
HALBJAHRESBERICHT

STADTSPARKASSE DÜSSELDORF NRW-FONDS

OGAW-SONDERVERMÖGEN
NACH DEUTSCHEM RECHT

ZUM 31. DEZEMBER 2018

Vermögensaufstellung zum 31.12.2018

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien			
– Deutschland	EUR	10.695.081,26	4,66
– Euro-Länder	EUR	22.963.296,84	10,00
– Sonstige EU/EWR-Länder	EUR	15.797.821,63	6,88
– Nicht EU/EWR-Länder	EUR	10.162.592,46	4,42
2. Anleihen			
– Pfandbriefe	EUR	11.578.132,23	5,04
– Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	122.788.439,92	53,46
– Unternehmensanleihen	EUR	25.415.910,47	11,06
3. Investmentanteile			
– Indexfonds	EUR	1.041.500,00	0,45
4. Derivate			
– Futures (Verkauf)	EUR	13.200,00	0,01
5. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	5.113.183,76	2,23
– Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	2.780.795,71	1,21
– Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	977,68	0,00
6. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	1.540.788,75	0,67
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-203.275,67	-0,09
III. Fondsvermögen		EUR	229.688.445,04
			100,00¹

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

Vermögensaufstellung zum 31.12.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	218.329.603,36	95,05	
Aktien									
Automobilhersteller und Zulieferer									
DE0005190003	BMW AG	STK	11.600	0	0	EUR	70,7000	820.120,00	0,36
DE0007100000	Daimler AG	STK	17.000	0	0	EUR	45,9100	780.470,00	0,34
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	STK	29.000	0	0	EUR	12,6820	367.778,00	0,16
FR0000121501	Peugeot S.A.	STK	16.000	16.000	0	EUR	18,2600	292.160,00	0,13
FR0000131906	Renault S.A.	STK	5.000	0	0	EUR	54,0300	270.150,00	0,12
Banken									
CH0244767585	UBS Group AG	STK	50.000	0	0	CHF	12,2350	543.512,06	0,24
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) S.A.	STK	106.711	0	0	EUR	4,6410	495.245,75	0,22
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	100.000	0	0	EUR	3,9450	394.500,00	0,17
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	17.400	0	0	EUR	39,3750	685.125,00	0,30
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK	68.400	0	0	EUR	9,3580	640.087,20	0,28
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	250.000	0	0	EUR	1,9398	484.950,00	0,21
GB0031348658	Barclays PLC	STK	200.000	0	0	GBP	1,5014	333.089,30	0,15
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	249.900	0	0	GBP	6,5020	1.802.384,69	0,78
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	465.000	0	0	GBP	0,5121	264.144,76	0,12
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken A.B. A	STK	54.400	54.400	0	SEK	86,1000	456.014,60	0,20
Bauwesen und Materialien									
DK0010219153	Rockwool International A.S. B	STK	1.300	1.300	0	DKK	1.700,0000	295.953,08	0,13
ES0167050915	ACS, Actividades de Construcción y Servicios, S.A.	STK	16.500	0	0	EUR	32,8500	542.025,00	0,24
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	5.100	5.100	0	EUR	72,1200	367.812,00	0,16
FR0000125486	Vinci S.A.	STK	10.000	0	0	EUR	71,9600	719.600,00	0,31
Chemie									
FR0000120073	Air Liquide S.A. Ét. Expl. P. G. Cl.	STK	6.600	0	0	EUR	106,2500	701.250,00	0,31
DE000BASF111	BASF SE	STK	12.900	0	9.000	EUR	60,4000	779.160,00	0,34
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.	STK	8.400	0	0	EUR	69,9000	587.160,00	0,26
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	2.772	2.772	0	EUR	138,5500	384.060,60	0,17
DE000SYM9999	Symrise AG	STK	6.500	6.500	0	EUR	64,5000	419.250,00	0,18
Einzelhandel									
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.V.	STK	26.000	0	0	EUR	22,0650	573.690,00	0,25
GB0032089863	Next Group PLC	STK	9.000	0	0	GBP	40,4800	404.126,46	0,18
Energieversorgung									
DE0007037129	RWE AG	STK	31.000	0	0	EUR	18,9650	587.915,00	0,26
Erdöl und Erdgas									
IT0003132476	Eni S.p.A.	STK	26.839	0	0	EUR	13,7480	368.982,57	0,16
FI0009013296	Neste Oyj	STK	6.800	6.800	0	EUR	67,3600	458.048,00	0,20
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	20.929	0	0	EUR	14,1650	296.459,29	0,13
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell PLC A	STK	30.900	0	0	EUR	25,5050	788.104,50	0,34
FR0000120271	Total S.A.	STK	45.800	0	0	EUR	46,0850	2.110.693,00	0,92
GB0007980591	BP PLC	STK	255.000	0	0	GBP	5,0270	1.421.946,76	0,62
NO0010096985	Equinor ASA	STK	26.000	0	0	NOK	183,7500	478.388,65	0,21
Finanzdienstleistungen									
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK	2.100	0	0	EUR	104,9500	220.395,00	0,10

Vermögensaufstellung zum 31.12.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Gesundheit								
CH0013841017	Lonza Group AG	STK	1.700	1.700	0	CHF 254,7000	384.691,93	0,17
CH0012005267	Novartis AG	STK	40.000	20.000	0	CHF 84,0400	2.986.628,76	1,30
CH0012032113	Roche Holding AG	STK	767	0	0	CHF 239,4000	163.137,84	0,07
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	20.000	0	0	DKK 297,9000	797.868,07	0,35
DE000BAY0017	Bayer AG	STK	10.000	0	0	EUR 60,5600	605.600,00	0,26
FR0010259150	Ipsen S.A.	STK	2.600	2.600	0	EUR 109,2000	283.920,00	0,12
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK	5.400	0	0	EUR 30,6950	165.753,00	0,07
DE0006599905	Merck KGaA	STK	1.000	0	0	EUR 89,9800	89.980,00	0,04
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	21.600	4.300	0	EUR 75,2200	1.624.752,00	0,71
BE0003739530	UCB S.A.	STK	4.300	4.300	0	EUR 71,4800	307.364,00	0,13
GB0009895292	Astrazeneca PLC	STK	17.000	0	0	GBP 58,5400	1.103.915,70	0,48
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC	STK	74.100	0	0	GBP 15,0700	1.238.698,84	0,54
Immobilien								
SE0000379190	Castellum A.B.	STK	31.300	31.300	0	SEK 163,3500	497.783,13	0,22
Industriegüter und Dienstleistungen								
CH0012221716	ABB Ltd.	STK	15.000	0	0	CHF 18,6950	249.144,86	0,11
NL0000235190	Airbus SE	STK	4.000	0	0	EUR 83,7600	335.040,00	0,15
FR0010220475	Alstom S.A.	STK	14.500	0	0	EUR 34,8800	505.760,00	0,22
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	10.000	0	0	EUR 31,7600	317.600,00	0,14
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	STK	2.600	2.600	0	EUR 158,4000	411.840,00	0,18
FR0000073272	Safran S.A.	STK	6.700	4.200	0	EUR 103,1000	690.770,00	0,30
DE0007165607	Sartorius AG	STK	2.900	2.900	0	EUR 96,0000	278.400,00	0,12
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	8.300	0	0	EUR 59,3200	492.356,00	0,21
DE0007236101	Siemens AG	STK	14.900	0	0	EUR 97,3800	1.450.962,00	0,63
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC	STK	15.000	0	0	EUR 23,0200	345.300,00	0,15
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	30.000	0	0	GBP 13,7450	457.404,33	0,20
SE0000667891	Sandvik A.B.	STK	28.800	0	0	SEK 126,3500	354.278,20	0,15
Konsumgüter und Haushaltswaren								
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK	1.700	0	1.700	EUR 182,4000	310.080,00	0,14
FR0000120321	L'Oreal S.A.	STK	3.000	0	0	EUR 198,1000	594.300,00	0,26
FR0000121014	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	STK	4.000	0	0	EUR 252,4500	1.009.800,00	0,44
NL0000009355	Unilever N.V. CVA	STK	23.500	0	0	EUR 46,8850	1.101.797,50	0,48
GB0002875804	British American Tobacco PLC	STK	22.000	0	0	GBP 25,6900	626.932,89	0,27
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group PLC	STK	2.500	0	0	GBP 60,6600	168.219,63	0,07
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	20.000	15.000	0	GBP 41,2500	915.141,43	0,40
Nahrungsmittel und Getränke								
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	37.500	12.500	0	CHF 79,8000	2.658.700,19	1,16
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev SA/NV	STK	8.282	0	0	EUR 57,5000	476.215,00	0,21
FR0000120644	Danone S.A.	STK	4.000	0	0	EUR 60,6700	242.680,00	0,11
ES0184262212	Viscofan S.A.	STK	16.600	7.600	0	EUR 47,4600	787.836,00	0,34
GB0002374006	Diageo PLC	STK	35.000	0	0	GBP 27,8750	1.082.224,07	0,47
Rohstoffe								
JE00B4T3BW64	Glencore PLC	STK	153.400	0	70.000	GBP 2,9000	493.466,44	0,21
GB0007188757	Rio Tinto PLC	STK	23.500	0	0	GBP 37,6250	980.795,90	0,43
SE0011088665	Boliden AB (Post Split)	STK	15.900	0	0	SEK 191,9800	297.187,00	0,13

Vermögensaufstellung zum 31.12.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Technologie									
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	6.000	0	0	EUR	136,6200	819.720,00	0,36
FR0000125338	Capgemini SE	STK	2.700	0	0	EUR	85,9200	231.984,00	0,10
DE0007164600	SAP SE	STK	12.000	0	0	EUR	86,9300	1.043.160,00	0,45
Telekommunikation									
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK	58.443	0	0	EUR	14,8200	866.125,26	0,38
FI0009007884	Elisa Oyj A	STK	7.100	0	0	EUR	36,0800	256.168,00	0,11
ES0178430E18	Telefonica S.A.	STK	51.800	0	0	EUR	7,3780	382.180,40	0,17
GB0030913577	BT Group PLC	STK	35.000	0	0	GBP	2,3835	92.537,44	0,04
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC	STK	225.000	0	0	GBP	1,5458	385.806,99	0,17
Versicherungen									
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	2.000	0	0	CHF	293,1000	520.812,05	0,23
DE0008404005	Allianz SE	STK	11.600	0	0	EUR	175,1400	2.031.624,00	0,88
NL0011872643	ASR Nederland N.V.	STK	12.400	12.400	0	EUR	34,5800	428.792,00	0,19
FR0000120628	AXA S.A.	STK	20.000	0	0	EUR	18,7800	375.600,00	0,16
FR0000120222	CNP Assurances S.A.	STK	24.000	0	0	EUR	18,3100	439.440,00	0,19
GB0007099541	Prudential PLC	STK	36.000	0	0	GBP	13,8950	554.875,21	0,24
Verzinsliche Wertpapiere									
DE0001102408	0,000% BRD Anl. 15.08.26	EUR	15.000	0	0	%	99,9844	14.997.667,50	6,53
DE0001102374	0,500% BRD Anl. 15.02.25	EUR	7.250	7.250	0	%	104,0834	7.546.049,76	3,29
DE0001102390	0,500% BRD Anl. 15.02.26	EUR	10.000	0	0	%	103,9520	10.395.200,00	4,53
DE0001102440	0,500% BRD Anl. 15.02.28	EUR	5.000	0	0	%	102,9242	5.146.210,00	2,24
DE0001102424	0,500% BRD Anl. 15.08.27	EUR	8.000	0	0	%	103,3664	8.269.314,40	3,60
DE000NWB0584	0,500% NRW.BANK IHS 11.05.26	EUR	1.000	0	0	%	100,7483	1.007.483,30	0,44
DE0001102366	1,000% BRD Anl. 15.08.24	EUR	7.500	7.500	0	%	106,9224	8.019.177,00	3,49
DE000A13R8M3	1,375% Metro MTN 28.10.21	EUR	2.000	0	0	%	101,0700	2.021.400,00	0,88
DE0001102309	1,500% BRD Anl. 15.02.23	EUR	1.000	0	0	%	107,9902	1.079.901,55	0,47
DE000A1X2301	1,500% Bund-Länder-Anleihe SA 15.07.20	EUR	4.500	0	0	%	103,0238	4.636.070,10	2,02
DE0001102333	1,750% BRD Anl. 15.02.24	EUR	8.200	0	0	%	110,4650	9.058.131,23	3,94
DE000A1R0XG3	2,000% BASF MTN 05.12.22	EUR	2.000	0	0	%	106,8029	2.136.058,50	0,93
DE000A1R07S9	2,125% KfW Anl. 15.08.23	EUR	5.000	0	0	%	110,2130	5.510.650,00	2,40
XS0977496636	2,750% Deutsche Post MTN 09.10.23	EUR	2.600	0	0	%	110,5402	2.874.046,24	1,25
DE000NRW0CN5	3,500% Nordrhein-Westfalen LSA 07.07.21	EUR	2.500	0	0	%	109,6172	2.740.431,25	1,19
DE000NRW10D9	4,125% Nordrhein-Westfalen LSA 13.03.19	EUR	1.000	0	0	%	100,8700	1.008.700,00	0,44
FI4000197959	0,500% Finnland Bds. 15.04.26	EUR	1.000	0	0	%	102,0058	1.020.058,35	0,44
FR0012517027	0,500% Frankreich OAT 25.05.25	EUR	4.000	0	0	%	101,8120	4.072.479,00	1,77
FR0013131877	0,500% Frankreich OAT 25.05.26	EUR	2.000	0	0	%	101,0695	2.021.390,40	0,88
NL0011819040	0,500% Niederlande Anl. 15.07.26	EUR	3.000	0	0	%	102,6621	3.079.862,55	1,34
IT0005142143	0,650% Italien B.T.P. 01.11.20	EUR	1.500	0	0	%	100,2918	1.504.376,70	0,65
XS1396261338	0,750% BMW Finance MTN 15.04.24	EUR	2.500	0	0	%	98,6943	2.467.357,00	1,07
BE0000334434	0,800% Belgien OBL 22.06.25	EUR	3.000	0	0	%	103,3130	3.099.390,00	1,35
FR0012938116	1,000% Frankreich OAT 25.11.25	EUR	2.000	0	0	%	104,9598	2.099.196,70	0,91
AT0000A1FAP5	1,200% Österreich BO 20.10.25	EUR	3.000	0	0	%	107,2467	3.217.399,95	1,40
XS1140300663	1,500% Verbund Nts. 20.11.24	EUR	1.800	0	0	%	104,8468	1.887.242,40	0,82
AT0000A185T1	1,650% Österreich Obl. 21.10.24	EUR	2.000	0	0	%	109,7747	2.195.493,40	0,96

Vermögensaufstellung zum 31.12.2018

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
FR0011962398	1,750% Frankreich OAT 25.11.24	EUR	2.000	0	0	%	109,6391	2.192.782,70	0,95
ES0413211816	2,250% BBVA CEH 10.06.24	EUR	2.400	0	0	%	109,9815	2.639.556,00	1,15
XS0832628423	2,250% EIB MTN 14.10.22	EUR	2.400	0	0	%	109,3845	2.625.228,00	1,14
FR0011619436	2,250% Frankreich OAT 25.05.24	EUR	1.500	0	0	%	112,0059	1.680.089,18	0,73
BE0000332412	2,600% Belgien OBL 22.06.24	EUR	1.500	0	0	%	113,6756	1.705.133,78	0,74
XS0748631164	2,625% EIB MTN 16.03.20	EUR	2.500	0	0	%	103,7674	2.594.185,00	1,13
BE6243179650	2,875% Anheuser-Busch InBev MTN 25.09.24	EUR	2.000	0	0	%	110,0458	2.200.916,70	0,96
DK0009922676	3,000% Dänemark Anl. 15.11.21	DKK	7.800	0	0	%	110,1200	1.150.247,74	0,50
IT0004988553	3,000% UniCredit MTN 31.01.24	EUR	2.400	0	0	%	111,0837	2.666.007,96	1,16
IE00B6X95T99	3,400% Irland TRB 18.03.24	EUR	1.000	0	0	%	116,8369	1.168.368,75	0,51
IT0004872328	3,625% Intesa Sanpaolo HPF 05.12.22	EUR	3.000	0	0	%	112,1521	3.364.564,35	1,46
XS0975256685	3,625% Repsol International Finance MTN 07.10.21	EUR	2.000	0	0	%	109,3183	2.186.366,80	0,95
XS0874864860	3,987% Telefonica Emisiones MTN 23.01.23	EUR	2.500	0	0	%	113,4942	2.837.354,88	1,24
ES0413211071	4,000% BBVA CEH 25.02.25	EUR	2.400	0	0	%	121,1668	2.908.003,92	1,27
XS0543882095	4,000% Polen MTN 23.03.21	EUR	2.400	0	0	%	109,1628	2.619.906,00	1,14
IT0004644735	4,500% Italien B.T.P. 01.03.26	EUR	1.500	0	0	%	114,3153	1.714.728,75	0,75
XS0677389347	4,500% Koninklijke KPN MTN 04.10.21	EUR	2.500	0	0	%	111,5550	2.788.875,00	1,21
IT0004695075	4,750% Italien B.T.P. 01.09.21	EUR	1.200	0	0	%	109,7915	1.317.497,88	0,57
XS0842659426	4,875% ENEL Finance International MTN 17.04.23	EUR	2.500	0	0	%	117,7849	2.944.621,50	1,28
IT0004848831	5,500% Italien B.T.P. 01.11.22	EUR	2.000	0	0	%	114,7819	2.295.639,00	1,00
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Gesundheit									
CH0012032048	Roche Holding AG GEN	STK	10.000	7.000	0	CHF	243,4000	2.162.498,33	0,94
Andere Wertpapiere									
Erdöl und Erdgas									
ES06735169D7	Repsol S.A. ANR	STK	20.929	20.929	0	EUR	0,4010	8.392,53	0,00
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	1.071.671,45	0,47
Verzinsliche Wertpapiere									
XS1084563615	1,750% Robert Bosch MTN 08.07.24	EUR	1.000	0	0	%	107,1671	1.071.671,45	0,47
Investmentanteile							EUR	1.041.500,00	0,45
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile									
DE000ETFL441	Deka MDAX UCITS ETF	ANT	5.000	0	0	EUR	208,3000	1.041.500,00	0,45
Summe Wertpapiervermögen²							EUR	220.442.774,81	95,97

Vermögensaufstellung zum 31.12.2018

Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
Aktienindex-Derivate						EUR	30.000,00	0,02
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Aktienindex-Terminkontrakte								
EURO STOXX 50 Index Future 03/19	EDT	EUR	Anzahl -1.250				30.000,00	0,02
Zins-Derivate						EUR	-16.800,00	-0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsterminkontrakte								
6,000% Euro Bund Future 03/19	EDT	EUR	-2.000.000				-16.800,00	-0,01
Bankguthaben						EUR	7.894.957,15	3,44
EUR-Guthaben bei:								
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale (Verwahrstelle)		EUR	5.113.183,76			% 100,0000	5.113.183,76	2,23
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)								
		GBP	2.504.719,87			% 100,0000	2.778.391,43	1,21
		NOK	24.010,75			% 100,0000	2.404,28	0,00
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)		CHF	1.100,43			% 100,0000	977,68	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	1.540.788,75	0,67
Dividendenansprüche		EUR	88.119,18				88.119,18	0,04
Quellensteueransprüche		EUR	230.966,51				230.966,51	0,10
Zinsansprüche		EUR	1.221.703,06				1.221.703,06	0,53
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-203.275,67	-0,09
Kostenabgrenzung		EUR	-190.075,67				-190.075,67	-0,08
Variation Margin		EUR	-13.200,00				-13.200,00	-0,01
Fondsvermögen							229.688.445,04	100,00 ³
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I						EUR	60,73	
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R						EUR	51,44	
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I						STK	3.371.000	
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R						STK	485.497	

² Die Wertpapiere und Schuldscheinanleihen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

³ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**Devisenkurse (in Mengennotiz)**

		per 28.12.2018		
Britische Pfund	(GBP)	0,901500	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,467400	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	9,986650	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,271250	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,125550	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörse

EDT EUREX Terminbörse Deutschland

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Automobilhersteller und Zulieferer				
DE0005439004	Continental AG	STK	0	1.200
DE0007664039	VW AG VZ	STK	0	3.000
Banken				
CH0012138530	Credit Suisse Group AG	STK	0	17.500
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	0	4.800
Erdöl und Erdgas				
SE0000825820	Lundin Petroleum A.B.	STK	0	24.000
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell PLC A	STK	0	18.900
Industriegüter und Dienstleistungen				
FR0000121725	Dassault Aviation S.A.	STK	0	150
DE0005565204	Dürr AG	STK	0	4.000
DE0007472060	Wirecard AG	STK	0	3.500
Konsumgüter und Haushaltswaren				
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	STK	0	5.700
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA VZ	STK	0	2.000
FR0000052292	Hermes International S.A.	STK	0	292
DE000A1PHFF7	Hugo Boss AG	STK	0	6.000
GB0004544929	Imperial Brands PLC	STK	0	4.000
Medien				
GB0006776081	Pearson PLC	STK	0	58.000
Technologie				
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK	0	8.000
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK	0	13.000
FI0009000681	Nokia Corp.	STK	0	35.000
Verzinsliche Wertpapiere				
ES00000124W3	3,800% Spanien Bos. 30.04.24	EUR	0	3.200
IT0004953417	4,500% Italien B.T.P. 01.03.24	EUR	0	3.200
ES00000122T3	4,850% Spanien Bos. 31.10.20	EUR	0	1.200
ES00000123U9	5,400% Spanien Bos. 31.01.23	EUR	0	2.000

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
Andere Wertpapiere				
Banken				
ES06139009R7	Banco Santander S.A. ANR	STK	100.000	100.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Aktien				
Chemie				
DE000A2E4L75	Linde AG	STK	0	1.800

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
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			31.263
DAX Index Future, EURO STOXX 50 Index Future)				
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			3.206
Euro Bund Future)				

Sondervermögen Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Anteilklassen-Bezeichnung	I	R
Mindestanlagesumme	95.000	keine
Fondsaufgabe	15.02.2002	05.09.2007
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%; derzeit 5,00%	bis zu 5,00%; derzeit 5,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	bis zu 0,90%; derzeit 0,90%	bis zu 1,35%; derzeit 1,35%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE0006636475	DE000A0MYG04

Anhang gem. §7 Nr. 9 KARBV

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

Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I	EUR	60,73
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R	EUR	51,44
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I	STK	3.371.000
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R	STK	485.497

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 NRW-Fonds zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

95,97% 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.
