

# Halbjahresbericht

## CSR Aktien Deutschland Plus

zum 30. Juni 2024

---

# Halbjahresbericht des CSR Aktien Deutschland Plus

ZUM 30. JUNI 2024

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7

## ■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>32.044.462,15</b>	<b>100,16</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>30.580.640,55</b>	<b>95,59</b>
Finanzwerte	7.517.919,39	23,50
Verbraucher-Dienstleistungen	4.700.227,83	14,69
Gesundheitswesen	4.596.507,61	14,37
Rohstoffe	3.336.146,54	10,43
Industriewerte	2.884.114,02	9,02
Technologie	2.762.734,65	8,64
Telekommunikation	1.510.632,76	4,72
Konsumgüter	1.158.080,55	3,62
Versorgungsunternehmen	951.380,16	2,97
Immobilien	674.290,35	2,11
Energiewerte	488.606,69	1,53
<b>2. Anleihen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>3. Derivate</b>	<b>-143.930,00</b>	<b>-0,45</b>
Aktienindex-Derivate	-143.930,00	-0,45
<b>4. Forderungen</b>	<b>68.611,45</b>	<b>0,21</b>
<b>5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>1.539.140,15</b>	<b>4,81</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-52.209,19</b>	<b>-0,16</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-52.209,19	-0,16
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>31.992.252,96</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 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>30.580.640,55</b>	<b>95,59</b>		
<b>Aktien</b>										
<b>Euro</b>							<b>30.580.640,55</b>	<b>95,59</b>		
ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0		STK	4.004	-	923	EUR 223,000	892.892,00	2,79	
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005		STK	4.150	-	810	EUR 259,500	1.076.925,00	3,37	
BEIERSDORF	DE0005200000		STK	8.481	5.990	3.105	EUR 136,550	1.158.080,55	3,62	
BMW	DE0005190003		STK	8.018	-	-	EUR 88,380	708.630,84	2,22	
BRENNTAG NAM.	DE000A1DAHH0		STK	12.954	-	1.428	EUR 62,960	815.583,84	2,55	
COBANK	DE000CBK1001		STK	81.771	21.264	28.553	EUR 14,185	1.159.921,64	3,63	
CONTINENTAL	DE0005439004		STK	9.271	-	-	EUR 52,900	490.435,90	1,53	
COVESTRO	DE0006062144		STK	16.918	-	-	EUR 54,800	927.106,40	2,90	
DEUTSCHE BK.	DE0005140008		STK	50.019	-	16.504	EUR 14,908	745.683,25	2,33	
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055		STK	7.582	-	3.331	EUR 191,100	1.448.920,20	4,53	
DT.POST NAM.	DE0005552004		STK	15.706	-	1.544	EUR 37,790	593.529,74	1,86	
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508		STK	64.337	8.837	10.565	EUR 23,480	1.510.632,76	4,72	
E.ON NAM.	DE000ENAG999		STK	77.632	-	15.199	EUR 12,255	951.380,16	2,97	
FRESENIUS	DE0005785604		STK	33.552	-	-	EUR 27,880	935.429,76	2,92	
HANNOVER RÜCK NAM.	DE0008402215		STK	6.369	-	1.000	EUR 236,700	1.507.542,30	4,71	
HEIDELBERG MAT.	DE0006047004		STK	7.090	-	1.600	EUR 96,820	686.453,80	2,15	
HENKEL VORZ.	DE0006048432		STK	16.988	-	2.565	EUR 83,220	1.413.741,36	4,42	
INFINEON TECHN. NAM.	DE0006231004		STK	13.621	-	1.768	EUR 34,305	467.268,41	1,46	
MERCEDES-BENZ GR. NAM.	DE0007100000		STK	12.088	3.441	2.988	EUR 64,570	780.522,16	2,44	
MERCK	DE0006599905		STK	6.412	-	1.669	EUR 154,750	992.257,00	3,10	
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026		STK	3.381	650	647	EUR 467,000	1.578.927,00	4,94	
QIAGEN NAM.	NL0015001WM6		STK	36.775	-	1	EUR 38,550	1.417.676,25	4,43	
SAP	DE0007164600		STK	12.112	2.684	1.949	EUR 189,520	2.295.466,24	7,18	
SARTORIUS VORZ.	DE0007165631		STK	1.734	-	766	EUR 219,000	379.746,00	1,19	
SIEMENS EN. NAM.	DE000ENER6Y0		STK	20.099	-	3.500	EUR 24,310	488.606,69	1,53	
SIEMENS HEALTHINEERS	DE000SHL1006		STK	16.197	9.444	-	EUR 53,800	871.398,60	2,72	
SIEMENS NAM.	DE0007236101		STK	9.234	457	250	EUR 173,720	1.604.130,48	5,01	
SYMRISE	DE000SYM9999		STK	13.941	-	1.200	EUR 114,300	1.593.456,30	4,98	
VONOVIA NAM.	DE000A1ML7J1		STK	25.397	-	5.700	EUR 26,550	674.290,35	2,11	
ZALANDO	DE000ZAL1111		STK	18.913	-	2.000	EUR 21,890	414.005,57	1,29	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>30.580.640,55</b>	<b>95,59</b>		
<b>Derivate</b>							<b>-143.930,00</b>	<b>-0,45</b>		
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>-67.500,00</b>	<b>-0,21</b>		
DAX FUTURE 200924		EUREX	STK	-45			EUR	-67.500,00	-0,21	
<b>Optionsrechte</b>							<b>-76.430,00</b>	<b>-0,24</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>										
C DAX 18200 190724		EUREX	STK	-20			EUR	301,400	-30.140,00	-0,09
C DAX 18300 190724		EUREX	STK	-20			EUR	241,500	-24.150,00	-0,08
P DAX 18200 190724		EUREX	STK	-20			EUR	221,400	-22.140,00	-0,07

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>1.539.140,15</b>	<b>4,81</b>
<b>Bankguthaben</b>								<b>1.539.140,15</b>	<b>4,81</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
<b>Verwahrstelle</b>									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	1.539.140,15			% 100,000	1.539.140,15	4,81
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>68.611,45</b>	<b>0,21</b>
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	1.111,45				1.111,45	0,00
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	67.500,00				67.500,00	0,21
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-52.209,19</b>	<b>-0,16</b>
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-39.361,45				-39.361,45	-0,12
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-12.847,74				-12.847,74	-0,04
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>		<b>31.992.252,96</b>	<b>100,00*</b>

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

CSR Aktien Deutschland Plus I	
ISIN	DE000A2P37Q2
Fondsvermögen (EUR)	29.936.423,77
Anteilwert (EUR)	1.109,88
Umlaufende Anteile (STK)	26.972,7620

CSR Aktien Deutschland Plus R	
ISIN	DE000A2P37R0
Fondsvermögen (EUR)	2.055.829,19
Anteilwert (EUR)	109,18
Umlaufende Anteile (STK)	18.829,0070

## ■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.06.2024 oder letztbekannte.

## ■ Marktschlüssel

### b) Terminbörsen

---

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 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

#### Aktienindex-Terminkontrakte

**Verkaufte Kontrakte** **EUR** **27.104**

Basiswerte: (DAX FUTURE 150324, DAX FUTURE 210624)

### Optionsrechte

#### Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

#### Optionsrechte auf Aktienindices

**Verkaufte Kaufoptionen (call)** **EUR** **9.110**

Basiswerte: (C DAX 16650 160224, C DAX 16900 150324, C DAX 17950 170524, C DAX 18000 190424, C DAX 18900 210624)

**Verkaufte Verkaufsoptionen (put)** **EUR** **17.415**

Basiswerte: (P DAX 16500 160224, P DAX 16600 160224, P DAX 16650 160224, P DAX 16750 190124, P DAX 16900 150324, P DAX 16950 160224, P DAX 17000 150324, P DAX 17950 170524, P DAX 18000 190424, P DAX 18150 170524)

## ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen</b>	<b>95,59 %</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen</b>	<b>-0,45 %</b>

### Sonstige Angaben

#### CSR Aktien Deutschland Plus I

ISIN	DE000A2P37Q2
Fondsvermögen (EUR)	29.936.423,77
Anteilwert (EUR)	1.109,88
Umlaufende Anteile (STK)	26.972,7620
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 1,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,835%, derzeit 0,485%
Mindestanlagesumme (EUR)	250.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

#### CSR Aktien Deutschland Plus R

ISIN	DE000A2P37R0
Fondsvermögen (EUR)	2.055.829,19
Anteilwert (EUR)	109,18
Umlaufende Anteile (STK)	18.829,0070
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 3,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,835%, derzeit 0,835%
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

### Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

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 gleichartig).

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.



