Halbjahresbericht

PRIVACON Multi-Strategie-Fonds

zum 31. Januar 2023

MONEGA

DAS ATTRAKTIVE FONDSKONZEPT

Halbjahresbericht des PRIVACON Multi-Strategie-Fonds

zum 31. Januar 2023

- **Vermögensübersicht** 2
- **Vermögensaufstellung** 3
- **Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind** 5
- **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV** 6

Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	**17.576.082,04**	**100,10**
1. Aktien	**0,00**	**0,00**
2. Anleihen	**0,00**	**0,00**
3. Derivate	**0,00**	**0,00**
4. Forderungen	**0,00**	**0,00**
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	**0,00**	**0,00**
6. Bankguthaben	**1.667.546,40**	**9,50**
7. Sonstige Vermögensgegenstände	**15.908.535,64**	**90,60**
Zielfondsanteile	**15.908.535,64**	**90,60**
Indexfonds	15.908.535,64	90,60
II. Verbindlichkeiten	**-16.998,05**	**-0,10**
Sonstige Verbindlichkeiten	-16.998,05	-0,10
III. Fondsvermögen	**17.559.083,99**	**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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Investmentanteile									**15.908.535,64**	**90,60**
Gesellschaftsfremde Investmentanteile										
US-Dollar									**15.908.535,64**	**90,60**
CFS-DBXT.MSCI WORLD IND. ’1C’	IE00BM67HV82		ANT	15.500	15.500	-	USD	46,298	660.765,00	3,76
ISH.IV-EDGE MSCI WLD.QU.F.U.	IE00BP3QZ601		ANT	30.000	30.000	-	USD	49,730	1.373.693,66	7,82
ISHARESII-DEV.MARK.PROP.YIELD	IE00B1FZS350		ANT	31.000	31.000	-	USD	24,020	685.622,21	3,90
ISHARESVII- CORE S&P 500	IE00B5BMR087		ANT	4.450	4.450	-	USD	418,730	1.715.711,52	9,77
ISHS IV-E.MSCI W.SIZE FAC.U.E.	IE00BP3QZD73		ANT	37.000	37.000	-	USD	40,048	1.364.375,00	7,77
ISHS IV-E.MSCI WD MOM.FAC.U.E.	IE00BP3QZ825		ANT	27.000	27.000	-	USD	55,606	1.382.400,00	7,87
ISHSIV-EDGE MSCI WO.VA.F.U.ETF	IE00BFYTYS33		ANT	300.000	300.000	-	USD	4,938	1.364.138,75	7,77
ISHS VI-ISH.EDG.MSCI WLD M.V.E	IE00BMCZLJ20		ANT	270.000	270.000	-	USD	5,245	1.303.965,00	7,43
XTR.(IE)-MSCI W.HLTH.C. ’1C’	IE00BM67HK77		ANT	14.100	14.100	34.000	USD	47,982	622.938,00	3,55
XTR.(IE)-MSCI W.INF.TEC. ’1C’	IE00BM67HT60		ANT	15.000	36.000	21.000	USD	51,175	706.800,00	4,03
XTR.(IE)-MSCI WO.CO.SERV. ’1C’	IE00BM67HR47		ANT	54.000	54.000	-	USD	14,499	720.900,00	4,11
XTR.(IE)-MSCI WORLD C.D. ’1C’	IE00BM67HP23		ANT	17.600	20.000	2.400	USD	44,794	725.912,00	4,13
XTR.(IE)-MSCI WORLD C.ST. ’1C’	IE00BM67HN09		ANT	15.600	15.600	26.000	USD	43,860	630.006,00	3,59
XTR.(IE) - MSCI WORLD EN. ’1C’	IE00BM67HM91		ANT	15.200	-	1.800	USD	46,776	654.664,00	3,73
XTR.(IE)-MSCI WORLD FIN. ’1C’	IE00BM67HL84		ANT	29.700	29.700	88.000	USD	24,898	680.872,50	3,88
XTR.(IE)-MSCI WORLD MAT. ’1C’	IE00BM67HS53		ANT	13.400	13.400	15.000	USD	56,214	693.584,00	3,95
XTR.(IE)-MSCI WORLD UTIL. ’1C’	IE00BM67HQ30		ANT	21.600	21.600	17.000	USD	31,284	622.188,00	3,54
Summe Wertpapiervermögen									**15.908.535,64**	**90,60**
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									**1.667.546,41**	**9,50**
Bankguthaben									**1.667.546,41**	**9,50**
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	1.667.546,41			%	100,000	1.667.546,41	9,50
Kurzfristige Verbindlichkeiten									**-0,01**	**0,00**
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen										
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	-0,01				100,000	-0,01	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									**-16.998,05**	**-0,10**
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-1.515,90					-1.515,90	-0,01
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-15.482,15					-15.482,15	-0,09
Fondsvermögen						**EUR**			**17.559.083,99**	**100,00*)**

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

PRIVACON Multi-Strategie-Fonds -I-	
ISIN	DE000A2DL4E9
Fondsvermögen (EUR)	17.559.083,99
Anteilwert (EUR)	133,07
Umlaufende Anteile (STK)	131.955,00

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		
US-Dollar	(USD)	1,08605 = 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
Investmentanteile				
Gesellschaftsfremde Investmentanteile				
Euro				
MUL-LYX.MSCI WD.FIN.TR U.	LU0533032859	ANT	-	1.000
XTRACK.SHORTDAX DAILY SW. ’1C’	LU0292106241	ANT	29.000	64.000
US-Dollar				
ISHARES-CORE S&P 500	IE0031442068	ANT	22.000	22.000
ISHARESIII-MSCI WORLD	IE00B4L5Y983	ANT	17.000	47.000
XTR.(IE) - MSCI WORLD ”1C’	IE00BJ0KDQ92	ANT	30.000	30.000
XTR.S&P 500 INV.DAILY SW.’1C’	LU0322251520	ANT	110.000	110.000
Japanische Yen				
XTRACKERS NIKKEI 225 ’1D’	LU0839027447	ANT	-	26.000

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	**90,60 %**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	**0,00 %**

Sonstige Angaben

PRIVACON Multi-Strategie-Fonds -I-	
ISIN	DE000A2DL4E9
Fondsvermögen (EUR)	17.559.083,99
Anteilwert (EUR)	133,07
Umlaufende Anteile (STK)	131.955,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,95%
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

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 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.

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung [1]
CFS-dbxt.MSCI World Ind. ’1C’	0,15000 % p.a.
iShares-Core S&P 500	0,07000 % p.a.
iSharesII-Dev.Mark.Prop.Yield	0,59000 % p.a.
iSharesIII-MSCI World	0,20000 % p.a.
iSharesVII- Core S&P 500	0,07000 % p.a.
iSh.IV-Edge MSCI Wld.Qu.F.U.	0,30000 % p.a.
iShs IV-E.MSCI Wd Mom.Fac.U.E.	0,30000 % p.a.
iShs IV-E.MSCI W.Size Fac.U.E.	0,30000 % p.a.
iShs VI-iSh.Edg.MSCI Wld M.V.E	0,30000 % p.a.
iShsIV-Edge MSCI Wo.Va.F.U.ETF	0,30000 % p.a.
MUL-LYX.MSCI Wd.Fin.TR U.	0,30000 % p.a.
Xtrackers Nikkei 225 ’1D’	0,01000 % p.a.
Xtrack.ShortDAX Daily Sw. ’1C’	0,40000 % p.a.
Xtr.(IE) - MSCI World En. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE) - MSCI World ”1C’	0,09000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI W.Hlth.C. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI W.Inf.Tec. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI Wo.Co.Serv. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI World C.D. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI World C.St. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI World Fin. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI World Mat. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI World Util. ’1C’	0,10000 % p.a.
Xtr.S&P 500 Inv.Daily Sw.’1C’	0,50000 % 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.