

HALBJAHRESBERICHT STADTSPARKASSE DÜSSELDORF NRW-FONDS

OGAW-Sondervermögen nach deutschem Recht
zum 31.12.2019

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.12.2019

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien			
– Deutschland	EUR	14.034.748,51	5,53
– Euro-Länder	EUR	30.234.342,81	11,92
– Sonstige EU/EWR-Länder	EUR	16.468.889,43	6,49
– Nicht EU/EWR-Länder	EUR	12.315.932,95	4,86
2. Anleihen			
– Pfandbriefe	EUR	16.104.831,37	6,35
– Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	95.469.844,76	37,65
– Unternehmensanleihen	EUR	59.186.934,43	23,34
3. Investmentanteile			
– Indexfonds	EUR	1.360.000,00	0,54
4. Derivate			
– Optionsrechte (Kauf)	EUR	10.930,50	0,00
– Futures (Verkauf)	EUR	205.700,00	0,09
5. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	7.407.484,87	2,92
– Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	7.967,11	0,00
– Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	1.004,86	0,00
6. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	1.554.094,72	0,61
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-762.356,18	-0,30
III. Fondsvermögen		EUR	253.600.350,14
			100,00¹

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

Vermögensaufstellung zum 31.12.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	234.710.308,01	92,55	
Aktien									
Automobilhersteller und Zulieferer									
DE0005190003	BMW AG	STK	11.600	0	0	EUR	73,1400	848.424,00	0,33
DE0007100000	Daimler AG	STK	17.000	0	0	EUR	49,3700	839.290,00	0,33
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE VZ	STK	8.200	8.200	0	EUR	66,6400	546.448,00	0,22
Banken									
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) S.A.	STK	106.711	0	0	EUR	5,0050	534.088,56	0,21
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	100.000	0	0	EUR	3,7425	374.250,00	0,15
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	17.400	0	0	EUR	52,7300	917.502,00	0,36
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK	68.400	0	0	EUR	10,7000	731.880,00	0,29
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	250.000	0	0	EUR	2,3485	587.125,00	0,23
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	249.900	0	0	GBP	5,9630	1.744.195,82	0,69
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	465.000	0	0	GBP	0,6312	343.545,39	0,14
Bauwesen und Materialien									
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	5.100	0	0	EUR	102,1000	520.710,00	0,21
FR0000125486	Vinci S.A.	STK	10.000	0	0	EUR	98,9800	989.800,00	0,39
AT0000831706	Wienerberger AG	STK	22.300	22.300	0	EUR	26,4200	589.166,00	0,23
Chemie									
FR0000120073	Air Liquide S.A. Ét. Expl. P. G. Cl.	STK	7.260	660	0	EUR	125,9500	914.397,00	0,36
DE000BASF111	BASF SE	STK	12.900	0	0	EUR	67,3500	868.815,00	0,34
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.	STK	8.400	0	0	EUR	116,1000	975.240,00	0,38
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	2.772	0	0	EUR	190,8000	528.897,60	0,21
Einzelhandel									
GB0032089863	Next Group PLC	STK	9.000	0	0	GBP	71,2800	750.886,64	0,30
Energieversorgung									
DK0060094928	Orsted A/S	STK	6.000	6.000	0	DKK	689,0000	553.369,21	0,22
IT0003128367	Enel S.P.A.	STK	90.000	0	0	EUR	7,0720	636.480,00	0,25
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	65.000	0	0	EUR	9,2840	603.460,00	0,24
IT0005211237	Italgas S.P.A.	STK	60.000	0	0	EUR	5,4440	326.640,00	0,13
DE0007037129	RWE AG	STK	31.000	0	0	EUR	27,3500	847.850,00	0,33
Erdöl und Erdgas									
IT0003132476	Eni S.p.A.	STK	26.839	0	0	EUR	13,8460	371.612,79	0,15
AT0000743059	OMV AG	STK	9.500	9.500	0	EUR	50,0800	475.760,00	0,19
GB00B03MLX29	Royal Dutch Shell PLC A	STK	30.900	0	0	EUR	26,2950	812.515,50	0,32
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	100.000	0	0	EUR	4,6860	468.600,00	0,18
FR0000120271	Total S.A.	STK	30.000	0	0	EUR	49,1850	1.475.550,00	0,58
GB0007980591	BP PLC	STK	255.000	0	0	GBP	4,7850	1.428.191,02	0,56
Finanzdienstleistungen									
FR0004125920	Amundi S.A.	STK	9.000	0	0	EUR	69,8000	628.200,00	0,25
NL0012059018	Exor N.V.	STK	7.800	7.800	0	EUR	69,0800	538.824,00	0,21
GB00BKFB1C65	M&G Prudential PLC	STK	36.000	36.000	0	GBP	2,3840	100.455,32	0,04
Gesundheit									
CH0432492467	Alcon AG	STK	8.000	0	0	CHF	54,8000	403.776,19	0,16
CH0012005267	Novartis AG	STK	40.000	0	0	CHF	91,9000	3.385.678,10	1,34
CH0012032113	Roche Holding AG	STK	67	0	700	CHF	307,6000	18.981,53	0,01
CH0012549785	Sonova Holding AG	STK	3.350	0	0	CHF	221,5000	683.421,60	0,27
DK0060448595	Coloplast AS	STK	4.600	4.600	0	DKK	826,4000	508.853,37	0,20
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	20.000	0	0	DKK	386,6500	1.035.124,35	0,41
DE000BAY0017	Bayer AG	STK	10.000	0	0	EUR	72,8100	728.100,00	0,29
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK	11.400	11.400	0	EUR	43,5750	496.755,00	0,20

Vermögensaufstellung zum 31.12.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FR000120578	Sanofi S.A.	STK	21.600	0	0	EUR 89,7500	1.938.600,00	0,76
GB0009895292	Astrazeneca PLC	STK	17.000	0	0	GBP 76,5400	1.523.005,79	0,60
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC	STK	74.100	0	0	GBP 17,9800	1.559.452,22	0,61
Immobilien								
BE0003593044	Cofinimmo S.A., SICAFI	STK	3.900	3.900	0	EUR 131,8000	514.020,00	0,20
SE0000379190	Castellum A.B.	STK	31.300	0	0	SEK 220,0000	659.546,96	0,26
Industriegüter und Dienstleistungen								
NL0000235190	Airbus SE	STK	4.000	0	0	EUR 130,0000	520.000,00	0,21
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK	16.500	16.500	0	EUR 34,0100	561.165,00	0,22
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	10.000	0	0	EUR 46,2000	462.000,00	0,18
FR0010307819	Legrand S.A.	STK	5.000	0	0	EUR 73,0400	365.200,00	0,14
IT0003856405	Leonardo S.p.A.	STK	42.500	42.500	0	EUR 10,4500	444.125,00	0,18
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	9.500	9.500	0	EUR 54,3400	516.230,00	0,20
FR0000073272	Safran S.A.	STK	6.700	0	0	EUR 137,1000	918.570,00	0,36
DE0007165607	Sartorius AG	STK	2.000	0	188	EUR 175,0000	350.000,00	0,14
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	22.400	3.200	0	EUR 91,5400	2.050.496,00	0,81
DE0007236101	Siemens AG	STK	10.000	0	0	EUR 116,5400	1.165.400,00	0,46
SE0000667891	Sandvik A.B.	STK	28.800	0	0	SEK 182,6500	503.837,94	0,20
Konsumgüter und Haushaltswaren								
FR0000120321	L'Oreal S.A.	STK	3.000	0	0	EUR 263,2000	789.600,00	0,31
FR0000121014	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	STK	4.000	0	0	EUR 414,6000	1.658.400,00	0,65
NL0000388619	Unilever N.V.	STK	32.750	32.750	0	EUR 51,4600	1.685.315,00	0,66
GB0002875804	British American Tobacco PLC	STK	22.000	0	0	GBP 32,5650	838.567,33	0,33
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	20.000	0	0	GBP 43,7300	1.023.702,23	0,40
SE0009922164	Essity AB B	STK	20.000	0	0	SEK 301,8000	578.133,23	0,23
Nahrungsmittel und Getränke								
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	37.500	0	0	CHF 104,7800	3.618.927,01	1,43
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev SA/NV	STK	8.282	0	0	EUR 73,7300	610.631,86	0,24
GB0002374006	Diageo PLC	STK	17.500	0	0	GBP 32,0500	656.493,24	0,26
Rohstoffe								
GB0007188757	Rio Tinto PLC	STK	23.500	0	0	GBP 45,0700	1.239.708,55	0,49
Technologie								
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	6.000	0	0	EUR 262,9000	1.577.400,00	0,62
DE0007164600	SAP SE	STK	12.000	0	0	EUR 120,3200	1.443.840,00	0,57
Telekommunikation								
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK	58.443	0	0	EUR 14,5700	851.514,51	0,34
FI0009007884	Elisa Oyj A	STK	7.100	0	0	EUR 49,2500	349.675,00	0,14
DE000A0Z2Z25	Freenet AG	STK	23.800	23.800	0	EUR 20,4400	486.472,00	0,19
ES0178430E18	Telefonica S.A.	STK	51.800	0	0	EUR 6,3200	327.376,00	0,13
Versicherungen								
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	1.300	0	0	CHF 485,8000	581.662,45	0,23
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	2.000	0	0	CHF 397,1000	731.475,94	0,29
BE0974264930	Ageas Sa/Nv	STK	7.000	0	0	EUR 52,9000	370.300,00	0,15
DE0008404005	Allianz SE	STK	13.600	0	0	EUR 218,4000	2.970.240,00	1,17
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK	30.000	0	0	EUR 18,3950	551.850,00	0,22
FR0000120628	AXA S.A.	STK	20.000	0	0	EUR 25,0950	501.900,00	0,20
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK	2.300	0	0	EUR 172,3000	396.290,00	0,16
DE0008430026	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft AG	STK	4.300	0	0	EUR 263,0000	1.130.900,00	0,45
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK	39.300	0	0	EUR 10,1200	397.716,00	0,16
GB0007099541	Prudential PLC	STK	36.000	36.000	36.000	GBP 14,4600	609.305,32	0,24

Vermögensaufstellung zum 31.12.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Verzinsliche Wertpapiere								
DE0001102408	0,000% BRD Anl. 15.08.26	EUR	7.000	0	0 %	102,5613	7.179.287,50	2,83
DE0001102473	0,000% BRD Anl. 15.08.29	EUR	5.000	5.000	0 %	101,7792	5.088.958,25	2,01
DE0001102465	0,250% BRD Anl. 15.02.29	EUR	5.000	6.500	2.500 %	104,3697	5.218.486,75	2,06
DE0001102390	0,500% BRD Anl. 15.02.26	EUR	5.000	0	0 %	105,6434	5.282.172,25	2,08
DE0001102440	0,500% BRD Anl. 15.02.28	EUR	5.000	0	0 %	106,5645	5.328.225,00	2,10
DE0001102424	0,500% BRD Anl. 15.08.27	EUR	8.000	0	0 %	106,4252	8.514.013,20	3,36
DE000NWB0584	0,500% NRW.BANK IHS 11.05.26	EUR	1.000	0	0 %	103,6260	1.036.260,00	0,41
DE000A169NC2	1,375% Daimler MTN 11.05.28	EUR	2.000	0	0 %	106,5485	2.130.970,00	0,84
DE000A13R8M3	1,375% Metro MTN 28.10.21	EUR	2.000	0	0 %	101,8700	2.037.400,00	0,80
XS1191116174	1,500% Infineon Anl. 10.03.22	EUR	2.000	0	0 %	103,3162	2.066.323,60	0,81
XS0977496636	2,750% Deutsche Post MTN 09.10.23	EUR	2.600	0	0 %	110,3556	2.869.246,38	1,13
XS1026109204	4,000% Fresenius Nts. 01.02.24	EUR	1.000	0	0 %	115,0000	1.150.000,00	0,45
FI4000197959	0,500% Finnland Bds. 15.04.26	EUR	1.000	0	0 %	104,5198	1.045.198,10	0,41
NL0011819040	0,500% Niederlande Anl. 15.07.26	EUR	3.000	0	0 %	105,1655	3.154.965,00	1,24
SK4120012220	0,625% Slowakei Anl. 22.05.26	EUR	3.000	0	0 %	104,4317	3.132.950,10	1,24
IT0005142143	0,650% Italien B.T.P. 01.11.20	EUR	1.500	0	0 %	100,7480	1.511.220,00	0,60
XS1396261338	0,750% BMW Finance MTN 15.04.24	EUR	2.500	0	0 %	102,8486	2.571.215,00	1,01
XS1443997819	0,750% Total Capital MTN 12.07.28	EUR	1.000	0	0 %	103,6056	1.036.055,65	0,41
BE0000334434	0,800% Belgien OBL 22.06.25	EUR	3.000	0	0 %	105,8530	3.175.590,00	1,25
XS1956028168	0,875% Fortum MTN 27.02.23	EUR	2.000	0	0 %	101,8046	2.036.091,50	0,80
XS1505573482	0,875% Snam MTN 25.10.26	EUR	2.000	0	0 %	102,2078	2.044.155,50	0,81
FR0012938116	1,000% Frankreich OAT 25.11.25	EUR	7.500	7.500	0 %	107,4063	8.055.468,75	3,18
XS1799162588	1,000% Grenke Finance MTN 05.04.23	EUR	1.000	0	0 %	101,1000	1.011.000,00	0,40
XS1575444622	1,000% Iberdrola Finanzas MTN 07.03.25	EUR	3.000	0	0 %	104,0922	3.122.766,75	1,23
XS1734689620	1,000% OMV MTN 14.12.26	EUR	1.000	0	0 %	104,9074	1.049.074,20	0,41
XS1395060491	1,000% Red Eléctrica Financiaciones MTN 21.04.26	EUR	1.000	0	0 %	104,1847	1.041.846,95	0,41
SI0002103776	1,000% Slowenien Bds. 06.03.28	EUR	2.000	0	0 %	106,6395	2.132.790,00	0,84
XS1527126772	1,117% BP Capital Markets MTN 25.01.24	EUR	1.000	0	0 %	103,9703	1.039.703,05	0,41
ES0413900533	1,125% Banco Santander CEH 25.10.28	EUR	2.000	0	0 %	108,2972	2.165.943,00	0,85
XS2018637327	1,125% HeidelbergCement Finance MTN 01.12.27	EUR	1.000	0	0 %	101,5403	1.015.402,65	0,40
XS1590568132	1,125% Naturgy Capital Markets MTN 11.04.24	EUR	1.000	0	0 %	103,9689	1.039.689,30	0,41
AT0000A1FAP5	1,200% Österreich BO 20.10.25	EUR	3.000	0	0 %	108,5597	3.256.792,50	1,28
FR0013216926	1,208% Danone MTN 03.11.28	EUR	1.000	0	0 %	108,4972	1.084.972,20	0,43
FR0013231099	1,250% Autoroutes du Sud de la France MTN 18.01.27	EUR	1.000	0	0 %	106,9693	1.069.692,90	0,42
ES0211845302	1,375% Abertis Infraestructuras OBL 20.05.26	EUR	1.000	0	0 %	102,3933	1.023.932,70	0,40
XS1557095616	1,375% Deutsche Telekom International Fin. MTN 30.01.27	EUR	2.000	0	0 %	106,4506	2.129.011,30	0,84
XS1652866002	1,375% Terna MTN 26.07.27	EUR	1.000	0	0 %	105,8209	1.058.209,15	0,42
XS1140300663	1,500% Verbund Nts. 20.11.24	EUR	1.800	0	0 %	106,8556	1.923.401,07	0,76
XS1589806907	1,625% HeidelbergCement Finance Luxembourg MTN 07.04.26	EUR	1.000	0	0 %	105,3382	1.053.382,35	0,42
AT0000A185T1	1,650% Österreich Obl. 21.10.24	EUR	2.000	0	0 %	109,7068	2.194.135,00	0,87
FR0011962398	1,750% Frankreich OAT 25.11.24	EUR	2.000	0	0 %	110,4343	2.208.685,00	0,87
XS1489184900	1,875% Glencore Finance MTN 13.09.23	EUR	1.000	0	0 %	104,5708	1.045.707,70	0,41

Vermögensaufstellung zum 31.12.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
XS1586555945	1,875% Volkswagen International Finance MTN 30.03.27	EUR	1.000	0	0 %	105,9452	1.059.452,40	0,42
XS1130139667	2,125% Litauen MTN 29.10.26	EUR	3.000	0	0 %	114,1338	3.424.012,50	1,35
SI0002103545	2,125% Slowenien Bds. 28.07.25	EUR	1.000	0	0 %	112,8435	1.128.435,00	0,44
XS1385395121	2,375% EDP Finance MTN 23.03.23	EUR	2.000	0	0 %	107,2304	2.144.608,60	0,85
XS0942094805	2,500% Essity AB MTN 06.09.23	EUR	1.000	0	0 %	108,5124	1.085.123,85	0,43
XS0933241456	2,500% Telenor MTN 22.05.25	EUR	1.000	0	0 %	112,3484	1.123.484,45	0,44
BE0000332412	2,600% Belgien OBL 22.06.24	EUR	1.500	0	0 %	113,4340	1.701.510,00	0,67
BE6243179650	2,875% Anheuser-Busch InBev MTN 25.09.24	EUR	2.000	0	0 %	113,6066	2.272.132,90	0,90
PTOTEKOE0011	2,875% Portugal Obr. 15.10.25	EUR	3.000	0	0 %	116,0905	3.482.715,00	1,37
PTOTETOE0012	2,875% Portugal Obr. 21.07.26	EUR	3.000	0	0 %	117,5623	3.526.870,05	1,39
NO0010705536	3,000% Norwegen Anl. 14.03.24	NOK	20.000	0	0 %	106,4500	2.164.519,77	0,85
IT0004988553	3,000% UniCredit MTN 31.01.24	EUR	2.400	0	0 %	112,8491	2.708.379,24	1,07
FR0011560077	3,125% Orange MTN 09.01.24	EUR	1.000	0	0 %	112,2352	1.122.351,60	0,44
IE00B6X95T99	3,400% Irland TRB 18.03.24	EUR	1.000	0	0 %	115,7740	1.157.740,00	0,46
GR0114031561	3,450% Griechenland Nts. 02.04.24	EUR	1.000	1.000	0 %	112,4700	1.124.700,00	0,44
XS0704178556	3,625% B.A.T. International Finance MTN 09.11.21	EUR	1.000	0	0 %	107,0419	1.070.418,60	0,42
IT0004872328	3,625% Intesa Sanpaolo HPF 05.12.22	EUR	3.000	0	0 %	111,2144	3.336.433,20	1,32
XS0975256685	3,625% Repsol International Finance MTN 07.10.21	EUR	2.000	0	0 %	106,6185	2.132.370,60	0,84
XS0874864860	3,987% Telefonica Emisiones MTN 23.01.23	EUR	2.500	0	0 %	112,1003	2.802.508,25	1,11
ES0413211071	4,000% BBVA CEH 25.02.25	EUR	2.400	0	0 %	121,0296	2.904.709,68	1,15
XS0543882095	4,000% Polen MTN 23.03.21	EUR	2.400	0	0 %	105,4340	2.530.416,00	1,00
XS0677389347	4,500% Koninklijke KPN MTN 04.10.21	EUR	2.500	0	0 %	107,7000	2.692.500,00	1,06
IT0004695075	4,750% Italien B.T.P. 01.09.21	EUR	1.200	0	0 %	108,0550	1.296.660,54	0,51
XS0842659426	4,875% ENEL Finance International MTN 17.04.23	EUR	2.500	0	0 %	116,0832	2.902.079,88	1,14
XS0304458051	5,375% Vodafone Group MTN 06.06.22	EUR	1.000	0	0 %	113,0653	1.130.653,40	0,45
IT0004848831	5,500% Italien B.T.P. 01.11.22	EUR	2.000	0	0 %	115,0609	2.301.218,50	0,91
Sonstige Beteiligungswertpapiere								
Gesundheit								
CH0012032048	Roche Holding AG GEN	STK	10.000	0	0 CHF	314,0000	2.892.010,13	1,14
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	9.105.216,25	3,59
Verzinsliche Wertpapiere								
DE000AAR0256	0,010% Aareal Bank IHS 08.07.27	EUR	2.500	0	0 %	99,7836	2.494.591,25	0,98
XS2021499871	0,010% DekaBank DGZ ÖPF 02.17.27	EUR	2.500	0	0 %	99,7910	2.494.775,00	0,98
NL0013332430	0,250% Niederlande Anl. 15.07.29	EUR	4.000	0	0 %	102,8962	4.115.850,00	1,62
Investmentanteile						EUR	1.360.000,00	0,54
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								
DE000ETFL441	Deka MDAX UCITS ETF	ANT	5.000	0	0 EUR	272,0000	1.360.000,00	0,54
Summe Wertpapiervermögen²						EUR	245.175.524,26	96,68

Vermögensaufstellung zum 31.12.2019

Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate						EUR	66.480,50	0,03	
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
DAX Index Future 03/20	EDT	EUR Anzahl	-100				13.550,00	0,01	
EURO STOXX 50 Index Future 03/20	EDT	EUR Anzahl	-2.000				42.000,00	0,02	
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
PUT DAX Index 12200,00 01/20	EDT	STK Anzahl	315			EUR	8,3000	2.614,50	0,00
PUT Euro Stoxx 50 Index 3450,00 01/20	EDT	STK Anzahl	3.080			EUR	2,7000	8.316,00	0,00
Zins-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	150.150,00	0,06	
Zinsterminkontrakte									
6,000% Euro Bobl Future 03/20	EDT	EUR	-5.000.000				39.000,00	0,02	
6,000% Euro Bund Future 03/20	EDT	EUR	-4.500.000				111.150,00	0,04	
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei:						EUR	7.416.456,84	2,92	
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale (Verwahrstelle)		EUR	7.407.484,87			%	100,0000	7.407.484,87	2,92
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)									
		GBP	4.719,87			%	100,0000	5.524,52	0,00
		NOK	24.025,09			%	100,0000	2.442,59	0,00
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)		CHF	1.091,03			%	100,0000	1.004,86	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände									
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	1.554.094,72	0,61	
Dividendenansprüche		EUR	35.604,85				35.604,85	0,01	
Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	163,50				163,50	0,00	
Quellensteueransprüche		EUR	255.103,21				255.103,21	0,10	
Zinsansprüche		EUR	1.263.223,16				1.263.223,16	0,50	
Sonstige Verbindlichkeiten									
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-762.356,18	-0,30	
Kostenabgrenzung		EUR	-225.296,18				-225.296,18	-0,09	
Variation Margin		EUR	-205.700,00				-205.700,00	-0,08	
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-331.360,00				-331.360,00	-0,13	
Fondsvermögen									
Fondsvermögen						EUR	253.600.350,14	100,00 ³	
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I						EUR	64,09		
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R						EUR	54,27		
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I						STK	3.596.226		
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R						STK	425.672		

2 Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen 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 30.12.2019		
Britische Pfund	(GBP)	0,854350	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,470600	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	9,835900	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,440500	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,085750	=	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 (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):**

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Automobilhersteller und Zulieferer				
FR0000121501	Peugeot S.A.	STK	0	16.000
Banken				
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken A.B. A	STK	0	54.400
Bauwesen und Materialien				
ES0167050915	ACS, Actividades de Construcción y Servicios, S.A.	STK	0	16.500
Chemie				
DE000SYM9999	Symrise AG	STK	0	6.500
Einzelhandel				
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.V.	STK	0	26.000
Energieversorgung				
AT0000746409	Verbund AG A	STK	9.700	9.700
Erdöl und Erdgas				
FI0009013296	Neste Oyj	STK	0	20.400
Finanzdienstleistungen				
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK	0	2.100
Gesundheit				
CH0038389992	BB Biotech AG	STK	0	5.000
CH0013841017	Lonza Group AG	STK	0	1.700
Industriegüter und Dienstleistungen				
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	STK	0	2.600
Konsumgüter und Haushaltswaren				
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group PLC	STK	0	2.500
NL0000009355	Unilever N.V. CVA	STK	0	32.750
Nahrungsmittel und Getränke				
DK0010181759	Carlsberg A.S. B	STK	0	4.000
FR0000120644	Danone S.A.	STK	0	4.000
NL0000009165	Heineken N.V.	STK	0	5.000
Technologie				
FR0000125338	Capgemini SE	STK	0	2.700
Versicherungen				
FR0000120222	CNP Assurances S.A.	STK	0	24.000
Verzinsliche Wertpapiere				
ES00000127G9	2,150% Spanien OBL 31.10.25	EUR	0	2.500
ES00000123C7	5,900% Spanien Bos. 30.07.26	EUR	0	2.000
Andere Wertpapiere				
Energieversorgung				
ES06445809I8	Iberdrola ANR	STK	65.000	65.000

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			28.059
DAX Index Future, EURO STOXX 50 Index Future)				
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			77.557
Euro Bobl Future, Euro Bund Future)				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)				
(Basiswerte:	EUR			622
Dax (Performanceindex), ESTX 50 Price Index (EUR))				

Sondervermögen Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Anteilklassen-Bezeichnung	I	R
Mindestanlagesumme	95.000,00	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	64,09
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R	EUR	54,27
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds I	STK	3.596.226
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds R	STK	425.672

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:

96,68% 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.
