

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2023

VERWAHRSTELLE:



BERATUNG UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht
Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	93.016.879,18	100,31
1. Investmentanteile	90.474.956,49	97,57
EUR	80.921.820,82	87,27
USD	9.553.135,67	10,30
2. Derivate	51.024,53	0,06
3. Bankguthaben	2.482.967,10	2,68
4. Sonstige Vermögensgegenstände	7.931,06	0,01
II. Verbindlichkeiten	-288.807,53	-0,31
III. Fondsvermögen	92.728.071,65	100,00

Halbjahresbericht

Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	90.474.956,49	97,57
Investmentanteile							EUR	90.474.956,49	97,57
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	90.474.956,49	97,57
AIS-Amundi IDX MSCI EMER.MKTS Namens-Anteile C Cap.EUR o.N.	LU1681045370	ANT		334.920	116.200	0	EUR 4,407	1.475.925,46	1,59
Am.Idx Sols-Amundi Sm.Factory Act.Nom.UC.ETF EUR Unh.Acc. oN	LU2037749822	ANT		7.500	3.300	0	EUR 67,090	503.175,00	0,54
Deka iB.EO L.Sov.D.1-10 U.ETF Inhaber-Anteile	DE000ETFL110	ANT		69.500	0	7.700	EUR 97,488	6.775.416,00	7,31
iSh.STOXX Europe 600 U.ETF DE Inhaber-Anteile	DE0002635307	ANT		65.600	0	18.400	EUR 45,885	3.010.056,00	3,25
iShares Core EO STOXX.50 U.E.DE Inhaber-Anteile	DE0005933956	ANT		12.000	0	0	EUR 44,660	535.920,00	0,58
iShs IV-iSh.MSCI EMU ESG Scr. Reg. Shares EUR Acc. o.N.	IE00BFNM3B99	ANT		272.000	272.000	0	EUR 7,253	1.972.816,00	2,13
iShs-EO Corp Bd Lar.Cap U.ETF Registered Shares o.N.	IE0032523478	ANT		49.800	0	0	EUR 118,901	5.921.284,74	6,39
iShsIII-Core EO Govt Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B4WXXJ64	ANT		69.220	0	0	EUR 108,515	7.511.408,30	8,10
iShsIII-EO Covered Bond U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B3B8Q275	ANT		43.800	0	8.500	EUR 135,595	5.939.061,00	6,40
iShsIII-EO Crp.Bd BBB-BB U.ETF Registered Shares o.N.	IE00BSKRK281	ANT		677.780	677.780	0	EUR 4,582	3.105.791,29	3,35
iShsV-Germany.Govt Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B5V94313	ANT		53.800	9.100	0	EUR 120,855	6.501.999,00	7,01
iShsVII-Nikkei 225 UCITS ETF Reg. Shares JPY (Acc) o.N.	IE00B52MJD48	ANT		2.400	2.400	2.050	EUR 209,950	503.880,00	0,54
L&G ETF-L&G Clean Energy ETF Reg. Shs USD Acc. oN	IE00BK5BCH80	ANT		48.000	0	0	EUR 10,626	510.048,00	0,55
MUL-Ly.ESG EO Co.Bd(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.EUR o.N	LU1829219127	ANT		52.600	52.600	0	EUR 136,934	7.202.728,40	7,77
MUL-LYXOR S&P 500 UCITS ETF Nam.-Ant. EUR Dis.oN	LU0496786574	ANT		61.870	0	0	EUR 41,699	2.579.917,13	2,78
UBS(L)FS-BB USD EM Sov. UC.ETF Namens-Anteile A Dis USD o.N.	LU1324516050	ANT		1.024.920	1.024.920	0	EUR 8,036	8.236.257,12	8,88
UBS(L)FS-BBG MSCI EO ALCS.UETF Inhaber-Anteile A Dis.EUR o.N.	LU1484799769	ANT		385.390	385.390	0	EUR 12,478	4.808.703,72	5,19
Vanguard EUR Euroz.Gov.B.U.ETF Registered Shares EUR Dis.oN	IE00BZ163H91	ANT		98.570	98.570	0	EUR 22,218	2.190.028,26	2,36
Xtr.(IE)-MSCI USA ESG UCI.ETF Registered Shares 1C o.N.	IE00BFMNPS42	ANT		42.900	0	0	EUR 42,720	1.832.688,00	1,98
Xtr.II Eurozone Gov.Bond Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290355717	ANT		19.500	0	0	EUR 207,950	4.055.025,00	4,37
Xtrackers II EUR Corporate Bd Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0478205379	ANT		40.240	0	0	EUR 142,885	5.749.692,40	6,20
HSBC ETFS-Japan Sust.Equity Reg. Shs USD Acc. oN	IE00BKY55S33	ANT		107.780	0	0	USD 14,967	1.478.726,98	1,59
Lyxor IF-Robot.& AI UCITS ETF Act. Nom. USD Acc. oN	LU1838002480	ANT		18.000	7.800	0	USD 33,048	545.288,29	0,59
MUL-Amu.MSCI EMER.MAR.II ETF Act.Nom. USD Dis. oN	LU2573966905	ANT		23.000	23.000	0	USD 44,710	942.643,69	1,02
SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS Registered Shs USD Acc oN	IE00BH4GPZ28	ANT		109.668	0	45.750	USD 31,020	3.118.435,57	3,36
UBS(Irl)ETF-S&P 500 ESG UC.ETF Reg. Shs A USD Acc. oN	IE00BHXMH11	ANT		118.524	0	43.900	USD 31,920	3.468.041,14	3,74
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	90.474.956,49	97,57

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	51.024,53	0,06
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-41.238,73	-0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-41.238,73	-0,04
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 09.23 EUREX		185	EUR	Anzahl	-30			-18.150,00	-0,02
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 09.23 CME		352	USD	Anzahl	-5			-23.088,73	-0,02
Devisen-Derivate							EUR	92.263,26	0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Währungsterminkontrakte							EUR	92.263,26	0,10
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 09.23 CME		352	USD	11.000.000			USD 1,095	92.263,26	0,10
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.482.967,10	2,68
Bankguthaben							EUR	2.482.967,10	2,68
EUR - Guthaben bei:									
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	1.943.940,17			% 100,000	1.943.940,17	2,10
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
Landesbank Baden-Württemberg			JPY	17.507.958,00			% 100,000	111.051,01	0,12
Landesbank Baden-Württemberg			USD	466.878,93			% 100,000	427.975,92	0,46
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	7.931,06	0,01
Zinsansprüche			EUR	7.931,06				7.931,06	0,01

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-288.807,53	-0,31
Verwaltungsvergütung			EUR	-278.504,99				-278.504,99	-0,30
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.302,54				-2.302,54	0,00
Prüfungskosten			EUR	-7.500,00				-7.500,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-500,00				-500,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	92.728.071,65	100,00 1)
Anteilwert							EUR	106,10	
Ausgabepreis							EUR	109,28	
Anteile im Umlauf							STK	873.984	

Fußnoten:

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

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

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2023	
JPY	(JPY)	157,6569000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0909000	= 1 EUR (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
352	Chicago - CME Globex

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

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
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
iS.eb.r.G.G.5.5-10.5y U.ETF DE Inhaber-Anteile	DE0006289499	ANT	0	20.800	
iShs II-J.P.M.ESG \$ EM B.U.ETF Registered Inc.Shares USD o.N.	IE00BDDRDW15	ANT	0	2.259.400	
iShs VII-EO G.Bd 3-7yr U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B3VTML14	ANT	0	24.800	
iShsII-STOXX Europe 50 U.ETF Registered Shs EUR (Dist) o.N.	IE0008470928	ANT	0	33.000	
iShsIII-Core EO Corp.Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B3F81R35	ANT	0	60.300	
iShsIII-EO Cor.Bd ex-Fin.U.ETF Registered Shares EUR o.N.	IE00B4L5ZG21	ANT	0	30.000	
Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF Inh.-An. I o.N.	LU0635178014	ANT	0	28.650	
MUL-Lyx.EO STOXX Ba.(DR)UC.ETF Namens-Ant. Acc.EUR o.N	LU1829219390	ANT	0	5.300	
SPDR BI.1-3Y.Eu.Go.Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B6YX5F63	ANT	0	32.435	
Xtrackers DAX Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0274211480	ANT	6.600	6.600	
Xtrackers Nifty 50 Swap Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0292109690	ANT	0	2.350	

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

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
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

Derivate

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

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, S+P 500)

EUR

4.807,25

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BOBL)

EUR

2.988,93

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): CROSS RATE EO/DL)

EUR

11.037,97

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,57
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,06

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	106,10
Ausgabepreis	EUR	109,28
Anteile im Umlauf	STK	873.984

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Frankfurt am Main, den 3. Juli 2023

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht

Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968
Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,—
Eigenmittel: EUR 71.352.213,88 (Stand: September 2022)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen

2. Verwahrstelle

Landesbank Baden-Württemberg

Hausanschrift:

Am Hauptbahnhof 2
70173 Stuttgart

Postanschrift:

Postfach 10 60 49
70049 Stuttgart

Telefon: 0711 / 1 27-0
Telefax: 0711 / 1 27-435 44
www.lbbw.de

Rechtsform: Anstalt des öffentlichen Rechts
Haftendes Eigenkapital: € Mio 14.197 (Stand: 31.12.2021)

3. Beratungsgesellschaft und Vertrieb

Stadtsparkasse Düsseldorf
Anstalt des Öffentlichen Rechts

Postanschrift:

Berliner Allee 33
40212 Düsseldorf

Telefon (0211) 878-2211
Telefax (0211) 878-1748
www.sskduesseldorf.de

WKN / ISIN: A0NBG5 / DE000A0NBG59