

Halbjahresbericht

CSR Aktien Deutschland Plus

zum 30. Juni 2022

Halbjahresbericht des CSR Aktien Deutschland Plus

ZUM 30. JUNI 2022

■ 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	12.482.180,37	101,27
1. Aktien	11.527.183,66	93,52
Gesundheitswesen	1.978.896,21	16,06
Finanzwerte	1.872.185,28	15,19
Verbraucher-Dienstleistungen	1.663.078,28	13,49
Rohstoffe	1.583.008,60	12,84
Industriewerte	1.445.984,14	11,73
Konsumgüter	837.462,74	6,79
Versorgungsunternehmen	576.551,98	4,68
Immobilien	571.771,20	4,64
Technologie	554.378,34	4,50
Telekommunikation	443.866,89	3,60
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	26.925,00	0,22
Aktienindex-Derivate	26.925,00	0,22
4. Forderungen	70.157,84	0,57
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	857.913,87	6,96
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-156.703,71	-1,27
Sonstige Verbindlichkeiten	-156.703,71	-1,27
III. Fondsvermögen	12.325.476,66	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 30.06.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere							11.527.183,66	93,52	
Aktien									
Euro							11.527.183,66	93,52	
ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0	STK	2.393	433	-	EUR	168,760	403.842,68	3,28
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005	STK	1.810	-	2.792	EUR	182,120	329.637,20	2,67
BMW	DE0005190003	STK	3.397	-	252	EUR	73,460	249.543,62	2,02
BRENNTAG NAM.	DE000A1DAHH0	STK	4.225	2.493	-	EUR	62,100	262.372,50	2,13
CONTINENTAL	DE0005439004	STK	3.268	1.974	-	EUR	66,500	217.322,00	1,76
COVESTRO	DE0006062144	STK	7.980	5.763	-	EUR	32,980	263.180,40	2,14
DEUTSCHE BK.	DE0005140008	STK	35.232	12.151	-	EUR	8,318	293.059,78	2,38
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055	STK	3.324	1.290	-	EUR	159,600	530.510,40	4,30
DT.POST NAM.	DE0005552004	STK	9.657	-	1.053	EUR	35,740	345.141,18	2,80
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508	STK	23.428	-	12.341	EUR	18,946	443.866,89	3,60
E.ON NAM.	DE000ENAG999	STK	71.997	71.997	-	EUR	8,008	576.551,98	4,68
FRESENIUS MED.C.	DE0005785802	STK	8.337	6.160	-	EUR	47,630	397.091,31	3,22
HANNOVER RÜCK NAM.	DE0008402215	STK	2.865	2.865	-	EUR	138,500	396.802,50	3,22
HEIDELBERGCEMENT	DE0006047004	STK	5.229	3.449	-	EUR	45,840	239.697,36	1,94
HENKEL VORZ.	DE0006048432	STK	7.377	5.433	-	EUR	58,780	433.620,06	3,52
INFINEON TECHN. NAM.	DE0006231004	STK	8.792	-	5.525	EUR	23,090	203.007,28	1,65
LINDE	IE00BZ12WP82	STK	1.490	-	3.361	EUR	273,950	408.185,50	3,31
MERCEDES-BENZ GR. NAM.	DE0007100000	STK	4.394	-	3.969	EUR	55,220	242.636,68	1,97
MERCK	DE0006599905	STK	2.757	1.325	-	EUR	161,000	443.877,00	3,60
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026	STK	1.437	-	122	EUR	224,200	322.175,40	2,61
PORSCHE VORZ.	DE000PAH0038	STK	3.440	1.725	-	EUR	63,120	217.132,80	1,76
PUMA	DE0006969603	STK	5.084	3.963	-	EUR	62,840	319.478,56	2,59
QIAGEN NAM.	NL0012169213	STK	25.457	23.012	-	EUR	44,700	1.137.927,90	9,23
SAP	DE0007164600	STK	4.042	-	7.335	EUR	86,930	351.371,06	2,85
SARTORIUS VORZ.	DE0007165631	STK	1.785	1.511	-	EUR	333,400	595.119,00	4,83
SIEMENS NAM.	DE0007236101	STK	2.740	-	5.484	EUR	97,090	266.026,60	2,16
SYMRISE	DE000SYM9999	STK	6.252	3.972	-	EUR	103,850	649.270,20	5,27
VONOVIA NAM.	DE000A1ML7J1	STK	19.448	11.648	-	EUR	29,400	571.771,20	4,64
VW VORZ.	DE0007664039	STK	1.613	-	505	EUR	127,420	205.528,46	1,67
ZALANDO	DE000ZAL1111	STK	8.471	8.471	-	EUR	24,960	211.436,16	1,72
Summe Wertpapiervermögen							11.527.183,66	93,52	
Derivate							26.925,00	0,22	
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte							67.200,00	0,55	
DAX FUTURE 09/22		EUREX	STK	-5		EUR		67.200,00	0,55
Optionsrechte							-40.275,00	-0,33	
Optionsrechte auf Aktienindices									
CALL DAX 13000 07/22		EUREX	STK	-9		EUR	179,300	-8.068,50	-0,07
CALL DAX 13300 07/22		EUREX	STK	-9		EUR	80,100	-3.604,50	-0,03
CALL DAX 13650 07/22		EUREX	STK	-9		EUR	26,900	-1.210,50	-0,01
CALL DAX 13900 07/22		EUREX	STK	-9		EUR	12,800	-576,00	0,00
PUT DAX 13300 07/22		EUREX	STK	-9		EUR	595,900	-26.815,50	-0,22

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								857.913,87	6,96
Bankguthaben								857.913,87	6,96
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	857.913,87			% 100,000	857.913,87	6,96
Sonstige Vermögensgegenstände								70.157,84	0,57
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	70.157,84				70.157,84	0,57
Sonstige Verbindlichkeiten								-156.703,71	-1,27
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-82.947,21				-82.947,21	-0,67
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-6.556,50				-6.556,50	-0,05
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-67.200,00				-67.200,00	-0,55
Fondsvermögen							EUR	12.325.476,66	100,00*

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

CSR Aktien Deutschland Plus I	
ISIN	DE000A2P37Q2
Fondsvermögen (EUR)	9.587.006,12
Anteilwert (EUR)	926,55
Umlaufende Anteile (STK)	10.347,0000

CSR Aktien Deutschland Plus R	
ISIN	DE000A2P37R0
Fondsvermögen (EUR)	2.738.470,54
Anteilwert (EUR)	91,90
Umlaufende Anteile (STK)	29.797,1070

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.06.2022 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

BASF NAM.	DE000BASF111	STK	-	10.354
BEIERSDORF	DE0005200000	STK	-	1.092
DAIMLER TRUCK HOLD. NAM.	DE000DTR0CK8	STK	-	4.181
FRESENIUS	DE0005785604	STK	-	4.568
LANXESS	DE0005470405	STK	-	9.232
SIEMENS EN. NAM.	DE000ENERGY0	STK	-	5.568
UNIPER NAM.	DE000UNSE018	STK	-	13.246

■ Während des Berichtszeitraumes 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

Gekaufte Kontrakte **EUR** **690**

Basiswerte: (DAX FUTURE 09/22)

Verkaufte Kontrakte **EUR** **32.883**

Basiswerte: (DAX FUTURE 03/22, DAX FUTURE 06/22, DAX FUTURE 09/22)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Verkaufte Kaufoptionen (call) **EUR** **15.380**

Basiswerte: (CALL DAX 12600 03/22, CALL DAX 13200 03/22, CALL DAX 13500 03/22, CALL DAX 13500 05/22, CALL DAX 13800 03/22, CALL DAX 13900 05/22, CALL DAX 14100 03/22, CALL DAX 14100 04/22, CALL DAX 14100 05/22, CALL DAX 14100 06/22, CALL DAX 14400 03/22, CALL DAX 14700 03/22, CALL DAX 15150 02/22, CALL DAX 15200 02/22, CALL DAX 15300 03/22, CALL DAX 15350 03/22, CALL DAX 15450 03/22, CALL DAX 15500 02/22, CALL DAX 15800 02/22)

Verkaufte Verkaufsoptionen (put) **EUR** **7.502**

Basiswerte: (PUT DAX 12300 03/22, PUT DAX 13500 03/22, PUT DAX 13900 05/22, PUT DAX 13900 07/22, PUT DAX 14100 04/22, PUT DAX 14100 05/22, PUT DAX 14100 06/22, PUT DAX 15350 03/22, PUT DAX 15500 02/22, PUT DAX 15800 02/22)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen 93,52 %

Bestand der Derivate am Fondsvermögen 0,22 %

Sonstige Angaben

CSR Aktien Deutschland Plus I

ISIN	DE000A2P37Q2
Fondsvermögen (EUR)	9.587.006,12
Anteilwert (EUR)	926,55
Umlaufende Anteile (STK)	10.347,0000
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 1,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,825%, derzeit 0,475%
Mindestanlagesumme (EUR)	250.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

CSR Aktien Deutschland Plus R

ISIN	DE000A2P37R0
Fondsvermögen (EUR)	2.738.470,54
Anteilwert (EUR)	91,90
Umlaufende Anteile (STK)	29.797,1070
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 3,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,825%, derzeit 0,825%
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.

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben

Mit Wirkung vom 01.01.2022 wurde das Sondervermögen von der Internationale Kapitalanlagegesellschaft mbH, Düsseldorf übernommen.

