

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. DEZEMBER 2021

VERWAHRSTELLE:



BERATUNG UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensübersicht zum 31.12.2021

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	249.456.848,64	100,24
1. Aktien	67.480.669,84	27,12
Bundesrep. Deutschland	18.361.447,80	7,38
Dänemark	2.062.713,48	0,83
Frankreich	17.476.443,60	7,02
Großbritannien	4.360.042,90	1,75
Irland	4.990.432,00	2,01
Italien	2.445.426,60	0,98
Niederlande	6.264.038,85	2,52
Schweden	2.109.176,06	0,85
Schweiz	6.439.468,65	2,59
Spanien	2.971.479,90	1,19
2. Anleihen	155.947.935,17	62,67
< 1 Jahr	6.238.150,00	2,51
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	16.415.545,17	6,60
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	65.700.908,00	26,40
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	67.593.332,00	27,16
3. Sonstige Beteiligungswertpapiere	2.261.561,68	0,91
CHF	2.261.561,68	0,91
4. Investmentanteile	13.342.354,50	5,36
EUR	13.342.354,50	5,36
5. Derivate	83.281,46	0,03
6. Bankguthaben	9.170.021,92	3,68
7. Sonstige Vermögensgegenstände	1.171.024,07	0,47

**Halbjahresbericht
Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds**

Vermögensübersicht zum 31.12.2021

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
II. Verbindlichkeiten	-598.084,00	-0,24
III. Fondsvermögen	248.858.764,64	100,00

Halbjahresbericht

Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	239.032.521,19	96,05
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	225.690.166,69	90,69
Aktien							EUR	67.480.669,84	27,12
Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1	CH0210483332		STK	13.000	0	0 CHF	136,950	1.719.978,75	0,69
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	15.000	0	0 CHF	127,440	1.846.778,09	0,74
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	CH0244767585		STK	137.200	0	0 CHF	16,420	2.176.431,26	0,87
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	CH0011075394		STK	1.800	0	0 CHF	400,400	696.280,55	0,28
A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	DK0010244508		STK	325	0	0 DKK	23.450,000	1.024.885,02	0,41
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	DK0060534915		STK	10.500	0	0 DKK	735,000	1.037.828,46	0,42
Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01	NL0011794037		STK	29.850	29.850	0 EUR	30,485	909.977,25	0,37
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	FR0000120073		STK	7.260	0	0 EUR	153,680	1.115.716,80	0,45
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	10.000	0	0 EUR	207,650	2.076.500,00	0,83
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	NL0010273215		STK	5.180	2.430	2.750 EUR	710,400	3.679.872,00	1,48
Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000062072		STK	45.820	45.820	0 EUR	18,630	853.626,60	0,34
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	28.400	0	0 EUR	26,285	746.494,00	0,30
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	ES0113211835		STK	116.300	116.300	0 EUR	5,250	610.575,00	0,25
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	ES0113900J37		STK	265.800	190.700	0 EUR	2,941	781.584,90	0,31
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111		STK	16.600	0	0 EUR	61,780	1.025.548,00	0,41
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	DE0005190003		STK	7.300	7.300	0 EUR	88,490	645.977,00	0,26
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104		STK	36.500	0	0 EUR	60,670	2.214.455,00	0,89
Capgemini SE Actions Port. EO 8	FR0000125338		STK	7.400	0	0 EUR	215,700	1.596.180,00	0,64
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007		STK	12.700	0	0 EUR	61,930	786.511,00	0,32
CRH PLC Registered Shares EO -,32	IE0001827041		STK	25.000	0	0 EUR	46,960	1.174.000,00	0,47
Daimler AG Namens-Aktien o.N.	DE0007100000		STK	22.200	0	0 EUR	67,590	1.500.498,00	0,60
Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.	DE0005140008		STK	53.850	53.850	0 EUR	11,018	593.319,30	0,24
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004		STK	25.225	0	25.225 EUR	56,540	1.426.221,50	0,57
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	DE0005557508		STK	77.200	0	77.243 EUR	16,300	1.258.360,00	0,51
EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18	FR0000121667		STK	3.670	3.670	0 EUR	187,640	688.638,80	0,28
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292		STK	600	0	0 EUR	1.537,500	922.500,00	0,37
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	DE0006231004		STK	31.800	16.800	0 EUR	40,760	1.296.168,00	0,52
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202		STK	68.400	0	0 EUR	12,294	840.909,60	0,34
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	IT0000072618		STK	700.000	0	0 EUR	2,274	1.591.800,00	0,64
Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50	NL0000009827		STK	4.200	0	0 EUR	198,400	833.280,00	0,33

Halbjahresbericht

Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Linde PLC Registered Shares EO 0,001	IE00BZ12WP82		STK	12.472	0	0 EUR	306,000	3.816.432,00	1,53
LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3	FR0000121014		STK	4.000	0	0 EUR	730,000	2.920.000,00	1,17
Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.	DE0006599905		STK	6.750	0	0 EUR	227,000	1.532.250,00	0,62
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	4.500	0	0 EUR	260,500	1.172.250,00	0,47
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	FR0000120321		STK	6.500	0	0 EUR	419,800	2.728.700,00	1,10
Pernod-Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N.	FR0000120693		STK	3.700	0	0 EUR	212,000	784.400,00	0,32
PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0006969603		STK	6.000	0	0 EUR	107,500	645.000,00	0,26
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	11.000	0	0 EUR	124,900	1.373.900,00	0,55
Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	DE0007165631		STK	1.280	1.280	0 EUR	595,200	761.856,00	0,31
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	17.200	0	0 EUR	172,840	2.972.848,00	1,19
Siemens AG Namens-Aktien o.N.	DE0007236101		STK	20.000	0	0 EUR	152,680	3.053.600,00	1,23
Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1	ES0178430E18		STK	410.000	0	0 EUR	3,852	1.579.320,00	0,63
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	GB0009895292		STK	17.000	0	0 GBP	86,730	1.756.713,93	0,71
BP PLC Registered Shares DL -,25	GB0007980591		STK	310.000	0	0 GBP	3,330	1.229.953,53	0,49
Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -,10	GB00B24CGK77		STK	6.700	0	0 GBP	63,470	506.671,04	0,20
Spirax-Sarco Engineering PLC Reg. Shares LS -,26923076	GB00BWFGQN14		STK	4.500	0	0 GBP	161,650	866.704,40	0,35
Boliden AB Namn-Aktier o.N.	SE0015811559		STK	22.500	0	0 SEK	350,000	768.330,16	0,31
Investor AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	SE0015811963		STK	32.000	0	0 SEK	227,750	711.059,08	0,29
Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0,025	SE0015810247		STK	20.000	0	0 SEK	322,750	629.786,82	0,25
Verzinsliche Wertpapiere						EUR		155.947.935,17	62,67
0,0100 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.230 v.2019(2027)	DE000AAR0256		EUR	2.500	0	0 %	100,024	2.500.600,00	1,00
4,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Cédulas Hip. 2005(25)	ES0413211071		EUR	2.400	0	0 %	113,142	2.715.408,00	1,09
1,1250 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2018(28)	ES0413900533		EUR	2.000	0	0 %	106,899	2.137.980,00	0,86
0,2500 % BASF SE MTN v.2020(2020/2027)	DE000A289DC9		EUR	1.500	0	0 %	100,945	1.514.175,00	0,61
2,6000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72	BE0000332412		EUR	1.500	0	0 %	107,996	1.619.940,00	0,65
0,8000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2015(25) Ser. 74	BE0000334434		EUR	3.000	0	0 %	104,569	3.137.070,00	1,26
0,7500 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2016(24)	XS1396261338		EUR	2.500	0	0 %	102,082	2.552.050,00	1,03
0,3750 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(27)	XS2102357014		EUR	2.000	0	0 %	101,405	2.028.100,00	0,81
0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2015 (2025)	DE0001102374		EUR	6.000	0	0 %	103,546	6.212.760,00	2,50
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2016 (2026)	DE0001102408		EUR	5.600	0	0 %	102,326	5.730.256,00	2,30
0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2017 (2027)	DE0001102424		EUR	5.000	0	0 %	105,296	5.264.800,00	2,12
0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2018 (2028)	DE0001102440		EUR	5.000	0	0 %	105,646	5.282.300,00	2,12
0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029)	DE0001102465		EUR	5.000	0	0 %	104,389	5.219.450,00	2,10
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029)	DE0001102473		EUR	6.000	0	0 %	102,494	6.149.640,00	2,47

Halbjahresbericht

Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2021 (2031)	DE0001102531		EUR	3.000	0	0 %	102,016	3.060.480,00	1,23
2,5000 % Continental AG MTN v.20(26/26)	XS2178586157		EUR	2.500	0	0 %	109,631	2.740.775,00	1,10
1,3750 % Daimler AG Medium Term Notes v.16(28)	DE000A169NC2		EUR	2.000	0	0 %	107,315	2.146.300,00	0,86
1,2080 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/28)	FR0013216926		EUR	1.000	0	0 %	106,406	1.064.060,00	0,43
0,0100 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-OPF.A148 v.19(27)	XS2021499871		EUR	2.500	0	0 %	99,941	2.498.525,00	1,00
0,7500 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.20(29/29)	XS2177122624		EUR	2.300	0	0 %	103,424	2.378.752,00	0,96
0,5000 % Deutsche Telekom AG MTN v.2019(2027)	XS2024715794		EUR	3.000	0	0 %	101,869	3.056.070,00	1,23
1,3750 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(27)	XS1557095616		EUR	2.000	0	0 %	106,160	2.123.200,00	0,85
1,5000 % Deutsche Wohnen SE Anleihe v.2020(2020/2030)	DE000A289NF1		EUR	1.500	0	0 %	104,739	1.571.085,00	0,63
4,8750 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Medium-Term Notes 2012(23)	XS0842659426		EUR	2.500	0	0 %	106,827	2.670.675,00	1,07
1,6250 % Essity AB EO-Med.-Term Nts 2017(17/27)	XS1584122763		EUR	3.000	0	0 %	106,458	3.193.740,00	1,28
0,5000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2016(26)	FI4000197959		EUR	1.000	0	0 %	104,060	1.040.600,00	0,42
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2014(24)	FR0011962398		EUR	2.000	0	0 %	106,634	2.132.680,00	0,86
1,0000 % Frankreich EO-OAT 2015(25)	FR0012938116		EUR	7.500	0	0 %	105,528	7.914.600,00	3,18
4,0000 % Fresenius SE & Co. KGaA EO-Notes 2014(14/24) Reg.S	XS1026109204		EUR	1.000	0	0 %	108,326	1.083.260,00	0,44
1,6250 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. EO-Med.-Term Nts 2017(17/26)	XS1589806907		EUR	1.000	0	0 %	105,412	1.054.120,00	0,42
1,1250 % HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(27/27)	XS2018637327		EUR	1.000	0	0 %	103,690	1.036.900,00	0,42
1,5000 % Heineken N.V. EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	XS1691781865		EUR	1.400	0	0 %	107,176	1.500.464,00	0,60
1,1250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/26)	XS2194283672		EUR	2.400	0	0 %	103,623	2.486.952,00	1,00
3,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hypo-Pfdr.12(22)	IT0004872328		EUR	3.000	0	0 %	103,822	3.114.660,00	1,25
3,4000 % Irland EO-Treasury Bonds 2014(24)	IE00B6X95T99		EUR	1.000	0	0 %	108,838	1.088.380,00	0,44
5,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2012(22)	IT0004848831		EUR	2.000	0	0 %	104,934	2.098.680,00	0,84
1,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(30)	IT0005413171		EUR	3.000	0	0 %	105,206	3.156.180,00	1,27
0,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(26)	IT0005437147		EUR	3.500	3.500	0 %	98,519	3.448.165,00	1,39
1,1250 % Kon. KPN N.V. EO-Med.-Term Notes 2016(16/28)	XS1485533431		EUR	2.500	2.500	0 %	103,239	2.580.975,00	1,04
2,1250 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2014(26)	XS1130139667		EUR	3.000	0	0 %	110,533	3.315.990,00	1,33
0,5000 % Niederlande EO-Anl. 2016(26)	NL0011819040		EUR	3.000	0	0 %	104,347	3.130.410,00	1,26
0,5000 % NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 058 v.16(26)	DE000NWB0584		EUR	1.000	0	0 %	102,476	1.024.760,00	0,41
1,0000 % OMV AG EO-Medium-Term Notes 2017(26)	XS1734689620		EUR	1.000	0	0 %	103,989	1.039.890,00	0,42
3,1250 % Orange S.A. EO-Med.-Term Notes 2013(13/24)	FR0011560077		EUR	1.000	0	0 %	106,713	1.067.130,00	0,43
0,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/29)	FR0013534484		EUR	1.500	0	0 %	98,398	1.475.970,00	0,59
1,6500 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2014(24)	AT0000A185T1		EUR	2.000	0	0 %	106,356	2.127.120,00	0,85
1,2000 % Österreich, Republik EO-Bundesanl. 2015(25)	AT0000A1FAP5		EUR	3.000	0	0 %	106,583	3.197.490,00	1,28
2,8750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2015(25)	PTOTEKOE0011		EUR	3.000	0	0 %	112,351	3.370.530,00	1,35
2,8750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2016(26)	PTOTETOE0012		EUR	3.000	0	0 %	114,343	3.430.290,00	1,38
1,0000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1395060491		EUR	1.000	0	0 %	104,152	1.041.520,00	0,42

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,6250 % Slowakei EO-Anl. 2016(26) Ser. 231	SK4120012220		EUR	3.000	0	0 %	104,927	3.147.810,00	1,26
2,1250 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2015(25)	SI0002103545		EUR	2.000	0	0 %	109,166	2.183.320,00	0,88
1,0000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2018(28)	SI0002103776		EUR	2.000	0	0 %	106,504	2.130.080,00	0,86
0,8750 % Snam S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1505573482		EUR	2.000	0	0 %	102,815	2.056.300,00	0,83
1,7880 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS1961772560		EUR	2.200	0	0 %	108,968	2.397.296,00	0,96
2,5000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Notes 2013(25)	XS0933241456		EUR	1.000	0	0 %	108,441	1.084.410,00	0,44
1,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2017(27)	XS1652866002		EUR	1.000	0	0 %	105,251	1.052.510,00	0,42
5,3750 % Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2007(22)	XS0304458051		EUR	1.000	0	0 %	102,481	1.024.810,00	0,41
3,0000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.20(25)	XS2152062209		EUR	1.100	0	0 %	108,862	1.197.482,00	0,48
1,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(27)	XS1586555945		EUR	1.000	0	0 %	107,370	1.073.700,00	0,43
3,0000 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2014(24)	NO0010705536		NOK	20.000	0	0 %	103,478	2.074.310,17	0,83
Sonstige Beteiligungswertpapiere							EUR	2.261.561,68	0,91
Roche Holding AG Inhaber-Genussscheine o.N.	CH0012032048		STK	6.175	0	0 CHF	379,100	2.261.561,68	0,91
Investmentanteile							EUR	13.342.354,50	5,36
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	13.342.354,50	5,36
iShares Core EO STOXX.50 U.E.DE Inhaber-Anteile	DE0005933956		ANT	44.400	0	0 EUR	43,170	1.916.748,00	0,77
iShsII-STOXX Europe 50 U.ETF Registered Shs EUR (Dist) o.N.	IE0008470928		ANT	61.600	0	0 EUR	39,045	2.405.172,00	0,97
iShsIII-Core EO Corp.Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B3F81R35		ANT	33.600	0	0 EUR	133,915	4.499.544,00	1,81
Xtrackers II EUR Corporate Bd Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0478205379		ANT	27.850	0	0 EUR	162,330	4.520.890,50	1,82
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	239.032.521,19	96,05
Derivate							EUR	83.281,46	0,03
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-180.718,54	-0,07
Forderungen/Verbindlichkeiten									

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-180.718,54	-0,07	
FUTURE DAX (PERFORMANCE-INDEX) 03.22 EUREX		185	EUR	Anzahl -4				-37.300,00	-0,01	
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 03.22 EUREX		185	EUR	Anzahl -100				-143.418,54	-0,06	
Zins-Derivate							EUR	264.000,00	0,11	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte							EUR	264.000,00	0,11	
FUTURE EURO-BOBL 03.22 EUREX		185	EUR	-5.000.000				49.500,00	0,02	
FUTURE EURO-BUND 03.22 EUREX		185	EUR	-7.500.000				214.500,00	0,09	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	9.170.021,92	3,68	
Bankguthaben							EUR	9.170.021,92	3,68	
EUR - Guthaben bei:										
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale (D)			EUR	9.170.021,92			%	100,000	9.170.021,92	3,68
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.171.024,07	0,47	
Zinsansprüche			EUR	910.218,13				910.218,13	0,37	
Quellensteueransprüche			EUR	260.805,94				260.805,94	0,10	
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-598.084,00	-0,24	
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-4.014,87				-4.014,87	0,00	
Verwaltungsvergütung			EUR	-579.407,54				-579.407,54	-0,23	
Verwahrstellenvergütung			EUR	-6.161,59				-6.161,59	0,00	
Prüfungskosten			EUR	-7.500,00				-7.500,00	0,00	
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.000,00				-1.000,00	0,00	
Fondsvermögen							EUR	248.858.764,64	100,00 1)	

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Vermögensaufstellung zum 31.12.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds - AK I									
Anteilwert							EUR	64,08	
Ausgabepreis							EUR	67,28	
Rücknahmepreis							EUR	64,08	
Anzahl Anteile							STK	3.606.123	
Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds - AK R									
Anteilwert							EUR	54,27	
Ausgabepreis							EUR	56,98	
Rücknahmepreis							EUR	54,27	
Anzahl Anteile							STK	327.486	

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 NRW-Fonds

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Barclays PLC Registered Shares LS 0,25	GB0031348658	STK	0	400.000	
Daimler Truck Holding AG junge Namens-Aktien o.N.	DE000DTR0CK8	STK	11.100	11.100	
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	IT0003128367	STK	0	90.000	
Husqvarna AB Namn-Aktier B SK 100	SE0001662230	STK	0	50.000	
Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	NL0000009538	STK	0	11.631	
Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -,25	CH0025751329	STK	0	6.750	
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50	CH0012005267	STK	0	25.400	
Rio Tinto PLC Registered Shares LS -,10	GB0007188757	STK	0	10.000	
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	FR0000120578	STK	0	15.600	
Siemens Energy AG	DE000ENER6Y0	STK	0	10.000	
Wienerberger AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000831706	STK	0	42.350	
Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.	DE000ZAL1111	STK	0	3.916	
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2011(21)	IT0004695075	EUR	0	1.200	
4,5000 % Kon. KPN N.V. EO-Medium-Term Notes 2011(21)	XS0677389347	EUR	0	2.500	
Andere Wertpapiere					
Telefónica S.A. Anrechte	ES06784309F4	STK	410.000	410.000	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
iSh.ST.Eu.600 Food&Be.U.ETF DE Inhaber-Anlageaktien	DE000A0H08H3	ANT	0	35.000	

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

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): DAX PERFORMANCE-INDEX, ESTX 50 PR.EUR)

EUR

63.347,13

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND)

EUR

30.770,76

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.

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

**Halbjahresbericht
Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 5,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 1,350% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds - AK I	95.000	5,00	0,900	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR
Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds - AK R	keine	5,00	1,350	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	96,05
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,03

Sonstige Angaben

Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds - AK I

Anteilwert	EUR	64,08
Ausgabepreis	EUR	67,28
Rücknahmepreis	EUR	64,08
Anzahl Anteile	STK	3.606.123

Stadtparkasse Düsseldorf NRW-Fonds - AK R

Anteilwert	EUR	54,27
Ausgabepreis	EUR	56,98
Rücknahmepreis	EUR	54,27
Anzahl Anteile	STK	327.486

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.

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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 03. Januar 2022

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse I	15. Februar 2002
Anteilklasse R	5. September 2007

Erstausgabepreise

Anteilklasse I	EUR 50,- zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse R	EUR 50,- zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse I	derzeit 5,00 %
Anteilklasse R	derzeit 5,00 %

Mindestanlagesumme

Anteilklasse I	EUR 95.000,-
Anteilklasse R	keine

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,90 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 1,35 % p.a.

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse I	derzeit 0,025 % p.a.
Anteilklasse R	derzeit 0,025 % p.a.

Währung

Anteilklasse I	Euro
Anteilklasse R	Euro

Ertragsverwendung

Anteilklasse I	Ausschüttung
Anteilklasse R	Ausschüttung

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse I	663647 / DE0006636475
Anteilklasse R	A0MYG0 / DE000A0MYG04

Halbjahresbericht

Stadtsparkasse Düsseldorf NRW-Fonds

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 57.243.165,68 (Stand: September 2020)

Geschäftsführer:

Frank Eggloff, München
Ian Lees, Leverkusen
Katja Müller, Bad Homburg
Markus Neubauer, Frankfurt am Main
Michael Reinhard, Bad Vilbel
Stefan Rockel, Lauterbach (Hessen)
Stephan Scholl, Königstein im Taunus
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Daniel F. Just, Pöcking

2. Verwahrstelle

Helaba Landesbank Hessen-Thüringen

Hausanschrift:

Neue Mainzer Straße 52-58 / Main Tower
60311 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 9132 01
Telefax: +49 69 291517
www.helaba.de

Rechtsform: Anstalt des öffentlichen Rechts
Haftendes Eigenkapital: € 6.942.458.000;00 (Stand: 31.12.2020)

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