

Halbjahresbericht

CSR Aktien Deutschland Plus

zum 30. Juni 2023

Halbjahresbericht des CSR Aktien Deutschland Plus

ZUM 30. JUNI 2023

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	6
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	16.407.939,48	103,60
1. Aktien	15.716.840,99	99,24
Finanzwerte	3.685.889,49	23,27
Gesundheitswesen	2.795.567,83	17,65
Verbraucher-Dienstleistungen	2.569.857,61	16,23
Rohstoffe	1.811.940,80	11,44
Industriewerte	1.536.806,29	9,70
Technologie	1.124.612,13	7,10
Telekommunikation	611.984,74	3,86
Versorgungsunternehmen	573.861,76	3,62
Konsumgüter	440.501,25	2,78
Immobilien	408.274,43	2,58
Energiewerte	157.544,66	0,99
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	-56.055,50	-0,35
Aktienindex-Derivate	-56.055,50	-0,35
4. Forderungen	919.656,33	5,81
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	-172.502,34	-1,09
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-569.945,75	-3,60
Sonstige Verbindlichkeiten	-569.945,75	-3,60
III. Fondsvermögen	15.837.993,73	100,00^{*)}

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

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere							15.716.840,99	99,24	
Aktien									
Euro							15.716.840,99	99,24	
ADIDAS NAM.	DE000A1EWW0	STK	2.782	567	1.634	EUR	177,780	494.583,96	3,12
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	2.845	456	-	EUR	213,200	606.554,00	3,83
BEIERSDORF	DE0005200000	STK	3.633	3.633	-	EUR	121,250	440.501,25	2,78
BMW	DE0005190003	STK	3.602	912	1.292	EUR	112,520	405.297,04	2,56
BRENNTAG NAM.	DE000A1DAHH0	STK	8.560	2.607	839	EUR	71,400	611.184,00	3,86
COBANK	DE000CBK1001	STK	46.351	58.379	12.028	EUR	10,150	470.462,65	2,97
CONTINENTAL	DE0005439004	STK	4.848	-	-	EUR	69,100	334.996,80	2,12
COVESTRO	DE0006062144	STK	8.870	3.249	5.813	EUR	47,580	422.034,60	2,66
DEUTSCHE BK.	DE0005140008	STK	43.202	8.332	-	EUR	9,618	415.516,84	2,62
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055	STK	4.762	786	-	EUR	169,100	805.254,20	5,08
DT.POST NAM.	DE0005552004	STK	8.799	-	1.637	EUR	44,730	393.579,27	2,49
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508	STK	30.636	6.201	-	EUR	19,976	611.984,74	3,86
E.ON NAM.	DE000ENAG999	STK	49.132	5.316	19.702	EUR	11,680	573.861,76	3,62
FRESENIUS	DE0005785604	STK	20.527	20.527	-	EUR	25,370	520.769,99	3,29
HANNOVER RÜCK NAM.	DE0008402215	STK	4.036	1.171	-	EUR	194,350	784.396,60	4,95
HEIDELBERG MAT.	DE0006047004	STK	4.547	-	1.410	EUR	75,200	341.934,40	2,16
HENKEL VORZ.	DE0006048432	STK	8.944	1.326	1.023	EUR	73,260	655.237,44	4,14
INFINEON TECHN. NAM.	DE0006231004	STK	9.286	-	-	EUR	37,785	350.871,51	2,22
MERCEDES-BENZ GR. NAM.	DE0007100000	STK	5.599	2.839	2.761	EUR	73,670	412.478,33	2,60
MERCK	DE0006599905	STK	4.834	1.728	-	EUR	151,550	732.592,70	4,63
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	1.757	320	-	EUR	343,600	603.705,20	3,81
QIAGEN NAM.	NL0012169213	STK	18.037	17.854	14.471	EUR	41,140	742.042,18	4,69
SAP	DE0007164600	STK	6.183	1.152	1.138	EUR	125,140	773.740,62	4,89
SARTORIUS VORZ.	DE0007165631	STK	1.932	1.080	701	EUR	317,100	612.637,20	3,87
SIEMENS EN. NAM.	DE000ENER6Y0	STK	9.737	9.737	-	EUR	16,180	157.544,66	0,99
SIEMENS HEALTHINEERS	DE000SHL1006	STK	3.616	3.616	-	EUR	51,860	187.525,76	1,18
SIEMENS NAM.	DE0007236101	STK	5.253	3.382	2.534	EUR	152,540	801.292,62	5,06
SYMRISE	DE000SYM9999	STK	8.110	2.315	1.090	EUR	96,020	778.722,20	4,92
VONOVIA NAM.	DE000A1ML7J1	STK	22.815	13.581	8.638	EUR	17,895	408.274,43	2,58
ZALANDO	DE000ZAL1111	STK	10.139	3.619	1.474	EUR	26,360	267.264,04	1,69
Summe Wertpapiervermögen							15.716.840,99	99,24	
Derivate							-56.055,50	-0,35	
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte							-7.787,50	-0,05	
DAX FUTURE 150923		EUREX	STK	1		EUR		1.125,00	0,01
DAX FUTURE 150923		EUREX	STK	-27		EUR		-8.912,50	-0,06
Optionsrechte							-48.268,00	-0,30	
Optionsrechte auf Aktienindices									
C DAX 16000 210723		EUREX	STK	-11		EUR	283,100	-15.570,50	-0,10
C DAX 16200 210723		EUREX	STK	-11		EUR	153,200	-8.426,00	-0,05
C DAX 16300 210723		EUREX	STK	-11		EUR	104,800	-5.764,00	-0,04
C DAX 16350 210723		EUREX	STK	-11		EUR	85,100	-4.680,50	-0,03
P DAX 16350 210723		EUREX	STK	-11		EUR	251,400	-13.827,00	-0,09

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Sonstige Vermögensgegenstände								919.656,33	5,81
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	911.868,83				911.868,83	5,76
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	7.787,50				7.787,50	0,05
Kurzfristige Verbindlichkeiten								-172.502,34	-1,09
EUR - Kredite									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	-172.502,34			100,000	-172.502,34	-1,09
Sonstige Verbindlichkeiten								-569.945,75	-3,60
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-561.922,12				-561.922,12	-3,55
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-8.023,63				-8.023,63	-0,05
Fondsvermögen						EUR		15.837.993,73	100,00^{*)}

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

CSR Aktien Deutschland Plus I	
ISIN	DE000A2P37Q2
Fondsvermögen (EUR)	13.521.238,04
Anteilwert (EUR)	1.021,63
Umlaufende Anteile (STK)	13.235,0000

CSR Aktien Deutschland Plus R	
ISIN	DE000A2P37R0
Fondsvermögen (EUR)	2.316.755,69
Anteilwert (EUR)	101,01
Umlaufende Anteile (STK)	22.936,0070

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2023 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 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

Aktien

Euro

DR.ING.H.C.F.PORSCHE VORZ.	DE000PAG9113	STK	3.211	3.211
FRESENIUS MED.C.	DE0005785802	STK	-	19.029
PORSCHE VORZ.	DE000PAH0038	STK	1.680	6.854
PUMA	DE0006969603	STK	-	7.326
VW VORZ.	DE0007664039	STK	447	2.548

US-Dollar

LINDE	IE000S9YS762	STK	-	2.250
-------	--------------	-----	---	-------

■ 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** **21.289**

Basiswerte: (DAX FUTURE 03/23, DAX FUTURE 06/23, DAX FUTURE 150923)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Verkaufte Kaufoptionen (call) **EUR** **14.453**

Basiswerte: (C DAX 15700 160623, C DAX 15850 190523, C DAX 16000 160623, C DAX 16100 160623, C DAX 16200 160623, CALL DAX 14800 02/23, CALL DAX 14800 04/23, CALL DAX 14900 02/23, CALL DAX 14950 04/23, CALL DAX 15000 02/23, CALL DAX 15050 01/23, CALL DAX 15100 03/23, CALL DAX 15200 04/23, CALL DAX 15250 04/23, CALL DAX 15350 03/23, CALL DAX 15400 02/23, CALL DAX 15400 03/23, CALL DAX 15500 03/23)

Verkaufte Verkaufsoptionen (put) **EUR** **8.956**

Basiswerte: (P DAX 15600 210423, P DAX 15850 190523, P DAX 16000 160623, P DAX 16200 160623, PUT DAX 14800 02/23, PUT DAX 14800 04/23, PUT DAX 15100 03/23, PUT DAX 15250 04/23, PUT DAX 15350 02/23, PUT DAX 15400 02/23, PUT DAX 15400 03/23)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	99,24 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,35 %
Sonstige Angaben	

CSR Aktien Deutschland Plus I

ISIN	DE000A2P37Q2
Fondsvermögen (EUR)	13.521.238,04
Anteilwert (EUR)	1.021,63
Umlaufende Anteile (STK)	13.235,0000
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)	2.316.755,69
Anteilwert (EUR)	101,01
Umlaufende Anteile (STK)	22.936,0070
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

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 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.

