

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI
Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013
für das Geschäftsjahr
vom 01. September 2012 bis 31. August 2013

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

Zusammengefasste Vermögensaufstellung zum 28.02.2013

Fondsvermögen	Kurswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
Renten	4.623.063,68	17,80
Investmentanteile	19.241.531,07	74,09
Sonstiges	2.106.769,23	8,11
Summe	25.971.363,98	100,00

Renten nach Sektoren	Kurswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
Corporates (inkl. Financials)	366.982,88	1,41
Diverse Renten	1.090.038,00	4,20
öffentliche Anleihen	1.551.015,10	5,97
Sonderkreditinstitute, Supra-Nationale	1.615.027,70	6,22
Summe	4.623.063,68	17,80

Renten nach Währungen	Kurswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
EUR	4.623.063,68	17,80
Summe	4.623.063,68	17,80

Renten nach Restlaufzeit	Kurswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
< 1 Jahr	504.940,00	1,95
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	2.481.147,63	9,55
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	1.636.976,05	6,30
Summe	4.623.063,68	17,80

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

Zusammengefasste Vermögensaufstellung zum 28.02.2013

Investmentanteile nach Fondskategorie	Kurswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
Indexfonds	16.002.548,87	61,62
Rentenfonds	3.238.982,20	12,47
Summe	19.241.531,07	74,09

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

Vermögensaufstellung zum 28.02.2013

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 28.02.2013	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bestandspositionen							EUR	23.864.594,75	91,89	
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	4.623.063,68	17,80	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	4.623.063,68	17,80	
4,0000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2008(14) Ser. 54	BE0000314238		EUR	500			%	104,020	520.097,70	2,00
3,7500 % Berlin, Land Landessch.v.2003(2013)Ausg.159	DE0003290367		EUR	500			%	100,988	504.940,00	1,94
4,0000 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2004(14)	FR0010120410		EUR	500			%	105,986	529.929,75	2,04
Deut. Börse Commodities GmbH Xetra-Gold IHS 2007(09/Und)	DE000A0S9GB0		STK	27.800		8.200	EUR	39,210	1.090.038,00	4,20
3,2500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2009(14)	EU000A0T74M4		EUR	500			%	105,195	525.977,40	2,03
3,5000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2009(16)	XS0425743506		EUR	500			%	109,388	546.938,05	2,11
3,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2005 (2015)	DE0002760956		EUR	500			%	107,632	538.159,90	2,07
4,5000 % Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2007(14)	XS0300112108		EUR	350			%	104,852	366.982,88	1,41
Investmentanteile							EUR	19.241.531,07	74,09	
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	19.241.531,07	74,09	
AGIF VII-All.PIM.Emerg.Mkts Bd Inhaber-Anteile I-EUR o.N.	IE0034110852		ANT	8.420	8.420		EUR	130,160	1.095.947,20	4,22
Amundi ETF MSCI Nordic Actions au Porteur o.N.	FR0010655738		ANT	1.600	2.400	800	EUR	243,930	390.288,00	1,50
ComStage ETF-MSCI North Amer. Inhaber-Anteile I o.N.	LU0392494992		ANT	24.900		15.200	EUR	31,090	774.141,00	2,98
db x-tr.II-IBO.So.Eu.Z.U.ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290355717		ANT	1.730		7.270	EUR	189,080	327.108,40	1,26
db x-tr.II-iBoxx Ger.C. ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0321463506		ANT	16.600			EUR	184,090	3.055.894,00	11,77
db x-tr.II-iBoxx Gl.Inf.-L.ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290357929		ANT	5.350	2.700	4.950	EUR	203,500	1.088.725,00	4,19
Fr.Temp.Inv.Fds -T.Gl.Bd Fd Namens-Ant.I(acc.)EUR-H1 o.N.	LU0316492775		ANT	94.200	94.200		EUR	17,100	1.610.820,00	6,20
iSh. eb.rexx Jumbo Pfandbriefe Inhaber-Anteile	DE0002635265		ANT	21.700			EUR	107,380	2.330.146,00	8,97
iShares DAX (DE) Inhaber-Anteile	DE0005933931		ANT	8.000	8.000		EUR	69,480	555.840,00	2,14
iShares PLC-MSCI Europe ex-UK Bearer Shares (Dt. Zert.) o.N.	DE000A0J2094		ANT	40.700	58.200	17.500	EUR	22,320	908.424,00	3,50
iShares-Mar.iB.EO Corporate Bd Bearer Shares (Dt. Zert.) o.N.	DE0002511243		ANT	16.000			EUR	127,520	2.040.320,00	7,86
Oaktree (L.)Fds-Gl.Hi.Yi.Bd.Fd Actions Nom.H-EUR GB Cap. o.N.	LU0854924387		ANT	4.500	10.200	5.700	EUR	118,270	532.215,00	2,05
RBS MKT ACC.-Rog.Int.Com.I.ETF Inhaber-Anteile o.N.	LU0249326488		ANT	26.000	26.000		EUR	26,110	678.860,00	2,61
Source Mkts-ST.Eur.Mid200S.ETF Registered Shares Class A o.N.	IE00B60SX063		ANT	16.200		1.100	EUR	49,040	794.448,00	3,06
SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF Registered Shares o.N.	IE00B466KX20		ANT	7.680	7.680		EUR	37,400	287.232,00	1,11
SSgA I-Eur.ex UK Idx Real Est. Actions Port. I (4 Déc.) o.N.	FR0010596692		ANT	1.950	1.950		EUR	278,370	542.821,50	2,09
CS ETF(IE)on MSCI UK Registered Shares o.N.	IE00B539F030		ANT	4.500			GBP	75,980	394.815,24	1,52
CS ETF(IE)on MSCI Jap.Smal.Cap Registered Shares o.N.	IE00B3VWMK93		ANT	1.200	1.200		JPY	9.698,000	96.915,39	0,37
CS ETF(IE)on MSCI Japan Registered Shares o.N.	IE00B53QDK08		ANT	3.800	3.800		JPY	9.028,000	285.696,20	1,10
CS ETF(Lux) on MSCI Emer.Mrks Inhaber-Anteile o.N.	LU0254097446		ANT	14.000			USD	108,810	1.161.967,96	4,47
SPDR S&P 400 US Mid Cap ETF Registered Shares o.N.	IE00B4YBJ215		ANT	12.600	12.600		USD	30,060	288.906,18	1,11
Summe Wertpapiervermögen							EUR	23.864.594,75	91,89	

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

Vermögensaufstellung zum 28.02.2013

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Wkg. in 1.000	Bestand 28.02.2013	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.040.712,54	7,86
Bankguthaben							EUR	2.040.712,54	7,86
Guthaben bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA									
Guthaben in Fondswährung							EUR	2.034.719,74	7,83
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							JPY	5.464,81	0,02
							USD	527,99	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	99.070,80	0,38
Zinsansprüche							EUR	83.557,60	0,32
Ansprüche auf Ausschüttung							EUR	15.513,20	0,06
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-33.014,11	-0,13
Depotbankvergütung							EUR	-711,84	0,00
Verwaltungsvergütung							EUR	-32.302,27	-0,12
Fondsvermögen							EUR	25.971.363,98	100,00 *)
Anteilwert							EUR	107,39	
Ausgabepreis							EUR	112,76	
Anteile im Umlauf							STK	241.841	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									91,89
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									0,00

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

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

- Aktien, börsengehandelte Derivate und Investmentfonds werden, sofern vorhanden, mit handelbaren Börsenkursen (auf Schlusskursbasis) bewertet (Quelle: Bloomberg/Heimatbörse).
- Rentenpapiere werden mit handelbaren Kursen nach § 23 InvRBV (Quelle: IBOXX) bzw. mit Verkehrswerten nach § 24 InvRBV bewertet.
Quellen für diese Verkehrswertermittlungen der Bonds sind in erster Linie Bloomberg (validierte Kursstellungen diverser Broker) bzw. anerkannte externe Kursanbieter für illiquidere Rentenpapiere.
- Nicht börsennotierte Investmentfonds werden mit dem von der Investmentgesellschaft zuletzt veröffentlichten Rücknahmepreis (NAV) bewertet (Quelle: Bloomberg).
- Bankguthaben werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.

Das Sondervermögen ist teilweise in Produkten investiert, bei denen zum Abschlussstichtag infolge der Finanzmarktkrise ein liquider Markt nicht vorhanden war. Die Bewertung erfolgt insoweit mit geschätzten Zeitwerten auf der Grundlage von indikativen Broker-Quotierungen oder Bewertungsmodellen.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 27.02.2013	
Britische Pfund	(GBP)	0,8660000	= 1 EUR (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	120,0800000	= 1 EUR (EUR)
US Dollar	(USD)	1,3110000	= 1 EUR (EUR)

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

4,0000 % Frankreich EO-OAT 2003(13)	FR0000188989	EUR		250	
4,0000 % Nederlandse Waterschapsbank NV EO-Medium-Term Notes 2003(13)	XS0163939753	EUR		500	

Investmentanteile

Gruppenfremde Investmentanteile

CS ETF(IE)on NASDAQ 100 Registered Shares o.N.	IE00B53SZB19	ANT		4.500	
CS I(Lux)-Bd Em.Mkts Co.In.Gr. Namens-Anteile S EUR B o.N.	LU0592662174	ANT		10.000	
CS I(Lux)-Bond Gbl High Yield Namens-Anteile S EUR H o.N.	LU0614322724	ANT		17.900	
db x-tr.DB Hedge Fd. Index ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0328476337	ANT		73.000	
db x-track.MSCI Europe Idx.ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0274209237	ANT		45.000	
DWS Invest-Commodity Plus Inhaber-Anteile FC o.N.	LU0210304142	ANT		6.900	
JB Multibd-Emerging Bd Fd Euro Act. au Porteur C (EUR) o.N.	LU0100838936	ANT		3.000	

Halbjahresbericht zum 28. Februar 2013

Credit Suisse (D) Optima Konservativ BI

ISIN: DE000A0RC174

KAPITALANLAGEGESELLSCHAFT

Firma: BayernInvest Kapitalanlagegesellschaft mbH
Sitz: Karlstraße 35, 80333 München
Eigenmittel gem. §10 KWG: EUR 10.099.000 (28.02.2013)

GESCHÄFTSFÜHRUNG

Reinhard Moll, Sprecher
Dr. Oliver Schlick

DEPOTBANK

Firma: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Sitz: Brienner Straße 18, 80333 München
Eigenmittel gem. §10 KWG: EUR 158.730.000 (28.02.2013)

AUFSICHTSRAT

Nils Niermann, Vorsitzender	Bayerische Landesbank, München
Oliver Dressler, stv. Vorsitzender	Bayerische Landesbank, München
Dr. Rudolf Fuchs	Sparkasse Mainfranken Würzburg
Dr. Detlev Gröne	Bayerische Landesbank, München
Georg Jewgrafow	Bayerische Landesbank, München
Bernd Mayer	Bayerische Landesbank, München
Walter Pache	Sparkasse Günzburg-Krumbach
Richard Wagner	Versicherungskammer Bayern, München
Dr. Markus Thamerus	Bayerische Landesbank, München

Stand: 28. Februar 2013