

HALBJAHRESBERICHT FSI SOLID INVEST - AKTIEN MANDAT VV

Ein OGAW deutschen Rechts
zum 30.06.2020

INHALTSVERZEICHNIS

VERMÖGENSÜBERSICHT	3
VERMÖGENSAUFSTELLUNG	4
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	9

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		10.220.285,08	100,34
1. Aktien		8.843.272,70	86,82
- Deutschland	EUR	1.754.299,01	17,22
- Euro-Länder	EUR	768.455,85	7,54
- Sonstige EU/EWR-Länder	EUR	415.717,37	4,08
- Nicht EU/EWR-Länder	EUR	5.904.800,47	57,97
2. Investmentanteile		431.792,10	4,24
- Indexfonds	EUR	431.792,10	4,24
3. Derivate		358.095,00	3,52
- Optionsrechte (Kauf)	EUR	358.095,00	3,52
4. Bankguthaben		581.975,65	5,71
- Bankguthaben in EUR	EUR	581.915,09	5,71
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	60,56	0,00
5. Sonstige Vermögensgegenstände		5.149,63	0,05
II. Verbindlichkeiten		-34.467,52	-0,34
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-34.467,52	-0,34
III. Fondsvermögen	EUR	10.185.817,56	100,00¹⁾

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	8.122.119,66	79,74
Aktien							EUR	6.822.357,59	66,98
DE0008404005	Allianz SE		STK	1.443	893	0	EUR 181,7600	262.279,68	2,57
DE0005190003	BMW AG		STK	5.008	416	0	EUR 56,8200	284.554,56	2,79
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	19.446	0	0	EUR 3,9670	77.142,28	0,76
DE0007100000	Daimler AG		STK	8.652	2.195	0	EUR 36,1450	312.726,54	3,07
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	19.008	0	0	EUR 8,4640	160.883,71	1,58
DE000A2NB601	JENOPTIK AG		STK	13.237	3.660	0	EUR 20,8400	275.859,08	2,71
DE0008430026	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft AG		STK	1.216	1.216	0	EUR 231,4000	281.382,40	2,76
DE0007500001	ThyssenKrupp AG		STK	15.754	8.495	0	EUR 6,3140	99.470,76	0,98
US0138721065	Alcoa Corp.		STK	17.415	12.257	0	USD 11,2400	174.281,80	1,71
US0378331005	Apple Inc.		STK	1.747	1.747	1.575	USD 364,8000	567.426,97	5,57
US00206R1023	AT & T Inc.		STK	8.072	476	0	USD 30,2300	217.260,88	2,13
CA0641491075	Bank of Nova Scotia		STK	6.177	6.177	0	USD 41,2400	226.808,07	2,23
VGG1890L1076	Capri Holdings Ltd.		STK	30.870	21.798	0	USD 15,6300	429.593,64	4,22
US1667641005	Chevron Corp.		STK	2.832	1.517	0	USD 89,2300	224.991,64	2,21
US20030N1019	Comcast Corp. New A		STK	8.579	789	0	USD 38,9800	297.742,44	2,92
US30231G1022	Exxon Mobil Corp.		STK	5.934	4.012	0	USD 44,7200	236.271,63	2,32
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.V.		STK	35.867	8.200	0	USD 10,2400	327.007,15	3,21
US3696041033	General Electric Co.		STK	19.579	0	0	USD 6,8300	119.062,08	1,17
US4062161017	Halliburton Co.		STK	10.025	6.322	0	USD 12,9800	115.856,74	1,14
US4581401001	Intel Corp.		STK	7.480	0	0	USD 59,8300	398.458,26	3,91
US5951121038	Micron Technologies Inc.		STK	8.652	324	0	USD 51,5200	396.875,79	3,90
US5949181045	Microsoft Corp.		STK	2.891	2.891	2.347	USD 203,5100	523.836,90	5,14
US7185461040	Phillips 66		STK	4.525	2.225	0	USD 71,9000	289.674,13	2,84
US7475251036	Qualcomm Inc.		STK	3.414	0	0	USD 91,2100	277.247,87	2,72
AN8068571086	Schlumberger N.V.		STK	11.872	5.697	0	USD 18,3900	194.387,29	1,91
IL0011267213	Stratasys Ltd		STK	3.250	1.419	0	USD 15,8600	45.893,25	0,45
US9297401088	Westinghouse Air BrakeTechnologies Corp.		STK	105	0	0	USD 57,5700	5.382,05	0,05
Andere Wertpapiere							EUR	1.299.762,07	12,76
US01609W1027	Alibaba Group Holding Ltd. Sp.ADRs		STK	2.310	230	0	EUR 191,6000	442.596,00	4,35
US03524A1088	Anheuser-Busch Inbev Adr		STK	5.939	2.160	0	USD 49,3000	260.688,87	2,56
US6549022043	Nokia Corp. Sp.ADRs		STK	46.141	0	0	USD 4,4000	180.759,83	1,77
US7672041008	Rio Tinto PLC Sp.ADRs		STK	4.225	1.455	0	USD 56,1800	211.334,64	2,07
US7802591070	Royal Dutch Shell B Spons. ADRs		STK	7.310	4.436	0	USD 30,4500	198.183,23	1,95
US7802592060	Royal Dutch Shell Sp.ADRs		STK	213	0	0	USD 32,6900	6.199,50	0,06

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	721.153,04	7,08
Aktien							EUR	721.153,04	7,08
US1280302027	Cal-Maine Foods Inc.	STK		2.871	0	0 USD	44,4800	113.699,93	1,12
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc.	STK		5.336	550	0 USD	127,8600	607.453,11	5,96
Investmentanteile							EUR	431.792,10	4,24
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	431.792,10	4,24
DE0006289473	iShares eb.rexx Gov. Germany 1.5-2.5yr ETF (DE)	ANT		5.130	8.480	5.130 EUR	84,1700	431.792,10	4,24
Summe Wertpapiervermögen							EUR	9.275.064,80	91,06
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							EUR	358.095,00	3,52
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	98.575,00	0,97
Wertpapier-Optionsrechte							EUR	98.575,00	0,97
Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	98.575,00	0,97
Optionsrechte auf Aktien							EUR	98.575,00	0,97
CALL Bayerische Motoren Werke AG 64,00 12/20		EDT	STK Anzahl	4.600		EUR	2,8500	13.110,00	0,13
CALL Commerzbank AG 6,00 12/20		EDT	STK Anzahl	50.000		EUR	0,1000	5.000,00	0,05
CALL Daimler AG 46,00 12/20		EDT	STK Anzahl	6.500		EUR	1,1100	7.215,00	0,07
CALL Deutsche Bank AG 10,00 12/20		EDT	STK Anzahl	62.500		EUR	0,5800	36.250,00	0,36
CALL E.ON SE 10,00 12/20		EDT	STK Anzahl	50.000		EUR	0,7400	37.000,00	0,36
Optionsrechte							EUR	259.520,00	2,55
Optionsrechte auf Aktienindices							EUR	259.520,00	2,55
CALL DAX Index 13000,00 09/20		EDT	STK Anzahl	800		EUR	324,4000	259.520,00	2,55

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Verkäufe / Zugänge Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben						EUR	581.975,65	5,71
EUR - Guthaben bei:						EUR	581.915,09	5,71
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	581.915,09	%	100,0000	581.915,09	5,71
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR	60,56	0,00
			USD	68,02	%	100,0000	60,56	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	5.149,63	0,05
Dividendenansprüche						EUR	4.712,59	0,05
			EUR	4.712,59			4.712,59	0,05
Quellensteueransprüche						EUR	437,04	0,00
			EUR	437,04			437,04	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-34.467,52	-0,34
Kostenabgrenzung						EUR	-34.467,52	-0,34
			EUR	-34.467,52			-34.467,52	-0,34
Fondsvermögen						EUR	10.185.817,56	100,00²⁾
Anteilwert FSI Solid Invest - Aktien Mandat VV						EUR	55,990	
Umlaufende Anteile FSI Solid Invest - Aktien Mandat VV						STK	181.912,000	

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2020		
US-Dollar	(USD)	1,123150	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörse

EDT	EUREX
-----	-------

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
------	---------------------	---	--------------------	-----------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Zertifikate

DE000A0S9GB0	Deutsche Börse Commodities Xetra-Gold IHS 29.12.49	STK	0	15.098
--------------	--	-----	---	--------

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			289
CALL DAX Index 12000,00				
CALL DAX Index 13000,00)				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			73
PUT DAX Index 13000,00)				

Sondervermögen FSI Solid Invest - Aktien Mandat VV

Mindestanlagesumme	keine
Fondsaufgabe	02.01.2015
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%; derzeit 5,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 2,25%; derzeit 2,05%
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Währung	Euro
ISIN	DE000A1XDZT9

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

Sonstige Angaben

Anteilwert FSI Solid Invest - Aktien Mandat VV	EUR	55,990
Umlaufende Anteile FSI Solid Invest - Aktien Mandat VV	STK	181.912,000

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der Société Générale Securities Services GmbH mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses bei der Société Générale Securities Services GmbH einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand einer weiteren unabhängigen Modellierung verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Für die im Sondervermögen FSI Solid Invest - Aktien Mandat VV zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

91,06% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse

0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (u.a. anhand der Quelle Interactive Data, indikativer Quotes bzw. Bewertungsmodellen).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder - sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist - auf Basis von Börsenkursen. Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Unterföhring bei München, Juli 2020
Soci t  G n rale Securities Services GmbH
Die Gesch ftsf hrung