

Halbjahresbericht

CSR Ertrag Plus

zum 30. April 2024

Halbjahresbericht des CSR Ertrag Plus

ZUM 30. APRIL 2024

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

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	29.984.671,38	100,05
1. Aktien	8.822.906,61	29,44
Finanzwerte	2.157.274,72	7,20
Gesundheitswesen	1.358.282,41	4,53
Verbraucher-Dienstleistungen	1.352.727,21	4,51
Rohstoffe	940.079,30	3,14
Industriewerte	875.025,94	2,92
Technologie	629.779,70	2,10
Konsumgüter	476.745,60	1,59
Telekommunikation	411.082,21	1,37
Versorgungsunternehmen	309.082,40	1,03
Immobilien	193.630,32	0,65
Energiewerte	119.196,80	0,40
2. Anleihen	20.394.644,74	68,05
Gedekte Schuldverschreibungen	16.532.190,58	55,16
Finanzsektor	1.881.870,00	6,28
Staatlich garantierte Anlagen	1.459.584,16	4,87
Reise & Freizeit	375.000,00	1,25
Energiewerte	146.000,00	0,49
3. Derivate	-178.245,34	-0,59
Aktienindex-Derivate	2.024,66	0,01
Zins-Derivate	-180.270,00	-0,60
4. Forderungen	322.313,93	1,08
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	623.051,44	2,08
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-13.766,01	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten	-13.766,01	-0,05
III. Fondsvermögen	29.970.905,37	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 30.04.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								21.710.703,35	72,44
Aktien									
Euro								8.822.906,61	29,44
ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0	STK	1.130	1.130	-	553	EUR 226,400	255.832,00	0,85
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	1.288	1.288	-	350	EUR 266,600	343.380,80	1,15
BEIERSDORF	DE0005200000	STK	3.392	3.392	1.934	-	EUR 140,550	476.745,60	1,59
BMW	DE0005190003	STK	1.955	1.955	-	432	EUR 102,450	200.289,75	0,67
BRENNTAG NAM.	DE000A1DAHH0	STK	3.806	3.806	-	572	EUR 74,860	284.917,16	0,95
COBANK	DE000CBK1001	STK	23.865	23.865	4.892	7.419	EUR 13,960	333.155,40	1,11
CONTINENTAL	DE0005439004	STK	2.846	2.846	-	391	EUR 60,840	173.150,64	0,58
COVESTRO	DE0006062144	STK	4.943	4.943	-	-	EUR 46,980	232.222,14	0,77
DEUTSCHE BK.	DE0005140008	STK	14.577	14.577	-	9.197	EUR 15,010	218.800,77	0,73
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055	STK	2.265	2.265	-	889	EUR 181,150	410.304,75	1,37
DT.POST NAM.	DE0005552004	STK	5.362	5.362	-	880	EUR 39,260	210.512,12	0,70
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508	STK	19.129	19.129	2.839	2.206	EUR 21,490	411.082,21	1,37
E.ON NAM.	DE000ENAG999	STK	24.926	24.926	-	5.653	EUR 12,400	309.082,40	1,03
FRESENIUS	DE0005785604	STK	9.565	9.565	-	-	EUR 27,970	267.533,05	0,89
HANNOVER RÜCK NAM.	DE0008402215	STK	1.921	1.921	-	481	EUR 232,400	446.440,40	1,49
HEIDELBERG MAT.	DE0006047004	STK	2.098	2.098	-	806	EUR 94,640	198.554,72	0,66
HENKEL VORZ.	DE0006048432	STK	4.850	4.850	-	813	EUR 74,460	361.131,00	1,20
INFINEON TECHN. NAM.	DE0006231004	STK	4.015	4.015	-	1.412	EUR 32,720	131.370,80	0,44
MERCEDES-BENZ GR. NAM.	DE0007100000	STK	3.133	3.133	691	1.165	EUR 70,940	222.255,02	0,74
MERCK	DE0006599905	STK	1.862	1.862	-	629	EUR 148,950	277.344,90	0,93
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	983	983	318	245	EUR 412,200	405.192,60	1,35
QIAGEN NAM.	NL0015001WM6	STK	10.597	10.597	-	0	EUR 39,080	414.130,76	1,38
SAP	DE0007164600	STK	2.937	2.937	-	533	EUR 169,700	498.408,90	1,66
SARTORIUS VORZ.	DE0007165631	STK	532	532	-	416	EUR 282,300	150.183,60	0,50
SIEMENS EN. NAM.	DE000ENER6Y0	STK	6.176	6.176	-	2.500	EUR 19,300	119.196,80	0,40
SIEMENS HEALTHINEERS	DE000SHL1006	STK	4.781	4.781	2.406	-	EUR 52,100	249.090,10	0,83
SIEMENS NAM.	DE0007236101	STK	2.649	2.649	-	578	EUR 175,900	465.959,10	1,55
SYMRISE	DE000SYM9999	STK	4.200	4.200	-	887	EUR 100,700	422.940,00	1,41
VONOVIA NAM.	DE000A1ML7J1	STK	7.124	7.124	-	2.216	EUR 27,180	193.630,32	0,65
ZALANDO	DE000ZAL1111	STK	5.680	5.680	-	1.450	EUR 24,660	140.068,80	0,47
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								11.428.212,58	38,13
0,0000 % DT.LICHTMIETE V.18-23	DE000A2NB9P4	EUR	300.000	300.000	-	-	% 0,500	1.500,00	0,01
0,0500 % APOBANK HYP.-PFE A.1482 MTN	XS2079126467	EUR	1.500.000	1.500.000	-	-	% 84,166	1.262.490,90	4,21
0,2500 % UNICRED.BK. HYP.-PFE 20-32 MTN	DE000HV2AS10	EUR	2.000.000	2.000.000	-	-	% 80,216	1.604.318,60	5,35
0,5000 % DKB HYP.-PFE V.15-27	DE000DKB0432	EUR	1.000.000	1.000.000	-	1.000.000	% 92,272	922.724,00	3,08
0,7500 % APOBANK HYP.-PFE V.17-27 MTN	XS1693853944	EUR	1.500.000	1.500.000	-	-	% 91,729	1.375.932,15	4,59
0,7500 % APOBANK HYP.-PFE V.18-28 MTN	XS1852086211	EUR	1.000.000	1.000.000	-	-	% 90,283	902.833,80	3,01
0,7500 % H.VORARLBK. HYP.-PFE 15-25 MTN	XS1188081936	EUR	500.000	500.000	-	-	% 97,540	487.700,00	1,63
0,8500 % MÜNCH.HYP. HYP.PFE S.1677 MTN	DE000MHB2374	EUR	1.000.000	1.000.000	-	-	% 98,330	983.300,00	3,28

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
0,8750 % COBANK HYP.-PFE V.18-28 MTN	DE000CZ40MQ5		EUR	1.000.000	-	-	% 91,292	912.920,40	3,05	
0,8750 % DZ HYP HYP.-PFE R.358 MTN	DE000A13SR38		EUR	2.000.000	-	-	% 88,000	1.760.005,60	5,87	
2,5000 % MÜNCH.HYP. HYP.-PFE S.1618 MTN	DE000MHB10J3		EUR	1.250.000	-	-	% 97,159	1.214.487,13	4,05	
US-Dollar								1.459.584,16	4,87	
0,7500 % KFW V.20-30	US500769JG03		USD	2.000.000	-	-	% 78,033	1.459.584,16	4,87	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								7.506.848,00	25,05	
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro								7.506.848,00	25,05	
0,0000 % AFRICA GREENTEC ASSET V.17-32	DE000A2GSGF9		EUR	150.000	-	-	% 79,000	118.500,00	0,40	
0,0000 % DEUTSCHE LICHTMIETE V.18-23	DE000A2G9JL5		EUR	500.000	-	-	% 5,500	27.500,00	0,09	
0,0100 % SK PFORZH.CALW HYP.-PFE S.P15	DE000A254QW3		EUR	1.000.000	-	-	% 88,520	885.200,00	2,95	
0,6960 % KSK KÖLN HYP.-PFE E.1076	DE000A1TM490		EUR	2.000.000	-	-	% 97,260	1.945.200,00	6,49	
1,1250 % NASSAUISCHE SK HYP.-PFE 14-24	DE000A13R8H3		EUR	1.300.000	-	-	% 98,656	1.282.528,00	4,28	
1,3500 % KSK GÖPPINGEN HYP.-PFE R.5	DE000A12T457		EUR	1.000.000	-	-	% 99,255	992.550,00	3,31	
4,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.16-26	DE000A2AAVM5		EUR	1.300.000	-	-	% 91,000	1.183.000,00	3,95	
4,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.17-27	DE000A2E4PH3		EUR	200.000	-	-	% 97,000	194.000,00	0,65	
6,0000 % TIER MOB. V.20-25	DE000A254RZ4		EUR	500.000	-	-	% 75,000	375.000,00	1,25	
6,2500 % ENCORE ISS. 74(1) CLN V.23-26	DE000A3LQ9F9		EUR	535.500	-	-	% 94,000	503.370,00	1,68	
Summe Wertpapiervermögen								29.217.551,35	97,49	
Derivate								-178.245,34	-0,59	
Aktienindex-Derivate										
Aktienindex-Terminkontrakte								22.121,66	0,07	
DAX FUTURE 210624		EUREX	STK	-15			EUR	22.121,66	0,07	
Optionsrechte								-20.097,00	-0,07	
Optionsrechte auf Aktienindices										
C DAX 17950 170524		EUREX	STK	-6			EUR	233,600	-7.008,00	-0,02
P DAX 17950 170524		EUREX	STK	-6			EUR	169,500	-5.085,00	-0,02
P DAX 18150 170524		EUREX	STK	-6			EUR	266,800	-8.004,00	-0,03
Zins-Derivate										
Zinsterminkontrakte								-182.550,00	-0,61	
EURO-BOBL-FUTURE 060624		EUREX	STK	8.200.000			EUR	-115.970,00	-0,39	
EURO-BUND-FUTURE 060624		EUREX	STK	3.400.000			EUR	-66.580,00	-0,22	
Optionsrechte								2.280,00	0,01	
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte										
C EURO-BOBL-FUT. 116,75 240524		EUREX	STK	-12			EUR	1.680,00	0,01	
C EURO-BOBL-FUT. 117 240524		EUREX	STK	-12			EUR	1.440,00	0,00	
C EURO-BUND-FUT. 130,5 240524		EUREX	STK	-6			EUR	660,00	0,00	
P EURO-BOBL-FUT. 116,75 240524		EUREX	STK	-12			EUR	-1.500,00	-0,01	

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								623.051,44	2,08
Bankguthaben								623.051,44	2,08
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	563.054,36			% 100,000	563.054,36	1,88
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	64.151,88			% 100,000	59.997,08	0,20
Sonstige Vermögensgegenstände								322.313,93	1,08
ZINSANSPRÜCHE			EUR	136.141,45				136.141,45	0,45
DIVIDENDENANSPRÜCHE			EUR	8.803,96				8.803,96	0,03
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	19.220,18				19.220,18	0,06
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	158.148,34				158.148,34	0,53
Sonstige Verbindlichkeiten								-13.766,01	-0,05
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-13.766,01				-13.766,01	-0,05
Fondsvermögen							EUR	29.970.905,37	100,00^{*)}
Anteilwert							EUR	94,28	
Umlaufende Anteile							STK	317.884,3060	

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

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.04.2024 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.04.2024

US-Dollar	(USD)	1,06925 = 1 (EUR)
-----------	-------	-------------------

■ 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
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

5,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.13-23	DE000A1YCQ86	EUR	-	900.000
--	--------------	-----	---	---------

■ **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** **12.528**

Basiswerte: (DAX FUTURE 150324, DAX FUTURE 151223, DAX FUTURE 210624)

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte **EUR** **25.133**

Basiswerte: (EURO-BOBL-FUTURE 060624, EURO-BOBL-FUTURE 070324, EURO-BUND-FUTURE 060624, EURO-BUND-FUTURE 070324, EURO-BUND-FUTURE 12/23)

Währungs-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte **EUR** **251**

Basiswerte: (FX-FUTURE EUR/USD 03/24)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Verkaufte Kaufoptionen (call) **EUR** **2.996**

Basiswerte: (C DAX 15600 151223, C DAX 15700 151223, C DAX 16650 160224, C DAX 16900 150324, C DAX 17000 190124, C DAX 18000 190424)

Verkaufte Verkaufsoptionen (put) **EUR** **8.085**

Basiswerte: (P DAX 15400 171123, P DAX 15700 151223, P DAX 15800 2031, P DAX 16300 151223, P DAX 16500 160224, P DAX 16600 160224, P DAX 16650 151223, P DAX 16650 160224, P DAX 16750 190124, P DAX 16800 190124, P DAX 16900 150324, P DAX 16950 151223, P DAX 16950 160224, P DAX 17000 150324, P DAX 18000 190424)

■ 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
---------------------	------------------------------	------------------

Optionrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kaufoptionen (call) EUR 31.959

Basiswerte: (C EURO-BOBL-FUT. 116 221223, C EURO-BOBL-FUT. 117,50 230224, C EURO-BOBL-FUT. 117,75 220324, C EURO-BOBL-FUT. 119,50 260124, C EURO-BOBL-FUT. 118 26042024, C EURO-BUND-FUT. 130 260424, C EURO-BUND-FUT. 130,50 241123, C EURO-BUND-FUT. 131 260424, C EURO-BUND-FUT. 131,50 221223, C EURO-BUND-FUT. 132 220324, C EURO-BUND-FUT. 132,0 221223, C EURO-BUND-FUT. 132,5 220324, C EURO-BUND-FUT. 132,5 221223, C EURO-BUND-FUT. 132,50 260424, C EURO-BUND-FUT. 133 220324, C EURO-BUND-FUT. 133 230224, C EURO-BUND-FUT. 133,5 220324, C EURO-BUND-FUT. 133,5 221223, C EURO-BUND-FUT. 133,5 260424, C EURO-BUND-FUT. 133,50 260124, C EURO-BUND-FUT. 134 220324, C EURO-BUND-FUT. 134,0 260124, C EURO-BUND-FUT. 134,00 23022024, C EURO-BUND-FUT. 134,5 230224, C EURO-BUND-FUT. 134,50 221223, C EURO-BUND-FUT. 134,50 260124, C EURO-BUND-FUT. 135 230224, C EURO-BUND-FUT. 135,5 230224, C EURO-BUND-FUT. 135,50 260124, C EURO-BUND-FUT. 136 230224, C EURO-BUND-FUT. 136,0 260124, C EURO-BUND-FUT. 136,5 230224, C EURO-BUND-FUT. 136,50 260124, C EURO-BUND-FUT. 137,5 221223, C EURO-BUND-FUT. 138,0 260124)

Verkaufte Verkaufsoptionen (put) EUR 20.722

Basiswerte: (P EURO-BOBL-FUT. 116 221223, P EURO-BOBL-FUT. 117,50 230224, P EURO-BOBL-FUT. 117,50 260424, P EURO-BOBL-FUT. 117,75 220324, P EURO-BOBL-FUT. 118 260424, P EURO-BOBL-FUT. 119,50 260124, P EURO-BUND-FUT. 131 260424, P EURO-BUND-FUT. 131,50 26042024, P EURO-BUND-FUT. 132,00 26042024, P EURO-BUND-FUT. 132,50 220324, P EURO-BUND-FUT. 132,50 26042024, P EURO-BUND-FUT. 134 230224, P EURO-BUND-FUT. 134,5 230224, P EURO-BUND-FUT. 135,50 260124, P EURO-BUND-FUT. 136,50 260124, P EURO-BUND-FUT. 137 260124, P EURO-BUND-FUT. 137,5 221223, P EURO-BUND-FUT. 137,5 260124, P EURO-BUND-FUT. 138 260124, PUT EURO-BUND-FUT. 133,5 221223, PUT EURO-BUND-FUT. 138 221223)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	97,49 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,59 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	94,28
Umlaufende Anteile (STK)	317.884,3060

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 gleichtäglich).

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.

