

HALBJAHRESBERICHT STADTSPARKASSE DÜSSELDORF EURORENTEN PLUS

OGAW-Sondervermögen nach deutschem Recht

zum 30.06.2019

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2019

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen			
– Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	52.710.783,61	99,04
2. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	265.214,43	0,50
3. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	299.152,34	0,56
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-51.380,23	-0,10
III. Fondsvermögen		EUR	53.223.770,15
			100,00¹

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	51.150.858,61	96,11
Verzinsliche Wertpapiere								
DE000A14J3F7	0,250% Berlin LSA 22.04.25	EUR	1.000	0	0	% 102,8882	1.028.882,30	1,93
DE0001102366	1,000% BRD Anl. 15.08.24	EUR	2.700	0	0	% 108,5816	2.931.703,47	5,51
DE0001102333	1,750% BRD Anl. 15.02.24	EUR	2.100	0	0	% 111,4174	2.339.765,40	4,40
DE0001102341	2,500% BRD Anl. 15.08.46	EUR	1.500	1.500	1.000	% 159,6994	2.395.490,70	4,50
FR0013157096	0,000% Frankreich OAT 25.05.21	EUR	2.100	0	0	% 101,2756	2.126.788,23	4,00
FI4000197959	0,500% Finnland Bds. 15.04.26	EUR	500	0	0	% 105,6393	528.196,65	0,99
FI4000348727	0,500% Finnland Bds. 15.09.28	EUR	1.000	1.000	0	% 105,6528	1.056.528,30	1,99
AT0000A269M8	0,500% Oesterreich MTN 20.02.29	EUR	1.500	1.500	0	% 105,2482	1.578.722,55	2,97
SK4120012220	0,625% Slowakei Anl. 22.05.26	EUR	1.000	1.000	0	% 105,0380	1.050.380,00	1,97
IT0005215246	0,650% Italien B.T.P. 15.10.23	EUR	1.500	0	0	% 98,1435	1.472.153,10	2,77
FR0013341682	0,750% Frankreich OAT 25.11.28	EUR	1.200	0	1.200	% 107,5108	1.290.129,60	2,42
BE0000334434	0,800% Belgien OBL 22.06.25	EUR	1.400	0	0	% 106,7268	1.494.175,62	2,81
BE0000335449	1,000% Belgien OBL 22.06.31	EUR	1.000	0	0	% 108,9832	1.089.832,20	2,05
IE00BV8C9418	1,000% Irland TRB 15.05.26	EUR	700	0	0	% 107,9445	755.611,50	1,42
AT0000A1FAP5	1,200% Österreich BO 20.10.25	EUR	1.400	0	0	% 110,1652	1.542.312,38	2,90
IT0005210650	1,250% Italien B.T.P. 01.12.26	EUR	2.000	0	0	% 97,3545	1.947.091,00	3,66
ES0000012E51	1,450% Spanien Bos. 30.04.29	EUR	700	700	0	% 110,0845	770.591,50	1,45
FR0012993103	1,500% Frankreich OAT 25.05.31	EUR	1.500	1.500	0	% 115,7290	1.735.935,30	3,26
AT0000A1K9F1	1,500% Österreich BO 20.02.47	EUR	500	0	0	% 120,6180	603.090,10	1,13
BE0000338476	1,600% Belgien OBL 22.06.47	EUR	1.500	1.500	0	% 116,5490	1.748.235,00	3,28
SK4120011420	1,625% Slowakei Anl. 21.01.31	EUR	700	700	0	% 114,0071	798.049,91	1,50
FR0011486067	1,750% Frankreich OAT 25.05.23	EUR	1.400	0	0	% 109,3284	1.530.598,16	2,88
AT0000A105W3	1,750% Österreich BO 20.10.23	EUR	500	0	0	% 110,0569	550.284,40	1,03
XS1130139667	2,125% Litauen MTN 29.10.26	EUR	1.000	1.000	0	% 114,5240	1.145.240,00	2,15
PTOTEVOE0018	2,125% Portugal Obr. 17.10.28	EUR	700	700	0	% 115,9113	811.379,31	1,52
SI0002103545	2,125% Slowenien Bds. 28.07.25	EUR	1.000	1.000	0	% 114,0165	1.140.165,00	2,14
ES00000127G9	2,150% Spanien OBL 31.10.25	EUR	700	0	0	% 113,4358	794.050,39	1,49
IT0005045270	2,500% Italien B.T.P. 01.12.24	EUR	1.400	0	0	% 105,4518	1.476.325,48	2,77

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
IT0005345183	2,500% Italien B.T.P. 15.11.25	EUR	1.700	1.700	0	% 105,3746	1.791.368,71	3,37
NL0010721999	2,750% Niederlande Anl. 15.01.47	EUR	1.200	0	0	% 164,7615	1.977.138,12	3,71
PTOTEKOE0011	2,875% Portugal Obr. 15.10.25	EUR	1.000	1.000	0	% 117,7590	1.177.590,00	2,21
FR0011196856	3,000% Frankreich OAT 25.04.22	EUR	2.300	0	500	% 110,4728	2.540.874,86	4,77
IE00B6X95T99	3,400% Irland TRB 18.03.24	EUR	500	0	0	% 118,0163	590.081,65	1,11
IT0004634132	3,750% Italien B.T.P. 01.03.21	EUR	1.400	0	0	% 105,9175	1.482.844,44	2,79
NL0000102234	4,000% Niederlande Anl. 15.01.37	EUR	1.500	1.500	0	% 167,4523	2.511.784,80	4,72
IT0004889033	4,750% Italien Bds. 01.09.28	EUR	1.000	0	0	% 124,0400	1.240.399,80	2,33
ES00000122T3	4,850% Spanien Bos. 31.10.20	EUR	100	0	0	% 107,0687	107.068,68	0,20
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	1.559.925,00	2,93
Verzinsliche Wertpapiere								
NL0013332430	0,250% Niederlande Anl. 15.07.29	EUR	1.500	1.500	0	% 103,9950	1.559.925,00	2,93
Summe Wertpapiervermögen						EUR	52.710.783,61	99,04
Bankguthaben						EUR	265.214,43	0,50
EUR-Guthaben bei:								
BNP PARIBAS Securities Services S.C.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	265.214,43			% 100,0000	265.214,43	0,50
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	299.152,34	0,56
Zinsansprüche		EUR	299.152,34				299.152,34	0,56
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-51.380,23	-0,10
Kostenabgrenzung		EUR	-51.380,23				-51.380,23	-0,10
Fondsvermögen						EUR	53.223.770,15	100,00²
Anteilwert						EUR	112,81	
Umlaufende Anteile						STK	471.816	

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				
DE0001102408	0,000% BRD Anl. 15.08.26	EUR	0	1.400
DE0001102440	0,500% BRD Anl. 15.02.28	EUR	0	1.500
DE0001102309	1,500% BRD Anl. 15.02.23	EUR	0	2.000
DE0001102325	2,000% BRD Anl. 15.08.23	EUR	0	2.000
FR0012938116	1,000% Frankreich OAT 25.11.25	EUR	0	1.400
FR0013154044	1,250% Frankreich OAT 25.05.36	EUR	0	1.000
NL0010060257	2,250% Niederlande Anl. 15.07.22	EUR	0	1.400
FR0011059088	3,250% Frankreich OAT 25.10.21	EUR	0	1.400
BE0000325341	4,250% Belgien OBL 28.09.22	EUR	0	1.400
IT0004423957	4,500% Italien B.T.P. 01.03.19	EUR	0	2.400

Sondervermögen Stadtparkasse Düsseldorf EuroRenten Plus

Mindestanlagesumme	keine
Fondsaufgabe	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	Globalurkunde
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	112,81
Umlaufende Anteile	STK	471.816

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:

- 99,04% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse
- 0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (u.a. 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.
