

Halbjahresbericht

SALytic Strategy

zum 31. Januar 2025

Halbjahresbericht des SALytic Strategy

zum 31. JANUAR 2025

■ 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	25.680.767,29	100,07
1. Aktien	7.610.107,94	29,65
Finanzwerte	2.012.705,00	7,84
Industriewerte	1.418.897,08	5,53
Technologie	1.134.300,00	4,42
Gesundheitswesen	769.456,97	3,00
Rohstoffe	715.377,61	2,79
Verbraucher-Dienstleistungen	681.375,00	2,66
Versorgungsunternehmen	282.230,60	1,10
Telekommunikation	242.625,00	0,95
Konsumgüter	205.190,68	0,80
Immobilien	147.950,00	0,58
2. Anleihen	7.099.649,72	27,66
Banking/Bankwesen	1.130.585,71	4,41
Transportwesen	896.610,00	3,49
Immobilien	697.789,12	2,72
Regierungsanleihen	461.595,47	1,80
Energiewerte	416.736,00	1,62
Handel	398.695,56	1,55
Medien	391.966,28	1,53
Anleihen supranationaler Organisationen	391.681,28	1,53
Investitionsgüter	385.350,00	1,50
Gesundheitswesen	358.461,16	1,40
Versorgungswerte	352.860,00	1,37
Agency	352.538,48	1,37
Dienstleistungen	306.330,66	1,19
Anleihen ausländischer Regierungen	301.830,00	1,18
Reise & Freizeit	256.620,00	1,00
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	85.601,45	0,33
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	438.188,57	1,71

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
7. Sonstige		
Vermögensgegenstände	10.447.219,61	40,71
Zertifikate	1.215.830,00	4,74
Zielfondsanteile	9.231.389,61	35,97
Indexfonds	7.776.675,86	30,30
Aktienfonds	1.454.713,75	5,67
II. Verbindlichkeiten	-17.560,28	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten	-17.560,28	-0,07
III. Fondsvermögen	25.663.207,01	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 31.01.2025	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Euro									
AIR LIQUIDE	FR0000120073	STK	1.265	-	-	EUR	168.600	213.279,00	0,83
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	500	-	500	EUR	314.400	157.200,00	0,61
ASM INT.	NL0000334118	STK	500	-	-	EUR	567.000	283.500,00	1,10
ASML HOLD. NAM.	NL0010273215	STK	750	-	-	EUR	722.700	542.025,00	2,11
AXA	FR0000120628	STK	12.500	-	-	EUR	36.650	458.125,00	1,79
AZELIS GR. NAM.	BE0974400328	STK	204	-	-	EUR	19.860	4.051,44	0,02
BASF NAM.	DE000BASF111	STK	2.500	2.500	-	EUR	46.610	116.525,00	0,45
BNP PARIBAS	FR0000131104	STK	6.000	-	-	EUR	65.720	394.320,00	1,54
CIE D.ST.GOBAIN	FR0000125007	STK	2.750	-	-	EUR	90.580	249.095,00	0,97
COVESTRO	DE0006062144	STK	3.000	-	-	EUR	57.000	171.000,00	0,67
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055	STK	750	-	750	EUR	238.400	178.800,00	0,70
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508	STK	7.500	-	5.500	EUR	32.350	242.625,00	0,95
EUROAPI	FR0014008VX5	STK	86	-	-	EUR	3.230	277,78	0,00
FRAPORT	DE0005773303	STK	3.250	-	-	EUR	57.500	186.875,00	0,73
FRESENIUS	DE0005785604	STK	8.000	2.250	-	EUR	36.970	295.760,00	1,15
GERRESHEIMER	DE000A0LD6E6	STK	1.500	1.500	-	EUR	67.900	101.850,00	0,40
IBERDROLA	ES0144580Y14	STK	15.000	-	11.033	EUR	13.640	204.600,00	0,80
LVMH	FR0000121014	STK	550	150	-	EUR	703.500	386.925,00	1,51
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	650	-	-	EUR	522.400	339.560,00	1,32
NORDEA BK.	FI4000297767	STK	15.000	-	12.500	EUR	11.480	172.200,00	0,67
PUMA	DE0006969603	STK	5.000	-	-	EUR	30.410	152.050,00	0,59
SANOFI	FR0000120578	STK	2.000	-	-	EUR	104.400	208.800,00	0,81
SAP	DE0007164600	STK	1.150	1.150	-	EUR	268.500	308.775,00	1,20
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972	STK	1.500	-	-	EUR	245.350	368.025,00	1,43
SIEMENS NAM.	DE0007236101	STK	1.250	-	-	EUR	207.450	259.312,50	1,01
SOC.GÉNÉRALE	FR0000130809	STK	10.000	10.000	-	EUR	31.250	312.500,00	1,22
SODEXO	FR0000121220	STK	2.000	-	-	EUR	71.200	142.400,00	0,55
SPRINGER NATURE INH O.N.	DE000SPG1003	STK	2.963	2.963	-	EUR	26.200	77.630,60	0,30
VINCI	FR0000125486	STK	1.500	-	-	EUR	104.500	156.750,00	0,61
VONOVIA NAM.	DE000A1ML7J1	STK	5.000	5.000	-	EUR	29.590	147.950,00	0,58
US-Dollar									
LINDE	IE000S9YS762	STK	500	-	-	USD	446.120	214.573,61	0,84
Schweizer Franken									
HOLCIM NAM.	CH0012214059	STK	2.000	2.000	-	CHF	91.940	194.788,14	0,76
NESTLÉ	CH0038863350	STK	2.500	-	-	CHF	77.480	205.190,68	0,80
Dänische Kronen									
NOVO-NORDISK NAM. 'B'	DK0062498333	STK	2.000	-	1.000	DKK	607.300	162.769,19	0,63
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro									
0,3750 % BAYER V.21-29	XS2281343256	EUR	400.000	-	-	%	89.615	358.461,16	1,40
0,5000 % AGENCE FRANÇ.DÉV. MTN V.20-30	FR0013507993	EUR	400.000	400.000	-	%	88.135	352.538,48	1,37
0,8750 % LEG IMMO. MTN V.21-33	DE000A3H3JU7	EUR	400.000	-	-	%	79.827	319.309,12	1,24
0,8780 % UBISOFT ENTERT. V.20-27	FR0014000087	EUR	300.000	-	-	%	85.540	256.620,00	1,00

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2025	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
1,6250 % VERALLIA V.21-28	FR0014003G27	EUR	400.000	-	-	%	96,338	385.350,00	1,50
1,8750 % ENEL FRN V.21-UND.	XS2312746345	EUR	400.000	-	-	%	88,215	352.860,00	1,37
2,1250 % VONOVIA MTN V.18-30	DE000A19X8B2	EUR	400.000	-	-	%	94,620	378.480,00	1,47
2,3750 % EPSF MTN V.22-32	EU000A2SCAC2	EUR	400.000	-	-	%	97,920	391.681,28	1,53
2,5000 % BNP PARIBAS FRN 22-32 MTN	FR0014009HA0	EUR	400.000	400.000	-	%	98,076	392.302,56	1,53
3,2500 % HORNBACH BAUMARKT V.19-26	DE000A255DH9	EUR	400.000	-	-	%	99,674	398.695,56	1,55
4,3750 % BNP PARIBAS FRN V.23-29 MTN	FR001400DCZ6	EUR	300.000	-	-	%	104,073	312.218,55	1,22
4,7500 % DANSKE BK. FRN V.23-30 MTN	XS2637421848	EUR	400.000	-	-	%	106,516	426.064,60	1,66
Zertifikate									
Euro									
D.BÖRSEC. XETRA-GOLD IZ 07-UND	DE000A0S9GB0	STK	14.000	-	-	EUR	86,845	1.215.830,00	4,74
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro									
0,9500 % DT.BAHN FIN. FRN V.19-UND.	XS2010039035	EUR	400.000	-	-	%	99,240	396.960,00	1,55
1,2070 % PROSUS MTN V.22-26	XS2430287529	EUR	400.000	-	-	%	97,992	391.966,28	1,53
2,6140 % EAST JAPAN RAILW. MTN V.22-25	XS2526860965	EUR	500.000	-	-	%	99,930	499.650,00	1,95
3,7500 % CHILE 25/32	XS2975303483	EUR	300.000	300.000	-	%	100,610	301.830,00	1,18
3,8750 % BRENNTAG FIN. MTN V.24-32	XS2802928692	EUR	300.000	-	-	%	102,110	306.330,66	1,19
4,8750 % SAIPEM FIN.INT. MTN V.24-30	XS2826718087	EUR	400.000	275.000	-	%	104,184	416.736,00	1,62
US-Dollar									
3,5000 % USA TREA. V.23-30	US91282CGZ86	USD	500.000	-	-	%	95,970	461.595,47	1,80
Nicht notierte Wertpapiere									
Aktien									
Euro									
LINDE BESS.SCH.	BES_648300	STK	4.900	-	-	EUR	0,000	0,00	0,00
Investmentanteile									
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro									
ISHS 3-ISHS S&P 500 ESG EUR	IE000CR7DJI8	ANT	142.500	-	142.500	EUR	7,129	1.015.882,50	3,96
US-Dollar									
I.M.II-NASDAQ-100 ESG	IE000COQKPO9	ANT	36.000	7.200	6.200	USD	61,583	2.132.640,00	8,31
ISHS 3-ISHS S&P 500 ESG USD	IE000R9FA4A0	ANT	225.000	75.000	-	USD	7,628	1.651.050,00	6,43
L&G ART.INTELL.UCITS	IE00BK5BCD43	ANT	35.000	-	-	USD	23,751	799.653,36	3,12
SCHROD.ISF ASIAN TOT.RET. 'C'	LU0326949186	ANT	3.600	3.600	-	USD	420,069	1.454.713,75	5,67
XTR.(IE)-S&P500 EQ.WE.ESG '1C'	IE0004MFRED4	ANT	46.250	26.250	-	USD	48,942	2.177.450,00	8,48

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2025	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Summe Wertpapiervermögen								25.156.977,27	98,03
Bankguthaben, nicht verbriezte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								438.188,57	1,71
Bankguthaben								438.188,57	1,71
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN		EUR		438.188,57			%	100,000	438.188,57
Sonstige Vermögensgegenstände								85.601,45	0,33
ZINSANSPRÜCHE		EUR		85.601,45				85.601,45	0,33
Sonstige Verbindlichkeiten								-17.560,28	-0,07
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN		EUR		-2.576,82				-2.576,82	-0,01
KOSTENABGRENZUNGEN		EUR		-14.983,46				-14.983,46	-0,06
Fondsvermögen							EUR	25.663.207,01	100,00^{*)}

Anteilwert		EUR	62,07
Umlaufende Anteile		STK	413.433,4740

^{*)} 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 31.01.2025 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.01.2025

Schweizer Franken	(CHF)	0,94400 = 1 (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,46210 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,03955 = 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 Schuldcheindarlehen
(Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

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

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Euro

AIXTRON NAM.	DE000A0WMP16	STK	-	7.500
CARREFOUR	FR0000120172	STK	-	13.250
DT.POST NAM.	DE0005552004	STK	-	7.500
IBERDROLA INH.	ES06445809T5	STK	-	15.000
-ANR-				
JDE PEET'S	NL0014332678	STK	-	6.500
KERING	FR0000121485	STK	-	700

Englische Pfund

BARCLAYS	GB0031348658	STK	85.000	85.000
----------	--------------	-----	--------	--------

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

0,8000 % SPANIEN V.20-27	ES0000012G26	EUR	-	500.000
1,0000 % ESM MTN V.22-27	EU000A1Z99Q7	EUR	-	400.000
1,2500 % DAVIDE CAMPARI-MILANO V.20-27	XS2239553048	EUR	-	400.000
1,2500 % ING GR. FRN V.22-27 MTN	XS2443920249	EUR	-	400.000
1,5000 % CESKE DRAHY V.19-26	XS1991190361	EUR	-	400.000
1,6250 % LOUIS DREYFUS CO.FIN. V.21-28	XS2332552541	EUR	-	400.000
2,8850 % BARCLAYS FRN V.22-27 MTN	XS2487667276	EUR	-	400.000

**An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene
Wertpapiere**

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

3,7500 % METROP.L.GL.FD.I MTN V.22-30	XS2561748711	EUR	-	188.000
---	--------------	-----	---	---------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

Euro

FIDELITY FD.-SUST.A.EQ.FD. 'Y'	LU0951203347	ANT	-	72.000
--------------------------------------	--------------	-----	---	--------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	98,03 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	62,07
Umlaufende Anteile (STK)	413.433,4740

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

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 gleichtägig).

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⁾
Fidelity Fd.-Sust.A.Eq.Fd. 'Y'	1,07000 % p.a.
I.M.II-NASDAQ-100 ESG	0,25000 % 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.
L&G Art.Intell.UCITS	0,49000 % p.a.

Schrod.ISF Asian Tot.Ret. 'C'	1,29000 % p.a.
Xtr.(IE)-S&P500 Eq.We.ESG '1C'	0,17000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgesellschaften 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.

