

Halbjahresbericht

SALytic Active Equity

zum 30. September 2021

Halbjahresbericht des SALytic Active Equity

ZUM 30. SEPTEMBER 2021

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	6
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	39.159.262,72	100,08
1. Aktien	39.026.375,06	99,74
Industriewerte	7.221.860,80	18,46
Finanzwerte	6.668.772,80	17,04
Verbraucher-Dienstleistungen	5.480.833,84	14,01
Technologie	5.118.508,36	13,08
Rohstoffe	3.944.105,00	10,08
Konsumgüter	3.891.992,98	9,95
Versorgungsunternehmen	2.412.786,66	6,17
Energiewerte	1.994.447,12	5,10
Gesundheitswesen	1.858.167,50	4,75
Telekommunikation	434.900,00	1,11
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	-74,80	0,00
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	132.962,46	0,34
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-29.348,41	-0,08
Sonstige Verbindlichkeiten	-29.348,41	-0,08
III. Fondsvermögen	39.129.914,31	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 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								39.010.588,39	99,70
Aktien									
Euro								35.353.644,49	90,35
AIXTRON NAM.	DE000A0WMPJ6	STK	30.000	30.000	-	EUR	21,670	650.100,00	1,66
ANHEUSER-BUSCH	BE0974293251	STK	16.300	-	-	EUR	49,145	801.063,50	2,05
ARCELORMITTAL NOUV.	LU1598757687	STK	29.500	-	-	EUR	26,460	780.570,00	1,99
ASML HOLD.	NL0010273215	STK	3.750	2.150	400	EUR	645,900	2.422.125,00	6,19
AXA	FR0000120628	STK	63.000	-	-	EUR	24,085	1.517.355,00	3,88
AZELIS GR. NAM.	BE0974400328	STK	680	680	-	EUR	27,200	18.496,00	0,05
BASF NAM.	DE000BASF111	STK	16.900	5.900	-	EUR	65,850	1.112.865,00	2,84
BAYER NAM.	DE000BAY0017	STK	12.500	-	7.000	EUR	47,005	587.562,50	1,50
CECONOMY	DE0007257503	STK	170.000	170.000	-	EUR	3,732	634.440,00	1,62
COVESTRO	DE0006062144	STK	16.000	-	5.000	EUR	59,340	949.440,00	2,43
DAIMLER NAM.	DE0007100000	STK	12.000	3.000	-	EUR	76,720	920.640,00	2,35
DT.POST NAM.	DE0005552004	STK	28.700	-	-	EUR	54,480	1.563.576,00	4,00
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508	STK	25.000	-	-	EUR	17,396	434.900,00	1,11
DWS GR.	DE000DWS1007	STK	15.000	15.000	-	EUR	36,480	547.200,00	1,40
ENEL	IT0003128367	STK	92.000	-	-	EUR	6,651	611.892,00	1,56
ENGIE	FR0010208488	STK	53.000	53.000	-	EUR	11,342	601.126,00	1,54
HEIDELBERGCEMENT	DE0006047004	STK	15.000	-	3.000	EUR	64,780	971.700,00	2,48
IBERDROLA	ES0144580Y14	STK	69.307	-	-	EUR	8,684	601.861,99	1,54
JDE PEET'S	NL0014332678	STK	33.350	33.350	-	EUR	25,800	860.430,00	2,20
JENOPTIK NAM.	DE000A2NB601	STK	18.500	18.500	-	EUR	29,300	542.050,00	1,39
KON.AHOLD DELHAIZE	NL0011794037	STK	27.000	12.000	-	EUR	28,735	775.845,00	1,98
LINDE	IE00BZ12WP82	STK	4.300	-	-	EUR	256,100	1.101.230,00	2,81
LVMH	FR0000121014	STK	2.084	984	-	EUR	620,100	1.292.288,40	3,30
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	3.800	-	1.000	EUR	236,900	900.220,00	2,30
NORDEX	DE000A0D6554	STK	23.184	-	20.000	EUR	14,680	340.341,12	0,87
OMV	AT0000743059	STK	31.700	4.000	9.500	EUR	52,180	1.654.106,00	4,23
QIAGEN NAM.	NL0012169213	STK	13.900	-	5.000	EUR	44,790	622.581,00	1,59
RHEINMETALL	DE0007030009	STK	6.550	-	2.500	EUR	84,780	555.309,00	1,42
SANOFI	FR0000120578	STK	7.800	3.580	-	EUR	83,080	648.024,00	1,66
SAP	DE0007164600	STK	13.880	6.880	-	EUR	116,880	1.622.294,40	4,15
SCHNEIDER ELEC.	FR0000121972	STK	9.000	-	-	EUR	143,900	1.295.100,00	3,31
SOC.GÉNÉRALE	FR0000130809	STK	53.700	11.000	-	EUR	27,195	1.460.371,50	3,73
SODEXO	FR0000121220	STK	11.200	-	2.500	EUR	75,780	848.736,00	2,17
STRÖER	DE0007493991	STK	11.446	11.446	-	EUR	71,300	816.099,80	2,09
TALANX NAM.	DE000TLX1005	STK	20.581	-	10.000	EUR	36,880	759.027,28	1,94
VEOLIA ENVIR.	FR0000124141	STK	22.000	22.000	-	EUR	26,460	582.120,00	1,49
VINCI	FR0000125486	STK	9.600	4.000	-	EUR	90,150	865.440,00	2,21
VW VORZ.	DE0007664039	STK	7.700	-	1.300	EUR	193,640	1.491.028,00	3,81
WORLDLINE	FR0011981968	STK	9.000	-	-	EUR	66,010	594.090,00	1,52
US-Dollar								423.988,96	1,08
BIONTECH NAM. (SPONS.ADRS)	US09075V1026	STK	1.800	5.200	3.400	USD	272,990	423.988,96	1,08
Schweizer Franken								2.422.810,10	6,19
NESTLÉ	CH0038863350	STK	9.000	-	-	CHF	112,700	938.211,08	2,40
UBS GR. NAM.	CH0244767585	STK	107.000	16.000	-	CHF	15,000	1.484.599,02	3,79

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Englische Pfund								810.144,84	2,07
WHITBREAD	GB00B1KJJ408		STK	21.000	6.000	5.450	GBP 33,160	810.144,84	2,07
Nicht notierte Wertpapiere								15.786,67	0,04
Aktien									
Euro								15.786,67	0,04
VEOLIA ENVIR.	FR0014005GA0		STK	21.987	-	13	EUR 0,718	15.786,67	0,04
Summe Wertpapiervermögen								39.026.375,06	99,74
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								132.962,46	0,34
Bankguthaben								132.962,46	0,34
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	127.392,79			% 100,000	127.392,79	0,33
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			GBP	14,52			% 100,000	16,89	0,00
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			SEK	0,50			% 100,000	0,05	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			CHF	865,98			% 100,000	801,02	0,00
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			USD	5.506,99			% 100,000	4.751,71	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände								-74,80	0,00
ZINSANSPRÜCHE			EUR	-74,80				-74,80	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-29.348,41	-0,08
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-29.348,41				-29.348,41	-0,08
Fondsvermögen							EUR	39.129.914,31	100,00*)
Anteilwert							EUR	64,59	
Umlaufende Anteile							STK	605.863,00	

*) 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 30.09.2021 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.09.2021

Schweizer Franken	(CHF)	1,08110 = 1 (EUR)
Englische Pfund	(GBP)	0,85955 = 1 (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,13915 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,15895 = 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 (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

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

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Euro

ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0	STK	1.200	3.137
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	1.800	1.800
APERAM	LU0569974404	STK	-	19.600
DT.WOHNEN	DE000A0HN5C6	STK	8.000	27.300
IBERDROLA ANR.	ES06445809M0	STK	-	69.307
KNORR-BREMSE	DE000KBX1006	STK	4.000	4.000
KON.PHILIPS	NL0000009538	STK	-	8.800
NORDEX BEZ.R.	DE000A3E5CX4	STK	6	-
NORMA GR. NAM.	DE000A1H8BV3	STK	9.802	9.802
PROSUS	NL0013654783	STK	-	7.000
RWE	DE0007037129	STK	-	30.000
STMICROELEC.	NL0000226223	STK	-	42.500
TAKKT	DE0007446007	STK	-	20.824
WACKER CHEM.	DE000WCH8881	STK	-	4.720

Dänische Kronen

CARLSBERG 'B'	DK0010181759	STK	-	7.300
---------------	--------------	-----	---	-------

Englische Pfund

AVAST	GB00BDD85M81	STK	-	45.400
UNILEVER	GB00B10RZP78	STK	-	200

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	99,74 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	64,59
Umlaufende Anteile (STK)	605.863,00

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 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.

