

# Vermögensstrategie FT Halbjahresbericht

**31.12.2015**

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	8.294.554,99	100,13
1. Investmentfonds	7.054.021,12	85,15
2. Derivate	-178,70	0,00
Devisentermingeschäfte	-178,70	0,00
3. Bankguthaben	1.240.712,57	14,98
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	-10.577,61	-0,13
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-303,96	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten	-10.273,65	-0,13
<b>III. Fondsvermögen</b>	8.283.977,38	100,00

## Vermögensaufstellung

31.12.2015

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2015	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
<b>Investmentfonds</b>						<b>7.054.021,12</b>	<b>85,15</b>
<b>Indexfonds</b>						<b>7.054.021,12</b>	<b>85,15</b>
<b>Gruppenfremde Indexfonds</b>						<b>7.054.021,12</b>	<b>85,15</b>
C.S.-iBOXX EO L.S.D.O.TR U.ETF I LU0444605645	Anteile	2.124	2.124	0	155,2510 EUR	329.753,12	3,98
db x-trackers II-IBo.So.Eu.Z.U.ETF 1C LU0290355717	Anteile	5.711	2.670	248	222,6090 EUR	1.271.320,00	15,35
db x-trackers II-IBoxX EO Sov.E.7-10 1C LU0290357259	Anteile	4.038	3.864	4.059	246,5900 EUR	995.730,42	12,02
db x-trackers II-IBoxx S.Eu.5-7 ETF 1C LU0290357176	Anteile	6.035	1.956	245	228,7600 EUR	1.380.566,60	16,66
db x-trackers II-IBoxx S.EUR 1-3 ETF 1C LU0290356871	Anteile	4.847	5.624	8.243	169,6800 EUR	822.438,96	9,93
Source-S.GS Equ.Fact.Idx World A (Dt. Zert.) DE000A1XES75	Anteile	14.752	3.803	0	114,6224 USD	1.545.862,08	18,66
SPDR MSCI ACWI UCITS ETF IE00B44Z5B48	Anteile	8.033	255	8.763	96,4539 USD	708.349,94	8,55
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>						<b>7.054.021,12</b>	<b>85,15</b>

## Vermögensstrategie FT

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.12.2015	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge				
<b>Derivate</b>								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen								
handelt es sich um verkaufte Positionen.								
<b>Devisen-Derivate</b>						<b>-178,70</b>	<b>0,00</b>	
Forderungen/Verbindlichkeiten								
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>						<b>-178,70</b>	<b>0,00</b>	
EUR US-Dollar 16.03.16	EUR	-370.000				-178,70	0,00	
<b>Bankguthaben</b>						<b>1.240.712,57</b>	<b>14,98</b>	
Bankguthaben	EUR	959.292,59				959.292,59	11,58	
Bankguthaben	AUD	0,04				0,03	0,00	
Bankguthaben	JPY	5.524.435,00				41.933,29	0,51	
Bankguthaben	USD	261.957,69				239.486,66	2,89	
<b>Verbindlichkeiten</b>						<b>-10.577,61</b>	<b>-0,13</b>	
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>						<b>-303,96</b>	<b>0,00</b>	
Bankguthaben	GBP	-224,27				-303,96	0,00	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>-10.273,65</b>	<b>-0,13</b>	
Verwahrstellenvergütung	EUR	-1.666,66				-1.666,66	-0,02	
Verwaltungsvergütung	EUR	-3.138,99				-3.138,99	-0,04	
Prüfungskosten	EUR	-3.000,00				-3.000,00	-0,04	
Veröffentlichungskosten	EUR	-2.468,00				-2.468,00	-0,03	
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>8.283.977,38</b>	<b>100,00*</b>
Anteilwert					EUR	55,41		
Umlaufende Anteile					Stück	149,495		

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

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
		im Berichtszeitraum	
<b>Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:</b>			
<b>Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)</b>			
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>			
2,250% United States of America DL-Notes 2014(24) US912828G385	USD	0	181.900
<b>Zertifikate</b>			
DB ETC P GOLD EUR H60 DE000A1EK0G3	Stück	1.958	1.958
<b>Investmentfonds</b>			
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>			
ComS.-S.E.600Food+Bev.NR U.ETF I LU0378435803	Anteile	746	746
ComSt.-STX Eu.600 P+HG N.U.ETF I LU0378436520	Anteile	591	591
db x-t.MSCI EM Energy ldx. ETF 1C-USD LU0592216633	Anteile	0	19.359
db x-trackers MSCI USA Index ETF 1C LU0274210672	Anteile	3.414	3.414
db x-trackers MSCI Eur.Ind.ETF DR 1C LU0274209237	Anteile	1.566	3.120
iShares MDAX UCITS ETF (DE) DE0005933923	Anteile	894	894
iShares TecDAX UCITS ETF (DE) DE0005933972	Anteile	10.452	10.452
iShares V MSCI JP EUR Hg. UCITS ETF B (Dt. Zert.) DE000A1H53P0	Anteile	1.673	3.435

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Lyxor ETF DJ ST. 600 Health C. FR0010344879	Anteile	1.815	1.815	
db x-trackers MSCI EM Asia Idx. ETF 1C LU0292107991	Anteile	4.879	4.879	
db x-tr.MSCI W.Utilities I.ETF 1C USD LU0540980652	Anteile	4.771	4.771	
db x-trackers MSCI Wld.Cons.Dis.I.ETF 1C USD LU0540979720	Anteile	3.898	7.721	
db x-trackers MSCI Wd.Tel.Svcs.I.ETF 1C USD LU0540980579	Anteile	8.079	8.079	
db x-trackers MSCI Wld.Cons.S.I.ETF 1C USD LU0540980066	Anteile	3.292	3.292	
db x-trackers MSCI Wld.Heal.C.I.ETF 1C USD LU0540980223	Anteile	0	3.341	
db x-trackers MSCI Wld.Inf.Tec.I.ETF 1C USD LU0540980496	Anteile	5.880	11.541	
Source-H.Care S+P US Sel.Sect. A IE00B3WMTH43	Anteile	591	591	
				<b>Volumen in 1.000</b>
<b>Umsätze in Derivaten</b>				
<b>(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte. Bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>				
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
<b>Gekaufte Kontrakte</b>	<b>EUR</b>			<b>3.139</b>
(Basiswert[e]: DAX Performance-Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR), Nikkei 225 Stock Average Index, MSCI Emerging Markets Index, Nasdaq-100 Index, Russell 2000 Index (Close - Official), S&P 500 Index, VSTOXX Volatilitätsindex)				
<b>Verkaufte Kontrakte</b>	<b>EUR</b>			<b>374</b>

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
<b>(Basiswert[e]: MSCI Emerging Markets Index)</b>				
<b>Rentenindex-Terminkontrakte</b>				
<b>Gekaufte Kontrakte</b>	<b>EUR</b>			<b>540</b>
<b>(Basiswert[e]: Euro-Bund-Future (8,5-10,5 Jahre) langfristig , Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures)</b>				
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>				
EUR - USD	EUR			2.299
<b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>				
EUR - USD	EUR			2.377
<b>Optionsrechte</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>				
<b>Optionsrechte auf Aktienindizes</b>				
<b>Gekaufte Kaufoption</b>	<b>EUR</b>			<b>22</b>
<b>(Basiswert[e]: DAX Performance-Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR))</b>				
<b>Gekaufte Verkaufsoption</b>	<b>EUR</b>			<b>2</b>
<b>(Basiswert[e]: ESTX 50 Index (Price) (EUR))</b>				

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	85,15
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	55,41
Umlaufende Anteile	Stück	149.495



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung mit nachstehenden Kursen/Marktsätzen bewertet:

Wertpapierart	Region	Bewertungsdatum	§27 Bewertung mit handelbaren Kursen	§28 Bewertung mit Bewertungsmodellen	§32 Besonderheiten bei der Bewertung unternehmerischer Beteiligungen	§29 Besonderheiten bei Investmentanteilen, Bankguthaben und Verbindlichkeiten
<b>Investmentanteile</b>						
	Europa	29.12.2015	85,15 %			
<b>Derivate - Devisentermingeschäfte</b>						
		30.12.2015	0,00 %			
<b>Übriges Vermögen</b>						
		30.12.2015				14,85 %
			<b>85,15 %</b>			<b>14,85 %</b>

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen.

Für Investmentanteile ist der Sitz der Kapitalverwaltungsgesellschaft für die Region und das Bewertungsdatum maßgebend.

Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Bewertung von börsengehandelten Vermögensgegenständen erfolgt mit entsprechend handelbaren Kursen. Sollten für diese Vermögensgegenstände keine handelbaren Kurse verfügbar sein, erfolgt die Bewertung auf Basis geeigneter Modelle. Bewertungseinheiten werden nicht gebildet.

Devisenkurse	per	30.12.2015	
Australische Dollar	(AUD)	1,500508	= 1 EUR
Britische Pfund	(GBP)	0,737831	= 1 EUR
Japanische Yen	(JPY)	131,743407	= 1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,093830	= 1 EUR
<b>Terminbörse</b>			
Over-the-Counter			

Frankfurt am Main, den 31. Dezember 2015

BNY Mellon Service  
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH  
Frankfurt am Main  
  
(Geschäftsführung)