

# Halbjahresbericht

## SALytic Bond Opportunities

zum 30. September 2023

---

# Halbjahresbericht des SALytic Bond Opportunities

ZUM 30. SEPTEMBER 2023

■ 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
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>59.303.440,35</b>	<b>100,89</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>2. Anleihen</b>	<b>58.673.980,61</b>	<b>99,82</b>
Banking/Bankwesen	10.686.582,28	18,18
Basisindustrie	8.236.569,48	14,01
Transportwesen	7.462.424,95	12,70
Finanzsektor	4.428.287,10	7,53
Versorgungswerte	4.105.507,41	6,98
Regierungsanleihen	3.949.530,97	6,72
Konsumgüter	3.206.824,79	5,46
Telekommunikation	2.665.920,97	4,54
Investitionsgüter	2.279.326,02	3,88
Dienstleistungen	1.735.220,00	2,95
Handel	1.639.922,00	2,79
Technologie & Elektronik	1.319.973,92	2,25
Anleihen supranationaler Organisationen	1.289.071,56	2,19
Medien	1.272.700,00	2,17
Versicherungen	1.190.007,03	2,02
Immobilien	913.849,33	1,55
Reise & Freizeit	907.270,00	1,54
Anleihen ausländischer Regierungen	819.470,00	1,39
Gesundheitswesen	565.522,80	0,96
<b>3. Derivate</b>	<b>-15.761,35</b>	<b>-0,03</b>
Zins-Derivate	-15.761,35	-0,03
<b>4. Forderungen</b>	<b>1.243.405,18</b>	<b>2,12</b>
<b>5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>-598.184,09</b>	<b>-1,02</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-521.297,40</b>	<b>-0,89</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-521.297,40	-0,89

## ■ Vermögensübersicht

<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>58.782.142,95</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>
---------------------------	----------------------	----------------------------

<sup>\*)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>49.453.421,40</b>	<b>84,13</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Euro</b>								<b>49.453.421,40</b>	<b>84,13</b>
0,0000 % SPANIEN V.21-27	ES0000012J15		EUR	900.000	-	-	% 89,201	802.809,00	1,37
0,2500 % UBS GR. FRN V.20-26	CH0520042489		EUR	750.000	-	-	% 94,003	705.024,98	1,20
0,2750 % SLOWENIEN V.20-30	SI0002103966		EUR	300.000	300.000	-	% 81,206	243.617,49	0,41
0,3750 % CRÉDIT AGRIC. MTN V.21-28	FR0014003182		EUR	500.000	-	-	% 83,856	419.277,95	0,71
0,5000 % SPANIEN V.21-31	ES0000012I32		EUR	600.000	600.000	-	% 77,890	467.338,26	0,80
0,7000 % SPANIEN V.22-32	ES0000012K20		EUR	500.000	500.000	-	% 77,968	389.840,00	0,66
0,8000 % SPANIEN V.22-29	ES0000012K53		EUR	600.000	-	-	% 85,682	514.089,30	0,87
0,8750 % LEG IMMO. MTN V.19-27	DE000A254P51		EUR	400.000	-	-	% 85,889	343.555,76	0,58
0,8750 % LEG IMMO. MTN V.22-29	DE000A3MQNP4		EUR	700.000	-	-	% 81,471	570.293,57	0,97
0,8780 % UBISOFT ENTERT. V.20-27	FR0014000087		EUR	900.000	300.000	-	% 78,790	709.110,00	1,21
1,0000 % COCA-COLA HBC FIN. MTN V.19-27	XS1995781546		EUR	700.000	-	300.000	% 90,008	630.056,28	1,07
1,0000 % INDONESIEN V.21-29	XS2366690332		EUR	400.000	400.000	-	% 82,030	328.120,00	0,56
1,1250 % NORSK HYDRO V.19-25	XS1974922442		EUR	400.000	-	-	% 95,311	381.244,12	0,65
1,2500 % DAVIDE CAMPARI-MILANO V.20-27	XS2239553048		EUR	800.000	-	-	% 87,780	702.240,00	1,19
1,2500 % ING GR. FRN V.22-27 MTN	XS2443920249		EUR	1.200.000	-	-	% 92,587	1.111.047,36	1,89
1,2500 % SLOWENIEN V.17-27	SI0002103685		EUR	300.000	-	400.000	% 91,930	275.790,51	0,47
1,3750 % EVONIK IND. FRN V.21-81	DE000A3E5WW4		EUR	800.000	-	-	% 83,526	668.204,96	1,14
1,3750 % ORANGE FRN V.21-UND. MTN	FR0014003B55		EUR	400.000	400.000	-	% 79,750	319.000,00	0,54
1,3750 % VILMORIN+ CIE V.21-28	FR0014002KP7		EUR	500.000	-	300.000	% 80,610	403.050,00	0,69
1,5000 % CESKE DRAHY V.19-26	XS1991190361		EUR	3.100.000	-	-	% 91,952	2.850.500,53	4,85
1,5000 % SIXT V.18-24	DE000A2G9HU0		EUR	400.000	-	-	% 98,530	394.120,00	0,67
1,6250 % LOUIS DREYFUS CO.FIN. V.21-28	XS2332552541		EUR	1.250.000	-	-	% 88,139	1.101.732,88	1,87
1,6250 % VERALLIA V.21-28	FR0014003G27		EUR	1.900.000	-	-	% 87,874	1.669.600,68	2,84
1,7500 % LAGARDERE V.21-27	FR0014005SR9		EUR	1.300.000	-	-	% 97,900	1.272.700,00	2,17
1,7500 % VOESTALPINE MTN V.19-26	AT0000A27LQ1		EUR	1.100.000	-	300.000	% 93,680	1.030.480,00	1,75
1,8750 % BK.IRELAND GR. FRN V.22-26 MTN	XS2465984289		EUR	500.000	-	-	% 95,352	476.762,45	0,81
1,8750 % BUREAU VERITAS V.18-25	FR0013370129		EUR	800.000	-	-	% 96,840	774.720,00	1,32
1,8750 % ERICSSON MTN V.17-24	XS1571293684		EUR	500.000	-	-	% 98,830	494.150,00	0,84
2,0000 % NOKIA MTN V.19-26	XS1960685383		EUR	565.000	-	-	% 94,287	532.723,92	0,91
2,0000 % WIENERBERGER V.18-24	AT0000A20F93		EUR	1.200.000	-	-	% 98,090	1.177.080,00	2,00
2,1250 % FRAPORT V.20-27	XS2198879145		EUR	800.000	-	-	% 92,380	739.040,00	1,26
2,1250 % ING GR. FRN V.22-26 MTN	XS2483607474		EUR	700.000	-	-	% 96,368	674.577,96	1,15
2,1250 % LEASEPLAN MTN V.22-25	XS2477154871		EUR	700.000	-	-	% 96,582	676.076,38	1,15
2,2500 % ORSTED FRN V.17-UND.	XS1720192696		EUR	1.000.000	-	-	% 95,760	957.600,00	1,63
2,3750 % BAYER FRN V.19-79	XS2077670003		EUR	600.000	-	-	% 94,254	565.522,80	0,96
2,3750 % EFSF MTN V.22-32	EU000A2SCAC2		EUR	1.400.000	2.400.000	1.000.000	% 92,077	1.289.071,56	2,19
2,3750 % LOUIS DREYFUS CO.FIN. V.20-25	XS2264074647		EUR	500.000	-	-	% 95,702	478.508,35	0,81
2,5000 % ACCOR V.17-24	FR0013233384		EUR	200.000	-	-	% 99,080	198.160,00	0,34
2,5000 % SOLVAY FRN V.20-UND.	BE6324000858		EUR	1.000.000	-	-	% 92,407	924.067,90	1,57

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
2,8750 % DT.LUFTHANSA MTN V.21-27	XS2408458730		EUR	1.000.000	-	-	% 90,807	908.071,40	1,54
2,8750 % IPSOS V.18-25	FR0013367174		EUR	1.000.000	-	-	% 96,050	960.500,00	1,63
2,8750 % RYANAIR MTN V.20-25	XS2228260043		EUR	300.000	-	-	% 97,642	292.926,72	0,50
2,8750 % THYSSENKRUPP MTN V.19-24	DE000A2TEDB8		EUR	600.000	-	-	% 98,900	593.400,00	1,01
2,8850 % BARCLAYS FRN V.22-27 MTN	XS2487667276		EUR	833.000	-	-	% 95,937	799.152,71	1,36
3,0000 % TELEFÓNICA EUR. FRN V.18-UND.	XS1795406575		EUR	200.000	-	-	% 99,070	198.140,00	0,34
3,2500 % ENGIE FRN V.19-UND.	FR0013398229		EUR	900.000	-	-	% 96,954	872.581,50	1,48
3,2500 % HORNBACH BAUMARKT V.19-26	DE000A255DH9		EUR	1.300.000	-	1.500.000	% 95,144	1.236.872,00	2,10
3,2500 % SWISS LIFE FIN.I V.22-29	CH1210198136		EUR	400.000	400.000	-	% 93,854	375.416,00	0,64
3,3750 % ENEL FRN V.18-81	XS1713463559		EUR	600.000	-	-	% 92,436	554.613,78	0,94
3,3750 % INDONESIAIEN MTN V.15-25	XS1268430201		EUR	500.000	-	-	% 98,270	491.350,00	0,84
3,8750 % BFCM MTN V.23-28	FR001400FBN9		EUR	1.000.000	-	-	% 97,447	974.471,00	1,66
3,8750 % BOUYGUES V.23-31	FR001400IBM5		EUR	200.000	200.000	-	% 97,268	194.536,74	0,33
3,8750 % DT.BÖRSE V.23-33	DE000A351ZT4		EUR	700.000	700.000	-	% 98,300	688.100,00	1,17
3,8750 % KPN MTN V.23-31	XS2638080452		EUR	300.000	300.000	-	% 96,627	289.882,29	0,49
3,8750 % RABOBK FRN V.22-32 MTN	XS2524143554		EUR	900.000	900.000	-	% 94,591	851.318,64	1,45
3,9500 % AT&T V.23-31	XS2590758665		EUR	300.000	300.000	-	% 96,090	288.268,68	0,49
3,9500 % GRENKE FIN. MTN V.20-25	XS2155486942		EUR	600.000	-	-	% 96,140	576.840,00	0,98
4,1250 % SANTANDER C.F. MTN V.23-28	XS2618690981		EUR	400.000	400.000	-	% 99,010	396.039,40	0,67
4,3750 % BNP PARIBAS FRN V.23-29 MTN	FR001400DCZ6		EUR	600.000	200.000	-	% 99,175	595.050,96	1,01
4,4670 % ZÜRCHER KANTONALBK. FRN 23-27	CH1290222392		EUR	900.000	900.000	-	% 99,880	898.920,00	1,53
4,4770 % ORIX MTN V.23-28	XS2583644146		EUR	900.000	-	-	% 100,539	904.848,03	1,54
4,5000 % BILFINGER V.19-24	DE000A2YNQW7		EUR	1.500.000	-	-	% 99,340	1.490.100,00	2,53
4,5000 % FORTUM MTN V.23-33	XS2606261597		EUR	700.000	700.000	-	% 97,723	684.057,71	1,16
4,6250 % AIB GR. FRN V.23-29 MTN	XS2578472339		EUR	400.000	-	-	% 98,397	393.586,00	0,67
4,7500 % DANSKE BK. FRN V.23-30 MTN	XS2637421848		EUR	1.000.000	1.000.000	-	% 99,429	994.286,00	1,69
4,7500 % UBS GR. FRN V.23-32 MTN	CH1255915014		EUR	500.000	300.000	-	% 97,338	486.690,60	0,83
4,8750 % 3I GR. MTN V.23-29	XS2626289222		EUR	300.000	300.000	-	% 97,282	291.845,40	0,50
5,0000 % CAIXABK. FRN V.23-29 MTN	XS2649712689		EUR	200.000	200.000	-	% 99,605	199.210,28	0,34
5,3750 % DT.BK. FRN V.23-29 MTN	DE000A30V5C3		EUR	500.000	-	-	% 99,615	498.074,20	0,85
5,4250 % SOLVAY FIN. FRN V.13-UND.	XS0992293901		EUR	500.000	-	-	% 99,330	496.650,00	0,84
5,5000 % NEXANS V.23-28	FR001400H0F5		EUR	600.000	300.000	-	% 101,621	609.725,34	1,04
5,6250 % PKO BK.POL. FRN V.23-26 MTN	XS2582358789		EUR	100.000	-	-	% 100,052	100.051,88	0,17
5,7370 % CESKÁ SPORITELNA 23-28 MTN	FRN XS2676413235		EUR	300.000	300.000	-	% 100,250	300.750,00	0,51
5,9430 % CESKÁ SPORITELNA 23-27 MTN	FRN XS2638560156		EUR	700.000	700.000	-	% 100,884	706.189,19	1,20

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								<b>9.220.559,21</b>	<b>15,69</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Euro</b>								<b>7.522.113,74</b>	<b>12,80</b>
0,8750 % LYB INT.FIN.II V.19-26	XS2052310054		EUR	600.000	-	-	% 90,087	540.524,70	0,92
0,9500 % DT.BAHN FIN. FRN V.19-UND.	XS2010039035		EUR	500.000	-	1.000.000	%	462.305,00	0,79
1,6000 % DT.BAHN FIN. FRN V.19-UND.	XS2010039548		EUR	2.300.000	1.100.000	-	% 78,933	1.815.461,30	3,09
1,6250 % ENGIE FRN V.19-UND.	FR0013431244		EUR	900.000	500.000	-	% 93,079	837.714,42	1,43
2,8750 % AT&T FRN V.20-UND.	XS2114413565		EUR	1.700.000	-	-	% 92,390	1.570.630,00	2,67
3,0000 % INDRA SISTEMAS V.18-24	XS1809245829		EUR	300.000	-	-	% 97,700	293.100,00	0,50
3,7500 % METROP.L.GL.FD.I MTN V.22-30	XS2561748711		EUR	225.000	-	-	% 96,561	217.262,59	0,37
3,8750 % CARGILL V.23-30	XS2610788569		EUR	300.000	300.000	-	% 98,096	294.287,28	0,50
4,0000 % METROP.L.GL.FD.I MTN V.23-28	XS2606297864		EUR	600.000	-	-	% 99,555	597.328,44	1,02
4,3750 % EDP SERV.FIN.ES MTN V.23-32	XS2699159351		EUR	200.000	200.000	-	% 99,470	198.940,00	0,34
4,4920 % SUMI.MITSUI FIN. FRN 23-25 MTN	XS2629485447		EUR	300.000	300.000	-	% 99,272	297.816,30	0,51
4,5000 % NASDAQ V.23-32	XS2643673952		EUR	100.000	100.000	-	% 98,862	98.861,71	0,17
4,8750 % WIENERBERGER V.23-28	AT0000A37249		EUR	300.000	300.000	-	% 99,294	297.882,00	0,51
<b>US-Dollar</b>								<b>1.698.445,47</b>	<b>2,89</b>
1,1250 % USA TREA. V.21-28	US91282CCV19		USD	1.570.000	1.570.000	-	% 84,703	1.256.046,41	2,14
3,5000 % HOLCIM FIN.US V.16-26	US50587KAA97		USD	500.000	-	-	% 93,678	442.399,06	0,75
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>58.673.980,61</b>	<b>99,82</b>
<b>Derivate</b>								<b>-15.761,35</b>	<b>-0,03</b>
<b>Zins-Derivate</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>-15.761,35</b>	<b>-0,03</b>
EURO-SCHATZ-FUTURE 071223		EUREX	STK	2.500.000			EUR	-7.125,00	-0,01
2-YEAR US TREAS.NO.FUT. 12/23		CBOT	STK	2.000.000			USD	-8.636,35	-0,01
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>0,02</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>								<b>0,02</b>	<b>0,00</b>
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
HSBC CONTINENTAL EUROPE S.A., GERMANY			NOK	0,21			% 100,000	0,02	0,00
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>1.243.405,18</b>	<b>2,12</b>
ZINSANSPRÜCHE			EUR	715.673,78				715.673,78	1,22
GELEISTETE INITIAL MARGINS			EUR	11.948,05				11.948,05	0,02
SONSTIGE FORDERUNGEN			EUR	5,16				5,16	0,00
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	500.016,84				500.016,84	0,85
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	15.761,35				15.761,35	0,03
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>								<b>-598.184,11</b>	<b>-1,02</b>
<b>EUR - Kredite</b>									
HSBC CONTINENTAL EUROPE S.A., GERMANY			EUR	-592.574,31			100,000	-592.574,31	-1,01

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.09.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
HSBC CONTINENTAL EUROPE S.A., GERMANY			USD	-5.939,38			100,000	-5.609,80	-0,01
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-521.297,40</b>	<b>-0,89</b>
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-493.416,04				-493.416,04	-0,84
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-27.881,36				-27.881,36	-0,05
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>		<b>58.782.142,95</b>	<b>100,00*</b>

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

### SALytic Bond Opportunities I

ISIN	DE000A1JSW30
Fondsvermögen (EUR)	58.782.142,95
Anteilwert (EUR)	45,42
Umlaufende Anteile (STK)	1.294.176,00

## ■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 29.09.2023 oder letztbekannte.

### Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.09.2023

Norwegische Kronen	(NOK)	11,26600 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,05875 = 1 (EUR)

## ■ Marktschlüssel

### b) Terminbörsen

CBOT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
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 (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

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

### Börsengehandelte Wertpapiere

#### Verzinsliche Wertpapiere

##### Euro

0,0000 % LANXESS FRN V.16-76	XS1405763019	EUR	-	500.000
0,0000 % ORSTED FRN V.13-3013	XS0943370543	EUR	-	218.000
0,1250 % EFSF MTN V.22-30	EU000A1G0EP6	EUR	-	600.000
1,0000 % ESM MTN V.22-27	EU000A1Z99Q7	EUR	-	400.000
1,8750 % CARREFOUR MTN V.22-26	FR0014009DZ6	EUR	-	200.000
2,6250 % INDONESIAEN MTN V.16-23	XS1432493879	EUR	-	800.000
3,0000 % MTU AERO ENG. V.20-25	XS2197673747	EUR	-	500.000

##### Zloty

3,0000 % EIB MTN V.17-24	XS1622379698	PLN	-	770.000
--------------------------	--------------	-----	---	---------

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

#### Verzinsliche Wertpapiere

##### Euro

1,6250 % JAB HOLD. V.15-25	DE000A1Z0TA4	EUR	-	700.000
2,5000 % JAB HOLD. V.20-27	DE000A28V301	EUR	-	400.000

##### US-Dollar

1,5000 % USA TREA. V.16-26	US9128282A70	USD	-	1.462.000
----------------------------	--------------	-----	---	-----------

## ■ Während des Berichtszeitraums 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

#### Zinsterminkontrakte

**Gekaufte Kontrakte** **EUR** **4.477**

Basiswerte: (2-YEAR US TREAS.NO.FUT. 09/23, EURO-SCHATZ-FUTURE 070923)

## ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen</b>	<b>99,82 %</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen</b>	<b>-0,03 %</b>

### Sonstige Angaben

#### SALytic Bond Opportunities I

ISIN	DE000A1JSW30
Fondsvermögen (EUR)	58.782.142,95
Anteilwert (EUR)	45,42
Umlaufende Anteile (STK)	1.294.176,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,00%, derzeit 0,55%
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 gleichtäglich).

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.

