

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 30. JUNI 2024

VERWAHRSTELLE:



BERATUNG UND VERTRIEB:



**Halbjahresbericht
Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz**

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	92.915.848,49	100,31
1. Investmentanteile	90.118.502,12	97,29
EUR	77.296.844,15	83,45
USD	12.821.657,97	13,84
2. Derivate	-44.546,88	-0,05
3. Bankguthaben	2.782.623,93	3,00
4. Sonstige Vermögensgegenstände	59.269,32	0,06
II. Verbindlichkeiten	-290.614,33	-0,31
III. Fondsvermögen	92.625.234,16	100,00

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	90.118.502,12	97,29
Investmentanteile							EUR	90.118.502,12	97,29
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	90.118.502,12	97,29
AIS-Amundi IDX MSCI EMER.MKTS Namens-Anteile C Cap.EUR o.N.	LU1681045370		ANT	190.000	0	0	EUR 5,033	956.289,00	1,03
Deka iB.EO L.Sov.D.1-10 U.ETF Inhaber-Anteile	DE000ETFL110		ANT	51.350	0	0	EUR 99,272	5.097.617,20	5,50
iSh. III-iSh. EUR Gov. Bd Cl. Reg. Shares EUR Acc. o.N.	IE00BLDGH553		ANT	1.174.800	1.174.800	0	EUR 4,200	4.933.807,56	5,33
iSh.STOXX Europe 600 U.ETF DE Inhaber-Anteile	DE0002635307		ANT	21.600	0	21.000	EUR 50,870	1.098.792,00	1,19
iShares Core EO STOXX.50 U.E.DE Inhaber-Anteile	DE0005933956		ANT	27.000	0	0	EUR 49,655	1.340.685,00	1,45
iShs IV-iSh.MSCI EMU ESG Scr. Reg. Shares EUR Acc. o.N.	IE00BFNM3B99		ANT	272.000	0	0	EUR 8,197	2.229.584,00	2,41
iShs-EO Corp Bd Lar.Cap U.ETF Registered Shares o.N.	IE0032523478		ANT	30.000	0	0	EUR 122,095	3.662.850,00	3,95
iShsIII-Core EO Govt Bd U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B4WXJJ64		ANT	69.220	0	0	EUR 109,450	7.576.129,00	8,18
iShsIII-EO Covered Bond U.ETF Registered Shares o.N.	IE00B3B8Q275		ANT	47.230	0	0	EUR 139,195	6.574.179,85	7,10
iShsIII-EO Crp.Bd BBB-BB U.ETF Registered Shares o.N.	IE00BSKRK281		ANT	587.780	0	0	EUR 4,766	2.801.359,48	3,02
JPM ETFs(I)-JPM EUR CBREIU ESG Reg.Sh.JPM EO CB REI EO Acc.oN	IE00BF59RX87		ANT	24.000	5.500	0	EUR 100,995	2.423.880,00	2,62
MUF-Amundi MSCI WaterESG Scr. Actions au Port.Dist o.N.	FR0010527275		ANT	7.200	7.200	0	EUR 64,415	463.788,00	0,50
MUL Amundi Corp Bond PAB UCITS ETF Inh.Anteile Acc	LU1829219127		ANT	52.600	0	0	EUR 144,836	7.618.373,60	8,22
MUL Amundi S&P 500 II UCITS ETF Inh.Anteile Dist	LU0496786574		ANT	11.500	0	20.500	EUR 52,804	607.246,00	0,66
UBS(L)FS-BB USD EM Sov. UC.ETF Namens-Anteile A Dis USD o.N.	LU1324516050		ANT	996.620	0	56.300	EUR 8,421	8.392.537,02	9,06
UBS(L)FS-BBG MSCI EO ALCS.UETF Inhaber-Anteile A Dis.EUR o.N.	LU1484799769		ANT	414.090	28.700	0	EUR 12,944	5.359.980,96	5,79
UBS(L)FS-ESTXX50 ESG UCITS ETF Act. Nom. A EUR Dis. oN	LU1971906802		ANT	17.500	17.500	0	EUR 17,668	309.190,00	0,33
Vanguard EUR Euroz.Gov.B.U.ETF Registered Shares EUR Dis.oN	IE00BZ163H91		ANT	254.580	0	0	EUR 22,214	5.655.240,12	6,11
Vanguard Fds-V ESG EUR C.B ETF Reg.Shs EUR Acc. oN	IE000QADMYA3		ANT	1.133.600	1.133.600	0	EUR 5,408	6.130.055,36	6,62
Xtr.(IE)-MSCI USA ESG UCI.ETF Registered Shares 1C o.N.	IE00BFMNPS42		ANT	72.400	0	3.500	EUR 56,150	4.065.260,00	4,39
HSBC ETFS-Em.Mkt Sust.Equity Reg. Shs USD Acc. oN	IE00BKY59G90		ANT	112.000	37.000	0	USD 14,350	1.499.813,36	1,62
InvescoM2 Solar Energy ETF Reg. Shs USD Acc. oN	IE00BM8QRZ79		ANT	21.800	21.800	0	USD 21,365	434.636,99	0,47
iShsIV-NASDAQ US Biotech.U.ETF Registered Shares USD Acc.o.N.	IE00BYXG2H39		ANT	95.000	0	0	USD 6,583	583.554,96	0,63
MUL-Amundi MSCI Emerg.Mkts II Inh.-Anteile UCITS ETF Dist oN	LU2573966905		ANT	29.760	6.760	0	USD 48,308	1.341.588,35	1,45
SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS Registered Shs USD Acc oN	IE00BH4GPZ28		ANT	109.668	0	0	USD 39,275	4.019.420,21	4,34
UBS(IrI)ETF-S&P 500 ESG UC.ETF Reg. Shs A USD Acc. oN	IE00BHXMH11		ANT	118.524	0	0	USD 40,205	4.446.862,09	4,80
Xtr.(IE)-Art.Int.+Big Data ETF Reg. Shares 1C USD o.N.	IE00BGV5VN51		ANT	4.000	0	1.270	USD 132,820	495.782,01	0,54
Summe Wertpapiervermögen 2)							EUR	90.118.502,12	97,29

Halbjahresbericht Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	-44.546,88	-0,05
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-9.020,57	-0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-9.020,57	-0,01
FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 20.09.24 EUREX		185	EUR	Anzahl	-9			-2.115,00	0,00
FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 20.09.24 CME		352	USD	Anzahl	-8			-6.905,57	-0,01
Devisen-Derivate							EUR	-35.526,31	-0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Währungsterminkontrakte							EUR	-35.526,31	-0,04
FUTURE CROSS RATE EUR/USD 16.09.24 CME		352	USD		9.000.000		USD 1,076	-35.526,31	-0,04

Halbjahresbericht Stadtparkkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.782.623,93	3,00
Bankguthaben							EUR	2.782.623,93	3,00
EUR - Guthaben bei:									
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	2.485.837,68			% 100,000	2.485.837,68	2,68
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:									
Landesbank Baden-Württemberg			JPY	17.507.958,00			% 100,000	101.580,15	0,11
Landesbank Baden-Württemberg			USD	209.182,86			% 100,000	195.206,10	0,21
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	59.269,32	0,06
Zinsansprüche			EUR	9.683,25				9.683,25	0,01
Variation Margin			EUR	49.586,07				49.586,07	0,05
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-290.614,33	-0,31
Verwaltungsvergütung			EUR	-280.493,93				-280.493,93	-0,30
Verwahrstellenvergütung			EUR	-2.153,74				-2.153,74	0,00
Prüfungskosten			EUR	-7.472,22				-7.472,22	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-494,44				-494,44	0,00
Fondsvermögen							EUR	92.625.234,16	100,00 1)

Halbjahresbericht Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Anteilwert							EUR	112,39	
Ausgabepreis							EUR	115,76	
Anteile im Umlauf							STK	824.153	

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 Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2024	
JPY	(JPY)	172,3561000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0716000	= 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					
Am.Idx Sols-Amundi Sm.Factory Act.Nom.UC.ETF EUR Unh.Acc. oN	LU2037749822	ANT	0	7.500	
HSBC ETFS-Japan Sust.Equity Reg. Shs USD Acc. oN	IE00BKY55S33	ANT	0	97.780	
L&G ETF-L&G Clean Energy ETF Reg. Shs USD Acc. oN	IE00BK5BCH80	ANT	0	48.000	
Xtr.II Eurozone Gov.Bond Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0290355717	ANT	0	22.500	
Xtrackers II EUR Corporate Bd Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0478205379	ANT	0	40.240	

Halbjahresbericht Stadtsparkasse 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

6.811,06

Währungsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

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

EUR

11.286,53

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)

EUR

95,13

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 Stadtparkkasse Düsseldorf TOP-Substanz

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,29
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,05

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	112,39
Ausgabepreis	EUR	115,76
Anteile im Umlauf	STK	824.153

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

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.

**Halbjahresbericht
Stadtsparkasse Düsseldorf TOP-Substanz**

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 1. Juli 2024

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 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan
Mathias Heiß, Langen
Dr. André Jäger, Witten
Corinna Jäger, Nidderau
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

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

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) 878-0
Telefax (0211) 878-1748
www.sskduesseldorf.de

WKN / ISIN: A0NBG5 / DE000A0NBG59