

Halbjahresbericht

SALytic Strategy

zum 31. Januar 2023

Halbjahresbericht des SALytic Strategy

ZUM 31. JANUAR 2023

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

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	32.103.840,87	100,09
1. Aktien	8.557.153,88	26,68
Finanzwerte	2.045.025,50	6,38
Verbraucher-Dienstleistungen	1.283.942,50	4,00
Technologie	1.124.725,00	3,51
Industriewerte	928.685,12	2,90
Gesundheitswesen	927.433,79	2,89
Konsumgüter	871.040,29	2,72
Rohstoffe	675.699,00	2,11
Telekommunikation	357.875,00	1,12
Versorgungsunternehmen	342.727,68	1,07
2. Anleihen	11.239.464,11	35,04
Regierungsanleihen	2.065.372,89	6,44
Banking/Bankwesen	2.041.567,42	6,37
Transportwesen	1.363.317,41	4,25
Konsumgüter	1.158.811,22	3,61
Medien	748.617,92	2,33
Basisindustrie	683.967,67	2,13
Anleihen supranationaler Organisationen	555.078,00	1,73
Versorgungswerte	433.053,89	1,35
Handel	376.867,52	1,18
Immobilien	355.833,64	1,11
Investitionsgüter	349.742,48	1,09
Gesundheitswesen	329.653,16	1,03
Reise & Freizeit	299.280,00	0,93
Automobil	288.594,90	0,90
Versicherungen	189.705,99	0,59
3. Derivate	12.375,00	0,04
Zins-Derivate	12.375,00	0,04
4. Forderungen	104.754,80	0,33
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	1.932.101,73	6,02
7. Sonstige Vermögensgegenstände	10.257.991,35	31,98
Zertifikate	1.140.800,00	3,56

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Zielfondsanteile	9.117.191,35	28,43
Indexfonds	6.537.461,35	20,38
Aktienfonds	2.579.730,00	8,04
II. Verbindlichkeiten	-30.402,19	-0,09
Sonstige Verbindlichkeiten	-30.402,19	-0,09
III. Fondsvermögen	32.073.438,68	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 31.01.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								19.160.316,36	59,74
Aktien									
Euro								8.166.113,59	25,46
AIR LIQUIDE	FR0000120073		STK	1.150	1.150	-	EUR 146,060	167.969,00	0,52
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005		STK	1.600	-	-	EUR 219,200	350.720,00	1,09
ASM	NL0000334118		STK	500	-	500	EUR 308,200	154.100,00	0,48
ASML HOLD.	NL0010273215		STK	1.250	-	-	EUR 602,600	753.250,00	2,35
AXA	FR0000120628		STK	17.500	-	-	EUR 28,615	500.762,50	1,56
AZELIS GR. NAM.	BE0974400328		STK	204	-	-	EUR 24,780	5.055,12	0,02
BAYER NAM.	DE000BAY0017		STK	6.000	-	3.000	EUR 57,000	342.000,00	1,07
BNP PARIBAS	FR0000131104		STK	4.750	4.750	-	EUR 62,900	298.775,00	0,93
BRENNTAG NAM.	DE000A1DAH00		STK	3.000	3.000	-	EUR 68,360	205.080,00	0,64
CAPGEMINI	FR0000125338		STK	1.250	1.250	-	EUR 173,900	217.375,00	0,68
COMPUGR.MED. NAM.	DE000A288904		STK	4.700	4.700	-	EUR 42,920	201.724,00	0,63
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055		STK	2.000	-	-	EUR 164,250	328.500,00	1,02
DT.POST NAM.	DE0005552004		STK	10.000	-	-	EUR 39,380	393.800,00	1,23
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508		STK	17.500	-	-	EUR 20,450	357.875,00	1,12
EUROAPI	FR0014008VX5		STK	86	-	-	EUR 14,765	1.269,79	0,00
GERRESHEIMER	DE000A0LD6E6		STK	3.000	-	-	EUR 67,700	203.100,00	0,63
IBERDROLA	ES0144580Y14		STK	31.348	-	-	EUR 10,745	336.834,26	1,05
IBERDROLA ANR.	ES06445809P3		STK	31.348	-	-	EUR 0,188	5.893,42	0,02
ING GR.	NL0011821202		STK	21.500	21.500	-	EUR 13,252	284.918,00	0,89
KERING	FR0000121485		STK	400	-	-	EUR 570,500	228.200,00	0,71
KON.AHOLD DELHAIZE	NL0011794037		STK	12.500	-	-	EUR 27,385	342.312,50	1,07
LINDE	IE00BZ12WP82		STK	1.000	-	500	EUR 302,650	302.650,00	0,94
LVMH	FR0000121014		STK	600	-	-	EUR 800,000	480.000,00	1,50
MERCEDES-BENZ GR. NAM.	DE0007100000		STK	3.000	-	-	EUR 68,150	204.450,00	0,64
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026		STK	850	-	900	EUR 331,000	281.350,00	0,88
SANOFI	FR0000120578		STK	2.000	-	-	EUR 89,670	179.340,00	0,56
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972		STK	2.000	-	-	EUR 148,320	296.640,00	0,92
SODEXO	FR0000121220		STK	3.500	-	-	EUR 91,020	318.570,00	0,99
VINCI	FR0000125486		STK	2.250	-	2.000	EUR 103,640	233.190,00	0,73
VW VORZ.	DE0007664039		STK	1.500	-	-	EUR 126,940	190.410,00	0,59
Schweizer Franken								391.040,29	1,22
NESTLÉ	CH0038863350		STK	3.500	-	-	CHF 111,480	391.040,29	1,22
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								9.462.362,48	29,50
0,0000 % SPANIEN V.21-27	ES0000012J15		EUR	500.000	-	-	% 89,201	446.003,90	1,39
0,3750 % BAYER V.21-29	XS2281343256		EUR	400.000	400.000	-	% 82,413	329.653,16	1,03
0,3750 % LEG IMMO. MTN V.22-26	DE000A3MQNN9		EUR	400.000	-	-	% 88,958	355.833,64	1,11
0,5000 % BUND V.15-25	DE0001102374		EUR	600.000	300.000	-	% 95,960	575.760,00	1,80
0,5000 % SANT.CONS.BK. MTN V.22-25	XS2441296923		EUR	400.000	-	-	% 91,599	366.395,76	1,14
0,8000 % SPANIEN V.20-27	ES0000012G26		EUR	500.000	-	-	% 91,279	456.395,00	1,42
0,8750 % NESTLÉ FIN.INT. MTN V.22-27	XS2462321212		EUR	500.000	-	-	% 92,506	462.527,90	1,44
0,8780 % UBISOFT ENTERT. V.20-27	FR0014000O87		EUR	400.000	-	-	% 74,820	299.280,00	0,93
1,0000 % ESM MTN V.22-27	EU000A1Z99Q7		EUR	600.000	600.000	-	% 92,513	555.078,00	1,73

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,2000 % UNICREDIT MTN V.20-26	XS2104967695		EUR	250.000	-	-	% 93,597	233.991,50	0,73
1,2500 % DAVIDE CAMPARI-MILANO V.20-27	XS2239553048		EUR	400.000	-	-	% 87,390	349.560,00	1,09
1,2500 % ING GR. FRN V.22-27 MTN	XS2443920249		EUR	400.000	-	-	% 92,001	368.002,64	1,15
1,5000 % CESKE DRAHY V.19-26	XS1991190361		EUR	400.000	-	-	% 89,768	359.071,88	1,12
1,6250 % LOUIS DREYFUS CO.FIN. V.21-28	XS2332552541		EUR	400.000	200.000	-	% 86,681	346.723,32	1,08
1,6250 % VERALLIA V.21-28	FR0014003G27		EUR	400.000	-	-	% 87,436	349.742,48	1,09
1,7500 % LAGARDERE V.21-27	FR0014005SR9		EUR	400.000	-	-	% 96,170	384.680,00	1,20
1,7500 % VOESTALPINE MTN V.19-26	AT0000A27LQ1		EUR	200.000	-	-	% 94,890	189.780,00	0,59
2,0450 % EP INFRASTR. V.19-28	XS2062490649		EUR	200.000	-	-	% 74,383	148.766,00	0,46
2,1250 % ING GR. FRN V.22-26 MTN	XS2483607474		EUR	400.000	-	-	% 95,998	383.990,68	1,20
2,2500 % ORSTED FRN V.17-UND.	XS1720192696		EUR	300.000	300.000	-	% 94,763	284.287,89	0,89
2,8750 % DT.LUFTHANSA MTN V.21-25	XS2296201424		EUR	200.000	-	-	% 95,662	191.324,86	0,60
2,8750 % DT.LUFTHANSA MTN V.21-27	XS2408458730		EUR	200.000	-	-	% 88,338	176.676,94	0,55
2,8750 % THYSSENKRUPP MTN V.19-24	DE000A2TEDB8		EUR	200.000	-	-	% 98,417	196.834,54	0,61
2,8850 % BARCLAYS FRN V.22-27 MTN	XS2487667276		EUR	400.000	-	-	% 96,217	384.866,84	1,20
3,2500 % HORNBACH BAUMARKT V.19-26	DE000A255DH9		EUR	400.000	200.000	-	% 94,217	376.867,52	1,18
4,3750 % BNP PARIBAS FRN V.23-29 MTN	FR001400DCZ6		EUR	300.000	300.000	-	% 101,440	304.320,00	0,95
4,5000 % BILFINGER V.19-24	DE000A2YNQW7		EUR	100.000	-	-	% 99,473	99.473,13	0,31
4,5000 % LANXESS FRN V.16-76	XS1405763019		EUR	200.000	-	-	% 98,940	197.880,00	0,62
4,6250 % VW INT.FIN. FRN V.14-UND.	XS1048428442		EUR	300.000	-	-	% 96,198	288.594,90	0,90
Zertifikate									
Euro								1.140.800,00	3,56
D.BÖRSEC. XETRA-GOLD IZ 07-UND	DE000A0S9GB0		STK	20.000	-	20.000	EUR 57,040	1.140.800,00	3,56
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								1.777.101,63	5,54
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								1.189.887,64	3,71
1,2070 % PROSUS MTN V.22-26	XS2430287529		EUR	400.000	-	-	% 90,984	363.937,92	1,13
2,6140 % EAST JAPAN RAILW. V.22-25	XS2526860965		EUR	650.000	650.000	-	% 97,884	636.243,73	1,98
3,7500 % METROPL.GL.FD.I V.22-30	XS2561748711		EUR	188.000	188.000	-	% 100,907	189.705,99	0,59
US-Dollar								587.213,99	1,83
0,1250 % USA TREA. V.20-23	US91282CAP68		USD	375.000	450.000	375.000	% 96,840	334.376,87	1,04
0,2500 % USA TREA. V.20-25	US912828ZW33		USD	300.000	-	-	% 91,531	252.837,12	0,79
Nicht notierte Wertpapiere								0,00	0,00
Aktien									
Euro								0,00	0,00
LINDE BESS.SCH.	BES_648300		STK	4.900	-	-	EUR	0,00	0,00

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Investmentanteile								9.117.191,35	28,43
Gesellschaftseigene Investmentanteile									
Euro								1.293.755,00	4,03
SALYTIC ACT.EQ.	DE000A1JSW22		ANT	20.500	-	-	EUR 63,110	1.293.755,00	4,03
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								4.071.835,00	12,70
FIDELITY FD.-SUST.A.EQ.FD. 'Y'	LU0951203347		ANT	45.500	45.500	-	EUR 20,810	946.855,00	2,95
ISH.VII-NASDAQ 100 UCITS	IE00BYVQ9F29		ANT	100.000	100.000	-	EUR 7,430	743.000,00	2,32
ISHS 3-ISHS S&P 500 ESG EUR	IE000CR7DJI8		ANT	360.000	360.000	-	EUR 4,845	1.744.020,00	5,44
LYXOR JAPAN (TOPIX)	FR0011475078		ANT	2.000	2.000	-	EUR 149,420	298.840,00	0,93
SALYTIC WOHNIMMO.EUR.PL.	DE000A2QND38		ANT	8.000	-	-	EUR 42,390	339.120,00	1,06
US-Dollar								3.751.601,35	11,70
ISHARESII-S&P GL CLEAN EN.	IE00B1XNHC34		ANT	30.000	-	25.000	USD 11,742	324.360,00	1,01
ISHARES NASDAQ-100	DE000A0F5UF5		ANT	7.000	-	-	USD 117,141	755.020,00	2,35
ISHS 3-ISHS S&P 500 ESG USD	IE000R9FA4A0		ANT	365.000	365.000	-	USD 4,936	1.659.026,75	5,17
XTR.(IE) - RUSSELL 2000 '1C'	IE00BJZ2DD79		ANT	4.000	-	-	USD 275,095	1.013.194,60	3,16
Summe Wertpapiervermögen								30.054.609,34	93,71
Derivate								12.375,00	0,04
Zins-Derivate									
Zinsterminkontrakte								12.375,00	0,04
EURO-SCHATZ-FUTURE 03/23		185	STK	-1.500.000			EUR	12.375,00	0,04
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								1.932.101,73	6,02
Bankguthaben								1.932.101,73	6,02
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	1.932.101,73			% 100,000	1.932.101,73	6,02
Sonstige Vermögensgegenstände								104.754,80	0,33
ZINSANSPRÜCHE			EUR	104.575,56				104.575,56	0,33
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	179,24				179,24	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-30.402,19	-0,09
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-18.027,19				-18.027,19	-0,06
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-12.375,00				-12.375,00	-0,04
Fondsvermögen							EUR	32.073.438,68	100,00*)
Anteilwert							EUR	52,94	
Umlaufende Anteile							STK	605.834,7280	

*) 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 31.01.2023 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.01.2023

Schweizer Franken	(CHF)	0,99780 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,08605 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)
-----	--

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 (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

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

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Euro

BASF NAM.	DE000BASF111	STK	-	5.000
CIE D.ST.GOBAIN	FR0000125007	STK	-	4.000
ERSTE GR.BK.	AT0000652011	STK	-	10.000
JDE PEET'S	NL0014332678	STK	-	7.500
SIEMENS NAM.	DE0007236101	STK	-	2.000

US-Dollar

BIONTECH NAM. (SPONS.ADRS)	US09075V1026	STK	-	3.000
----------------------------	--------------	-----	---	-------

Schweizer Franken

NOVARTIS NAM.	CH0012005267	STK	-	4.000
ZUR ROSE GR. NAM.	CH0042615283	STK	-	1.250

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

US-Dollar

ISH.IV-ISH.MSCI CHINA A	IE00BQT3WG13	ANT	57.000	57.000
ISHARES VII- CORE S&P 500	IE00B5BMR087	ANT	-	8.650
ISHSV-AGRIBUSINES S UCITS	IE00B6R52143	ANT	-	12.000

■ 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** **2.717**

Basiswerte: (EURO STOXX 50 IND.FUT. 12/22)

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte **EUR** **1.945**

Basiswerte: (EURO-BOBL-FUTURE 12/22, EURO-SCHATZ-FUTURE 12/22)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	93,71 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,04 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	52,94
Umlaufende Anteile (STK)	605.834,7280

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 gleichartig).

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.

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
Fidelity Fd.-Sust.A.Eq.Fd. 'Y'	0,80000 % p.a.
iShares NASDAQ-100	0,30000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl Clean En.	0,65000 % p.a.
iSharesVII- Core S&P 500	0,07000 % p.a.
iSh.IV-iSh.MSCI China A	0,40000 % p.a.
iShs 3-iShs S&P 500 ESG EUR	0,10000 % p.a.
iShs 3-iShs S&P 500 ESG USD	0,07000 % p.a.
iShsV-Agribusiness UCITS	0,55000 % p.a.
iSh.VII-NASDAQ 100 UCITS	0,36000 % p.a.
Lyxor Japan (Topix)	0,45000 % p.a.
SALytic Act.Eq.	0,85000 % p.a.
SALytic Wohnimmo.Eur.Pl.	0,76000 % p.a.
Xtr.(IE) - Russell 2000 '1C'	0,15000 % 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 Rücknahmeaufschläge gezahlt.

