

HALBJAHRESBERICHT FSI SOLID INVEST - AKTIEN MANDAT VV

OGAW-Sondervermögen nach deutschem Recht

zum 30.06.2019

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2019

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien			
– Deutschland	EUR	1.601.202,45	19,36
– Euro-Länder	EUR	832.458,42	10,07
– Sonstige EU/EWR-Länder	EUR	329.714,15	3,99
– Nicht EU/EWR-Länder	EUR	3.882.699,35	46,94
2. Zertifikate			
– Deutschland	EUR	602.229,02	7,28
3. Investmentanteile			
– Indexfonds	EUR	152.902,00	1,85
4. Derivate			
– Optionsrechte (Kauf)	EUR	197.355,00	2,39
5. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	673.736,68	8,15
– Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	69,56	0,00
– Tages-/Termingelder in EUR	EUR	250.000,00	3,02
6. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	3.640,28	0,04
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-255.656,28	-3,09
III. Fondsvermögen		EUR	8.270.350,63
			100,00¹

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	6.818.383,88	82,44
Aktien								
DE0008404005	Allianz SE	STK	550	0	0	EUR 212,0000	116.600,00	1,41
DE0005190003	BMW AG	STK	4.592	1.205	0	EUR 65,0900	298.893,28	3,61
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK	19.446	0	0	EUR 6,3190	122.879,27	1,49
DE0007100000	Daimler AG	STK	6.457	1.587	0	EUR 48,9250	315.908,73	3,82
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK	19.008	0	0	EUR 6,7800	128.874,24	1,56
DE000A2NB601	JENOPTIK AG	STK	9.577	9.577	0	EUR 28,4500	272.465,65	3,29
DE0008430026	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft AG	STK	616	0	0	EUR 220,7000	135.951,20	1,64
DE0007164600	SAP SE	STK	965	0	0	EUR 120,7600	116.533,40	1,41
DE0007500001	ThyssenKrupp AG	STK	7.259	0	0	EUR 12,8250	93.096,68	1,13
US0138721065	Alcoa Corp.	STK	2.579	0	0	USD 23,4100	53.015,80	0,64
US0378331005	Apple Inc.	STK	1.575	0	0	USD 197,9200	273.730,24	3,31
US00206R1023	AT & T Inc.	STK	7.596	0	0	USD 33,5100	223.517,70	2,70
VGG1890L1076	Capri Holdings Ltd.	STK	9.072	9.072	0	USD 34,6800	276.270,60	3,34
US1667641005	Chevron Corp.	STK	1.315	0	0	USD 124,4400	143.693,89	1,74
US20030N1019	Comcast Corp. New A	STK	7.790	0	0	USD 42,2800	289.217,77	3,50
US30231G1022	Exxon Mobil Corp.	STK	1.922	0	0	USD 76,6300	129.331,63	1,56
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	STK	27.667	6.362	0	USD 13,8200	335.755,13	4,06
US3696041033	General Electric Co.	STK	19.579	19.579	19.579	USD 10,5000	180.522,92	2,18
US4062161017	Halliburton Co.	STK	3.703	0	0	USD 22,7400	73.942,94	0,89
US4581401001	Intel Corp.	STK	7.480	1.850	0	USD 47,8700	314.425,36	3,80
US5951121038	Micron Technologies Inc.	STK	8.328	0	0	USD 38,5900	282.207,17	3,41
US5949181045	Microsoft Corp.	STK	2.347	0	0	USD 133,9600	276.083,70	3,34
US7185461040	Phillips 66	STK	2.300	0	0	USD 93,5400	188.919,92	2,28
US7475251036	Qualcomm Inc.	STK	3.414	0	0	USD 76,0700	228.049,68	2,76
AN8068571086	Schlumberger N.V.	STK	6.175	2.358	0	USD 39,7400	215.485,16	2,61
IL0011267213	Stratasy Ltd	STK	1.831	0	0	USD 29,3700	47.222,05	0,57
US9297401088	WABTEC Corp.	STK	105	105	0	USD 71,7600	6.616,44	0,08
US9581021055	Western Digital Corp.	STK	6.000	0	0	USD 47,5500	250.526,87	3,03
Zertifikate								
DE000A0S9GB0	Deutsche Börse Commodities Xetra-Gold IHS 29.12.49	STK	15.098	0	0	EUR 39,8880	602.229,02	7,28
Andere Wertpapiere								
US03524A1088	Anheuser-Busch Inbev Adr	STK	3.779	0	0	USD 88,5100	293.712,06	3,55
US6549022043	Nokia Corp. Sp.ADRs	STK	46.141	0	0	USD 5,0100	202.991,23	2,45
US7672041008	Rio Tinto PLC Sp.ADRs	STK	2.770	0	0	USD 62,3400	151.634,88	1,83
US7802591070	Royal Dutch Shell B Spons. ADRs	STK	2.874	0	0	USD 65,7400	165.908,64	2,01
US7802592060	Royal Dutch Shell Sp.ADRs	STK	213	0	0	USD 65,0700	12.170,63	0,15
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	429.919,51	5,20
Aktien								
US1280302027	Cal-Maine Foods Inc.	STK	2.871	0	0	USD 41,7200	105.179,24	1,27
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc.	STK	4.786	1.201	0	USD 77,2700	324.740,27	3,93
Investmentanteile						EUR	152.902,00	1,85
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								
DE0006289473	iShares eb.rexx Gov. Germany 1.5-2.5yr ETF (DE)	ANT	1.780	0	0	EUR 85,9000	152.902,00	1,85
Summe Wertpapiervermögen						EUR	7.401.205,39	89,49

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
Derivate auf einzelne Wertpapiere						EUR	7.035,00	0,09
Wertpapier-Optionsrechte								
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Optionsrechte auf Aktien								
CALL Commerzbank 10,00 12/19	EDT	STK	50.000			EUR 0,0300	1.500,00	0,02
CALL Deutsche Bank 10,00 12/19	EDT	STK	42.500			EUR 0,0500	2.125,00	0,03
CALL E.ON SE 10,00 12/19	EDT	STK	11.000			EUR 0,3100	3.410,00	0,04
Aktienindex-Derivate						EUR	190.320,00	2,30
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Optionsrechte auf Aktienindices								
CALL DAX Index 12000,00 09/19	EDT	STK	Anzahl 325			EUR 585,6000	190.320,00	2,30
Bankguthaben						EUR	923.806,24	11,17
EUR-Guthaben bei:								
Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	673.736,68			% 100,0000	673.736,68	8,15
Guthaben Tagesgeld (bei anderen Kreditinstituten)		EUR	250.000,00			% 100,0000	250.000,00	3,02
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)		USD	79,21			% 100,0000	69,56	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	3.640,28	0,04
Dividendenansprüche		EUR	3.640,28				3.640,28	0,04
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-255.656,28	-3,09
Kostenabgrenzung		EUR	-255.549,34				-255.549,34	-3,09
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben		EUR	-106,94				-106,94	0,00
Fondsvermögen						EUR	8.270.350,63	100,00²
Anteilwert FSI Solid Invest – Aktien Mandat VV						EUR	59,45	
Umlaufende Anteile FSI Solid Invest – Aktien Mandat VV						STK	139.123	

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2019		
US-Dollar	(USD)	1,138800	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörse

EDT EUREX Terminbörse Deutschland

Während des Berichtszeitraumes 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				
Aktien				
DE000ENAG999	E.ON SE	STK	0	10.607
CA0679011084	Barrick Gold Corp.	STK	0	25.752

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			43
Dax (Performanceindex))				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			74
Dax (Performanceindex))				

Sondervermögen FSI Solid Invest – Aktien Mandat VV

Mindestanlagesumme	keine
Fondsauflage	02.01.2015
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%; derzeit 5,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	bis zu 2,25%, mindestens 25.000,00 EUR; derzeit 2,05%, mindestens 25.000,00 EUR
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	thesaurierend
Währung	EUR
ISIN	DE000A1XDZT9

ANHANG GEM. §7 NR. 9 KARBV

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

Anteilwert FSI Solid Invest – Aktien Mandat VV	EUR	59,45
Umlaufende Anteile FSI Solid Invest – Aktien Mandat VV	STK	139.123

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:

89,49% 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.
