
HALBJAHRESBERICHT

STADTSPARKASSE DÜSSELDORF EURORENTEN PLUS

OGAW-SONDERVERMÖGEN
NACH DEUTSCHEM RECHT

ZUM 30. JUNI 2018

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
I. Vermögensgegenstände				
1. Anleihen				
– Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	50.299.126,35	98,10	
2. Bankguthaben				
– Bankguthaben in EUR	EUR	604.288,02	1,18	
3. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	401.861,24	0,78	
II. Verbindlichkeiten				
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-31.822,26	-0,06	
III. Fondsvermögen		EUR	51.273.453,35	100,00¹

¹ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	50.299.126,35	98,10
Verzinsliche Wertpapiere									
DE0001102408	0,000% BRD Anl. 15.08.26	EUR	1.400	0	0	%	98,9658	1.385.521,62	2,70
DE000A14J3F7	0,250% Berlin LSA 22.04.25	EUR	1.000	0	0	%	99,4216	994.216,20	1,94
DE0001102440	0,500% BRD Anl. 15.02.28	EUR	1.500	1.500	0	%	101,7862	1.526.792,55	2,98
DE0001102366	1,000% BRD Anl. 15.08.24	EUR	700	0	0	%	106,9475	748.632,50	1,46
DE0001102309	1,500% BRD Anl. 15.02.23	EUR	2.000	0	0	%	108,7101	2.174.201,80	4,24
DE0001102333	1,750% BRD Anl. 15.02.24	EUR	2.100	0	0	%	111,0478	2.332.003,80	4,55
DE0001102325	2,000% BRD Anl. 15.08.23	EUR	2.000	0	0	%	111,7800	2.235.600,00	4,36
DE0001102341	2,500% BRD Anl. 15.08.46	EUR	400	0	0	%	136,6205	546.481,80	1,07
FR0013157096	0,000% Frankreich OAT 25.05.21	EUR	2.100	0	0	%	101,3025	2.127.352,50	4,15
FI4000197959	0,500% Finnland Bds. 15.04.26	EUR	500	0	0	%	101,3470	506.735,00	0,99
IT0005215246	0,650% Italien B.T.P. 15.10.23	EUR	1.500	0	0	%	93,2634	1.398.950,85	2,73
FR0013341682	0,750% Frankreich OAT 25.11.28	EUR	2.400	2.400	0	%	100,5430	2.413.032,00	4,71
BE0000334434	0,800% Belgien OBL 22.06.25	EUR	1.400	0	0	%	103,7490	1.452.486,00	2,83
BE0000335449	1,000% Belgien OBL 22.06.31	EUR	1.000	0	0	%	100,1408	1.001.407,70	1,95
FR0012938116	1,000% Frankreich OAT 25.11.25	EUR	1.400	0	0	%	105,4350	1.476.090,00	2,88
IE00BV8C9418	1,000% Irland TRB 15.05.26	EUR	700	0	0	%	103,6020	725.214,00	1,41
AT0000A1FAP5	1,200% Österreich BO 20.10.25	EUR	1.400	0	0	%	106,7935	1.495.109,00	2,92
FR0013154044	1,250% Frankreich OAT 25.05.36	EUR	1.000	0	0	%	100,5177	1.005.176,70	1,96
IT0005210650	1,250% Italien B.T.P. 01.12.26	EUR	2.000	0	0	%	90,4768	1.809.536,40	3,53
AT0000A1K9F1	1,500% Österreich BO 20.02.47	EUR	500	0	0	%	101,3563	506.781,35	0,99
FR0011486067	1,750% Frankreich OAT 25.05.23	EUR	1.400	0	0	%	109,3307	1.530.629,38	2,99
AT0000A105W3	1,750% Österreich BO 20.10.23	EUR	500	0	0	%	109,8045	549.022,50	1,07
ES00000127G9	2,150% Spanien OBL 31.10.25	EUR	700	0	0	%	108,6150	760.305,00	1,48
NL0010060257	2,250% Niederlande Anl. 15.07.22	EUR	2.100	0	0	%	110,8095	2.326.999,50	4,54
IT0005045270	2,500% Italien B.T.P. 01.12.24	EUR	1.400	0	0	%	101,2395	1.417.353,00	2,76
NL0010721999	2,750% Niederlande Anl. 15.01.47	EUR	500	0	0	%	142,2657	711.328,50	1,39
ES00000126B2	2,750% Spanien Bos. 31.10.24	EUR	1.400	0	0	%	112,7650	1.578.710,00	3,08
FR0011196856	3,000% Frankreich OAT 25.04.22	EUR	2.800	0	0	%	112,8473	3.159.723,28	6,16
FR0011059088	3,250% Frankreich OAT 25.10.21	EUR	1.400	0	0	%	112,2441	1.571.416,84	3,06
IE00B6X95T99	3,400% Irland TRB 18.03.24	EUR	500	0	0	%	118,6910	593.455,00	1,16
IT0004634132	3,750% Italien B.T.P. 01.03.21	EUR	1.400	0	0	%	106,6933	1.493.705,78	2,91
ES0000012932	4,200% Spanien OBL 31.01.37	EUR	1.000	0	0	%	133,1370	1.331.370,00	2,60
BE0000325341	4,250% Belgien OBL 28.09.22	EUR	1.400	0	0	%	119,4728	1.672.618,50	3,26
IT0004423957	4,500% Italien B.T.P. 01.03.19	EUR	2.400	0	0	%	102,8068	2.467.363,20	4,81
IT0004889033	4,750% Italien Bds. 01.09.28	EUR	1.000	0	0	%	116,2182	1.162.182,10	2,27
ES00000122T3	4,850% Spanien Bos. 31.10.20	EUR	100	0	1.400	%	111,6220	111.622,00	0,22
Summe Wertpapiervermögen							EUR	50.299.126,35	98,10

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben				EUR	604.288,02	1,18
EUR-Guthaben bei:						
BNP PARIBAS Securities Services S.C.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)	EUR	604.288,02	%	100,0000	604.288,02	1,18
Sonstige Vermögensgegenstände				EUR	401.861,24	0,78
Zinsansprüche	EUR	401.861,24			401.861,24	0,78
Sonstige Verbindlichkeiten				EUR	-31.822,26	-0,06
Kostenabgrenzung	EUR	-31.822,26			-31.822,26	-0,06
Fondsvermögen				EUR	51.273.453,35	100,00 ²
Anteilwert				EUR	109,73	
Umlaufende Anteile				STK	467.276	

² Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
IT0005142143	0,650% Italien B.T.P. 01.11.20	EUR	0	1.400

Derivate
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Zins-Derivate				
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			37
Euro Bund Future)				

Sondervermögen Stadtparkasse Düsseldorf EuroRenten Plus

Mindestanlagesumme	keine
Fondsauflage	03.09.2007
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%; derzeit 3,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	bis zu 0,50% mindestens 75.000 EUR; derzeit 0,08% mindestens 75.000 EUR
Stückelung	Globalkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend
Währung	EUR
ISIN	DE0009777623

Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

Anteilwert	EUR	109,73
Umlaufende Anteile	STK	467.276

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der Société Générale Securities Services GmbH mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses bei der Société Générale Securities Services GmbH einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand einer weiteren unabhängigen Modellierung verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Für die im Sondervermögen Stadtparkasse Düsseldorf EuroRenten Plus zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

- 98,10% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse
- 0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (unter anderem anhand der Quelle Interactive Data, indikativer Quotes bzw. Bewertungsmodellen).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder – sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist – auf Basis von Börsenkursen.

Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.
