österreich	Staatsanleihe	5,26 %	Chile
MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	Staatsanleihe	4,95 %	Mexiko
PERUVIAN GOVERNMENT INT BOND	Staatsanleihe	4,11 %	Peru
REPUBLIC OF PHILIPPINES	Staatsanleihe	3,78 %	Philippinen
STATE OF QATAR	Staatsanleihe	3,39 %	Katar
DOMINICAN REPUBLIC	Staatsanleihe	2,84 %	Dominikanische Republik
OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	Staatsanleihe	2,67 %	Oman
ARGENTINE REPUBLIC	Staatsanleihe	2,37 %	Argentinien
KINGDOM OF SAUDI ARABIA	Staatsanleihe	2,30 %	Saudi-Arabien
EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	Staatsanleihe	1,98 %	Ägypten
HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	Staatsanleihe	1,96 %	Ungarn

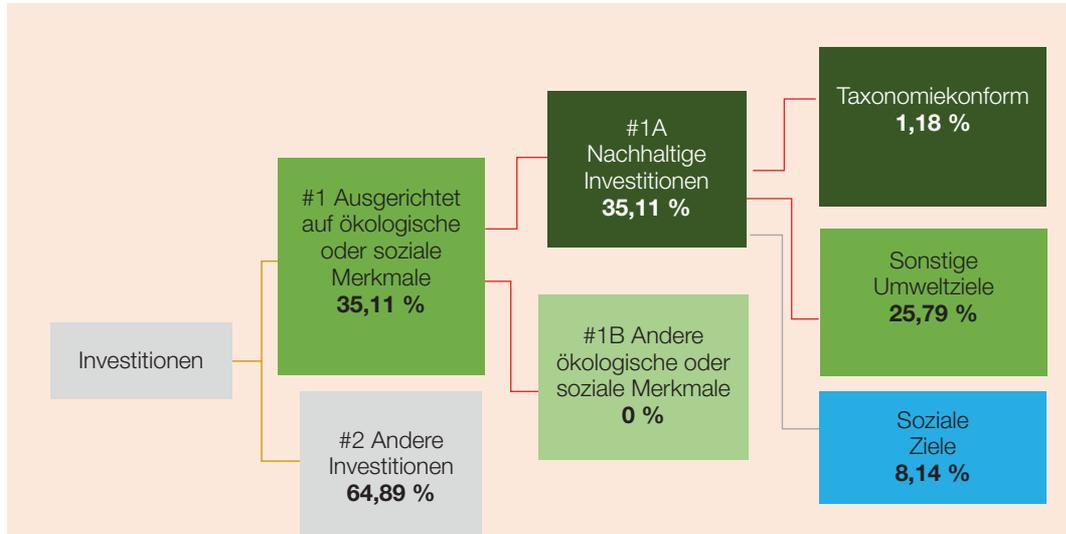


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.³



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

- Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:
- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen.⁴⁵

³ Obwohl im Prospekt des Teilfonds erwähnt wird, dass sich der Anlageverwalter verpflichtet hat, einen Mindestanteil des Nettoinventarwerts des Portfolios in nachhaltige Anlagen zu investieren, sei darauf hingewiesen, dass das Gesamtengagement des Teilfonds nach dem Ermessen des Anlageverwalters im besten Interesse des Portfolios aus einer Vielzahl von Gründen (wie unzureichende Anlagemöglichkeiten und makroökonomische Ereignisse) beschränkt sein kann. Deshalb konnte der Teilfonds mitunter ein Gesamtengagement aufweisen, das deutlich unter seinem NIW lag.

⁴ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

⁵ Für die Zwecke dieses Abschnitts sei darauf hingewiesen, dass der Teilfonds mitunter unterinvestiert sein kann. Die Tabelle in diesem Abschnitt beinhaltet den tatsächlichen Prozentsatz des investierten Kapitals in den einzelnen Sektoren, daher betragen die aufgeführten Prozentsätze insgesamt weniger als 100 %.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Energy	6,77 %
Staatsanleihe	68,28 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁶ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

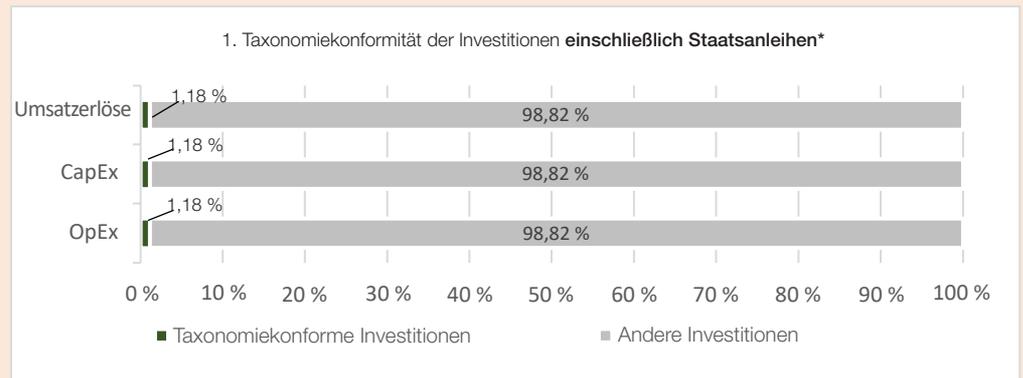
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

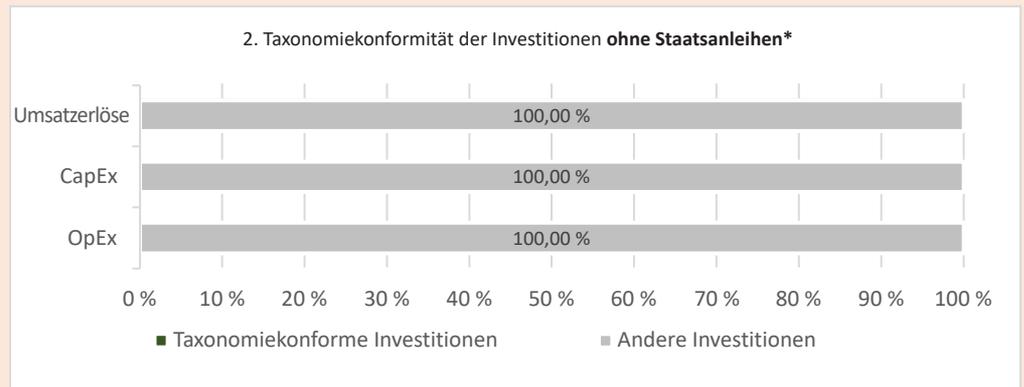
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



⁶ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 0 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die Anpassung der EU-Taxonomie beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 25,79 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 8,14 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

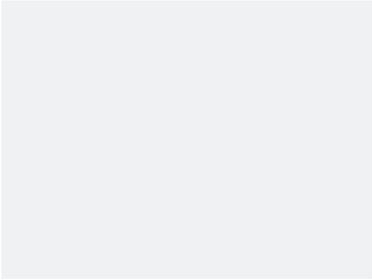
Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Man Funds plc

Ungeprüfte regelmäßige Angaben für die EU-
Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten
im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) (Fortsetzung)



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Pan-European Equity Growth (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300CYSOR0YAE33X30

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 68,87 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“)
- Kreislaufwirtschaft

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- verantwortungsvolle Arbeitsbeziehungen
- Investitionen in menschliche Gesundheit

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“)) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principle Adverse Impact („PAI“)) (weitere Informationen zu den SDG finden Sie weiter unten). Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung der Beiträge zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen	Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	62,76 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3) ²	138,57 Tonnen CO ₂ e / Mio. USD
2.	Kreislaufwirtschaft	Industrie, Innovation und Infrastruktur (SDG 9)	19,61 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	20,26 %
Soziales			
3.	Verantwortungsvolle Arbeitsbeziehungen	Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	31,90 %
4.	Investitionen in menschliche Gesundheit	Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)	52,05 %
		Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	31,90 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5);
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8);
- Industrie, Innovation und Infrastruktur (SDG 9)
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12) und
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13).

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

² Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) in seinen Due-Diligence-Prozess für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.

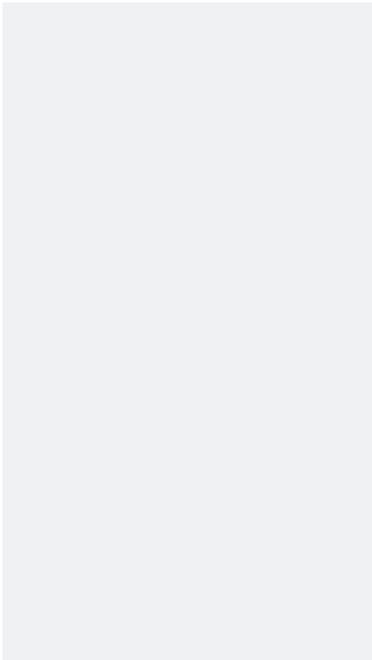
Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.



Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NOVO NORDISK AS	Gesundheitswesen	9,50 %	Denmark
LVMH MOET HENNESSY LOUIS	Zyklische Konsumgüter	8,07 %	Frankreich
L'OREAL	Basiskonsumgüter	7,77 %	Frankreich
NESTLE S.A.	Basiskonsumgüter	6,43 %	Schweiz
ABCAM PLC	Gesundheitswesen	5,12 %	Vereinigtes Königreich
MONCLER SPA	Zyklische Konsumgüter	4,49 %	Italien
FERRARI NV	Zyklische Konsumgüter	4,42 %	Italien



RYANAIR HOLDINGS PUBLIC	Industrieunternehmen	4,33 %	Irland
ASML HOLDING N.V.	Informationstechnologie	4,21 %	Niederlande
SAP SE	Informationstechnologie	4,05 %	Deutschland
ESSILORLUXOTTICA SA	Gesundheitswesen	3,85 %	Frankreich
ASTRAZENECA PLC	Gesundheitswesen	3,71 %	Vereinigtes Königreich
PUMA AG	Zyklische Konsumgüter	3,64 %	Deutschland
CHR. HANSEN HOLDING A/S	Grundstoffe	3,50 %	Denmark
Ayden N.V.	Informationstechnologie	3,37 %	Niederlande

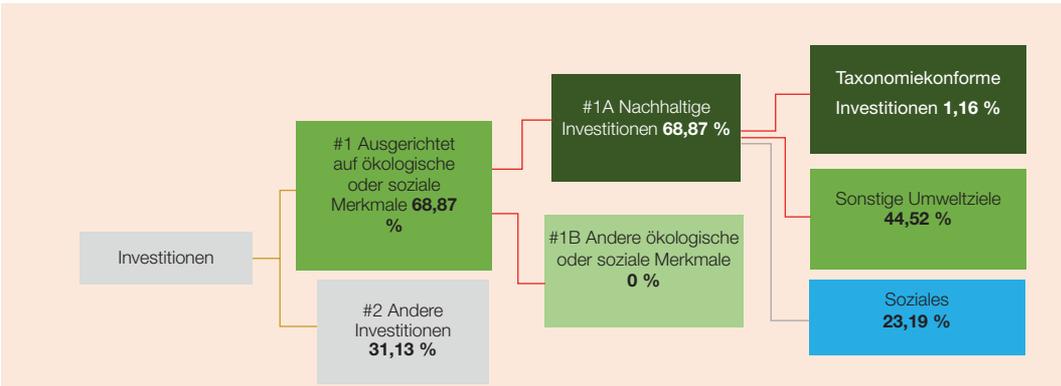


Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Zyklische Konsumgüter	30,23 %
Basiskonsumgüter	15,55 %
Finanzwerte	1,39 %
Gesundheitswesen	26,59 %
Industrieunternehmen	7,85 %
Informationstechnologie	13,13 %
Grundstoffe	3,50 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO-2arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

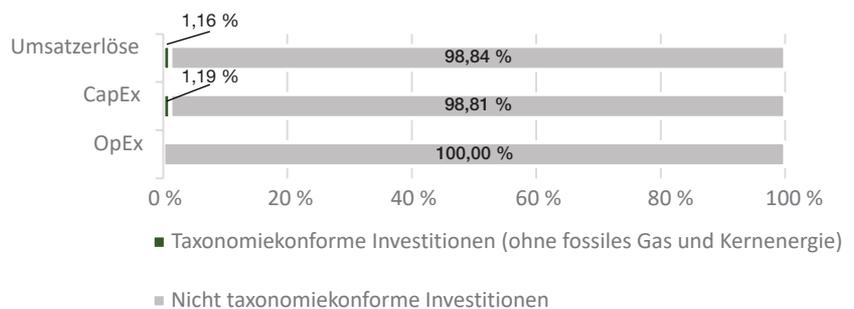
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

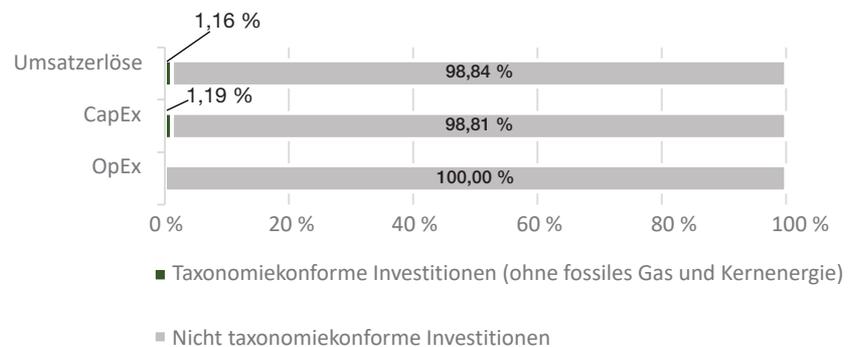
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitioneneinschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 44,52 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 23,19 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;

- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG RI Global Sustainable Growth (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493000EOQODBU42TL68

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 83,78 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“)
- Kreislaufwirtschaft

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- verantwortungsvolle Arbeitsbeziehungen
- Investitionen in menschliche Gesundheit

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“)) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principle Adverse Impact („PAI“)) (weitere Informationen zu den SDG finden Sie weiter unten). Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 50 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 50 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung der Beiträge zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen	Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	62,13 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3) ²	20,32 Tonnen CO ₂ e / Mio. USD
2.	Kreislaufwirtschaft	Industrie, Innovation und Infrastruktur (SDG 9)	26,70 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	28,01 %
Soziales			
3.	Verantwortungsvolle Arbeitsbeziehungen	Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	22,56 %
4.	Investitionen in menschliche Gesundheit	Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)	62,31 %
		Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	22,56 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds teilweise zu tätigen beabsichtigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der SDGs zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5);
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8);
- Industrie, Innovation und Infrastruktur (SDG 9)
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12) und
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13).

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

² Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) in seinen Due-Diligence-Prozess für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.

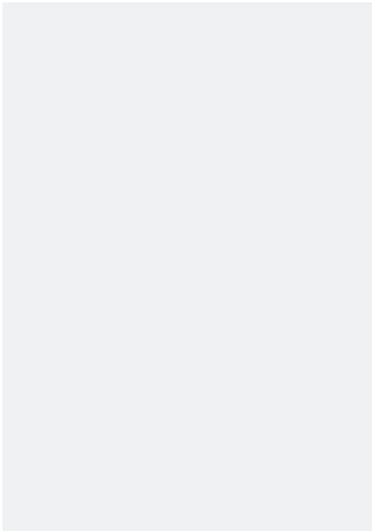


Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NOVO NORDISK AS	Gesundheitswesen	8,75 %	Denmark
VISA INC	Informations-	6,00 %	USA
L'OREAL	Basiskonsumgüter	5,89 %	Frankreich
SAP SE	Informationstechnologie	5,63 %	Deutschland
NESTLE S.A.	Basiskonsumgüter	5,49 %	Schweiz
ASML HOLDING N.V.	Informationstechnologie	4,73 %	Die Niederlande
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT	Zyklische Konsumgüter	4,54 %	Frankreich
ASTRAZENECEA PLC	Gesundheitswesen	4,53 %	Vereinigtes Königreich



MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	4,48 %	Vereinigtes Königreich
S&P GLOBAL INC	Finanzwerte	4,40 %	USA
ABCAM PLC	Gesundheitswesen	4,19 %	Vereinigtes Königreich
ESSILORLUXOTTICA SA	Gesundheitswesen	3,75 %	Frankreich
ANSYS, INC.	Informationstechnologie	3,48 %	USA
DELIVERY HERO SE	Zyklische Konsumgüter	3,27 %	Deutschland
ZOETIS INC.	Gesundheitswesen	2,78 %	USA

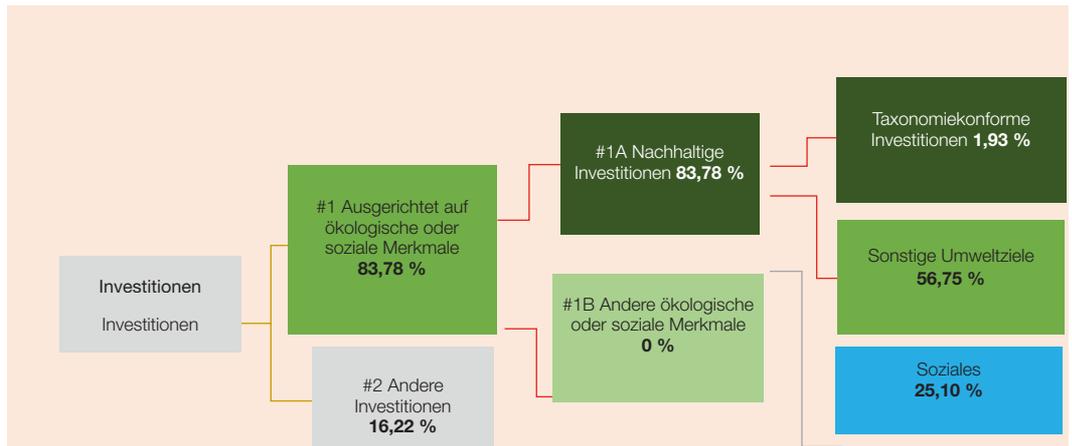


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Zyklische Konsumgüter	12,41 %
Basiskonsumgüter	11,38 %
Finanzwerte	4,40 %
Gesundheitswesen	32,83 %
Industrieunternehmen	3,42 %
Informationstechnologie	29,13 %
Grundstoffe	4,25 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

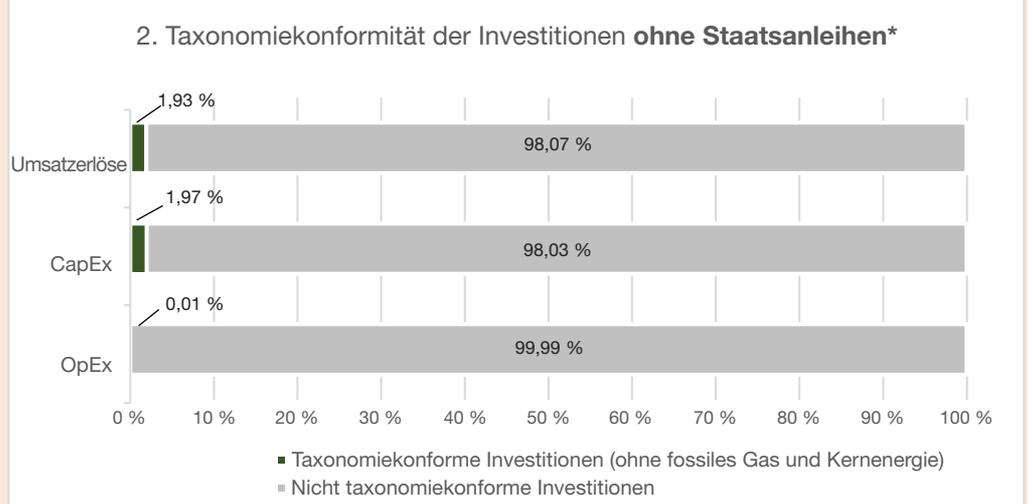
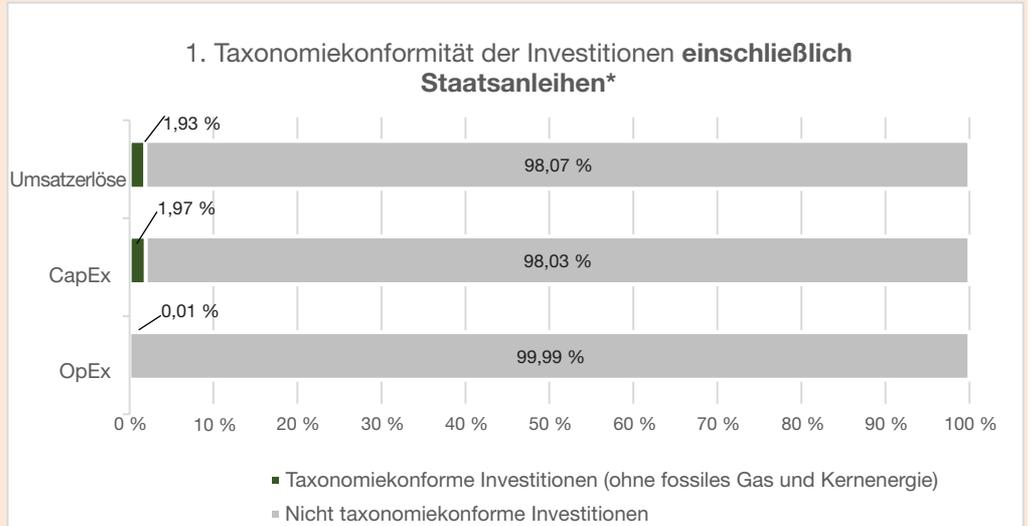
Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 56,75 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 25,10 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;

- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man Numeric Europe RI Climate (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900NJZDDLTB6R7472

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|--|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 75,76 % an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |
|--|--|

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Verwendung von Rohstoffen und
- Reduzierung der Wasserverschmutzung



Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals „SDG“)¹. Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, 50 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und sicherzustellen, dass alle Unternehmen des Anlageuniversums die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung der Beiträge zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.²

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Einsatz erneuerbarer Energien	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	42,45 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	51,03 %

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

² Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

2.	Reduzierung der Abfallerzeugung	Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	51,03 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3)	57,03 Tonnen CO2e / Mio. USD
		Angleichung des Teilfonds an das Temperaturziel des Pariser Abkommens (Zeithorizont von 2012 bis 2030)	1,7 Grad Celsius

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) in seinen Due-Diligence-Prozess für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt.

Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die negativen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der Anlageverwalter führt für die Zwecke der DNSH ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt. Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die negativen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft. Der Anlageverwalter berücksichtigt die folgenden Indikatoren. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar. Die wesentlichen negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden von der Verwaltungsgesellschaft und dem Anlageverwalter in Bezug auf den Teilfonds nicht berücksichtigt, da der Anlageverwalter ausschließlich quantitative Anlagestrategien anwendet, die derzeit nicht mit einer Prüfung der einzelnen Positionen in Bezug auf derartige negative Auswirkungen vereinbar sind.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MSCI EUROPE NR	Nicht klassifiziert	2,35 %	Euro-Staaten
NOVO NORDISK AS	Gesundheitswesen	2,32 %	Denmark
SIEMENS AKTIENGESELLSCHAFT	Industrieunternehmen	1,61 %	Deutschland
NOVARTIS AG	Gesundheitswesen	1,60 %	Schweiz
EQUINOR ASA	Energy	1,59 %	Norway
GALP ENERGIA SGPS SA	Energy	1,58 %	Portugal
NESTE OYJ	Energy	1,58 %	Finnland
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	Zyklische Konsumgüter	1,54 %	Spanien

ASML HOLDING N.V.	Informationstechnologie	1,50 %	Niederlande
SAP SE	Informationstechnologie	1,48 %	Deutschland
SWISSCOM AG	Kommunikationsdienstleistungen	1,47 %	Schweiz
BURBERRY GROUP PLC	Zyklische Konsumgüter	1,45 %	Vereinigtes Königreich
SWISS RE AG	Finanzwerte	1,45 %	Schweiz
RELX PLC	Industrieunternehmen	1,44 %	Vereinigtes Königreich
ROCHE HOLDING AG	Gesundheitswesen	1,43 %	Schweiz

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

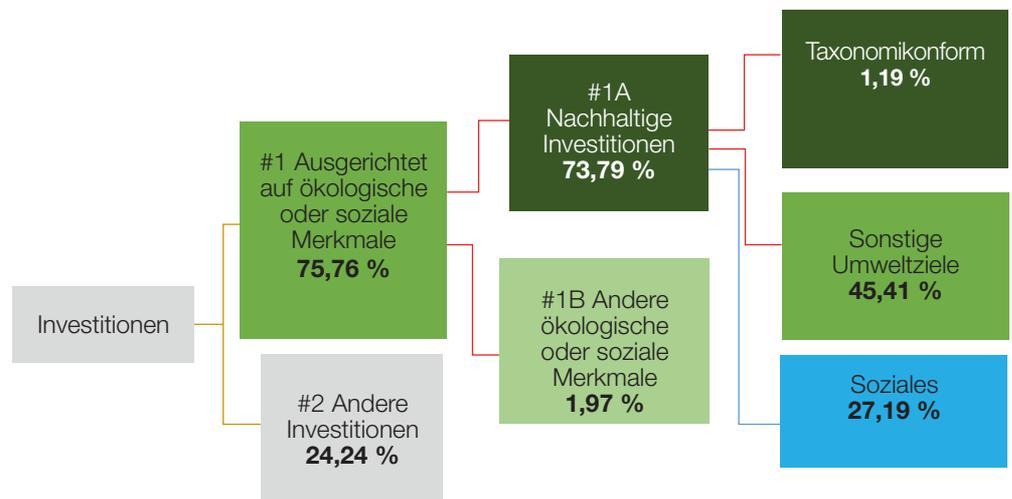


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	5,15 %
Zyklische Konsumgüter	10,98 %
Basiskonsumgüter	8,20 %
Energy	8,26 %
Finanzwerte	3,63 %
Gesundheitswesen	15,85 %
Industrieunternehmen	23,25 %
Informationstechnologie	8,43 %
Grundstoffe	9,89 %
Nicht klassifiziert	2,35 %
Versorger	2,18 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

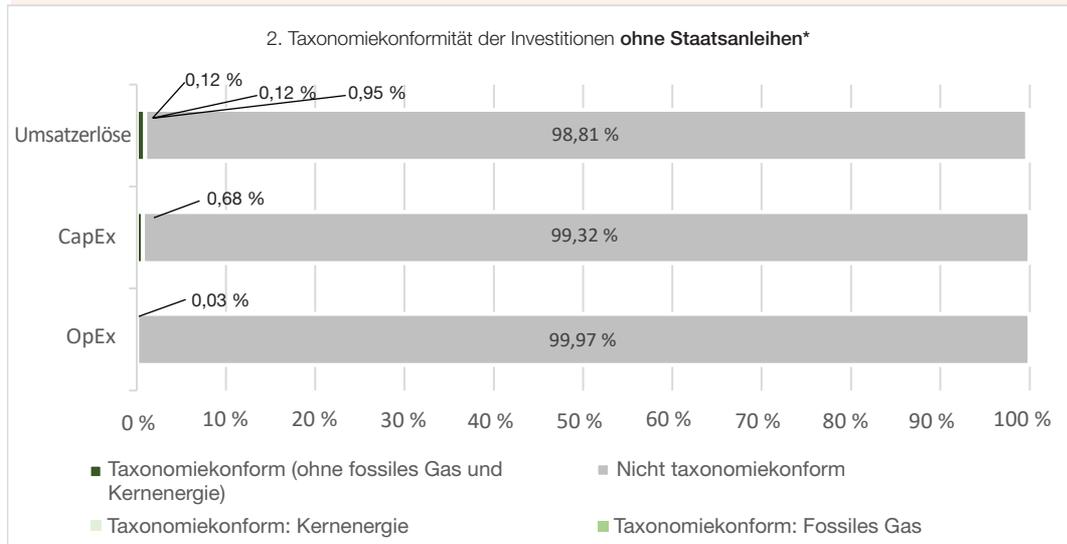
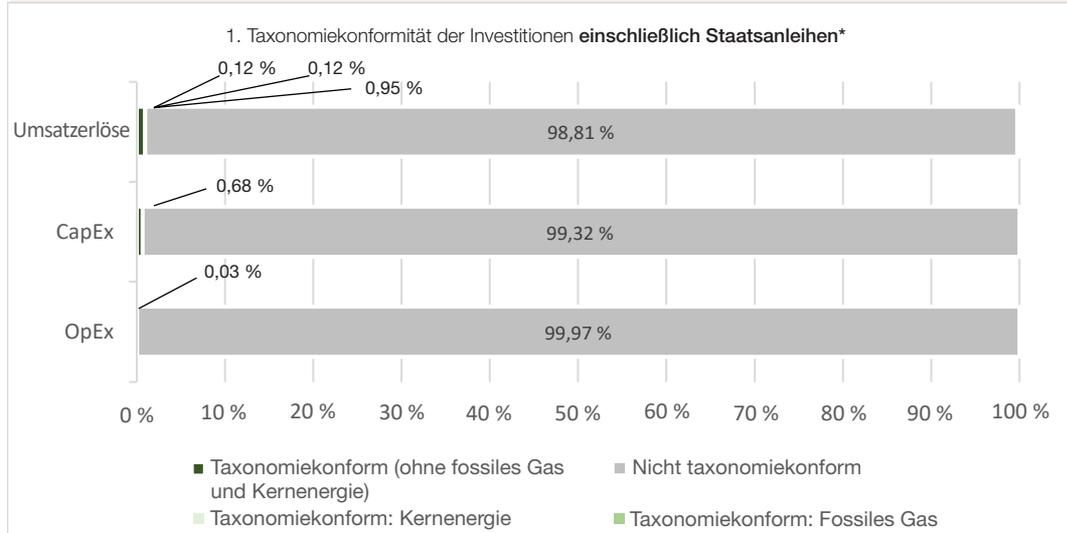
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds hat insgesamt 0,24 % seiner Investitionen in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie angelegt, die mit der EU-Taxonomie konform sind (ausgedrückt als Anteil der Einnahmen). Diese 0,24 % sind die Summe der Positionen in den Bereichen fossiles Gas und Kernenergie. Der Anlageverwalter hat für die Zwecke der grafischen Darstellung eine 50/50 Aufteilung zwischen fossilem Gas und Kernenergie geschätzt und daher in der Grafik 0,12 % für jede der beiden Aktivitäten ausgewiesen. Der Anlageverwalter weist darauf hin, dass bei dieser Aufteilung um eine Schätzung handelt, die er aufgrund fehlender relevanter Daten vornehmen musste. Insbesondere unterscheiden die verfügbaren Daten derzeit im Rahmen der Berichterstattung zur Taxonomiekonformität in Bezug auf die relevanten NACE-Sektorklassifizierungen nicht zwischen fossilem Gas und Kernenergie.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 45,41 %.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 27,19 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Asia (ex Japan) Equity (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 2549006XM3I7U65BJ879

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|---|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 60,88 % an nachhaltigen Investitionen</p> |
| <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> | <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> |
| <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> |
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Einsatz erneuerbarer Energien; und
- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“).

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Investitionen zugunsten wirtschaftlich oder sozial benachteiligter Bevölkerungsgruppen.

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“).¹ Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 33 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 33 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Einsatz erneuerbarer Energien	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	10,35 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	15,54 %
2.	Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	10,35 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	15,54 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3) ²	89,86 Tonnen CO ₂ e / Mio. USD
Soziales			
3.	Investitionen in wirtschaftlich oder sozial benachteiligte Gemeinden	Keine Armut (SDG 1)	15,17 %
		Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	44,15 %
		Weniger Ungleichheiten (SDG 10)	20,07 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Keine Armut (SDG 1);
- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7),
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8);
- Weniger Ungleichheiten (SDG 10) und
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13).

²Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen in den Prozess seiner sorgfältigen Prüfung (Due-Diligence) für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis obligatorischer und zusätzlicher PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („do no significant harm“, „DNSH“) gilt nur für die dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)	
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienstleistungen	6,39 %	China
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING COMPANY LIMITED	Informationstechnologie	6,32 %	Taiwan
AIA GROUP LIMITED	Finanzwerte	5,73 %	Hongkong
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	Finanzwerte	4,62 %	China

TRIP.COM GROUP LIMITED	Zyklische Konsumgüter	3,77 %	China
ICICI BANK LIMITED	Finanzwerte	3,57 %	Indien
PDD HOLDINGS INC	Zyklische Konsumgüter	3,46 %	China
SANDS CHINA LTD	Zyklische Konsumgüter	3,30 %	Macau
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	Finanzwerte	3,19 %	Hongkong
BANK MANDIRI	Finanzwerte	3,04 %	Indonesien
SK HYNIX INC	Informationstechnologie	2,96 %	Korea (Süd)
HDFC BANK LIMITED	Finanzwerte	2,91 %	Indien
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	Zyklische Konsumgüter	2,87 %	Indien
BHARTI AIRTEL LIMITED	Kommunikationsdienstleistungen	2,86 %	Indien
YUM CHINA HOLDINGS INC	Zyklische Konsumgüter	2,83 %	China

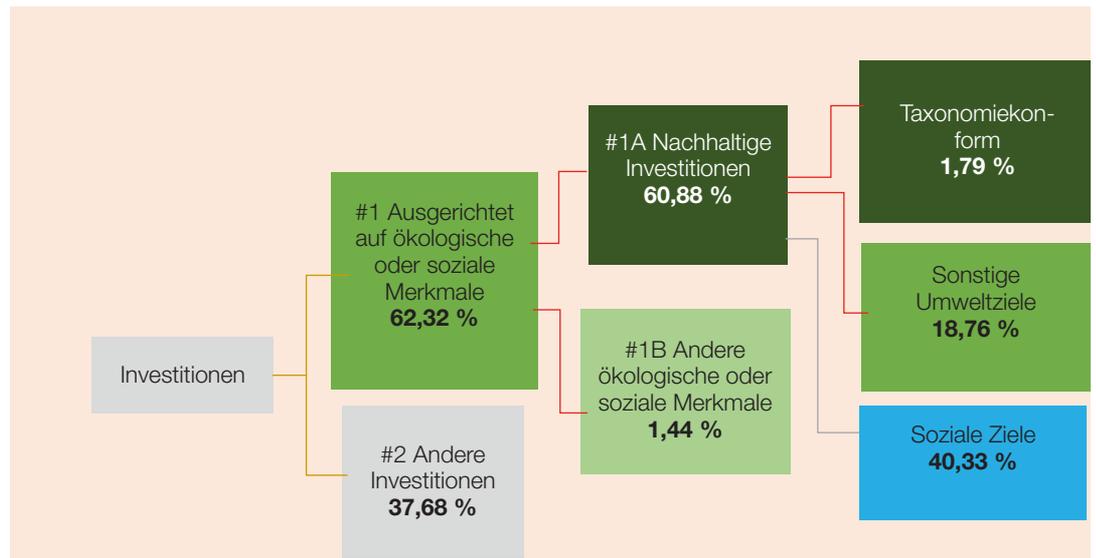
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	9,25 %
Zyklische Konsumgüter	17,40 %
Basiskonsumgüter	7,72 %
Finanzwerte	31,53 %
Gesundheitswesen	11,37 %
Industrieunternehmen	3,48 %

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

Informationstechnologie	14,35 %
Grundstoffe	1,00 %
Versorger	2,31 %



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

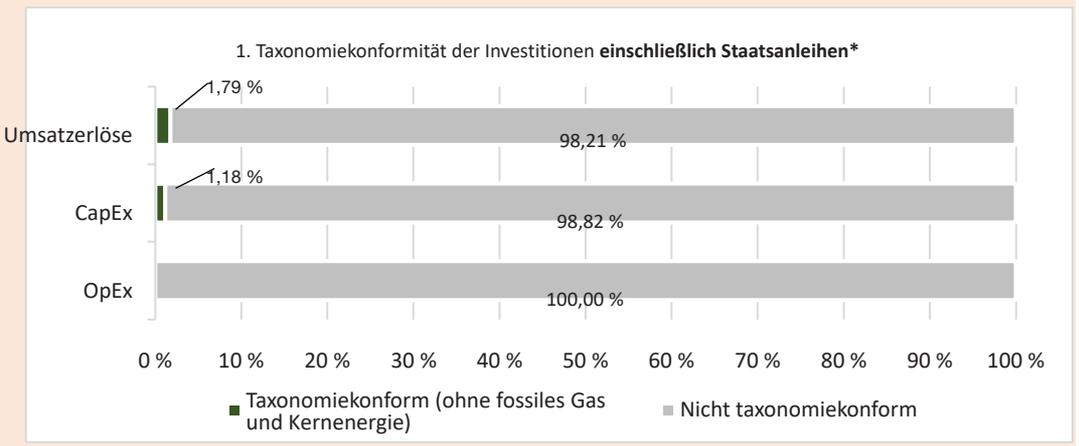
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

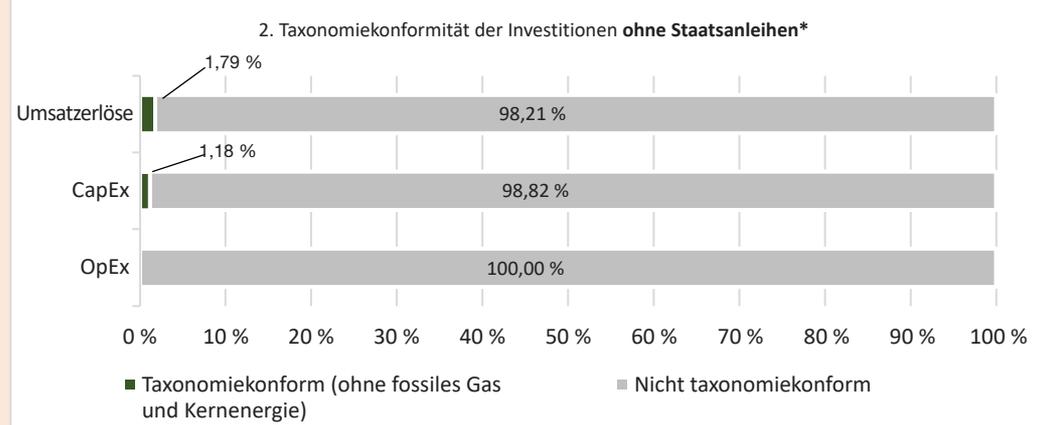
- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



s i n d nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 18,76 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 40,33 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements bzw. zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Man Funds plc

Ungeprüfte regelmäßige Angaben für die EU-Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) (Fortsetzung)



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Global Investment Grade Opportunities (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900VH6IB43U8VZH96

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 48,04 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Auswirkungen auf den Klimawandel (Faktoren wie Energieverbrauch und Kohlenstoffemissionen)
- Auswirkungen auf natürliche Ressourcen (Faktoren wie Rohstoffbeschaffung, Wasser- und Bodennutzung, biologische Vielfalt) und

- Auswirkungen auf Umweltverschmutzung und Abfall (Faktoren wie Abfallproduktion und toxische Emissionen)

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Beziehungen zu den lokalen Gemeinden und soziale Angebote – z. B. Zugang zu Wohnraum, Kommunikation, Finanzierungsmöglichkeiten und Gesundheitsversorgung.

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“).¹ Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Auswirkungen auf den Klimawandel: Faktoren wie Energienutzung und CO2-Emissionen,	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	6,33 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	28,49 %
2.	Auswirkungen auf natürliche Ressourcen (Faktoren wie Rohstoffbeschaffung, Wasser- und Bodennutzung, biologische Vielfalt) und	Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11)	17,17 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	12,39 %
3.	Auswirkungen auf Umweltverschmutzung und Abfall (Faktoren wie Abfallproduktion und toxische Emissionen)	Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11)	17,17 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	12,39 %
Soziales			
4.	Beziehungen zu den lokalen Gemeinden und soziale Angebote – z. B. Zugang zu Wohnraum, Kommunikation, Finanzierungsmöglichkeiten und Gesundheitsversorgung	Keine Armut (SDG 1)	8,25 %
		Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)	44,46 %
		Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	21,40 %
		Weniger Ungleichheiten (SDG 10)	7,01 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Keine Armut (SDG 1);
- Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)
- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7),
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)
- Weniger Ungleichheiten (SDG 10)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- Nachhaltige Städte und Gemeinden (SDG 11)
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12) und
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13).

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“) in seinen Due-Diligence-Prozess für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung

	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.

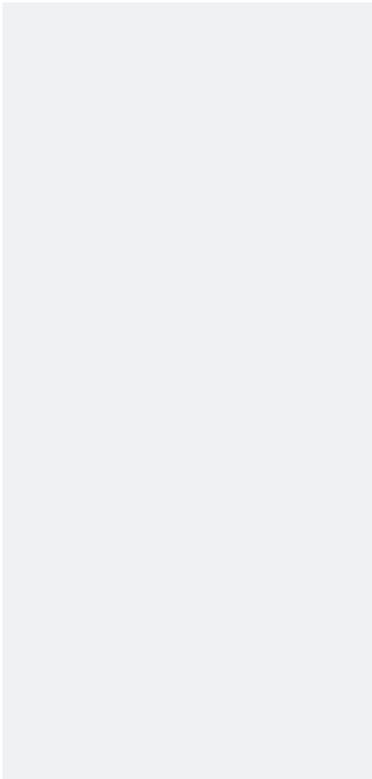


Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
GTC AURORA LUXEMBOURG S.A	Immobilien	5,13 %	Polen
SIRIUS REAL ESTATE LTD	Immobilien	4,96 %	Vereinigtes Königreich
INTERMEDIATE CAPITAL GROUP	Finanzwerte	4,80 %	Vereinigtes Königreich
INVESTEC PLC	Finanzwerte	4,29 %	Vereinigtes Königreich



SAINSBURY'S BANK PLC	Finanzwerte	4,23 %	Vereinigtes Königreich
VIVION INVESTMENTS S.A R.L.	Consumer	4,18 %	Luxemburg
CREDIT SUISSE GROUP AG	Finanzwerte	4,15 %	Schweiz
D.V.I. DEUTSCHE VERMOEGENS-UND	Immobilien	4,15 %	Deutschland
IG GROUP HOLDINGS PLC	Finanzwerte	4,13 %	Vereinigtes Königreich
UTMOST GROUP PLC	Finanzwerte	3,93 %	Vereinigtes Königreich
SHAWBROOK GROUP PLC	Finanzwerte	3,84 %	Vereinigtes Königreich
BANK OF VALLETTA P.L.C.	Finanzwerte	3,53 %	Malta
CHESNARA PLC	Finanzwerte	3,51 %	Vereinigtes Königreich
FEL ENERGY VI SARL	Energy	3,25 %	Luxemburg
RAIFFEISEN BANK ZRT.	Finanzwerte	2,93 %	Ungarn

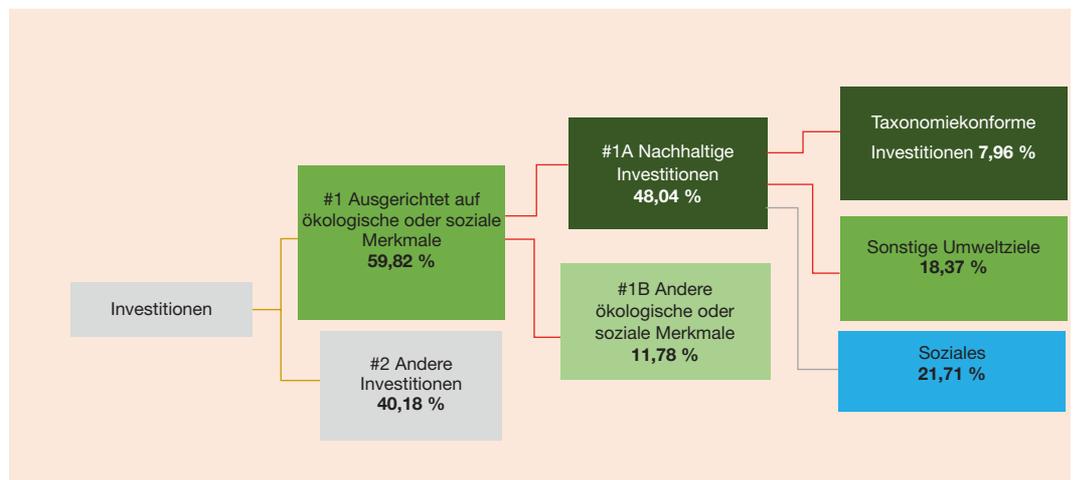


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.²



² Obwohl im Prospekt des Teilfonds erwähnt wird, dass sich der Anlageverwalter verpflichtet hat, einen Mindestanteil des Nettoinventarwerts des Portfolios in nachhaltige Anlagen zu investieren, sei darauf hingewiesen, dass der Teilfonds im Rahmen seiner Anlagestrategie möglicherweise Hebeleffekte eingesetzt hat und daher von Zeit zu Zeit ein Gesamtengagement hatte, das größer war als sein Nettoinventarwert.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen.³⁴

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	2,11 %
Zyklische Konsumgüter	9,84 %
Energy	6,37 %
Finanzwerte	62,04 %
Gesundheitswesen	4,45 %
Industrieunternehmen	3,98 %
Informationstechnologie	0,43 %
Grundstoffe	2,24 %
Immobilien	28,02 %
Nicht klassifiziert	0,37 %
Versorger	1,89 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

Für die Zwecke dieses Abschnitts sei darauf hingewiesen, dass der Teilfonds Hebeleffekte einsetzt und mitunter zu mehr als 100 % investiert sein kann. Die Tabelle in diesem Abschnitt beinhaltet den tatsächlichen Prozentsatz des investierten Kapitals in den einzelnen Sektoren. betragen die aufgeführten Prozentsätze insgesamt mehr als 100 %.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

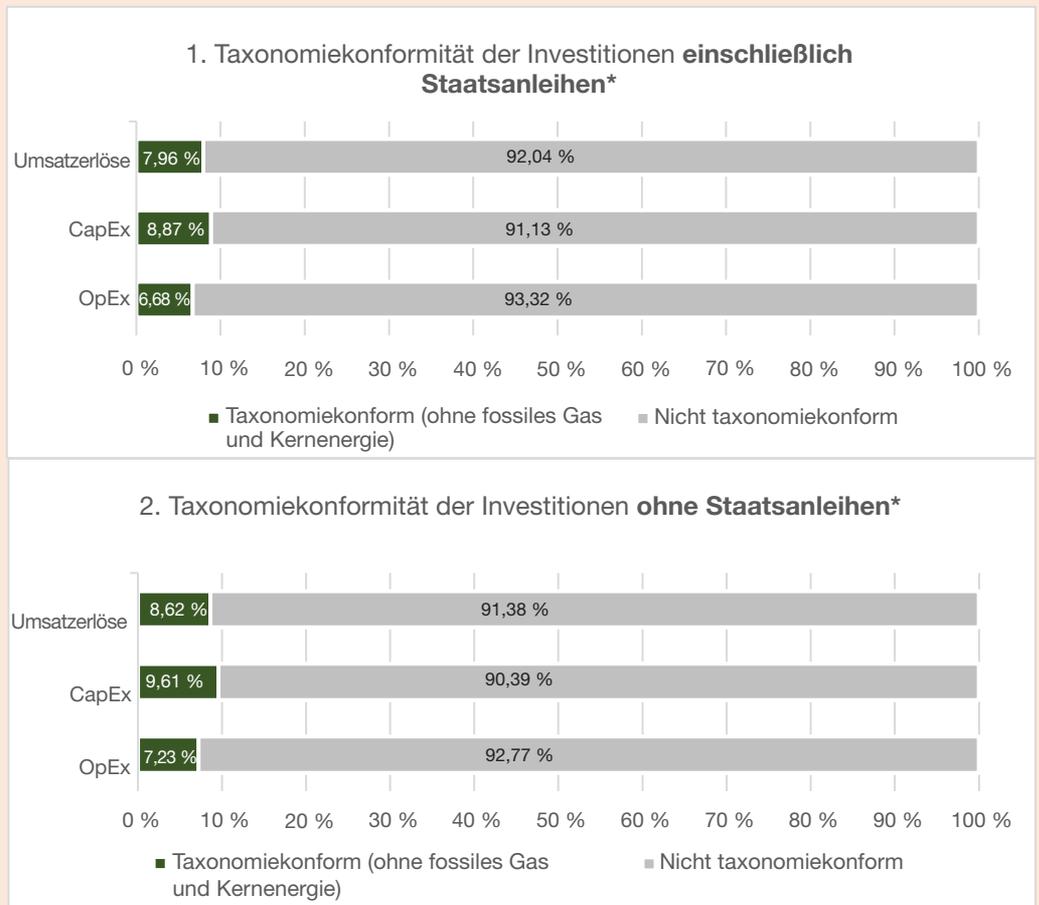
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt als Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁵ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 92,33 % der Gesamtinvestitionen wieder.

⁵ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 18,37 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 21,71 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen;

- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse; und
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG China Equity (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900TTX1UISTA91X07

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|---|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 47,28% an nachhaltigen Investitionen</p> |
| <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> | <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> |
| <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> |
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> |
| <p><input type="checkbox"/></p> | <p>Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Einsatz erneuerbarer Energien; und
- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“).

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Investitionen zugunsten wirtschaftlich oder sozial benachteiligter Bevölkerungsgruppen.

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“).¹ Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Einsatz erneuerbarer Energien	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	13,32 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	19,58 %
2.	Reduzierung von THG-Emissionen	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	13,32 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	19,58 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3) ²	90,78 Tonnen CO ₂ e / Mio. USD
Soziales			
3.	Investitionen in wirtschaftlich oder sozial benachteiligte Gemeinden	Keine Armut (SDG 1)	7,09 %
		Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8)	30,10 %
		Weniger Ungleichheiten (SDG 10)	11,59 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds tätigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der unten genannten Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, waren die Erreichung der SDG-Ziele, die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale maßgeblich sind, nämlich:

- Keine Armut (SDG 1);
- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7),
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum (SDG 8);
- Weniger Ungleichheiten (SDG 10) und
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13).

Die nachhaltigen Anlagen trugen aufgrund ihrer Ausrichtung auf die maßgeblichen SDGs, die oben dargelegt werden, zu dem genannten nachhaltigen Anlageziel bei.

²Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen in den Prozess seiner sorgfältigen Prüfung (Due-Diligence) für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	Finanzwerte	9,41 %	China
TRIP.COM GROUP LIMITED	Zyklische Konsumgüter	7,11 %	China
PDD HOLDINGS INC	Zyklische Konsumgüter	7,00 %	China
AIA GROUP LIMITED	Finanzwerte	6,26 %	Hongkong
TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienstleistungen	5,09 %	China
SANDS CHINA LTD	Zyklische Konsumgüter	4,93 %	Macau

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

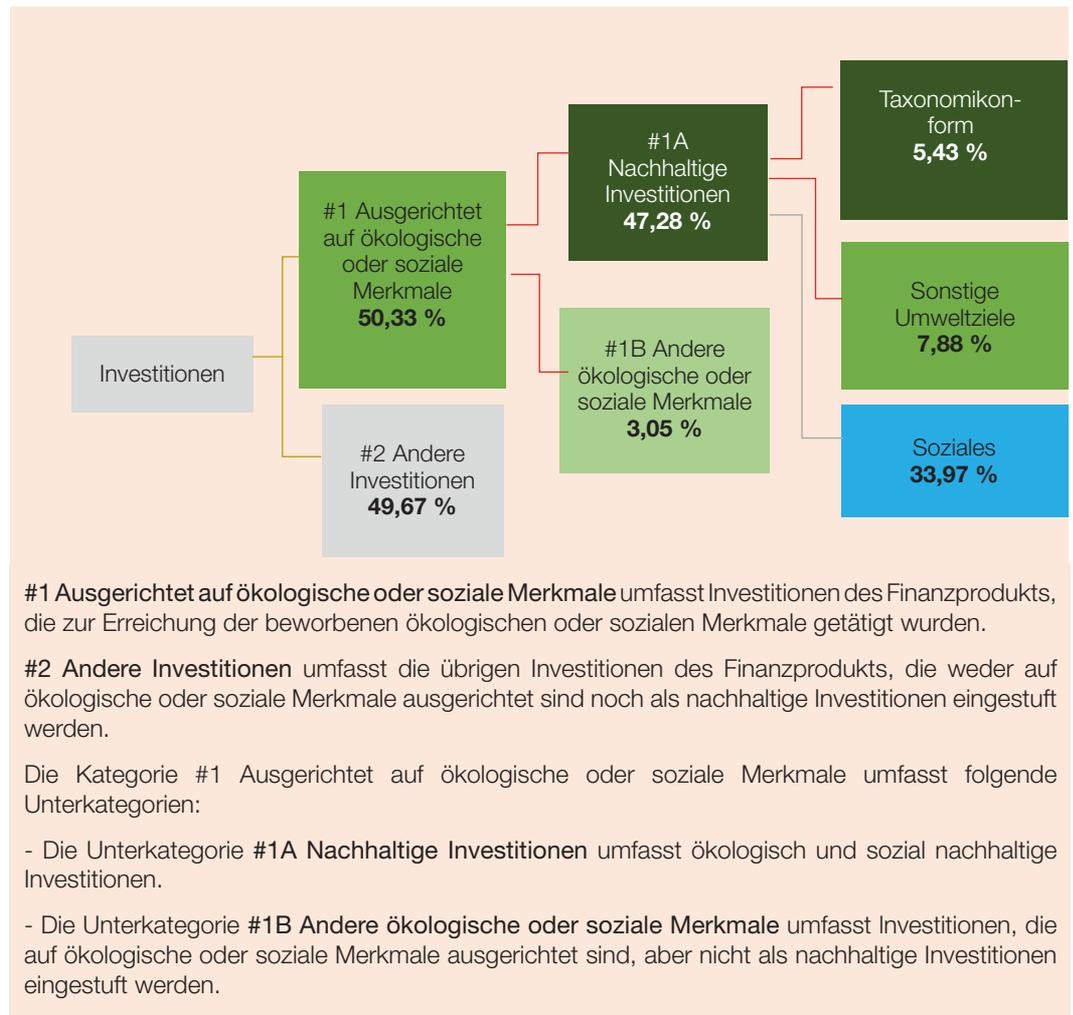
TSINGTAO BREWERY CO LTD	Basiskonsumgüter	4,65 %	China
PHARMARON BEIJING CO., LTD.	Gesundheitswesen	4,62 %	China
CHAILEASE HOLDING COMPANY LIMITED	Finanzwerte	4,48 %	Taiwan
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	Finanzwerte	4,34 %	China
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	Versorger	4,30 %	China
YUM CHINA HOLDINGS INC	Zyklische Konsumgüter	4,13 %	China
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	Industrieunternehmen	4,03 %	Taiwan
SHENZHEN MINDRAY BIOMEDICAL ELECTRONICS CO., LTD.	Gesundheitswesen	3,95 %	China
EAST MONEY INFORMATION CO.,LTD.	Finanzwerte	3,54 %	China

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	5,09 %
Zyklische Konsumgüter	30,37 %
Basiskonsumgüter	7,55 %
Finanzwerte	28,03 %
Gesundheitswesen	15,32 %
Industrieunternehmen	6,29 %
Grundstoffe	0,93 %

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

Versorger 5,92 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
 - In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

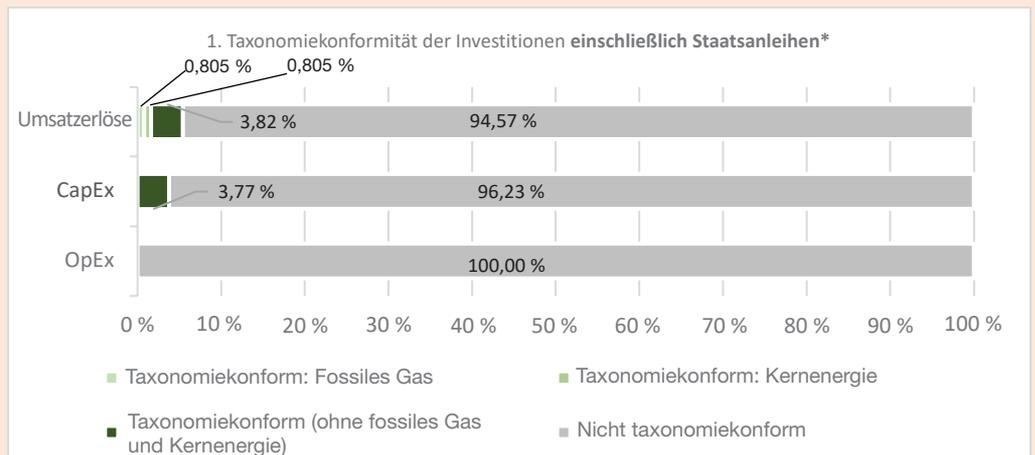
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

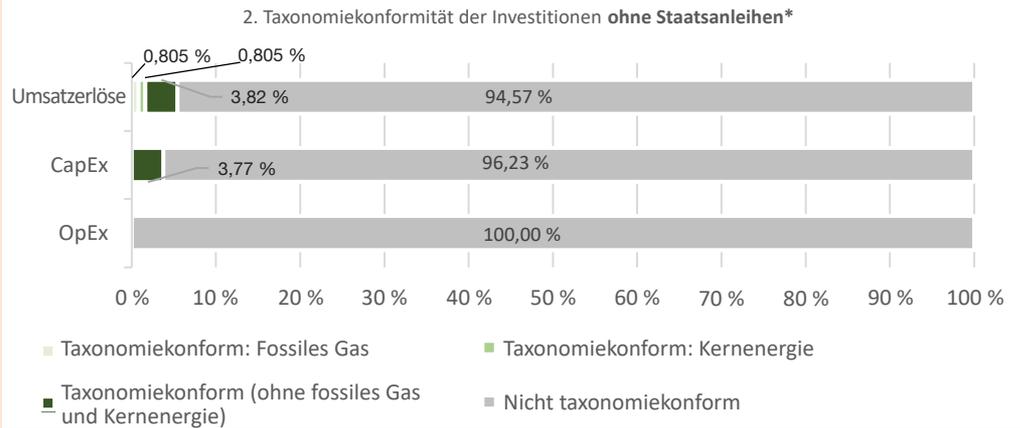
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds hat insgesamt 1,61 % seiner Investitionen in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie angelegt, die mit der EU-Taxonomie konform sind (ausgedrückt als Anteil der Einnahmen). Diese 1,61 % sind die Summe der Positionen in den Bereichen fossiles Gas und Kernenergie. Der Anlageverwalter hat für die Zwecke der grafischen Darstellung eine 50/50 Aufteilung zwischen fossilem Gas und Kernenergie geschätzt und daher in der Grafik 0,805 % für jede der beiden Aktivitäten ausgewiesen. Der Anlageverwalter weist darauf hin, dass bei dieser Aufteilung um eine Schätzung handelt, die er aufgrund fehlender relevanter Daten vornehmen musste. Insbesondere unterscheiden die verfügbaren Daten derzeit im Rahmen der Berichterstattung zur Taxonomiekonformität in Bezug auf die relevanten NACE-Sektorklassifizierungen nicht zwischen fossilem Gas und Kernenergie.

Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 7,88 %.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 33,97 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten



gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den „#verbleibenden“ Investitionen des Teilfonds gehörten auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprachen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements oder zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|---|--|
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 96,68 % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___ % an nachhaltigen Investitionen |
| <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 1,00 % | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Anlageziel des Teilfonds besteht darin, die Finanzierung von Unternehmen zu unterstützen, die Lösungen und Technologien in Verbindung mit dem Kampf gegen Wasserknappheit anbieten, die die Versorgung und Aufbereitung von qualitativ hochwertigem Wasser verbessern und/oder die Herausforderungen der Kreislaufwirtschaft in Angriff nehmen.

Der Teilfonds erfüllte das nachhaltige Anlageziel während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen des nachhaltige Anlageziel des Teilfonds wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“)¹. Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 5 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltigen Anlagen mit Umweltziel zu halten, die als mit der EU-Taxonomie konform einzustufen sind, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen des Anlageuniversums die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen und die Erreichung des nachhaltigen Anlageziels) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, das formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen:

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Nutzung von Wasser,	Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen (SDG 6)	56,77 %
		Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	60,09 %
2.	Kreislaufwirtschaft	Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	60,09 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend– der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen in den Prozess seiner sorgfältigen Prüfung (Due-Diligence) für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis obligatorischer und zusätzlicher PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.



Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- Entscheidung gegen die Investition;
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten verbessern.

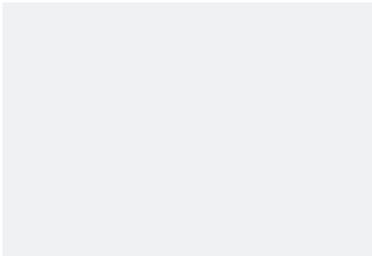
Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Das Verzeichnis umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMERICAN WATER WORKS COMPANY, INC.	Versorger	5,76 %	USA
DANAHER CORPORATION	Gesundheitswesen	5,58 %	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	Gesundheitswesen	5,01 %	USA
VEOLIA ENVIRONNEMENT	Versorger	4,63 %	Frankreich
REPUBLIC SERVICES, INC.	Industrieunternehmen	4,27 %	USA
ESSENTIAL UTILITIES INC	Versorger	4,01 %	USA
VALMONT INDUSTRIES	Industrieunternehmen	3,87 %	USA
IDEX CORP	Industrieunternehmen	3,86 %	USA
PTC INC	Informationstechnologie	3,62 %	USA
PENNON GROUP PLC	Versorger	3,48 %	Vereinigtes Königreich
SEVERN TRENT PLC	Versorger	3,40 %	Vereinigtes Königreich
WASTE CONNECTIONS INC	Industrieunternehmen	3,29 %	Kanada



CLEAN HARBORS, INC.	Industrieunternehmen	3,06 %	USA
ROPER INDUSTRIES INC	Industrieunternehmen	3,05 %	USA
AGILENT TECHNOLOGIES, INC.	Gesundheitswesen	3,04 %	USA

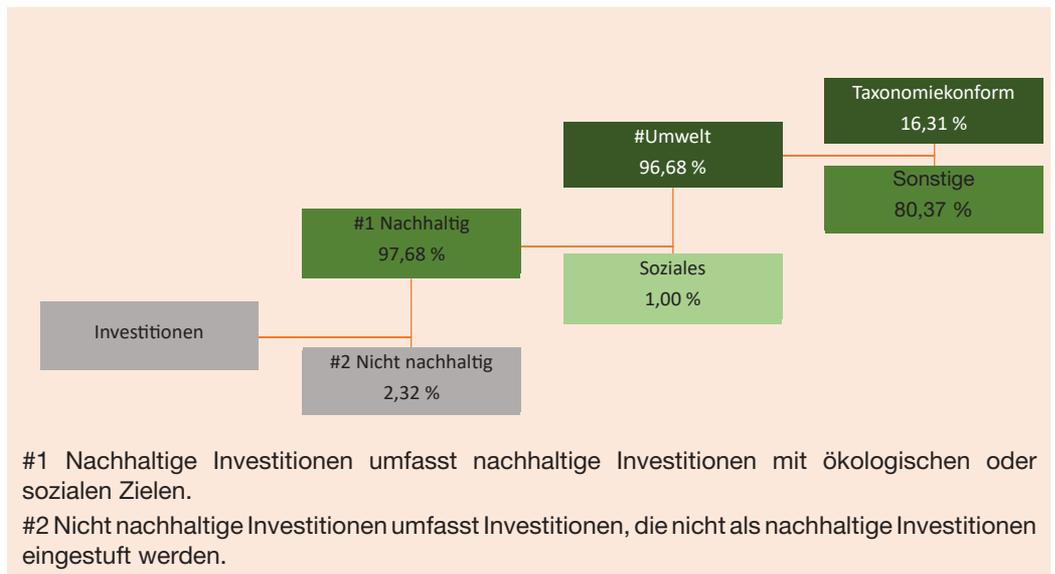


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen².

GICS-Sektor	% des Kapitals
Zyklische Konsumgüter	0,99 %
Gesundheitswesen	15,08 %

²Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

Industrieunternehmen	46,61 %
Informationstechnologie	5,68 %
Grundstoffe	5,89 %
Versorger	23,43 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Teilfonds hat sich verpflichtet, mindestens 5 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in ökologisch nachhaltigen Anlagen zu halten, die als mit der EU-Taxonomie konform einzustufen sind. Nachfolgend wird erläutert, inwieweit nachhaltige Investitionen mit Umweltziel während des Berichtszeitraums mit der EU-Taxonomie konform waren.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Nein

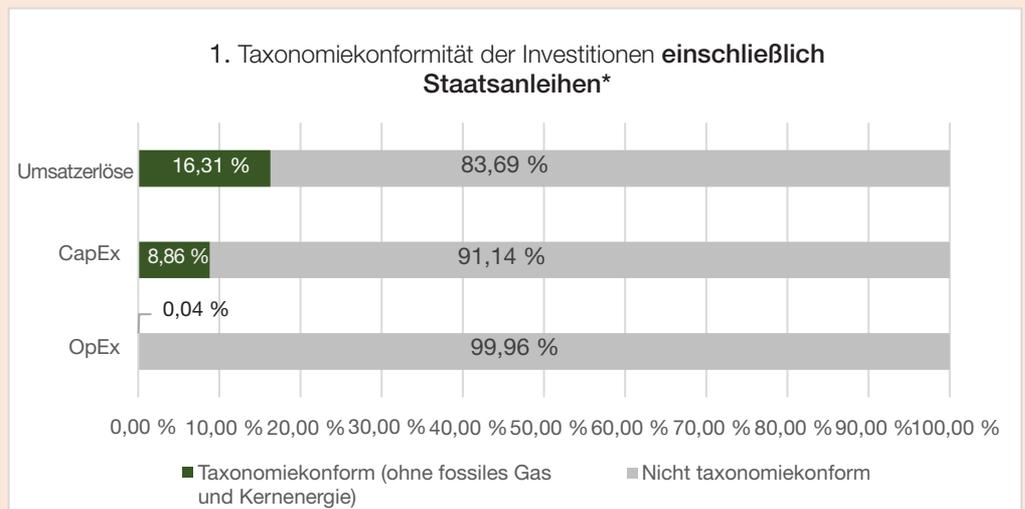
Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

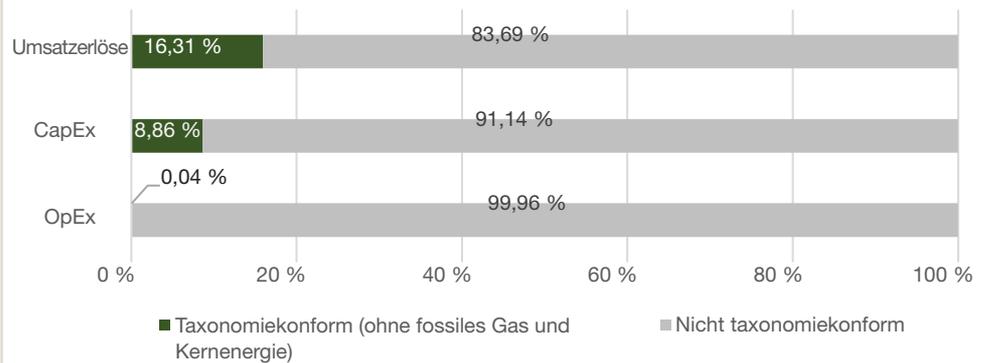
Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen. Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



2. Taxonomiekonformität der Investitionen **ohne Staatsanleihen***



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds investierte nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie konform sind

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen. Der Teilfonds hat zum 31. Dezember 2022 seine Verpflichtungen gemäß der EU-Taxonomie entsprechend den vorvertraglichen Angaben (im Anhang des Prospekts) in Prozent des NIW und in Prozent des gesamten Netto-Long-Engagements gegenüber Emittenten erfüllt.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 80,74 %.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 1,00 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nach der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.





Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die „#2 anderen Investitionen“ des Teilfonds betrafen Investitionen angelegt, die für das Liquiditätsmanagement durchgeführt wurden und über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügten, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Anlageverwalter hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um das nachhaltige Anlageziel des Teilfonds zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- potenzielle Investitionen wurden mithilfe des DNSH Tests überprüft, wie oben beschrieben;
- In jeden Schritt des Investitionsprozesses werden Nachhaltigkeitskriterien integriert: Das Verhalten und die Richtlinien der Unternehmen im Hinblick auf die Bereiche Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) wird anhand von Informationen bewertet, die von Drittanbietern zur Verfügung gestellt werden (z. B. ESG-Scores), sofern diese Informationen verfügbar sind. Zu den berücksichtigten Verhaltensweisen und Richtlinien gehören u. a. die Nutzung von Wasser und Land, die Abfallproduktion, die Nutzung erneuerbarer Energien, die Vielfalt der Belegschaft und die Vergütung der Führungskräfte.
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;
- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- [die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt]. *[Hinweis: Artikel 9s ist von Man zu bestätigen]*



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Teilfonds.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Man Funds plc – Man GLG Sustainable Strategic Income (der „Teilfonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900G7WC8068OI9686

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja Nein

- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 85,78 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___% | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> | Es wurden damit ökologische/ soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom Teilfonds beworbene ökologische Merkmale:

- Nutzung von Energie,
- Verwendung von Rohstoffen und
- Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen („THG“).

Vom Teilfonds beworbene soziale Merkmale:

- Bekämpfung von Ungleichheiten.

Der Teilfonds erfüllte diese Merkmale während des Berichtszeitraums, wie nachfolgend näher erläutert wird.

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum in nachhaltige Investitionen angelegt. Die Ziele der nachhaltigen Anlagen und die Beiträge der nachhaltigen Anlagen zu diesen Zielen werden nachfolgend dargelegt.

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt. Nachfolgend werden weitere Einzelheiten zum Grad der Taxonomiekonformität der vom Teilfonds getätigten Anlagen dargelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale wird mit den unten angeführten Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen. Bei den Indikatoren handelt es sich um die von den UN vorgeschriebenen Ziele für nachhaltige Entwicklung (UN Sustainable Development Goals („SDG“)) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principle Adverse Impact („PAI“)).

Die Nachhaltigkeitsindikatoren haben zur Einhaltung der Zielsetzung des Teilfonds beigetragen, mindestens 75 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in nachhaltige Anlagen zu investieren und mindestens 75 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Anlagen zu halten, die die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllen, und sicherzustellen, dass alle Unternehmen, in die investiert wurde, die ESG-Kriterien erfüllen. Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung der Beiträge zu einem ökologischen oder sozialen Ziel. Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, die formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Konformität der Anlagen des Teilfonds mit jedem Nachhaltigkeitsindikator als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in Übereinstimmung mit dem oben beschriebenen Verfahren.²

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

¹ Es gibt 17 Ziele für Nachhaltige Entwicklung: (1) Keine Armut, (2) Kein Hunger, (3) Gesundheit und Wohlergehen, (4) Hochwertige Bildung, (5) Gleichstellung der Geschlechter, (6) Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, (7) Bezahlbare und saubere Energie, (8) Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum, (9) Industrie, Innovation und Infrastruktur, (10) Weniger Ungleichheiten (11) Nachhaltige Städte und Gemeinden, (12) Nachhaltiger Konsum und Produktion, (13) Maßnahmen zum Klimaschutz, (14) Leben unter Wasser (15) Leben an Land, (16) Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen, (17) Partnerschaften zur Erreichung der Ziele.

² Angaben dazu, wie die PAI abgeschnitten haben, sind auf Anfrage erhältlich.

	Beworbenes Merkmal	Nachhaltigkeitsindikator	Konformität (in % des NIW)
Umwelt			
1.	Die Nutzung von Energie	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	35,70 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	46,68 %
2.	Die Verwendung von Rohstoffen	Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)	16,25 %
3.	Reduzierung von Treibhausgas-Emissionen	Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7)	35,70 %
		Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13)	46,68 %
		Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3)	175,45 Tonnen CO ₂ e / Mio. USD
Soziales			
4.	Bekämpfung von Ungleichheit	Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5)	51,17 %
		Weniger Ungleichheiten (SDG 10)	9,10 %

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für die Zwecke dieses periodischen Berichts nicht zutreffend, da der Teilfonds keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht hat.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds teilweise zu tätigen beabsichtigt, ist es, einen Beitrag zur Erreichung der SDGs zu leisten. Die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Teilfonds während des Berichtszeitraums getätigt hat, betrafen die Erreichung der SDG-Ziele und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principle Adverse Impact („PAI“), die für die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale und der PAI maßgeblich sind, nämlich:

- Gleichstellung der Geschlechter (SDG 5);
- Bezahlbare und saubere Energie (SDG 7),
- Weniger Ungleichheiten (SDG 10);
- Nachhaltigkeit bei Konsum und Produktion (SDG 12)
- Maßnahmen zum Klimaschutz (SDG 13); und
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - WACI) (PAI 3)

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der Anlageverwalter verwendet die Ausrichtung an den SDGs als Richtwert für die Messung des Beitrags zu einem ökologischen oder sozialen Ziel.

Der Anlageverwalter hat ein eigenes Verfahren (das „SDG Framework“) eingeführt, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs (und damit den Beitrag zu ökologischen oder sozialen Zielen) zu messen. Das SDG Framework kombiniert Daten von drei externen Datenanbietern, um das Ausmaß der Ausrichtung eines Emittenten auf die SDGs zu messen und einen Alignment Score zu erstellen, der eine positive Ausrichtung auf ein oder mehrere SDGs für eine bestimmte Investition zeigen kann.

Das Ergebnis dieses Prozesses ist ein Verzeichnis von Emittenten, das der Anlageverwalter verwenden kann und das formal als einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen auf der Grundlage des SDG-Regelwerks entsprechend bestimmt wurden. Wenn der Teilfonds in einen dieser Emittenten investiert, werden diese Emittenten dementsprechend als „Beitrag“ zu dem Ziel behandelt, zur Erreichung der relevanten SDGs beizutragen, auf die die betreffende Anlage durch ihre positive Bewertung ausgerichtet ist.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageverwalter hat den Test in Bezug auf den Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen in den Prozess seiner sorgfältigen Prüfung (Due-Diligence) für Investitionen integriert.

Der Anlageverwalter bewertet den DNSH-Test unter Bezugnahme auf die PAI-Indikatoren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter führt ein Verzeichnis mit obligatorischen und zusätzlichen PAI-Indikatoren, die er im Rahmen des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen berücksichtigt (siehe unten unter „Wie werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“) Mit anderen Worten: Es gibt ein Verzeichnis von Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer der Anlageverwalter Daten über die nachteiligen Auswirkungen von Investitionen einholt und überprüft.

Für die Zwecke des DNSH legt der Anlageverwalter seine eigene subjektive Schwelle dafür fest, was er als erheblichen Schaden ansieht. Dies wird in der Regel auf einer relativen Basis zur Benchmark für die Branche des jeweiligen Emittenten beurteilt. Wenn eine bestimmte potenzielle Anlage nach Einschätzung des Anlageverwalters erheblichen Schaden anrichtet, wird sie von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen. Während des Berichtszeitraums wurden alle potenziellen Anlagen bei denen festgestellt wurde, dass sie erheblichen Schaden anrichten, von der Behandlung als „nachhaltige Anlage“ ausgeschlossen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Anlageverwalter hat sichergestellt, dass nachhaltige Anlagen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang stehen, indem er im Rahmen seiner sorgfältigen Prüfung (Due Diligence) bei Anlagen in Unternehmen auf Emittentenebene prüft, ob ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen oder die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte vorliegt. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen. Jedes Unternehmen, das gegen die OECD-

Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte verstößt, wird als Unternehmen betrachtet, das erheblichen Schaden anrichtet, und wird daher von der Behandlung als nachhaltige Investition ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die Anlagen, die dem restlichen Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die PAI seiner Investitionsentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er diese Entscheidungen anhand der folgenden PAI-Indikatoren bewertete: (i) alle obligatorischen Indikatoren, die in Tabelle 1 von Anhang I technischer Regulierungsstandards der Offenlegungsverordnung (SFDR) (Delegierte Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission) (die „RTS“) aufgeführt sind, und (ii) bestimmte relevante Indikatoren aus Tabelle 2 und Tabelle 3 der RTS.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Indikatoren für den Teilfonds berücksichtigt. Die Indikatoren gelten nur für Investitionen in Unternehmen, mit Ausnahme der Indikatoren 15 und 16 in Tabelle 1, die für Investitionen in staatliche Emittenten gelten.

	Obligatorisch (aus Tabelle 1, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
1.	THG-Emissionen
2.	CO2-Fußabdruck
3.	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
4.	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
5.	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
6.	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
7.	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
8.	Emissionen in Wasser
9.	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
10.	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
11.	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
12.	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
13.	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
14.	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
15.	THG-Emissionsintensität
16.	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

	Zusätzlich (aus Tabelle 2, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
4.	Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen
6.	Wasserverbrauch und Recycling
7.	Investitionen in Unternehmen ohne Wasserbewirtschaftungsmaßnahmen
15.	Entwaldung
	Zusätzlich (aus Tabelle 3, Anhang I der Technischen Regulierungsstandards)
6.	Unzureichender Schutz von Hinweisgebern
9.	Fehlende Menschenrechtspolitik
15.	Fehlende Maßnahmen zur Bekämpfung von Korruption und Bestechung
16.	Unzureichende Maßnahmen bei Verstößen gegen die Standards zur Korruptions- und Bestechungsbekämpfung

Der Anlageverwalter hat bei jeder Investition eine Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) durchgeführt, die eine quantitative Bewertung der Auswirkungen der Investition im Hinblick auf die oben genannten Indikatoren umfasst, um etwaige durch diese Indikatoren festgestellte nachteilige Auswirkungen zu beurteilen. Wenn beispielsweise eine Messgröße ein numerisches Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn sie im Vergleich zum jeweiligen Sektor des Emittenten im untersten Dezil liegt. Wenn die Messgröße ein binäres Ergebnis für eine bestimmte Investition erzeugt, geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Investition nachteilige Auswirkungen hat, wenn das Ergebnis der schädlichen Ausprägung des binären Ergebnisses entspricht. Der Anlageverwalter überprüfte auch die nachteiligen Auswirkungen auf Grundlage der Wesentlichkeit in Bezug auf jeden relevanten Sektor und jede Gerichtsbarkeit.

Der Anlageverwalter hat im Anschluss an die quantitativen und materiellen Bewertungen entschieden, welche Maßnahmen zu ergreifen sind, um die festgestellten nachteiligen Auswirkungen zu begrenzen oder zu verringern. Diese Maßnahmen umfassten (vorbehaltlich der Verpflichtung bei des Anlageverwalters, jederzeit im besten Interesse des Teilfonds und seiner Anleger in Übereinstimmung mit den Investitionszielen und der Anlagepolitik des Teilfonds zu handeln):

- den Verkauf der Anlage
- die Beschränkung der Positionsgröße der Anlage oder
- die Durchführung der Anlage mit der Absicht, sich mit der Unternehmensleitung des Emittenten mit dem Ziel in Verbindung zu setzen, das sie ihre Geschäftstätigkeit unter Nachhaltigkeitsaspekten und in Übereinstimmung mit den Richtlinien des Anlageverwalters verbessern.

Die Auswirkungen der Investitionen des Teilfonds auf die vorgenannten Indikatoren wurden auf vierteljährlicher Basis überwacht und bewertet. Ausführliche Angaben zu den auf Emittentenebene durchgeführten Maßnahmen sind auf Anfrage vom Anlageverwalter erhältlich.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptanlagen des Teilfonds werden mit Stand vom 31. Dezember 2022 ausgewiesen. Hinweis: Die Spalte „in % der Vermögenswerte“ für die Zwecke dieses Abschnitts bezieht sich auf das Engagement bei jedem zu Grunde liegenden Emittenten in % des gesamten Kapitals/ NIW des Teilfonds.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MIDAMERICAN ENERGY COMPANY	Versorger	6,65 %	USA
ELECTRICITE DE FRANCE	Versorger	4,57 %	Frankreich
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	Finanzwerte	4,31 %	Vereinigtes Königreich
VERIZON COMMUNICATIONS	Kommunikationsdienstleistungen	3,73 %	USA
BANK OF IRELAND GROUP PLC	Finanzwerte	3,67 %	Irland
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV	Versorger	3,39 %	Italien
EDP- ENERGIAS DE PORTUGAL, S.A.	Versorger	3,37 %	Portugal
CO-OPERATIVE GROUP LIMITED	Nicht klassifiziert	3,28 %	Vereinigtes Königreich
ZF FINANCE GMBH	Zyklische Konsumgüter	3,08 %	Deutschland
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	Informations technologie	3,08 %	USA
DEUTSCHE BANK AG -REG	Finanzwerte	3,01 %	Deutschland
IBERDROLA INTL BV	Versorger	3,00 %	Spanien
ZURICH FINANCE (IRELAND) DESIGNATED ACTIVITY COMPANY	Finanzwerte	2,92 %	Irland
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finanzwerte	2,74 %	Vereinigtes Königreich
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRASTRUCTURE PLC	Versorger	2,73 %	Spanien

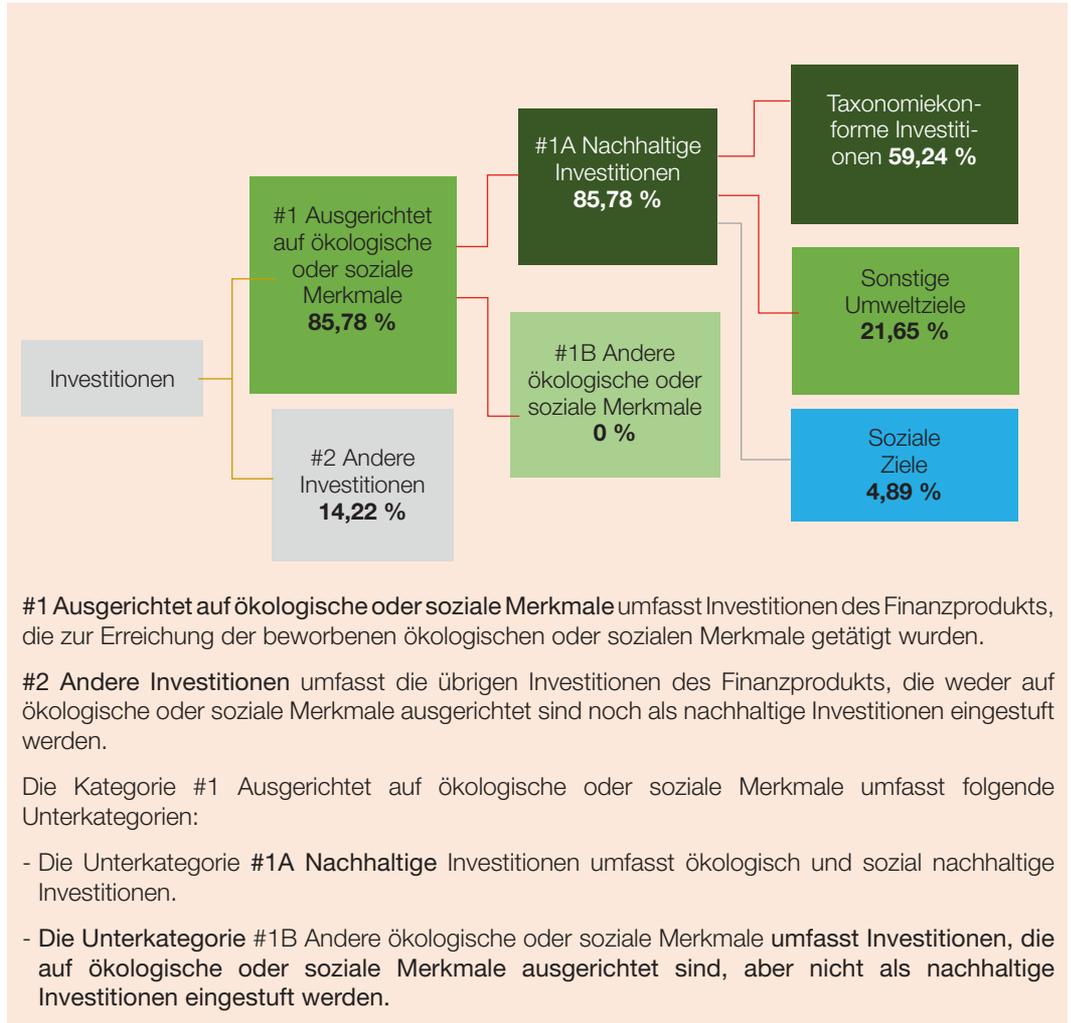


Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Teilfonds wurde mit Stand zum 31. Dezember 2022 ermittelt.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die nachfolgende Tabelle weist eine Aufschlüsselung des Engagements des Teilfonds nach Wirtschaftssektoren zum 31.12.2022 aus. Hinweis: Für die Zwecke dieses Abschnitts wird das Engagement in % des gesamten Kapitals/NIW des Teilfonds ausgewiesen³.

³ Die nachfolgenden Engagements beziehen sich nur auf die gesamten Long-Positionen des Fonds. Im Fall von Long-Only-Fonds werden Barmittel nicht berücksichtigt, so dass die Summe dieser Engagements geringer als 100 % des Kapitals/NIW sein kann. Im Falle bestimmter Long-Only-Fonds können die Engagements insgesamt geringfügig mehr als 100 % des Kapitals/NIW sein. Der Grund dafür ist, dass Short-Positionen ausgeschlossen sind und der Fonds gewisse Hebeleffekte einsetzen kann. Bei Long/Short-Fonds oder alternativen Multi-Asset-Fonds kann sich das Engagement aufgrund der eingesetzten Hebelung auf deutlich mehr als 100 % belaufen; oder die Gesamtsumme kann deutlich unterhalb von 100 % des Kapitals/NIW liegen, wenn der Anlageverwalter die Entscheidung getroffen hat, nicht das gesamte Fondskapital/NIW in Long-Positionen einzusetzen.

GICS-Sektor	% des Kapitals
Kommunikationsdienstleistungen	8,16 %
Zyklische Konsumgüter	3,08 %
Basiskonsumgüter	4,82 %
Energy	1,60 %
Finanzwerte	32,57 %
Staatsanleihe	5,32 %
Informationstechnologie	5,39 %
Immobilien	2,72 %
Nicht klassifiziert	5,35 %
Versorger	25,73 %



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl sich der Teilfonds nicht dazu verpflichtet hatte, hat er während des Berichtszeitraums in taxonomiekonforme Investitionen angelegt, wie nachfolgend näher erläutert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie⁴ investiert?

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxoniekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

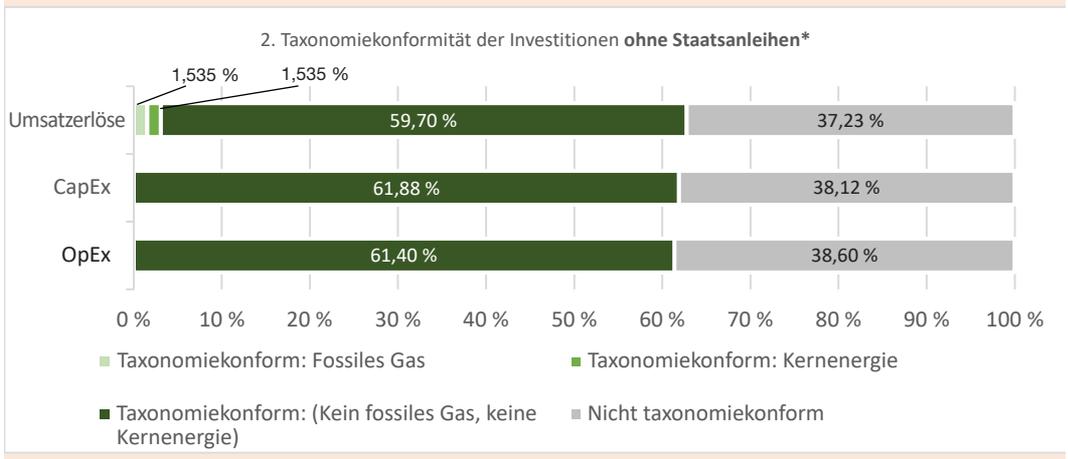
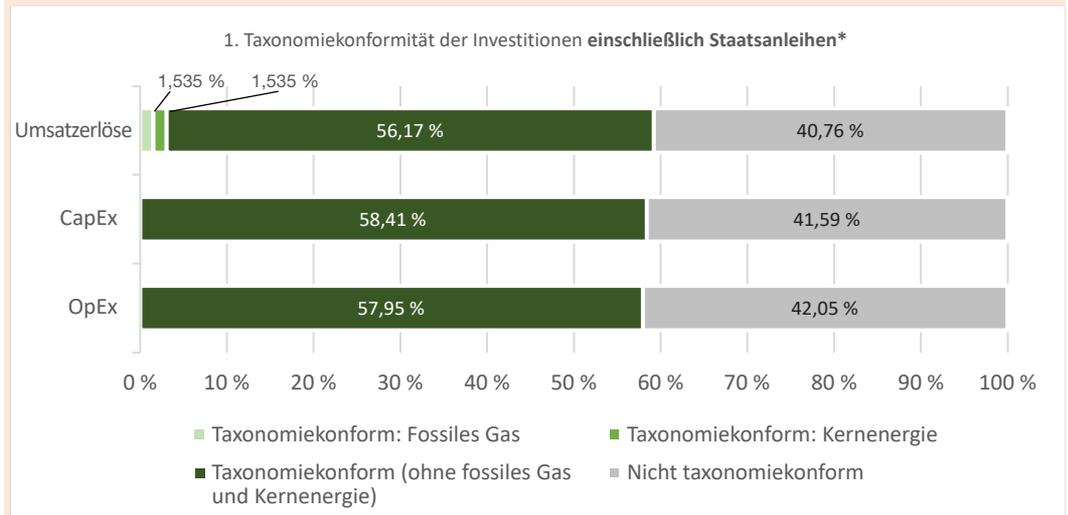
Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

⁴ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxoniekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-Emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Diese Grafik gibt 94,39 % der Gesamtinvestitionen wieder.

Der Teilfonds hat insgesamt 3,07 % seiner Investitionen in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie angelegt, die mit der EU-Taxonomie konform sind (ausgedrückt als Anteil der Einnahmen). Diese 3,07 % sind die Summe der Positionen in den Bereichen fossiles Gas und Kernenergie. Der Anlageverwalter hat für die Zwecke der grafischen Darstellung eine 50/50 Aufteilung zwischen fossilem Gas und Kernenergie geschätzt und daher in der Grafik 1,535 % für jede der beiden Aktivitäten ausgewiesen. Der Anlageverwalter weist darauf hin, dass bei dieser Aufteilung um eine Schätzung handelt, die er aufgrund fehlender relevanter Daten vornehmen musste. Insbesondere unterscheiden die verfügbaren Daten derzeit im Rahmen der Berichterstattung zur Taxonomiekonformität in Bezug auf die relevanten NACE-Sektorklassifizierungen nicht zwischen fossilem Gas und Kernenergie.

*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Hinweis: Die EU-Taxonomiekonformität beruht nicht auf einem Prozentsatz des NIW des Teilfonds, sondern auf einem Prozentsatz der Summe aller Emittenten, für die das Netto-Long-Engagement größer als 0 % des NIW war (Total Net Long Issuer Exposure), wie in der Veröffentlichung Fragen und Antworten zur EU-Offenlegungsverordnung des Gemeinsamen Ausschusses der europäischen Aufsichtsbehörden (FDR Q&A JC) 2022 62 vom 17. November 2022 empfohlen.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Entfällt

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend - der Teilfonds hat keine periodischen Berichte für frühere Berichtszeiträume veröffentlicht.



s i n d nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Teilfonds mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist, betrug 21,65 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds legte 4,89 % seiner Gesamtinvestitionen in nachhaltige Anlagen mit einer sozialen Zielsetzung an.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die „#2 anderen Investitionen“ des Teilfonds wurden in Investitionen angelegt, die darauf abzielen, die umfassenderen Ziele des Teilfonds zu erreichen. Dazu gehören auch Investitionen, die den ESG-Kriterien des Teilfonds möglicherweise nicht in vollem Umfang entsprechen, aber über ein angemessenes Mindestmaß an Sicherheiten verfügen, die z. B. durch Ausschlüsse von vornherein, die Integration des Risikomanagements im Bereich der Nachhaltigkeit und die Anwendung von Grundsätzen der guten Unternehmensführung erreicht wurden. Darüber hinaus hat der Teilfonds, wie im Prospekt angegeben, Anlagen für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, des Liquiditätsmanagements bzw. zu Absicherungszwecken getätigt, die nicht den Mindestanforderungen an Umwelt- oder Sozialstandards unterliegen. Der Teilfonds hat möglicherweise auch Barmittel und Barmitteläquivalente gehalten, für die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards gelten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltungsgesellschaft hat im Berichtszeitraum die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- Investitionen wurden vor der Anlage und fortlaufend einer umfassenden Sorgfaltsprüfung (Due Diligence) unterzogen.
- potenzielle Investitionen wurden unter Verwendung des SDG Frameworks überprüft, wie oben beschrieben;
- die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung bei den Unternehmen, in die investiert wird, (i) wurden vom Anlageverwalter vor dem Eingehen einer Anlage und (ii) danach in regelmäßigen Abständen beurteilt, solange die Investition im Teilfonds gehalten wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Sorgfaltspflicht des Anlageverwalters;
- die Anlageverwalter überwachte zudem die Unternehmen, in die investiert wurde, kontinuierlich, um sicherzustellen, dass die ESG-Kriterien eingehalten wurden;

- das proprietäre Engagement-Tool von Man Group wurde von den Investment- und Stewardship-Teams zur Überprüfung, Dokumentation und Nachverfolgung des Engagements bei Unternehmen eingesetzt. Das Engagement-Tool erfasst die Schlüsselinformationen zum Lebenszyklus der Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement, einschließlich der Art der Interaktion, der wichtigsten Interessengruppen, ESG-Ziele, Etappenziele, nächste Schritte und Ergebnisse;
- die Aktivitäten in Bezug auf ein Engagement wurden in Abhängigkeit von der Wesentlichkeit des anstehenden Sachverhalts durchgeführt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht anwendbar - der Teilfonds hat keinen bestimmten Index als Referenzwert für die Zwecke der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale durch den Teilfonds bestimmt.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Entfällt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Entfällt

EU-Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen und Rahmenverordnung

In Bezug auf die übrigen Teilfonds von Man Funds plc, für die dem Abschluss kein regelmäßiger Bericht beigefügt wurde, haben diese Teilfonds keine nachhaltigen Anlagen zum Ziel und fördern keine ökologischen oder sozialen Merkmale im Sinne der Verordnung (EU) 2019/2088 über die Offenlegung von Informationen zur Nachhaltigkeit im Finanzdienstleistungssektor (EU Sustainable Finance Disclosure Regulation oder „SFDR“). Die Teilfonds unterliegen daher nicht den zusätzlichen Offenlegungspflichten für Finanzprodukte gemäß Artikel 8 bzw. Artikel 9 der Offenlegungsverordnung. Aus demselben Grund unterliegen die Teilfonds nicht den Auflagen der Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen (die „Rahmenverordnung“). Die Teilfonds berücksichtigen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht.

1. Vertretung

Die Vertretung in der Schweiz ist Man Investments AG, Huobstrasse 3, 8808 Pfäffikon.

2. Zahlstelle

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

3. Stelle, von der die entsprechenden Dokumente bezogen werden können

Exemplare des Prospekts, der wesentlichen Anlegerinformationen, der Satzung, der Jahres- und Halbjahresberichte sowie weitere Informationen stehen kostenlos bei der Schweizer Vertretung zur Verfügung.

Die Gesamtkostenquoten der Klassen aller Teilfonds zum Ende des Geschäftsjahres werden in den untenstehenden Tabellen aufgeführt:

Name des Teilfonds	TER		
	(alle Kosten)	(alle Kosten ohne Performancegebühren)	Performancegebühren
<i>Man GLG Global Convertibles</i>			
Klasse D USD	1,77 %	1,77 %	0,00 %
Klasse D H EUR	1,77 %	1,77 %	0,00 %
Klasse DL USD	1,62 %	1,62 %	0,00 %
Klasse DL H EUR	1,61 %	1,61 %	0,00 %
Klasse DL H GBP	1,61 %	1,61 %	0,00 %
Klasse I USD	1,02 %	1,02 %	0,00 %
Klasse I H EUR	1,01 %	1,01 %	0,00 %
Klasse IL USD	0,86 %	0,86 %	0,00 %
Klasse IL H EUR	0,86 %	0,86 %	0,00 %
Klasse IM USD	0,86 %	0,86 %	0,00 %
Klasse IM H EUR	0,89 %	0,87 %	0,03 %
Klasse IM H GBP	0,92 %	0,87 %	0,05 %
Klasse IU H EUR	0,65 %	0,65 %	0,00 %
Klasse I H GBP	1,02 %	1,02 %	0,00 %
<i>Man GLG RI European Equity Leaders</i>			
Klasse D EUR	1,76 %	1,76 %	0,00 %
Klasse D C EUR	1,77 %	1,77 %	0,00 %
Klasse D C USD	1,77 %	1,77 %	0,00 %
Klasse D H USD	1,77 %	1,77 %	0,00 %
Klasse I EUR	1,02 %	1,02 %	0,00 %
Klasse I C EUR	1,02 %	1,02 %	0,00 %
Klasse I C SEK	0,99 %	0,99 %	0,00 %
Klasse I H USD	1,02 %	1,02 %	0,00 %
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity</i>			
Klasse D EUR	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse D EUR G Dist	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse D JPY	1,72 %	1,72 %	0,00 %
Klasse D USD	1,74 %	1,74 %	0,00 %
Klasse D H CHF	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse D H EUR	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse D H GBP	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse D H USD	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse I EUR	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I EUR Dist	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I GBP	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I JPY	0,96 %	0,96 %	0,00 %
Klasse I JPY Dist	0,96 %	0,96 %	0,00 %
Klasse I SEK	0,96 %	0,96 %	0,00 %
Klasse I USD	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I USD Dist	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I H CHF	0,97 %	0,97 %	0,00 %

Name des Teilfonds	TER		
	(alle Kosten)	(alle Kosten ohne Performancegebühren)	Performancegebühren
<i>Man GLG Japan CoreAlpha Equity (Fortsetzung)</i>			
Klasse I H EUR	0,96 %	0,96 %	0,00 %
Klasse I H EUR Dist	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I H GBP	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I H GBP Dist	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I H USD	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I H USD Dist	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse IXX JPY	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse IXX H EUR	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse IXX H EUR Dist	0,77 %	0,77 %	0,00 %
Klasse IXX H GBP Dist	0,77 %	0,77 %	0,00 %
Klasse IXX H CHF	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse IXX H USD Dist	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse IXX H USD	0,76 %	0,76 %	0,00 %
<i>Man Numeric Emerging Markets Equity</i>			
Klasse D CHF	1,91 %	1,91 %	0,00 %
Klasse D EUR	1,91 %	1,91 %	0,00 %
Klasse D USD	1,91 %	1,91 %	0,00 %
Klasse I EUR	1,16 %	1,16 %	0,00 %
Klasse I JPY	1,15 %	1,15 %	0,00 %
Klasse I SEK	1,16 %	1,16 %	0,00 %
Klasse I USD	1,16 %	1,16 %	0,00 %
Klasse IMU USD	1,11 %	0,85 %	0,26 %
Klasse I GBP	1,17 %	1,17 %	0,00 %
<i>Man Numeric Global RI Climate (vormals Man Numeric RI Global Equity)</i>			
Klasse D EUR	1,61 %	1,61 %	0,00 %
Klasse D USD	1,61 %	1,61 %	0,00 %
Klasse I EUR	0,60 %	0,60 %	0,00 %
Klasse I SEK	0,65 %	0,65 %	0,00 %
Klasse I USD	0,86 %	0,86 %	0,00 %
Klasse I H EUR	0,64 %	0,64 %	0,00 %
<i>Man GLG Global Emerging Markets Local Currency Rates</i>			
Klasse D C EUR	1,41 %	1,41 %	0,00 %
Klasse D C USD	1,52 %	1,52 %	0,00 %
Klasse I C EUR	0,82 %	0,82 %	0,00 %
Klasse I C GBP	0,65 %	0,65 %	0,00 %
Klasse I C SEK	0,60 %	0,60 %	0,00 %
Klasse I C USD	0,82 %	0,82 %	0,00 %
Klasse I C USD Dist	0,65 %	0,65 %	0,00 %
Klasse I H EUR Dist	0,68 %	0,68 %	0,00 %
Klasse I H GBP	0,82 %	0,82 %	0,00 %
<i>Man GLG Global Emerging Markets Bond</i>			
Klasse D C EUR	1,48 %	1,48 %	0,00 %
Klasse D C USD	1,48 %	1,48 %	0,00 %
Klasse D H EUR	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Klasse I C EUR	0,72 %	0,72 %	0,00 %
Klasse I C SEK	0,72 %	0,72 %	0,00 %
Klasse I C USD	0,72 %	0,72 %	0,00 %
Klasse I H EUR	0,72 %	0,72 %	0,00 %
Klasse IF H EUR	0,42 %	0,42 %	0,00 %

Name des Teilfonds	TER		
	(alle Kosten)	(alle Kosten ohne Performancegebühren)	Performancegebühren
<i>Man GLG Pan-European Equity Growth</i>			
Klasse D C EUR	1,74 %	1,74 %	0,00 %
Klasse D C USD	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse DF C EUR	1,28 %	1,28 %	0,00 %
Klasse I C CHF	0,98 %	0,98 %	0,00 %
Klasse I C EUR	0,98 %	0,98 %	0,00 %
Klasse I C SEK	0,99 %	0,99 %	0,00 %
Klasse I C USD	0,98 %	0,98 %	0,00 %
Klasse IF C EUR	0,52 %	0,52 %	0,00 %
Klasse DV C USD	1,98 %	1,98 %	0,00 %
Klasse IV C USD	1,23 %	1,23 %	0,00 %
<i>Man GLG RI Global Sustainable Growth</i>			
Klasse D C EUR	1,73 %	1,73 %	0,00 %
Klasse I USD	0,98 %	0,98 %	0,00 %
Klasse I C EUR	0,98 %	0,98 %	0,00 %
Klasse I C GBP	0,98 %	0,98 %	0,00 %
Klasse I C SEK	0,83 %	0,83 %	0,00 %
Klasse IU FH NOK	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Klasse I H (BRL) USD	0,99 %	0,99 %	0,00 %
<i>Man Numeric Europe RI Climate (vormals Man Numeric RI European Equity)</i>			
Klasse D C EUR	1,71 %	1,71 %	0,00 %
Klasse I C EUR	0,96 %	0,96 %	0,00 %
Klasse I C SEK	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse I C USD	0,87 %	0,87 %	0,00 %
Klasse I H GBP	0,95 %	0,95 %	0,00 %
Klasse I C GBP	0,95 %	0,95 %	0,00 %
<i>Man GLG RI Sustainable European Income (vormals Man GLG European Income Opportunities)</i>			
Klasse D C EUR	1,76 %	1,76 %	0,00 %
Klasse DF C EUR	1,30 %	1,30 %	0,00 %
Klasse I C EUR	1,00 %	1,00 %	0,00 %
Klasse I C EUR Dist	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse I C USD	1,00 %	1,00 %	0,00 %
Klasse IF C EUR	0,55 %	0,55 %	0,00 %
Klasse IM C EUR	0,75 %	0,75 %	0,00 %
Klasse I C EUR Dist Q	1,01 %	1,01 %	0,00 %
<i>Man Numeric China A Equity</i>			
Klasse D C EUR	2,22 %	2,22 %	0,00 %
Klasse D H EUR	2,27 %	2,27 %	0,00 %
Klasse I USD	1,50 %	1,50 %	0,00 %
Klasse I C EUR	1,22 %	1,22 %	0,00 %
Klasse I C GBP	1,51 %	1,51 %	0,00 %
Klasse I C SEK	1,33 %	1,33 %	0,00 %
<i>Man GLG Strategic Bond</i>			
Klasse D GBP	1,04 %	1,04 %	0,00 %
Klasse D GBP Dist	1,04 %	1,04 %	0,00 %
Klasse D H CHF	1,05 %	1,05 %	0,00 %
Klasse D H EUR	1,04 %	1,04 %	0,00 %
Klasse D H USD	1,04 %	1,04 %	0,00 %
Klasse DY H EUR	1,37 %	1,37 %	0,00 %
Klasse I GBP	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I GBP Dist	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I H CHF	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I H EUR	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I H EUR Dist	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I H JPY	0,62 %	0,62 %	0,00 %

Name des Teilfonds	TER		
	(alle Kosten)	(alle Kosten ohne Performancegebühren)	Performancegebühren
<i>Man GLG Strategic Bond (Fortsetzung)</i>			
Klasse I H USD	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I H USD Dist	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse IXF GBP	0,39 %	0,39 %	0,00 %
Klasse IXF GBP Dist	0,39 %	0,39 %	0,00 %
Klasse IXF H USD	0,39 %	0,39 %	0,00 %
Klasse DV H USD	1,38 %	1,38 %	0,00 %
Klasse IV H USD	1,07 %	1,07 %	0,00 %
Klasse D H USD Dist A	1,05 %	1,05 %	0,00 %
Klasse DY H USD	1,38 %	1,38 %	0,00 %
Klasse I GBP Dist A	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I H EUR Dist A	0,62 %	0,62 %	0,00 %
<i>Man GLG Asia (ex Japan) Equity</i>			
Klasse I USD	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse I C CHF	0,78 %	0,78 %	0,00 %
Klasse I C EUR	0,77 %	0,77 %	0,00 %
Klasse I C GBP	0,95 %	0,95 %	0,00 %
Klasse IF C EUR	0,71 %	0,71 %	0,00 %
Klasse IF C GBP	0,71 %	0,71 %	0,00 %
<i>Man Numeric US High Yield</i>			
Klasse I USD	0,70 %	0,70 %	0,00 %
<i>Man GLG Global Investment Grade Opportunities</i>			
Klasse IF H EUR	0,46 %	0,46 %	0,00 %
Klasse I H EUR	0,70 %	0,70 %	0,00 %
Klasse I H GBP	0,69 %	0,69 %	0,00 %
Klasse I USD	0,69 %	0,69 %	0,00 %
Klasse IF H GBP	0,45 %	0,45 %	0,00 %
Klasse IF H GBP Dist	0,47 %	0,47 %	0,00 %
Klasse IF EUR Dist	0,47 %	0,47 %	0,00 %
<i>Man GLG China Equity</i>			
Klasse I C EUR	0,68 %	0,68 %	0,00 %
Klasse I C GBP	0,59 %	0,59 %	0,00 %
Klasse IF C EUR	0,22 %	0,22 %	0,00 %
Klasse IF USD	1,63 %	1,63 %	0,00 %
Klasse I USD	0,98 %	0,98 %	0,00 %
<i>Man GLG RI Sustainable Water & Circular Economy</i>			
Klasse I C EUR	0,76 %	0,76 %	0,00 %
Klasse I C GBP	0,96 %	0,96 %	0,00 %
Klasse I C USD	0,97 %	0,97 %	0,00 %
Klasse IF C EUR	0,52 %	0,52 %	0,00 %
Klasse IF C USD	0,71 %	0,71 %	0,00 %
<i>Man GLG Sustainable Strategic Income</i>			
Klasse IF H EUR	(0,17 %)	(0,17 %)	0,00 %
Klasse IF USD	1,08 %	1,08 %	0,00 %
Klasse I H EUR	0,19 %	0,19 %	0,00 %
Klasse I H GBP	0,62 %	0,62 %	0,00 %
Klasse I USD	0,21 %	0,21 %	0,00 %
<i>Man GLG Dynamic Income</i>			
Klasse I USD	0,72 %	0,72 %	0,00 %
Klasse IF H EUR	0,18 %	0,18 %	0,00 %
Klasse IF USD	1,11 %	1,11 %	0,00 %
Klasse I H EUR	0,43 %	0,43 %	0,00 %
Klasse I H GBP	0,68 %	0,68 %	0,00 %