

Halbjahresbericht

CSR Bond Plus

zum 30. April 2025

Halbjahresbericht des CSR Bond Plus

ZUM 30. APRIL 2025

■ 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	75.301.305,37	100,03
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	72.139.114,09	95,83
Gedekte Schuldverschreibungen	43.293.789,34	57,51
Regierungsanleihen	19.920.478,90	26,46
Staatlich garantierte Anlagen	6.013.735,00	7,99
Finanzsektor	2.893.360,85	3,84
Energiewerte	17.750,00	0,02
3. Derivate	-86.683,83	-0,12
Zins-Derivate	-86.683,83	-0,12
4. Forderungen	503.301,40	0,67
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	2.745.573,71	3,65
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-23.773,80	-0,03
Sonstige Verbindlichkeiten	-23.773,80	-0,03
III. Fondsvermögen	75.277.531,57	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 30.04.2025	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								65.759.698,24	87,36
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								65.759.698,24	87,36
0,0000 % BUND V.19-29	DE0001102473		EUR	1.000.000	-	-	% 92,281	922.810,00	1,23
0,0000 % BUND V.20-30	DE0001030708		EUR	1.000.000	-	-	% 90,094	900.943,90	1,20
0,0000 % BUND V.20-30	DE0001102499		EUR	1.500.000	-	-	% 91,158	1.367.370,00	1,82
0,0000 % BUND V.20-30	DE0001102507		EUR	1.000.000	-	-	% 90,117	901.170,00	1,20
0,0000 % BUND V.21-31	DE0001102531		EUR	1.000.000	-	-	% 88,951	889.510,00	1,18
0,0000 % BUND V.21-31	DE0001102564		EUR	3.500.000	-	-	% 87,732	3.070.620,00	4,08
0,0000 % DT.LICHTMIETE V.18-23	DE000A2NB9P4		EUR	200.000	-	-	% 0,500	1.000,00	0,00
0,0000 % LAWI.RENTENBK. MTN V.21-31	XS2359292955		EUR	7.000.000	-	-	% 85,911	6.013.735,00	7,99
0,0100 % ING-DIBA HYP.-PFE V.21-28	DE000A1KRJV6		EUR	7.000.000	-	-	% 92,713	6.489.891,10	8,62
0,0500 % APOBANK HYP.-PFE A.1482 MTN	XS2079126467		EUR	4.000.000	-	-	% 89,498	3.579.930,00	4,76
0,1250 % WÜST.BSPK. HYP.-PFE R.12	DE000WBP0BB8		EUR	1.000.000	-	-	% 89,987	899.868,50	1,20
0,2500 % ING-DIBA HYP.-PFE V.16-26	DE000A1KRJQ6		EUR	3.000.000	-	-	% 97,373	2.921.189,40	3,88
0,7500 % APOBANK HYP.-PFE V.17-27 MTN	XS1693853944		EUR	5.000.000	-	-	% 96,505	4.825.225,00	6,41
0,7500 % APOBANK HYP.-PFE V.18-28 MTN	XS1852086211		EUR	2.000.000	-	-	% 95,224	1.904.480,00	2,53
0,7500 % NORD.LB HYP.-PFE V.18-27 MTN	DE000NLB2TD7		EUR	2.000.000	-	-	% 96,168	1.923.354,20	2,56
0,8750 % COBANK HYP.-PFE V.15-25 MTN	DE000CZ40KZ0		EUR	3.500.000	-	500.000	% 99,520	3.483.200,00	4,63
0,8750 % COBANK HYP.-PFE V.18-28 MTN	DE000CZ40MQ5		EUR	1.500.000	-	-	% 96,261	1.443.919,35	1,92
0,8750 % DZ HYP HYP.-PFE R.358 MTN	DE000A13SR38		EUR	6.000.000	-	-	% 93,002	5.580.121,80	7,41
1,2500 % BUND V.17-48	DE0001102432		EUR	8.000.000	-	-	% 73,130	5.850.400,00	7,77
2,0000 % BSK SCHW.H. HYP.-PFE 22-34 MTN	DE000A30VH59		EUR	1.300.000	-	-	% 92,760	1.205.884,29	1,60
2,2000 % BUND V.24-34	DE000BU2Z023		EUR	3.000.000	-	-	% 98,603	2.958.075,00	3,93
2,5000 % MÜNCH.HYP. HYP.-PFE S.1618 MTN	DE000MHB10J3		EUR	2.500.000	-	-	% 100,871	2.521.779,00	3,35
2,6000 % BUND V.23-33	DE000BU2Z015		EUR	3.000.000	-	-	% 101,986	3.059.580,00	4,06
3,0000 % LBBW HYP.-PFE S.850 MTN	DE000LB39BP4		EUR	3.000.000	-	-	% 101,521	3.045.641,70	4,05
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								6.379.415,85	8,47
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								6.379.415,85	8,47
0,0000 % DEUTSCHE LICHTMIETE V.18-23	DE000A2G9JL5		EUR	500.000	-	-	% 3,550	17.750,00	0,02
0,8750 % SSK MÜNCHEN HYP.-PFE R.8	DE000A168ZJ3		EUR	3.500.000	-	-	% 99,123	3.469.305,00	4,61
4,0000 % DT.BILDUNG STUDIENFD. V.16-26	DE000A2AAVM5		EUR	900.000	-	-	% 98,000	882.000,00	1,17
6,2500 % ENCORE ISS. 74(1) CLN V.23-26	DE000A3LQ9F9		EUR	2.142.100	-	-	% 93,850	2.010.360,85	2,67

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2025	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Summe Wertpapiervermögen								72.139.114,09	95,83
Derivate								-86.683,83	-0,12
Zins-Derivate									
Zinsterminkontrakte								-104.730,00	-0,14
EURO-BOBL-FUTURE 060625		EUREX	STK	-5.500.000			EUR	-134.650,00	-0,18
EURO-BUND-FUTURE 060625		EUREX	STK	4.600.000			EUR	29.920,00	0,04
Optionsrechte								18.046,17	0,02
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte									
C EURO-BOBL-FUT. 119,50 230525		EUREX	STK	-40			EUR	4.000,00	0,01
C EURO-BUND-FUT. 131,50 230525		EUREX	STK	-21			EUR	1.712,34	0,00
P EURO-BOBL-FUT. 119,50 230525		EUREX	STK	-40			EUR	9.200,00	0,01
P EURO-BUND-FUT. 131,50 230525		EUREX	STK	-21			EUR	3.133,83	0,00
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								2.745.573,71	3,65
Bankguthaben								2.745.573,71	3,65
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	2.745.573,71			% 100,000	2.745.573,71	3,65
Sonstige Vermögensgegenstände								503.301,40	0,67
ZINSANSPRÜCHE			EUR	408.127,57				408.127,57	0,54
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	8.490,00				8.490,00	0,01
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	86.683,83				86.683,83	0,12
Sonstige Verbindlichkeiten								-23.773,80	-0,03
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-23.773,80				-23.773,80	-0,03
Fondsvermögen						EUR		75.277.531,57	100,00^{*)}
Anteilwert							EUR	102,59	
Umlaufende Anteile							STK	733.798,0290	

*) 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 30.04.2025 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

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

0,7500 % H.VORARLBK. HYP.-PFE 15-25 MTN	XS1188081936	EUR	-	1.000.000
0,8500 % MÜNCH.HYP. HYP.PFE S.1677 MTN	DE000MHB2374	EUR	-	2.000.000
0,9500 % HASPA HYP.-PFE A.28	DE000A12UETO	EUR	-	2.000.000

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

6,0000 % NEXTBIKE 20/25	DE000A254RZ4	EUR	-	1.000.000
----------------------------	--------------	-----	---	-----------

■ **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

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte **EUR** **29.683**

Basiswerte: (EURO-BOBL-FUTURE 060325, EURO-BUND-FUTURE 060325, EURO-BUND-FUTURE 060625)

Verkaufte Kontrakte **EUR** **19.474**

Basiswerte: (EURO-BOBL-FUTURE 060325, EURO-BOBL-FUTURE 060625, EURO-BOBL-FUTURE 061224)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kaufoptionen (call) **EUR** **90.014**

Basiswerte: (C EURO-BOBL-FUT. 116,50 210225, C EURO-BOBL-FUT. 116,75 210225, C EURO-BOBL-FUT. 117 210325, C EURO-BOBL-FUT. 117,00 240125, C EURO-BOBL-FUT. 117,25 250425, C EURO-BOBL-FUT. 118,00 201224, C EURO-BOBL-FUT. 118,00 210325, C EURO-BOBL-FUT. 118,00 240125, C EURO-BOBL-FUT. 118,25 210325, C EURO-BOBL-FUT. 118,50 221124, C EURO-BOBL-FUT. 118,75 221124, C EURO-BOBL-FUT. 119,50 250425, C EURO-BUND-FUT. 127,50 210325, C EURO-BUND-FUT. 131,00 210325, C EURO-BUND-FUT. 131,5 250425, C EURO-BUND-FUT. 131,50 210225, C EURO-BUND-FUT. 132,00 210325, C EURO-BUND-FUT. 132,50 210325, C EURO-BUND-FUT. 134,00 201224, C EURO-BUND-FUT. 134,00 240125, C EURO-BUND-FUT. 134,50 201224, C EURO-BUND-FUT. 134,50 240125, C EURO-BUND-FUT. 135,00 201224, C EURO-BUND-FUT. 136,00 201224)

Verkaufte Verkaufsoptionen (put) **EUR** **57.201**

Basiswerte: (P EURO-BOBL-FUT. 117,00 250425, P EURO-BOBL-FUT. 117,50 250425, P EURO-BOBL-FUT. 118,00 201224, P EURO-BOBL-FUT. 118,00 240125, P EURO-BOBL-FUT. 118,25 240125, P EURO-BOBL-FUT. 119,00 250425, P EURO-BOBL-FUT. 119,25 221124, P EURO-BOBL-FUT. 119,50 250425, P EURO-BUND-FUT. 128,00 250425, P EURO-BUND-FUT. 131,00 210325, P EURO-BUND-FUT. 131,50 210225, P EURO-BUND-FUT. 131,50 240125, P EURO-BUND-FUT. 132,00 210325, P EURO-BUND-FUT. 135,50 201224, PUT EURO-BUND-FUT. 131,50 250425)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	95,83 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,12 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	102,59
Umlaufende Anteile (STK)	733.798,0290

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.

