

Halbjahresbericht

SALytic Strategy

zum 31. Januar 2022

Halbjahresbericht des SAlytic Strategy

ZUM 31. JANUAR 2022

■ 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	35.623.120,62	100,70
1. Aktien	12.771.603,86	36,10
Finanzwerte	2.653.485,46	7,50
Verbraucher-Dienstleistungen	2.435.972,32	6,89
Technologie	1.592.898,70	4,50
Industriewerte	1.433.470,50	4,05
Gesundheitswesen	1.302.344,74	3,68
Rohstoffe	1.089.570,00	3,08
Konsumgüter	901.209,31	2,55
Versorgungsunternehmen	747.132,83	2,11
Energiewerte	323.760,00	0,92
Telekommunikation	291.760,00	0,82
2. Anleihen	6.851.972,11	19,37
Regierungsanleihen	1.846.802,20	5,22
Transportwesen	811.831,58	2,29
Medien	797.932,00	2,26
Basisindustrie	723.869,44	2,05
Immobilien	396.050,52	1,12
Investitionsgüter	395.596,88	1,12
Reise & Freizeit	385.220,00	1,09
Automobil	326.428,50	0,92
Gesundheitswesen	301.017,00	0,85
Banking/Bankwesen	251.574,33	0,71
Handel	214.761,88	0,61
Energiewerte	201.072,60	0,57
Konsumgüter	199.815,18	0,56
3. Derivate	15.360,00	0,04
Zins-Derivate	15.360,00	0,04
4. Forderungen	832.063,92	2,35
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	4.853.316,38	13,72
7. Sonstige Vermögensgegenstände	10.298.804,35	29,11
Zertifikate	1.287.625,00	3,64
Zielfondsanteile	9.011.179,35	25,47

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Indexfonds	6.690.606,85	18,91
Aktiefonds	1.354.435,00	3,83
Gemischte Fonds	966.137,50	2,73
II. Verbindlichkeiten	-248.400,27	-0,70
Sonstige Verbindlichkeiten	-248.400,27	-0,70
III. Fondsvermögen	35.374.720,35	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 31.01.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								19.992.039,00	56,52
Aktien									
Euro								11.155.242,83	31,53
AIXTRON NAM.	DE000A0WMPJ6	STK	12.000	12.000	-	EUR	18,170	218.040,00	0,62
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	1.600	1.600	1.750	EUR	227,350	363.760,00	1,03
APERAM	LU0569974404	STK	4.000	-	-	EUR	49,760	199.040,00	0,56
ASM	NL0000334118	STK	1.000	1.000	-	EUR	302,000	302.000,00	0,85
ASML HOLD.	NL0010273215	STK	1.000	-	250	EUR	594,200	594.200,00	1,68
AXA	FR0000120628	STK	17.500	-	-	EUR	27,955	489.212,50	1,38
AZELIS GR. NAM.	BE0974400328	STK	204	204	-	EUR	22,625	4.615,50	0,01
BASF NAM.	DE000BASF111	STK	6.000	-	-	EUR	67,520	405.120,00	1,15
BAYER NAM.	DE000BAY0017	STK	5.500	-	-	EUR	53,840	296.120,00	0,84
CECONOMY	DE0007257503	STK	53.500	-	-	EUR	3,932	210.362,00	0,59
COVESTRO	DE0006062144	STK	5.000	2.000	-	EUR	52,860	264.300,00	0,75
DAIMLER TRUCK HOLD. JUNGE NAM.	DE000DTR0CK8	STK	1.500	-	-	EUR	31,380	47.070,00	0,13
DT.POST NAM.	DE0005552004	STK	7.000	-	2.000	EUR	52,990	370.930,00	1,05
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508	STK	17.500	6.000	-	EUR	16,672	291.760,00	0,82
ENEL	IT0003128367	STK	31.500	-	-	EUR	6,781	213.601,50	0,60
ENGIE	FR0010208488	STK	16.500	-	-	EUR	13,554	223.641,00	0,63
ERSTE GR.BK.	AT0000652011	STK	10.000	10.000	-	EUR	41,230	412.300,00	1,17
IBERDROLA	ES0144580Y14	STK	30.001	13.716	-	EUR	10,160	304.810,16	0,86
IBERDROLA ANR.	ES06445809N8	STK	30.001	-	-	EUR	0,169	5.080,17	0,01
IND.DE DISEÑO TEXTIL	ES0148396007	STK	10.000	10.000	-	EUR	26,740	267.400,00	0,76
JDE PEET'S	NL0014332678	STK	8.000	-	-	EUR	26,605	212.840,00	0,60
KERING	FR0000121485	STK	400	-	-	EUR	656,300	262.520,00	0,74
KON.AHOLD DELHAIZE	NL0011794037	STK	12.500	-	-	EUR	28,755	359.437,50	1,02
LINDE	IE00BZ12WP82	STK	1.500	-	500	EUR	280,100	420.150,00	1,19
LVMH	FR0000121014	STK	400	250	-	EUR	722,600	289.040,00	0,82
MERCEDES-BENZ GR. NAM.	DE0007100000	STK	3.000	3.000	-	EUR	69,930	209.790,00	0,59
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	1.750	-	700	EUR	279,050	488.337,50	1,38
OMV	AT0000743059	STK	6.000	-	-	EUR	53,960	323.760,00	0,92
PORSCHE VORZ.	DE000PAH0038	STK	3.000	-	-	EUR	82,400	247.200,00	0,70
QIAGEN NAM.	NL0012169213	STK	7.500	3.500	-	EUR	43,750	328.125,00	0,93
SANOFI	FR0000120578	STK	4.000	-	-	EUR	92,750	371.000,00	1,05
SAP	DE0007164600	STK	2.250	-	2.000	EUR	110,400	248.400,00	0,70
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972	STK	3.000	-	500	EUR	149,360	448.080,00	1,27
SOC.GÉNÉRALE	FR0000130809	STK	15.000	-	-	EUR	32,685	490.275,00	1,39
SODEXO	FR0000121220	STK	3.500	-	-	EUR	82,040	287.140,00	0,81
VINCI	FR0000125486	STK	4.250	-	-	EUR	96,660	410.805,00	1,16
VW VORZ.	DE0007664039	STK	1.500	-	-	EUR	183,320	274.980,00	0,78
US-Dollar								230.258,70	0,65
BIONTECH NAM. (SPONS.ADRS)	US09075V1026	STK	1.500	750	1.000	USD	172,080	230.258,70	0,65
Schweizer Franken								1.386.102,33	3,92
NESTLÉ	CH0038863350	STK	3.500	-	-	CHF	119,080	399.329,31	1,13
NOVARTIS NAM.	CH0012005267	STK	4.000	-	-	CHF	80,130	307.099,74	0,87
UBS GR. NAM.	CH0244767585	STK	25.000	-	-	CHF	17,100	409.600,46	1,16
ZUR ROSE GR. NAM.	CH0042615283	STK	1.250	1.250	-	CHF	225,500	270.072,82	0,76

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								5.932.810,14	16,77
0,3750 % LEG IMMO. MTN V.22-26	DE000A3MQNN9		EUR	400.000	400.000	-	% 99,013	396.050,52	1,12
0,5000 % BUND V.15-25	DE0001102374		EUR	300.000	-	-	% 102,962	308.886,78	0,87
0,5000 % ITALIEN B.T.P. V.20-26	IT0005419848		EUR	500.000	500.000	-	% 100,478	502.391,80	1,42
0,8000 % SPANIEN V.20-27	ES0000012G26		EUR	500.000	500.000	-	% 103,072	515.361,65	1,46
0,8780 % UBISOFT ENTERT. V.20-27	FR0014000087		EUR	400.000	400.000	-	% 96,305	385.220,00	1,09
1,2000 % UNICREDIT MTN V.20-26	XS2104967695		EUR	250.000	-	-	% 100,630	251.574,33	0,71
1,5000 % CESKE DRAHY V.19-26	XS1991190361		EUR	400.000	-	-	% 103,067	412.269,48	1,17
1,6250 % LOUIS DREYFUS CO.FIN. V.21-28	XS2332552541		EUR	200.000	-	-	% 99,908	199.815,18	0,56
1,6250 % VERALLIA V.21-28	FR0014003G27		EUR	400.000	400.000	-	% 98,899	395.596,88	1,12
1,7500 % LAGARDERE V.21-27	FR0014005SR9		EUR	400.000	400.000	-	% 99,733	398.932,00	1,13
1,7500 % VOESTALPINE MTN V.19-26	AT0000A27LQ1		EUR	200.000	-	-	% 102,963	205.926,00	0,58
2,0450 % EP INFRASTR. V.19-28	XS2062490649		EUR	200.000	-	-	% 100,536	201.072,60	0,57
2,3750 % BAYER FRN V.15-75	DE000A14J611		EUR	300.000	-	-	% 100,339	301.017,00	0,85
2,8750 % DT.LUFTHANSA MTN V.21-25	XS2296201424		EUR	200.000	-	-	% 101,102	202.203,34	0,57
2,8750 % DT.LUFTHANSA MTN V.21-27	XS2408458730		EUR	200.000	200.000	-	% 98,679	197.358,76	0,56
2,8750 % THYSSENKRUPP MTN V.19-24	DE000A2TEDB8		EUR	200.000	-	-	% 101,542	203.084,00	0,57
3,2500 % HORNBACH BAUMARKT V.19-26	DE000A255DH9		EUR	200.000	-	-	% 107,381	214.761,88	0,61
4,5000 % BILFINGER V.19-24	DE000A2YNQW7		EUR	100.000	-	-	% 106,126	106.125,84	0,30
4,5000 % LANXESS FRN V.16-76	XS1405763019		EUR	200.000	-	-	% 104,367	208.733,60	0,59
4,6250 % VW INT.FIN. FRN V.14-UND.	XS1048428442		EUR	300.000	-	-	% 108,810	326.428,50	0,92
Zertifikate									
Euro								1.287.625,00	3,64
D.BÖRSEC. XETRA-GOLD IZ 07-UND	DE000A0S9GB0		STK	25.000	-	-	EUR 51,505	1.287.625,00	3,64
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								919.161,97	2,60
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								399.000,00	1,13
1,2070 % PROSUS MTN V.22-26	XS2430287529		EUR	400.000	400.000	-	% 99,750	399.000,00	1,13
US-Dollar								520.161,97	1,47
0,1250 % USA TREA. V.20-23	US91282CAP68		USD	300.000	-	-	% 98,359	263.227,60	0,74
0,2500 % USA TREA. V.20-25	US912828ZW33		USD	300.000	-	-	% 96,008	256.934,37	0,73
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
Investmentanteile								9.011.179,35	25,47
Gesellschaftseigene Investmentanteile									
Euro								1.354.435,00	3,83
SALYTIC ACT.EQ.	DE000A1JSW22		ANT	20.500	1.750	-	EUR 66,070	1.354.435,00	3,83

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								966.137,50	2,73
MARTAGON SOLID PLUS	DE000A0M1U41		ANT	1.250	1.250	-	EUR 772,910	966.137,50	2,73
US-Dollar								6.690.606,85	18,91
ISHARESII-S&P GL CLEAN EN.	IE00B1XNHC34		ANT	55.000	-	-	USD 10,582	519.200,00	1,47
ISHARES NASDAQ-100	DE000A0F5UF5		ANT	12.825	8.325	3.000	USD 143,600	1.642.882,50	4,64
ISHARES VII- CORE S&P 500	IE00B5BMR087		ANT	8.650	8.650	-	USD 456,140	3.519.724,35	9,95
XTR.(IE) - RUSSELL 2000 '1C'	IE00BJZ2DD79		ANT	4.000	-	2.250	USD 282,716	1.008.800,00	2,85
Summe Wertpapiervermögen								29.922.380,32	84,59
Derivate								15.360,00	0,04
Zins-Derivate									
Zinsterminkontrakte								15.360,00	0,04
EURO-BUND-FUTURE 03/22		EUREX	STK	-300.000			EUR	15.360,00	0,04
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								4.853.316,38	13,72
Bankguthaben								4.853.316,38	13,72
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	4.853.316,38			% 100,000	4.853.316,38	13,72
Sonstige Vermögensgegenstände								832.063,92	2,35
ZINSANSPRÜCHE			EUR	60.693,41				60.693,41	0,17
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	771.370,51				771.370,51	2,18
Sonstige Verbindlichkeiten								-248.400,27	-0,70
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-213.174,46				-213.174,46	-0,60
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-19.865,81				-19.865,81	-0,06
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-15.360,00				-15.360,00	-0,04
Fondsvermögen							EUR	35.374.720,35	100,00^{*)}
Anteilwert							EUR	56,58	
Umlaufende Anteile							STK	625.162,20	

^{*)} 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 31.01.2022 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.01.2022

Schweizer Franken	(CHF)	1,04370 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,12100 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

EUREX 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 (Marktzuzuordnung zum Berichtsstichtag):

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

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Euro

ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0	STK	-	1.500
ANHEUSER-BUSCH	BE0974293251	STK	2.500	7.500
DWS GR.	DE000DWS1007	STK	5.000	5.000
HEIDELBERGCEMENT	DE0006047004	STK	-	4.000
T				
KNORR-BREMSE	DE000KBX1006	STK	-	2.000
RHEINMETALL	DE0007030009	STK	-	3.000
STRÖER	DE0007493991	STK	-	2.150
TALANX NAM.	DE000TLX1005	STK	-	8.000
TOTALENERGIES	FR0000120271	STK	-	8.000
WORLDDLINE	FR0011981968	STK	-	2.500

Dänische Kronen

CARLSBERG 'B'	DK0010181759	STK	-	2.000
---------------	--------------	-----	---	-------

Englische Pfund

WHITBREAD	GB00B1KJJ408	STK	-	6.500
-----------	--------------	-----	---	-------

Schwedische Kronen

ESSITY NAM. 'B'	SE0009922164	STK	-	4.500
-----------------	--------------	-----	---	-------

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

0,8750 % CEZ MTN V.19-26	XS2084418339	EUR	-	477.000
1,8750 % OTTO MTN V.17-24	XS1625975153	EUR	-	200.000
2,1250 % LAGARDÈRE V.19-26	FR0013449261	EUR	-	200.000
2,8750 % PERUSAHAAN LIS.NEG. MTN 18-25	XS1891336932	EUR	-	200.000

Norwegische Kronen

1,5000 % EIB MTN V.17-24	XS1555330999	NOK	-	5.000.000
--------------------------	--------------	-----	---	-----------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

Euro

ISH.VII-NASDAQ 100 UCITS	IE00BYVQ9F29	ANT	-	110.000
ISHARES V-S&P 500 EUR-HD.	IE00B3ZW0K18	ANT	-	32.500
UBS(LUX)EQ.-CHINA OPP. 'Q'	LU1923635863	ANT	-	3.250

US-Dollar

XTRACKERS MSCI CHINA '1C'	LU0514695690	ANT	-	15.000
---------------------------	--------------	-----	---	--------

■ Während des Berichtszeitraumes 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** **3.829**

Basiswerte: (DAX FUTURE 03/22, DAX FUTURE 12/21)

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte **EUR** **344**

Basiswerte: (EURO-BUND-FUTURE 12/21)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	84,59 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,04 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	56,58
Umlaufende Anteile (STK)	625.162,20

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.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
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.

iSharesV-S&P 500 EUR-Hd.	0,20000 % p.a.
iSh.VII-NASDAQ 100 UCITS	0,36000 % p.a.
MARTAGON Solid Plus	0,58000 % p.a.
SALytic Act.Eq.	0,85000 % p.a.
UBS(Lux)Eq.-China Opp. 'Q'	1,12000 % p.a.
Xtrackers MSCI China '1C'	0,45000 % 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 Rücknahmeabschläge gezahlt.

