

Halbjahresbericht

SALytic Stiftungsfonds AMI

1. September 2023 bis 29. Februar 2024

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 29.02.2024

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	22.597.093,87	26,82
Belgien	1.515,20	0,00
Deutschland	6.823.586,50	8,10
Dänemark	879.695,21	1,04
Finnland	674.400,00	0,80
Frankreich	7.753.330,15	9,20
Irland	1.119.768,99	1,33
Niederlande	3.271.505,00	3,88
Schweiz	1.542.292,82	1,83
Spanien	531.000,00	0,63
Verzinsliche Wertpapiere	47.856.857,45	56,80
Deutschland	13.138.532,36	15,59
Dänemark	1.031.290,00	1,22
Europäische Institutionen	456.255,00	0,54
Finnland	517.495,00	0,61
Frankreich	5.390.868,00	6,40
Großbritannien	2.830.770,00	3,36
Indonesien	1.426.225,00	1,69
Irland	794.863,00	0,94
Italien	2.006.881,00	2,38
Japan	199.012,00	0,24
Liechtenstein	1.083.082,00	1,29
Luxemburg	2.005.734,00	2,38
Niederlande	5.442.411,00	6,46
Polen	808.608,00	0,96
Schweiz	1.328.238,00	1,58
Spanien	2.051.937,00	2,44
Tschechische Republik	1.460.088,00	1,73
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	5.387.288,09	6,39
Österreich	497.280,00	0,59
Zertifikate	2.432.600,00	2,89
Deutschland	2.432.600,00	2,89
Investmentanteile	10.476.122,56	12,43
Aktienfonds	10.151.002,56	12,05
Gemischte Fonds	325.120,00	0,39
Bankguthaben	135.502,78	0,16
Sonstige Vermögensgegenstände	792.867,49	0,94
Verbindlichkeiten	-35.269,92	-0,04
Fondsvermögen	84.255.774,23	100,00¹⁾

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Vermögensgegenstände									
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	65.585.061,96	77,84	
Aktien						EUR	22.438.483,87	26,63	
Belgien						EUR	1.515,20	0,00	
Azelis Group NV	BE0974400328	STK	80	0	0	EUR	18,9400	1.515,20	0,00
Deutschland						EUR	6.823.586,50	8,10	
Adidas AG	DE000A1EWWW0	STK	2.200	0	0	EUR	187,1200	411.664,00	0,49
Aixtron AG	DE000A0WMPJ6	STK	10.000	10.000	0	EUR	25,6800	256.800,00	0,30

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Allianz SE	DE0008404005	STK	4.000	0	500	EUR	253,8500	1.015.400,00	1,21
Brenntag AG	DE000A1DAH0	STK	6.000	0	0	EUR	84,3800	506.280,00	0,60
CompuGroup Medical SE NA O.N.	DE000A288904	STK	10.000	0	0	EUR	29,3600	293.600,00	0,35
Covestro AG	DE0006062144	STK	13.000	13.000	0	EUR	50,3000	653.900,00	0,78
Deutsche Börse AG	DE0005810055	STK	3.000	0	0	EUR	193,6000	580.800,00	0,69
Deutsche Post AG	DE0005552004	STK	16.000	5.000	0	EUR	42,9100	686.560,00	0,81
Deutsche Telekom AG	DE0005557508	STK	22.500	0	2.500	EUR	21,9850	494.662,50	0,59
Fresenius SE & Co KGaA St.	DE0005785604	STK	10.000	10.000	0	EUR	25,8800	258.800,00	0,31
Mercedes-Benz Gruppe AG	DE0007100000	STK	8.000	0	1.000	EUR	73,6400	589.120,00	0,70
Münchener Rückvers. AG	DE0008430026	STK	2.500	0	0	EUR	430,4000	1.076.000,00	1,28
Dänemark						EUR		879.695,21	1,04
Novo-Nordisk AS B Shares	DK0062498333	STK	8.000	8.000	0	DKK	819,7000	879.695,21	1,04
Finland						EUR		674.400,00	0,80
Nordea Bank Holding ABP	FI4000297767	STK	60.000	0	0	EUR	11,2400	674.400,00	0,80
Frankreich						EUR		7.753.330,15	9,20
AXA SA	FR0000120628	STK	32.500	10.000	0	EUR	32,8800	1.068.600,00	1,27
Air Liquide SA	FR0000120073	STK	3.000	0	0	EUR	187,9000	563.700,00	0,67
BNP Paribas SA	FR0000131104	STK	8.000	8.000	0	EUR	55,3800	443.040,00	0,53
Cap Gemini SA	FR0000125338	STK	3.200	0	300	EUR	224,7000	719.040,00	0,85
Carrefour SA	FR0000120172	STK	30.000	0	0	EUR	15,5300	465.900,00	0,55
Euroapi Sas	FR0014008VX5	STK	239	0	0	EUR	3,8500	920,15	0,00
Kering SA	FR0000121485	STK	1.500	0	0	EUR	425,0500	637.575,00	0,76
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014	STK	1.200	0	0	EUR	842,8000	1.011.360,00	1,20
Saint-Gobain (Cie. de) SA	FR0000125007	STK	6.000	6.000	0	EUR	71,2000	427.200,00	0,51
Sanofi SA	FR0000120578	STK	5.500	0	0	EUR	87,8900	483.395,00	0,57
Schneider Electric SE	FR0000121972	STK	4.000	0	0	EUR	209,8000	839.200,00	1,00
Sodexo SA	FR0000121220	STK	6.000	0	0	EUR	73,7000	442.200,00	0,52
Vinci SA	FR0000125486	STK	5.500	0	0	EUR	118,4000	651.200,00	0,77
Irland						EUR		1.119.768,99	1,33
Linde PLC	IE00059YS762	STK	2.700	0	0	USD	448,8200	1.119.768,99	1,33
Niederlande						EUR		3.112.895,00	3,69
ASM International NV	NL0000334118	STK	1.350	0	150	EUR	563,7000	760.995,00	0,90
ASML Holding NV	NL0010273215	STK	1.900	0	0	EUR	870,5000	1.653.950,00	1,96
ING Groep NV	NL0011821202	STK	55.000	0	0	EUR	12,6900	697.950,00	0,83
Schweiz						EUR		1.542.292,82	1,83
Nestle SA	CH0038863350	STK	8.000	0	500	CHF	91,7600	770.380,32	0,91
STMicroelectronics NV	NL0000226223	STK	18.500	18.500	0	EUR	41,7250	771.912,50	0,92
Spanien						EUR		531.000,00	0,63
Iberdrola SA	ES0144580Y14	STK	50.000	0	8.980	EUR	10,6200	531.000,00	0,63
Verzinsliche Wertpapiere						EUR		40.713.978,09	48,32
0,0000 % Spain 2021/2027	ES0000012J15	EUR	700	0	0	%	91,7610	642.327,00	0,76
0,1250 % European Financial Stability Facility (EFSF) 2022/2030	EU000A1G0EP6	EUR	1.000	0	0	%	85,1490	851.490,00	1,01
0,3750 % LEG Immobilien MTN MC 2022/2026	DE000A3MQNN9	EUR	300	0	0	%	93,4530	280.359,00	0,33
0,7500 % European Stability Mechanism (ESM) MTN 2018/2028	EU000A1Z99F0	EUR	500	0	0	%	91,2510	456.255,00	0,54
0,8400 % Wintershall Dea Finance MC 2019/2025	XS2054209833	EUR	200	0	0	%	95,0540	190.108,00	0,23
0,8750 % LEG Immobilien MTN MC 2022/2029	DE000A3MQNP4	EUR	500	0	0	%	85,7660	428.830,00	0,51
0,8750 % London Stock Exchange Group MTN 2017/2024	XS1685653302	EUR	500	0	0	%	98,3820	491.910,00	0,58
0,8780 % UbiSoft Entertainment MC 2020/2027	FR0014000087	EUR	600	0	0	%	86,4390	518.634,00	0,62
1,0000 % Indonesia (Republic of) MC 2021/2029	XS2366690332	EUR	500	0	0	%	86,7940	433.970,00	0,52
1,1250 % Amplifon MC 2020/2027	XS2116503546	EUR	200	0	0	%	92,9190	185.838,00	0,22

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,2000 % UniCredit MTN fix-to-float 2020/2026	XS2104967695	EUR	500	0	0 %	97,5610	487.805,00	0,58
1,2070 % Prosus MTN MC 2022/2026	XS2430287529	EUR	600	0	0 %	95,1530	570.918,00	0,68
1,5000 % Ceske Drahya 2019/2026	XS1991190361	EUR	1.100	0	0 %	95,0280	1.045.308,00	1,24
1,6250 % Louis Dreyfus Co Finance MC 2021/2028	XS2332552541	EUR	800	0	0 %	91,8680	734.944,00	0,87
1,6250 % Verallia MC 2021/2028	FR0014003G27	EUR	600	0	0 %	91,4920	548.952,00	0,65
1,8750 % Bureau Veritas 2018/2025	FR0013370129	EUR	600	0	0 %	98,2990	589.794,00	0,70
1,8750 % Enel S.9.5Y fix-to-float PERP (sub.) 2021/2199	XS2312746345	EUR	600	600	0 %	81,8130	490.878,00	0,58
1,9500 % Spain 2015/2030	ES00000127A2	EUR	1.500	0	0 %	93,9740	1.409.610,00	1,67
2,0000 % Wienerberger 2018/2024	AT0000A20F93	EUR	500	0	0 %	99,4560	497.280,00	0,59
2,1500 % Indonesia (Republic of) MTN 2017/2024	XS1647481206	EUR	500	0	0 %	99,1500	495.750,00	0,59
2,2640 % Mitsubishi UFJ Financial Group 2022/2025	XS2489981485	EUR	200	0	0 %	99,5060	199.012,00	0,24
2,3750 % Accor MC 2021/2028	FR0014006ND8	EUR	300	0	0 %	94,1930	282.579,00	0,34
2,3750 % Iliad MC 2020/2026	FR0013518420	EUR	500	0	0 %	95,7970	478.985,00	0,57
2,3750 % Louis Dreyfus Co Finance MC 2020/2025	XS2264074647	EUR	400	0	0 %	97,3950	389.580,00	0,46
2,4000 % Bundesobligation S.7Y 2023/2030	DE000BU27006	EUR	1.500	2.000	500 %	100,0990	1.501.485,00	1,78
2,8750 % AT&T S.B PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2114413565	EUR	1.500	0	0 %	97,3180	1.459.770,00	1,73
2,8750 % Deutsche Luft-hansa MTN MC 2021/2027	XS2408458730	EUR	600	0	0 %	96,2300	577.380,00	0,69
2,8850 % Barclays Bank MTN fix-to-float 2022/2027	XS2487667276	EUR	700	0	0 %	98,1230	686.861,00	0,82
3,0000 % Deutsche Luft-hansa MTN MC 2020/2026	XS2265369657	EUR	300	0	0 %	97,3800	292.140,00	0,35
3,0000 % ZF Finance MTN MC 2020/2025	XS2231715322	EUR	600	0	0 %	98,1370	588.822,00	0,70
3,2500 % Hornbach Baumarkt 2019/2026	DE000A255DH9	EUR	500	0	0 %	98,1250	490.625,00	0,58
3,2500 % Swiss Life Finance I MC 2022/2029	CH1210198136	EUR	1.100	0	0 %	98,4620	1.083.082,00	1,29
3,3750 % Allianz MTN PERP fix-to-float (sub.) 2014/2199	DE000A13R7Z7	EUR	500	0	0 %	99,2730	496.365,00	0,59
3,3750 % Indonesia (Republic of) MTN 2015/2025	XS1268430201	EUR	500	0	0 %	99,3010	496.505,00	0,59
3,6250 % BNP Paribas MTN 2022/2029	FR001400CFW8	EUR	700	0	0 %	99,1610	694.127,00	0,82
3,7500 % Metrop. Life Global Fdg. I MTN 2022/2030	XS2561748711	EUR	500	0	0 %	101,2610	506.305,00	0,60
3,7500 % Sixt MTN MC 2024/2029	DE000A3827R4	EUR	600	600	0 %	100,3910	602.346,00	0,71
3,8750 % Banque Fed. Credit Mutuel MTN 2023/2028	FR001400FBN9	EUR	800	0	0 %	100,1790	801.432,00	0,95
3,8750 % Cargill MC 2023/2030	XS2610788569	EUR	500	0	0 %	102,1760	510.880,00	0,61
3,8750 % Deutsche Börse MC 2023/2033	DE000A351ZT4	EUR	500	500	0 %	103,3730	516.865,00	0,61
3,8750 % ING Groep fix-to-float 2024/2029	XS2764264607	EUR	600	600	0 %	99,8200	598.920,00	0,71
3,8750 % Rabobank Nederland MTN S.GMTN fix-to-float (sub.) 2022/2032	XS2524143554	EUR	700	0	0 %	98,5190	689.633,00	0,82
3,9070 % General Mills MC 2023/2029	XS2605914105	EUR	500	0	0 %	101,2440	506.220,00	0,60
4,0000 % BASF MTN MC 2023/2029	XS2595418323	EUR	500	0	0 %	102,6550	513.275,00	0,61
4,0000 % Metrop. Life Global Fdg. I MTN 2023/2028	XS2606297864	EUR	500	0	0 %	101,6800	508.400,00	0,60
4,2500 % BASF MTN MC 2023/2032	XS2595418596	EUR	500	0	0 %	104,2620	521.310,00	0,62
4,4670 % Zürcher Kantonalbank fix-to-float 2023/2027	CH1290222392	EUR	1.000	1.000	0 %	101,5980	1.015.980,00	1,21
4,5000 % Fortum MTN MC 2023/2033	XS2606261597	EUR	500	0	0 %	103,4990	517.495,00	0,61
4,5000 % ING Groep fix-to-float 2023/2029	XS2624976077	EUR	1.000	0	0 %	102,1310	1.021.310,00	1,21
4,5000 % NASDAQ MC 2023/2032	XS2643673952	EUR	500	500	0 %	104,2820	521.410,00	0,62
4,5000 % Pandora MTN MC 2023/2028	XS2596599147	EUR	500	0	0 %	102,6040	513.020,00	0,61
4,5950 % LB Baden-Württemberg MTN FRN 2024/2026	DE000LB39BG3	EUR	1.000	1.000	0 %	99,6040	996.040,00	1,18

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
4,6560 % Morgan Stanley fix-to-float 2023/2029	XS2595028536	EUR	500	0	0 %	102,8730	514.365,00	0,61
4,7100 % Davide Campari- Milano MC 2023/2030	XS2623930117	EUR	300	0	0 %	105,0120	315.036,00	0,37
4,7500 % Danske Bank MTN fix-to-float 2023/2030	XS2637421848	EUR	500	0	0 %	103,6540	518.270,00	0,62
4,7500 % UBS Group fix-to-float 2023/2032	CH1255915014	EUR	300	0	0 %	104,0860	312.258,00	0,37
4,7520 % HSBC Holdings MTN fix-to-float 2023/2028	XS2597113989	EUR	500	0	0 %	102,3450	511.725,00	0,61
4,8750 % 3I Group MC 2023/2029	XS2626289222	EUR	600	0	0 %	104,0440	624.264,00	0,74
4,8750 % Bank of Ireland Group fix-to-float 2023/2028	XS2576362839	EUR	500	0	0 %	103,2950	516.475,00	0,61
4,9180 % Barclays Bank MTN fix-to-float 2023/2030	XS2662538425	EUR	500	0	0 %	103,2020	516.010,00	0,61
5,3750 % Orange MTN PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	FR001400GDJ1	EUR	1.000	0	0 %	103,8750	1.038.750,00	1,23
5,6250 % Powszechna Kasa Oszczed- nosci Bank MTN fix-to-float 2023/2026	XS2582358789	EUR	800	0	0 %	101,0760	808.608,00	0,96
5,9430 % Ceska Sportelna MTN fix-to-float 2023/2027	XS2638560156	EUR	400	0	0 %	103,6950	414.780,00	0,49
6,3750 % Enel MTN PERP fix- to-float (sub.) 2023/2199	XS2576550086	EUR	800	0	0 %	105,2950	842.360,00	1,00
6,6250 % Bayer S.NC5 fix- to-float (sub.) 2023/2083	XS2684826014	EUR	1.000	1.000	0 %	99,2020	992.020,00	1,18
1,5000 % US Treasury Notes 2016/2026	US9128282A70	USD	1.000	0	0 %	93,0625	859.938,09	1,02
Zertifikate						EUR	2.432.600,00	2,89
Deutsche Börse XETRA Gold ETC	DE000A0S9GB0	STK	40.000	0	0 EUR	60,8150	2.432.600,00	2,89
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	7.301.489,36	8,67
Aktien						EUR	158.610,00	0,19
Niederlande						EUR	158.610,00	0,19
Pluxee France	NL0015001W49	STK	6.000	6.000	0 EUR	26,4350	158.610,00	0,19
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	7.142.879,36	8,48
0,3750 % Credit Agricole MTN 2021/2028	FR0014003182	EUR	500	0	0 %	87,5230	437.615,00	0,52
0,9500 % Deutsche Bahn Finance PERP fix-to-float (sub.) 2019/2199	XS2010039035	EUR	1.500	0	0 %	95,9710	1.439.565,00	1,71
1,0000 % JAB Holdings 2019/2027	DE000A2SBDE0	EUR	100	0	0 %	90,6960	90.696,00	0,11
1,5000 % Smurfit Kappa Acquisitions MC 2019/2027	XS2050968333	EUR	300	0	0 %	92,7960	278.388,00	0,33
1,6000 % Deutsche Bahn Finance PERP fix-to-float (sub.) 2019/2199	XS2010039548	EUR	800	300	0 %	85,6110	684.888,00	0,81
2,3750 % European Financial Sta- bility Facility (EFSF) 2022/2032	EU000A2SCAC2	EUR	1.200	0	0 %	96,1870	1.154.244,00	1,37
2,4980 % Wintershall DEA Finance fix-to-float PERP (sub.) 2021/2199	XS2286041517	EUR	400	0	0 %	92,2540	369.016,00	0,44
2,5000 % JAB Holdings 2018/2029	DE000A1919H2	EUR	500	0	0 %	94,4500	472.250,00	0,56
4,6250 % Commerzbank MTN fix-to-float 2024/2031	DE000CZ439T8	EUR	700	700	0 %	100,7660	705.362,00	0,84
7,0000 % Bayer fix-to- float (sub.) 2023/2083	XS2684846806	EUR	1.000	1.000	0 %	100,6760	1.006.760,00	1,19
3,5000 % Allianz S.REGS PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	USX10001AA78	USD	600	0	0 %	90,9220	504.095,36	0,60
Investmentanteile						EUR	10.476.122,56	12,43
Gruppeneigene Investmentanteile						EUR	325.120,00	0,39
SALytic Wohnimmobilien Euro Plus I (a)	DE000A2QND38	ANT	8.000	0	0 EUR	40,6400	325.120,00	0,39
Gruppenfremde Investmentanteile						EUR	10.151.002,56	12,05
Fidelity Funds - Sustainable Asia Equity Fund	LU0951203347	ANT	80.000	0	30.000 EUR	18,3200	1.465.600,00	1,74
Invesco Nasdaq-100 ESG UCITS ETF	IE000COQKPO9	ANT	18.000	0	2.000 USD	51,5800	857.919,05	1,02
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	IE00BK5BCD43	ANT	70.000	70.000	0 EUR	17,8700	1.250.900,00	1,48
SALytic Active Equity	DE000A1JSW22	ANT	12.500	0	0 EUR	69,7200	871.500,00	1,03
X S&P 500 EW ESG 1C	IE0004MFRED4	ANT	25.000	25.000	0 EUR	39,7300	993.250,00	1,18
iShares NASDAQ 100 UCITS ETF	IE00BYVQ9F29	ANT	70.000	0	0 EUR	10,9180	764.260,00	0,91
iShares S&P 500 ESG UCITS ETF	IE000CR7DJ18	ANT	350.000	0	50.000 EUR	6,0650	2.122.750,00	2,52

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
iShares S&P 500 ESG UCITS ETF	IE000R9FA4A0	ANT	310.000	90.000	180.000	USD	6,3704	1.824.823,51	2,17
Summe Wertpapiervermögen							83.362.673,88	98,94	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	135.502,78	0,16	
Bankguthaben						EUR	135.502,78	0,16	
EUR - Guthaben bei						EUR	124.911,15	0,15	
Verwahrstelle		EUR	124.911,15				124.911,15	0,15	
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen						EUR	5.945,40	0,01	
Verwahrstelle		GBP	5.086,88				5.945,40	0,01	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR	4.646,23	0,01	
Verwahrstelle		USD	5.028,15				4.646,23	0,01	
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	792.867,49	0,94	
Quellensteuerrück- stattungsansprüche		EUR					1.464,75	0,00	
Zinsansprüche		EUR					791.402,74	0,94	
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-35.269,92	-0,04	
Fondsvermögen						EUR	84.255.774,23	100,00²⁾	
Anteilwert Klasse I (a)						EUR	53,25		
Anteilwert Klasse SV (a)						EUR	50,74		
Umlaufende Anteile Klasse I (a)						STK	1.270.154		
Umlaufende Anteile Klasse SV (a)						STK	327.664		
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)						EUR	67.630.164,91		
Fondsvermögen Anteilklasse SV (a)						EUR	16.625.609,32		
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								98,94	
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00	

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Depotgebühren und Kosten für Researchmaterial

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Zusätzliche Angaben nach § 16 Absatz 1 Nummer 2 KARBV – Angaben zum Bewertungsverfahren

Alle Wertpapiere, 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.

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen. Anteile an Investmentvermögen werden zum letzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.

Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis des Vortages.

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.

Das bisherige Vorgehen bei der Bewertung der Assets des Sondervermögens findet auch vor dem Hintergrund der Auswirkungen durch Covid-19 Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen in diesem Zusammenhang waren bisher nicht notwendig.

Zum Stichtag 29. Februar 2024 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 100 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.02.2024

Schweiz, Franken	(CHF)	0,95288	= 1 (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45440	= 1 (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85560	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08220	= 1 (EUR)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte per 29.02.2024 oder letztbekannte

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Belgien				
Anheuser-Busch InBev NV	BE0974293251	STK	0	8.000
Deutschland				
Bayer AG	DE000BAY0017	STK	0	11.000
Gerresheimer AG	DE000A0LD6E6	STK	0	3.750
Dänemark				
Novo Nordisk A/S	DK0060534915	STK	0	4.000
Niederlande				
JDE Peet's BV	NL0014332678	STK	0	15.000
Qiagen NV	NL0012169213	STK	0	8.000
Qiagen Nv Eo -,01	NL0015001WM6	STK	7.760	7.760
Spanien				
Iberdrola Inh. -Anr-	ES06445809R9	STK	50.000	50.000
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Nestle Finance International MTN MC 2020/2024	XS2170362326	EUR	0	500
0,5000 % European Stability Mechanism (ESM) MTN 2019/2029	EU000A1Z99H6	EUR	0	1.000
0,5000 % Santander Consumer Bank MTN 2022/2025	XS2441296923	EUR	0	500
0,7500 % Austria MTN 2018/2028	AT0000A1ZGE4	EUR	0	1.700
0,7500 % Iliad MC 2021/2024	FR0014001YE4	EUR	0	500
1,0000 % Givaudan Finance MC 2020/2027	XS2126169742	EUR	0	700
1,1250 % Givaudan MC 2018/2025	XS1875331636	EUR	0	600
1,1250 % Nestle Finance International MC 2020/2026	XS2148372696	EUR	0	300
1,5000 % Sixt MC 2018/2024	DE000A2G9HU0	EUR	0	500
1,6250 % KION Group MTN MC 2020/2025	XS2232027727	EUR	0	300
1,7500 % Lagardere MC 2021/2027	FR0014005SR9	EUR	0	500
2,1250 % Lagardere MC 2019/2026	FR0013449261	EUR	0	500
3,7500 % Bayer Multi Reset Notes (subord.) 2014/2074	DE000A11QR73	EUR	0	1.300
3,8750 % Heineken MTN MC 2023/2030	XS2599730822	EUR	0	600
4,6250 % Red Electrica Corporacion PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2552369469	EUR	0	500
5,8000 % Poland Gov. Bond S.0524 FRN 2017/2024	PL0000110615	PLN	0	3.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
1,0000 % European Stability Mechanism (ESM) 2022/2027	EU000A1Z99Q7	EUR	0	500
2,6140 % East Japan Railway MTN 2022/2025	XS2526860965	EUR	0	500
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
Lyxor UCITS ETF Japan TOPIX Daily Hedged D-EUR	FR0011475078	ANT	0	4.400

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

Verwaltungsvergütung der im SALytic Stiftungsfonds AMI enthaltenen % p.a.

Investmentanteile:

Fidelity Funds - Sustainable Asia Equity Fund	0,80000
Invesco Nasdaq-100 ESG UCITS ETF	0,25000
L&G Artificial Intelligence UCITS ETF	0,49000
Lyxor UCITS ETF Japan TOPIX Daily Hedged D-EUR	0,90000
SALytic Active Equity	0,85000
SALytic Wohnimmobilien Euro Plus I (a)	0,76000
X S&P 500 EW ESG 1C	0,24000
iShares NASDAQ 100 UCITS ETF	0,36000
iShares S&P 500 ESG UCITS ETF (IE000CR7DJ18/EUR)	0,10000

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

Verwaltungsvergütung der im SALytic Stiftungsfonds AMI enthaltenen	% p.a.
--	--------

Investmentanteile:

iShares S&P 500 ESG UCITS ETF (IE000R9FA4A0/USD)	0,07000
--	---------

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im März 2024

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1
50679 Köln
Postfach 10 16 65
50456 Köln
Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729
Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com

Amtsgericht Köln: HRB 3495
USt-Id-Nr. DE 115658034

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 29.02.2024)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Gesellschafter

Ampega Asset Management GmbH (94,9 %)
Talanx AG (5,1 %)

Aufsichtsrat

Dr. Jan Wicke, Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Clemens Jungsthöfel, Stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstands der Hannover Rück SE, Hannover

Jens Hagemann
Dipl.-Kaufmann, München

Dr. Christian Hermelingmeier
Mitglied des Vorstands der HDI Global SE, Hannover

Sven Lixenfeld
Mitglied des Vorstands der HDI Deutschland AG, Düsseldorf

Geschäftsführung

Dr. Thomas Mann, Sprecher
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Dr. Dirk Erdmann
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Stefan Kampmeyer
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari

Verwahrstelle

UBS Europe SE
Bockenheimer Landstr. 2 - 4
60306 Frankfurt am Main
Deutschland

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Auslagerung

Compliance, Revision, Rechnungswesen und IT-Dienstleistungen sind auf Konzernunternehmen ausgelagert, d. h. die Talanx AG (Compliance und Revision), die HDI AG (Rechnungswesen und IT-Dienstleistungen).

Anlageberater

SALytic Invest AG
St.-Apern-Straße 20
50667 Köln
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)
Marie-Curie-Straße 24 - 28
60439 Frankfurt am Main
Deutschland

Über Änderungen wird in den regelmäßig zu erstellenden Halbjahres- und Jahresberichten sowie auf der Homepage der Ampega Investment GmbH (www.ampega.com) informiert.



Ampega Investment GmbH
Postfach 10 16 65, 50456 Köln, Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729
Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com