

# Halbjahresbericht

## zum 30. September 2024

### Indexstrategie ausgewogen

Ein Investmentfonds mit Sondervermögenscharakter (fonds commun de placement) gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung

K805



HAUCK  
AUFHÄUSER  
FUND SERVICES

Verwaltungsgesellschaft



HAUCK  
AUFHÄUSER  
LAMPE

Verwahrstelle

## Inhalt

Management und Verwaltung .....	3
Erläuterungen zu der Vermögensübersicht .....	5
Indexstrategie ausgewogen .....	7



# Management und Verwaltung

## Verwaltungsgesellschaft

### **Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**

R.C.S. Luxembourg B28878  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach  
Gezeichnetes Kapital zum 31. Dezember 2023: EUR 11,0 Mio.

## Aufsichtsrat

### **Vorsitzender**

#### **Dr. Holger Sepp**

Vorstand  
Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Frankfurt am Main

### **Mitglieder**

#### **Marie-Anne van den Berg**

Independent Director

#### **Andreas Neugebauer**

Independent Director

## Vorstand

### **Elisabeth Backes**

Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

### **Christoph Kraiker**

Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

### **Wendelin Schmitt**

Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

## Verwahrstelle

### **Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg**

1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

## Zahl-, Vertriebs- und Kontaktstellen

### *Großherzogtum Luxemburg*

#### **Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg**

1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

### *Bundesrepublik Deutschland*

#### **Kontaktstelle Deutschland:**

**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

#### **Vertriebsstelle Deutschland:**

**Performance Asset Management AG**  
Augustaanlage 3, D-68165 Mannheim

## Anlageberater

### **Performance Swiss AG**

Hauptstrasse 22, CH-4313 Möhlin

### **Kornhaab & Cie Vermögensverwaltung AG**

Rudi-Schillings-Straße 10, D-54296 Trier

## Abschlussprüfer

### **KPMG Audit S.à r.l.**

Cabinet de révision agréé  
39, Avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxemburg

## Register- und Transferstelle

ab 01.04.2024:

**Hauck & Aufhäuser Administration Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

bis 31.03.2024:

**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach



### Sehr geehrte Damen und Herren,

der vorliegende Bericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung des Investmentfonds Indexstrategie ausgewogen.

Der Investmentfonds ist ein nach Luxemburger Recht in Form eines fonds commun de placement (FCP) errichtetes Sondervermögen aus Wertpapieren und sonstigen Vermögenswerten. Er wurde nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung ("Gesetz von 2010") gegründet und erfüllt die Anforderungen der Richtlinie des Rates der Europäischen Gemeinschaften Nr. 2009/65/EG vom 13. Juli 2009, zuletzt geändert durch die Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlamentes und des Rates vom 23. Juli 2014 ("Richtlinie 2009/65/EG").

Mit Wirkung zum 20. Juni 2024 erfolgte aus geschäftsstrategischen Gründen im Einklang mit den gegenwärtig gültigen gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Bestimmungen die Verschmelzung des Fonds K & C AKTIENFONDS („übertragender Fonds“) auf die Anteilklasse K des Fonds Indexstrategie ausgewogen („übernehmender Fonds“). Die Verschmelzung erfolgte auf Basis der Anteilwerte vom 19. Juni 2024. Die Anteilklasse E des übernehmenden Fonds ist nicht unmittelbar von der Verschmelzung betroffen.

Die Verschmelzung erfolgte im Verhältnis:

1 Anteil K & C AKTIENFONDS (ISIN LU0351697841) zu 1,4659042 Anteile Indexstrategie ausgewogen K (ISIN LU2629492658)

Zeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, des Basisinformationsblattes für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP) zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht erfolgen.

Sonstige wichtige Informationen an die Anteilinhaber werden grundsätzlich auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft ([www.hal-privatbank.com](http://www.hal-privatbank.com)) veröffentlicht. Hier finden Sie ebenfalls aktuelle Fondspreise und Fakten zu Ihren Fonds. Daneben wird, in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen, in Luxemburg außerdem eine Veröffentlichung in einer Luxemburger Tageszeitung geschaltet.

Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. April 2024 bis zum 30. September 2024.

## Wertentwicklung des Netto-Fondsvermögens im Berichtszeitraum (nach BVI-Methode exkl. Verkaufsprovision)

Indexstrategie ausgewogen E / LU0282283927 (vom 1. April 2024 bis 30. September 2024)	3,48 %
Indexstrategie ausgewogen K / LU2629492658 (vom 19. Juni 2024 bis 30. September 2024)	0,37 %

Die Wertentwicklung ist die prozentuale Veränderung zwischen dem angelegten Vermögen am Anfang des Anlagezeitraumes und seinem Wert am Ende des Anlagezeitraumes und beruht auf der Annahme, dass etwaige Ausschüttungen wieder angelegt wurden. Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu.



# Erläuterungen zu der Vermögensübersicht

zum 30. September 2024

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften nach LUX GAAP auf dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

Der Wert eines Anteils ("Anteilwert") lautet auf die im Verkaufsprospekt festgelegte Währung der Anteilklasse ("Anteilklassenwährung"). Er wird unter Aufsicht der Verwahrstelle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem von ihr beauftragten Dritten an jedem im Verkaufsprospekt festgelegten Tag ("Bewertungstag") berechnet. Die Berechnung des Fonds und seiner Anteilklassen erfolgt durch Teilung des Netto-Fondsvermögens der jeweiligen Anteilklasse durch die Zahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile dieser Anteilklasse. Soweit in Jahres- und Halbjahresberichten sowie sonstigen Finanzstatistiken aufgrund gesetzlicher Vorschriften oder gemäß den Regelungen des Verwaltungsreglements Auskunft über die Situation des Fondsvermögens des Fonds insgesamt gegeben werden muss, erfolgen diese Angaben in Euro ("Referenzwährung"), und die Vermögenswerte werden in die Referenzwährung umgerechnet.

Das Netto-Fondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Die im Fonds enthaltenen Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Anteilwert bzw. Rücknahmepreis bewertet.
- b) Der Wert von Kassenbeständen oder Bankguthaben, Einlagenzertifikaten und ausstehenden Forderungen, vorausbezahlten Auslagen, Bardividenden und erklärten oder aufgelaufenen und noch nicht erhaltenen Zinsen entspricht dem jeweiligen vollen Betrag, es sei denn, dass dieser wahrscheinlich nicht voll bezahlt oder erhalten werden kann, in welchem Falle der Wert unter Einschluss eines angemessenen Abschlages ermittelt wird, um den tatsächlichen Wert zu erhalten.
- c) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, sofern nachfolgend nichts anderes geregelt ist.
- d) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in c) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, wird der Wert solcher Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt.
- e) Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, entspricht dem jeweiligen Nettoliquidationswert, wie er gemäß den Richtlinien des Vorstands auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt wird. Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures, Forwards oder Optionen vom Fonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettovermögenswert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Vorstand in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- f) Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet. Es wird darauf geachtet, dass Swap-Kontrakte zu marktüblichen Bedingungen im exklusiven Interesse des Fonds abgeschlossen werden.
- g) Geldmarktinstrumente können zu ihrem jeweiligen Verkehrswert, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern nachprüfaren Bewertungsregeln festlegt, bewertet werden.
- h) Sämtliche sonstige Wertpapiere oder sonstige Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Marktwert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben und entsprechend dem der Verwaltungsgesellschaft auszustellenden Verfahren zu bestimmen ist.
- i) Die auf Wertpapiere entfallenden anteiligen Zinsen werden mit einbezogen, soweit diese nicht im Kurswert berücksichtigt wurden (Dirty-Pricing).
- j) Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Fonds ausgedrückt sind, wird in diese Währung zu den zuletzt verfügbaren Devisenkursen umgerechnet. Wenn solche Kurse nicht verfügbar sind, wird der Wechselkurs nach Treu und Glauben und nach dem vom Vorstand aufgestellten Verfahren bestimmt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Fonds für angebracht hält.

Mit Wirkung zum 20. Juni 2024 erfolgte aus geschäftsstrategischen Gründen im Einklang mit den gegenwärtig gültigen gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Bestimmungen die Verschmelzung des Fonds K & C AKTIENFONDS („übertragender Fonds“) auf die Anteilklasse K des Fonds Indexstrategie ausgewogen („übernehmender Fonds“). Die Verschmelzung erfolgte auf Basis der Anteilwerte vom 19. Juni 2024. Die Anteilklasse E des übernehmenden Fonds ist nicht unmittelbar von der Verschmelzung betroffen.

Die Verschmelzung erfolgte im Verhältnis:

1 Anteil K & C AKTIENFONDS (ISIN LU0351697841) zu 1,4659042 Anteile Indexstrategie ausgewogen K (ISIN LU2629492658)



Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Anteilwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Fonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Anteilwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Anteilwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Anteilwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Im Berichtszeitraum kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ("SFTR") zum Einsatz. Somit sind im Halbjahresbericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.



# Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

## Indexstrategie ausgewogen

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Wertpapiervermögen</b>								<b>3.083.870,00</b>	<b>31,30</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Bundesrep. Deutschland</b>									
Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2022(2030/2082)	XS2451803063	Nominal	200.000,00	0,00	0,00	EUR	99,24	198.475,00	2,01
Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.MTN Reihe 35274 v.17(27)	DE000A2DASM5	Nominal	300.000,00	300.000,00	0,00	EUR	89,31	267.930,00	2,72
<b>Niederlande</b>									
Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR Certs 2014(Und.)	XS1002121454	Nominal	100.000,00	100.000,00	0,00	EUR	114,08	114.075,00	1,16
Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(30/Und.)	XS1206541366	Nominal	50.000,00	0,00	0,00	EUR	90,28	45.138,50	0,46
<b>Österreich</b>									
AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2022(22/Und.)	XS2432941693	Nominal	200.000,00	200.000,00	0,00	EUR	87,09	174.172,00	1,77
Porr AG EO-Var. Schuldv. 2024(28/Und.)	AT0000A39724	Nominal	200.000,00	100.000,00	0,00	EUR	109,04	218.085,00	2,21
<b>Organisierter Markt</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Bermuda</b>									
Athora Holding Ltd. EO-Bonds 2023(23/23/28)	XS2628821790	Nominal	100.000,00	100.000,00	0,00	EUR	107,84	107.837,50	1,09
<b>Bundesrep. Deutschland</b>									
ABO Energy GmbH & Co. KGaA Nachr.-IHS v.2024(2029)	DE000A3829F5	Nominal	300.000,00	300.000,00	0,00	EUR	99,85	299.550,00	3,04
BayWa AG Sub.-FLR-Nts.v.23(28/unb.)	DE000A351PD9	Nominal	200.000,00	100.000,00	0,00	EUR	46,46	92.914,00	0,94
DEAG Deutsche Entertainment AG Anleihe v.2023(2023/2026)	NO0012487596	Nominal	105.000,00	105.000,00	0,00	EUR	103,05	108.202,50	1,10
Groß & Partner Grundst. GmbH IHS v. 2024 (2026/2028)	DE000A383BH3	Nominal	300.000,00	300.000,00	0,00	EUR	96,50	289.500,00	2,94
Light AcquiCo GmbH FLR-Notes v.24(27/29)	NO0013252452	Nominal	250.000,00	250.000,00	0,00	EUR	100,09	250.225,00	2,54
Mutares SE & Co. KGaA FLR-Bonds v.23(23/27)	NO0012530965	Nominal	200.000,00	100.000,00	0,00	EUR	96,42	192.844,00	1,96
PAUL Tech AG Inh.-Schv. v.2020(2022/2025)	DE000A3H2TU8	Nominal	250.000,00	250.000,00	0,00	EUR	87,10	217.737,50	2,21
<b>Österreich</b>									
Lenzing AG EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2250987356	Nominal	200.000,00	100.000,00	0,00	EUR	96,84	193.684,00	1,97



Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Schweden</b>									
Verve Group SE EO-FLR Notes 2023(25/27)	SE0019892241	Nominal	300.000,00	300.000,00	0,00	EUR	104,50	313.500,00	3,18
<b>Investmentanteile*</b>								<b>6.163.236,35</b>	<b>62,56</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
<b>Irland</b>									
Am.ETF-MSCI W.SRI CL.N.Z.AM.P. Bear.Shs EUR Acc.	IE000Y77LGG9	Anteile	7.925,00	0,00	0,00	EUR	97,38	771.736,50	7,83
InvescoM2 EUR CorpHybBond ETF Reg. Shs EUR Acc.	IE00BKWD3B81	Anteile	7.300,00	7.300,00	0,00	EUR	42,38	309.366,70	3,14
iShs Core MSCI EM IMI U.ETF Registered Shares	IE00BKM4GZ66	Anteile	11.650,00	11.650,00	0,00	EUR	33,42	389.308,05	3,95
iShs Core S&P 500 UC.ETF USDD Registered Shares USD (Dist)	IE0031442068	Anteile	5.200,00	0,00	0,00	EUR	51,28	266.635,20	2,71
iShsIV-Fa.An.Hi.Yi.Co.Bd U.ETF Registered Shares USD Acc	IE00BDFJYP58	Anteile	41.500,00	41.500,00	0,00	EUR	6,09	252.565,06	2,56
SPDR Russell2000US.S.Cap U.ETF Registered Shares	IE00BJ38QD84	Anteile	9.725,00	9.725,00	0,00	EUR	57,69	561.035,25	5,70
WisdomTree Gl.Qual.Div.Gr.U.E. Registered Shares USD Acc.	IE00BZ56SW52	Anteile	5.350,00	0,00	0,00	USD	42,02	201.106,59	2,04
<b>Luxemburg</b>									
Amundi Stoxx Europe 600 Act.Nom.UCITS ETF Acc	LU0908500753	Anteile	3.950,00	2.325,00	0,00	EUR	246,10	972.095,00	9,87
Am.Idx Sol.Amu.EUR C.0-1 Y ESG Act.Nom.UCITS ETF DR-EUR(D)	LU1686830065	Anteile	3.825,00	0,00	0,00	EUR	125,07	478.392,75	4,86
Amundi Index Solu.-A.PRIME GL. Nam.-Ant.UC.ETF DR USD Acc.	LU2089238203	Anteile	25.250,00	0,00	0,00	EUR	29,88	754.343,75	7,66
MUL Amundi MSCI World Inf Tech UCITS ETF Inh.Anteile Acc	LU0533033667	Anteile	850,00	0,00	0,00	EUR	777,30	660.705,00	6,71
UBAM-Global High Yield Solut. Act.au Port. IC EUR Acc.	LU2559401711	Anteile	2.600,00	2.600,00	0,00	EUR	118,13	307.138,00	3,12
Xtrackers CSI300 Swap Inhaber-Anteile 1C	LU0779800910	Anteile	17.750,00	0,00	0,00	EUR	13,45	238.808,50	2,42
<b>Bankguthaben</b>								<b>564.321,51</b>	<b>5,73</b>
<b>EUR - Guthaben</b>									
EUR bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg			564.321,51			EUR		564.321,51	5,73
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>96.228,69</b>	<b>0,98</b>
Zinsansprüche aus Bankguthaben			1.465,45			EUR		1.465,45	0,01
Zinsansprüche aus Wertpapieren			94.763,24			EUR		94.763,24	0,96
<b>Gesamtaktiva</b>								<b>9.907.656,55</b>	<b>100,57</b>





Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.09.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Verbindlichkeiten</b>								<b>-56.550,32</b>	<b>-0,57</b>
<b>aus</b>									
Prüfungskosten			-38.255,14				EUR	-38.255,14	-0,39
Risikomanagementvergütung			-800,00				EUR	-800,00	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten			-5.037,37				EUR	-5.037,37	-0,05
Taxe d'abonnement			-805,05				EUR	-805,05	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung			-700,00				EUR	-700,00	-0,01
Vertriebsstellenvergütung			-2.755,68				EUR	-2.755,68	-0,03
Verwahrstellenvergütung			-822,30				EUR	-822,30	-0,01
Verwaltungsvergütung			-7.374,78				EUR	-7.374,78	-0,07
<b>Gesamtpassiva</b>								<b>-56.550,32</b>	<b>-0,57</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>9.851.106,23</b>	<b>100,00**</b>
<b>Anteilwert E</b>							EUR	<b>58,80</b>	
<b>Anteilwert K</b>							EUR	<b>100,37</b>	
<b>Umlaufende Anteile E</b>							STK	<b>92.500,517</b>	
<b>Umlaufende Anteile K</b>							STK	<b>43.955,765</b>	

\*Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich.

\*\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Fonds, welche nicht in Fondswährung ausgedrückt sind, sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Devisenkurse bewertet.

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per 27.09.2024
US-Dollar	USD	1,1179	= 1 Euro (EUR)



Fondsvermögen, Anteilwert und umlaufende Anteile  
Indexstrategie ausgewogen

	Anteilklasse E in EUR	Anteilklasse K in EUR
<b>zum 30.09.2024</b>		
Fondsvermögen	5.439.331,62	4.411.774,61
Anteilwert	58,80	100,37
Umlaufende Anteile	92.500,517	43.955,765

