

Halbjahresbericht

SALytic Strategy

zum 31. Januar 2021

Halbjahresbericht des SAlytic Strategy

ZUM 31. JANUAR 2021

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	4
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	7
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	16.629.834,32	100,66
1. Aktien	6.145.175,34	37,20
Industriewerte	996.702,50	6,03
Technologie	953.258,14	5,77
Gesundheitswesen	933.016,23	5,65
Finanzwerte	770.656,00	4,66
Verbraucher-Dienstleistungen	707.699,89	4,28
Konsumgüter	485.709,37	2,94
Rohstoffe	483.797,50	2,93
Versorgungsunternehmen	394.915,71	2,39
Telekommunikation	169.050,00	1,02
Immobilien	163.520,00	0,99
Energiewerte	86.850,00	0,53
2. Anleihen	3.405.467,61	20,61
Regierungsanleihen	604.636,95	3,66
Versorgungswerte	491.394,48	2,97
Transportwesen	413.880,00	2,51
Basisindustrie	317.615,63	1,92
Handel	313.731,64	1,90
Immobilien	308.490,00	1,87
Gesundheitswesen	304.607,16	1,84
Banking/Bankwesen	253.171,75	1,53
Energiewerte	208.700,00	1,26
Medien	189.240,00	1,15
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	217.709,64	1,32
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	659.759,62	3,99
7. Sonstige Vermögensgegenstände	6.201.722,11	37,54
Zertifikate	738.300,00	4,47
Zielfondsanteile	5.463.422,11	33,07
Indexfonds	4.189.134,61	25,36
Aktienfonds	1.274.287,50	7,71

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
II. Verbindlichkeiten	-109.174,99	-0,66
Sonstige Verbindlichkeiten	-109.174,99	-0,66
III. Fondsvermögen	16.520.659,33	100,00^{*)}

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Börsengehandelte Wertpapiere								10.000.011,00	60,53	
Aktien										
Euro								5.235.711,37	31,69	
ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0		STK	400	400	-	EUR	262,000	104.800,00	0,63
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005		STK	800	-	800	EUR	186,520	149.216,00	0,90
APERAM	LU0569974404		STK	4.000	6.000	2.000	EUR	35,650	142.600,00	0,86
ASML HOLD.	NL0010273215		STK	400	400	-	EUR	439,450	175.780,00	1,06
AXA	FR0000120628		STK	10.000	-	-	EUR	18,300	183.000,00	1,11
BASF NAM.	DE000BASF111		STK	2.250	-	750	EUR	63,830	143.617,50	0,87
BAYER NAM.	DE000BAY0017		STK	2.750	-	-	EUR	49,915	137.266,25	0,83
COVESTRO	DE0006062144		STK	3.000	3.000	-	EUR	56,160	168.480,00	1,02
DT.POST NAM.	DE0005552004		STK	6.000	2.500	5.500	EUR	40,810	244.860,00	1,48
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508		STK	11.500	-	-	EUR	14,700	169.050,00	1,02
DT.WOHNEN	DE000A0HN5C6		STK	4.000	-	1.000	EUR	40,880	163.520,00	0,99
FRESENIUS MED.C.	DE0005785802		STK	2.250	-	-	EUR	66,800	150.300,00	0,91
HEIDELBERGCEMENT	DE0006047004		STK	4.000	-	1.000	EUR	61,020	244.080,00	1,48
HELLOFRESH	DE000A161408		STK	1.250	2.000	750	EUR	69,800	87.250,00	0,53
HOCHTIEF	DE0006070006		STK	2.000	-	500	EUR	76,750	153.500,00	0,93
IBERDROLA	ES0144580Y14		STK	16.000	-	4.000	EUR	11,185	178.960,00	1,08
IBERDROLA ANR.	ES06445809L2		STK	20.000	-	-	EUR	0,160	3.195,71	0,02
KON.AHOLD DELHAIZE	NL0011794037		STK	8.000	-	-	EUR	23,590	188.720,00	1,14
KON.PHILIPS	NL0000009538		STK	3.591	-	1.000	EUR	44,955	161.433,41	0,98
LINDE	IE00BZ12WP82		STK	850	850	-	EUR	202,000	171.700,00	1,04
LVMH	FR0000121014		STK	150	-	300	EUR	498,300	74.745,00	0,45
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026		STK	1.300	300	-	EUR	218,800	284.440,00	1,72
OMV	AT0000743059		STK	2.500	2.500	-	EUR	34,740	86.850,00	0,53
PROSUS	NL0013654783		STK	2.000	2.000	-	EUR	95,820	191.640,00	1,16
QIAGEN NAM.	NL0012169213		STK	4.000	5.000	1.000	EUR	44,670	178.680,00	1,08
RWE	DE0007037129		STK	6.000	-	1.500	EUR	35,460	212.760,00	1,29
SAP	DE0007164600		STK	1.500	-	-	EUR	104,800	157.200,00	0,95
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972		STK	1.750	-	-	EUR	120,950	211.662,50	1,28
STMICROELEC.	NL0000226223		STK	7.500	-	2.000	EUR	33,270	249.525,00	1,51
TALANX NAM.	DE000TLX1005		STK	5.000	-	-	EUR	30,800	154.000,00	0,93
VW VORZ.	DE0007664039		STK	2.000	-	-	EUR	156,440	312.880,00	1,89
Schweizer Franken								490.467,27	2,97	
NESTLÉ	CH0038863350		STK	2.000	-	-	CHF	100,040	185.130,70	1,12
NOVARTIS NAM.	CH0012005267		STK	2.000	-	500	CHF	80,530	149.026,14	0,90
ROCHE HOLD. G.	CH0012032048		STK	550	250	150	CHF	307,150	156.310,43	0,95
Dänische Kronen								121.033,67	0,73	
CARLSBERG 'B'	DK0010181759		STK	1.000	1.000	-	DKK	900,200	121.033,67	0,73
Englische Pfund								74.723,64	0,45	
AVAST	GB00BDD85M81		STK	14.000	-	-	GBP	4,722	74.723,64	0,45
Schwedische Kronen								223.239,39	1,35	
ESSITY NAM. 'B'	SE0009922164		STK	4.500	-	1.500	SEK	267,300	118.849,89	0,72
TELEFON ERICSSON 'B'	SE0000108656		STK	10.000	-	-	SEK	105,650	104.389,50	0,63

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro								3.116.535,66	18,86	
0,5000 % BUND V.15-25	DE0001102374		EUR	300.000	-	200.000	%	105,235	315.705,00	1,91
0,8750 % CEZ MTN V.19-26	XS2084418339		EUR	477.000	-	-	%	103,018	491.394,48	2,97
1,2000 % UNICREDIT MTN V.20-26	XS2104967695		EUR	250.000	-	-	%	101,269	253.171,75	1,53
1,5000 % CESKE DRAHY V.19-26	XS1991190361		EUR	400.000	-	-	%	103,470	413.880,00	2,51
1,8750 % OTTO MTN V.17-24	XS1625975153		EUR	200.000	-	-	%	103,120	206.240,00	1,25
2,0450 % EP INFRASTR. V.19-28	XS2062490649		EUR	200.000	-	200.000	%	104,350	208.700,00	1,26
2,1250 % LAGARDÈRE V.19-26	FR0013449261		EUR	200.000	-	200.000	%	94,620	189.240,00	1,15
2,3750 % BAYER FRN V.15-75	DE000A14J611		EUR	300.000	-	-	%	101,536	304.607,16	1,84
3,2500 % HORNBACH BAUMARKT V.19-26	DE000A255DH9		EUR	100.000	-	-	%	107,492	107.491,64	0,65
4,0000 % VONOVIA FIN. FRN V.14-UND.	XS1117300837		EUR	300.000	-	-	%	102,830	308.490,00	1,87
4,5000 % LANXESS FRN V.16-76	XS1405763019		EUR	200.000	-	-	%	106,436	212.872,50	1,29
5,7500 % BILFINGER V.19-24	DE000A2YNQW7		EUR	100.000	-	-	%	104,743	104.743,13	0,63
Zertifikate										
Euro								738.300,00	4,47	
D.BÖRSEC. XETRA-GOLD IZ 07-UND	DE000A0S9GB0		STK	15.000	-	3.500	EUR	49,220	738.300,00	4,47
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								288.931,95	1,75	
Verzinsliche Wertpapiere										
US-Dollar								288.931,95	1,75	
3,1250 % USA TREA. V.18-28	US9128285M81		USD	300.000	-	-	%	117,008	288.931,95	1,75
Investmentanteile								5.463.422,11	33,07	
Gesellschaftseigene Investmentanteile										
Euro								707.520,00	4,28	
SALYTIC ACT.EQ.	DE000A1JSW22		ANT	12.000	-	4.000	EUR	58,960	707.520,00	4,28
Gesellschaftsfremde Investmentanteile										
Euro								3.314.292,50	20,06	
ISH.VII-NASDAQ 100 UCITS	IE00BYVQ9F29		ANT	110.000	-	40.000	EUR	8,350	918.500,00	5,56
ISHARES-V-S&P 500 EUR-HD.	IE00B3ZW0K18		ANT	22.500	5.000	5.000	EUR	81,290	1.829.025,00	11,07
UBS(LUX)EQ.-CHINA OPP. 'Q'	LU1923635863		ANT	3.250	-	750	EUR	174,390	566.767,50	3,43
US-Dollar								1.083.183,02	6,56	
ISHARESII-MSCI EM LAT.AMER.	IE00B27YCK28		ANT	40.000	45.000	5.000	USD	14,953	492.320,00	2,98
ISHARESII-S&P GL CLEAN EN.	IE00B1XNHC34		ANT	20.000	20.000	-	USD	17,324	285.200,00	1,73
XTR.(IE) - RUSSELL 2000 '1C'	IE00BJZ2DD79		ANT	1.250	1.250	-	USD	297,080	305.663,02	1,85
Englische Pfund								358.426,59	2,17	
VANGUARD FTSE 250 UCITS	IE00BKX55Q28		ANT	10.000	10.000	-	GBP	31,710	358.426,59	2,17
Summe Wertpapiervermögen								15.752.365,06	95,35	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								659.759,62	3,99	
Bankguthaben								659.759,62	3,99	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	659.759,62			%	100,000	659.759,62	3,99

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Sonstige Vermögensgegenstände								217.709,64	1,32
ZINSANSPRÜCHE			EUR	26.982,39				26.982,39	0,16
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	190.727,25				190.727,25	1,15
Sonstige Verbindlichkeiten								-109.174,99	-0,66
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-98.347,42				-98.347,42	-0,60
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-10.827,57				-10.827,57	-0,07
Fondsvermögen						EUR		16.520.659,33	100,00^{*)}
Anteilwert						EUR		52,97	
Umlaufende Anteile						STK		311.885,00	

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 29.01.2021 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.01.2021

Schweizer Franken	(CHF)	1,08075 = 1 (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,43760 = 1 (EUR)
Englische Pfund	(GBP)	0,88470 = 1 (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,12075 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,21490 = 1 (EUR)

Im Berichtszeitraum haben gegebenenfalls Kapitalmaßnahmen und eventuelle unterjährige Änderungen der Stammdaten eines Wertpapiers stattgefunden. Diese Kapitalmaßnahmen und die Umbuchungen aufgrund von Stammdatenänderungen sind ohne Umsatzzahlen in der „Vermögensaufstellung“ und in den „Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen“ enthalten.

■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Euro

EVONIK IND. NAM.	DE000EVNK013	STK	-	6.500
JENOPTIK NAM.	DE000A2NB601	STK	-	6.500
TOTAL	FR0000120271	STK	2.000	6.000
WIENERBERGER	AT0000831706	STK	-	8.000

Schweizer Franken

CLARIANT NAM.	CH0012142631	STK	-	8.000
---------------	--------------	-----	---	-------

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

0,6250 % AROUNDTOWN MTN V.19-25	XS2023872174	EUR	-	300.000
1,2890 % UBISOFT ENTERT. V.18-23	FR0013313186	EUR	-	300.000
1,3750 % SYMRISE V.20-27	XS2195096420	EUR	-	126.000
1,3750 % VW FIN. SERV. MTN V.18-23	XS1893631330	EUR	-	200.000
1,8750 % BUREAU VERITAS V.18-25	FR0013370129	EUR	-	200.000

Norwegische Kronen

3,7500 % NORWEGEN V.10-21	NO0010572878	NOK	-	4.000.000
------------------------------	--------------	-----	---	-----------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

0,8750 % LYB INT.FIN.II V.19-26	XS2052310054	EUR	-	250.000
1,0000 % JAB HOLD. V.19-27	DE000A2SBDE0	EUR	-	400.000

■ Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
---------------------	------------------------------	------------------

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte **EUR** **1.102**

Basiswerte: (EURO STOXX 50 IND.FUT. 12/20)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	95,35 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	52,97
Umlaufende Anteile (STK)	311.885,00

Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

Das im Folgenden dargestellte Vorgehen bei der Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens findet auch in Zeiten ggf. auftretender Marktverwerfungen i.Z.m. den Auswirkungen der Covid-19 Pandemie Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Alle Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt (§§ 27, 34 KARBV).

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen (§§ 28, 34 KARBV). Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem zuletzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen, kündbare Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet (§§ 29, 34 KARBV). Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis gemäß festgelegtem Bewertungszeitpunkt (Vortag oder gleichtäglich).

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung (§§ 28, 34 KARBV). Andere geeignete Verfahren kann die Verwendung eines von einem Dritten ermittelten Preises sein und unterliegt einer Plausibilitätsprüfung durch die KVG.

Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einem organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
iSharesII-MSCI EM Lat.Amer.	0,74000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl Clean En.	0,65000 % p.a.
iSharesV-S&P 500 EUR-Hd.	0,20000 % p.a.

iSh.VII-NASDAQ 100 UCITS	0,33000 % p.a.
SALytic Act.Eq.	0,85000 % p.a.
UBS(Lux)Eq.-China Opp. 'Q'	1,12000 % p.a.
Vanguard FTSE 250 UCITS	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE) - Russell 2000 '1C'	0,30000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgegesellschaften bzw. ausländischen Investmentgesellschaften berechnete Verwaltungsvergütung.

Bei den Angaben zu Verwaltungsvergütungen handelt es sich um den von den Gesellschaften maximal belasteten Prozentsatz.
Quelle: WM Datenservice, Verkaufsprospekte

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge gezahlt.
Im Berichtszeitraum wurden keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

