

HALBJAHRESBERICHT STADTSPARKASSE DÜSSELDORF TOP-CHANCE

OGAW-Sondervermögen nach deutschem Recht

zum 30.06.2019

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2019

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Investmentanteile			
– Indexfonds	EUR	53.115.478,74	96,91
2. Derivate			
– Optionsrechte (Verkauf)	EUR	-474.300,00	-0,87
– Futures (Verkauf)	EUR	-8.550,00	-0,02
3. Bankguthaben			
– Bankguthaben in EUR	EUR	1.001.480,97	1,83
– Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	404.654,69	0,74
4. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	878.743,94	1,61
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-107.052,09	-0,20
III. Fondsvermögen		EUR	54.810.456,25
			100,00¹

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Investmentanteile						EUR	53.115.478,74	96,91
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								
LU1681039647	Amundi Index Solutions - Euro Corporates UCITS ETF	ANT	3.370	2.100	0	EUR 225,5200	760.002,40	1,39
LU1681038912	Amundi Index Solutions - JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF	ANT	35.150	35.150	0	EUR 123,8794	4.354.360,91	7,94
LU1681045370	Amundi Index Solutions- MSCI EMER. MARK. UCITS ETF	ANT	1.607.700	0	0	EUR 4,1219	6.626.778,63	12,09
LU0378434582	ComStage ETF-DJ STOXX 600 TRI	ANT	26.700	0	0	EUR 80,1800	2.140.806,00	3,91
LU0478205379	db x-trackers II iBoxx Liquid Corp. ETF 1C	ANT	7.100	0	0	EUR 158,5150	1.125.456,50	2,05
DE000ETFL110	Deka iBoxx Euro Liquid Sov. Div. 1-10 ETF	ANT	7.000	0	0	EUR 118,8000	831.600,00	1,52
IE00B3YCGJ38	Invesco Markets-S&P 500 UCITS ETF	ANT	13.550	13.550	0	EUR 465,1800	6.303.189,00	11,50
IE00B66F4759	iShares - Euro High Yield Corporate Bond ETF	ANT	14.890	4.200	0	EUR 104,8700	1.561.514,30	2,85
IE0032523478	iShares Euro Corporate Bond Large Cap ETF	ANT	8.700	1.400	0	EUR 139,2500	1.211.475,00	2,21
IE00B1FZS913	iShares II PLC - Euro Government Bd 15-30UCITS ETF	ANT	3.000	0	3.000	EUR 258,6500	775.950,00	1,42
IE00B2NPKV68	iShares II PLC - J.P.Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	ANT	9.100	0	0	EUR 98,9500	900.445,00	1,64
IE00B3F81R35	iShares III PLC - iShares Core Euro Corp. Bond ETF	ANT	15.600	0	0	EUR 133,7900	2.087.124,00	3,81
IE00B9M6RS56	iShares JPM \$ EM Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist)	ANT	15.800	0	0	EUR 95,0650	1.502.027,00	2,74
IE00B4L5ZG21	iShares PLC - Barcl. Cap. Euro Corp. Bond ex Fin.	ANT	3.500	0	3.200	EUR 120,4250	421.487,50	0,77
DE0002635307	iShares STOXX Europe 600 ETF (DE)	ANT	21.400	0	0	EUR 38,0300	813.842,00	1,48
IE00B53L3W79	iShares VII PLC - iShares Core EURO STOXX 50	ANT	28.900	0	0	EUR 110,5200	3.194.028,00	5,83
IE00B5BMR087	iShares VII PLC - iShares Core S&P 500	ANT	11.900	0	1.600	EUR 253,2000	3.013.080,00	5,50
IE00BD4DXB77	Xtrackers \$ EM Bond Quality Weight. 2D € Hedg. ETF	ANT	120.400	0	0	EUR 12,8505	1.547.200,20	2,82
LU0274211217	Xtrackers - Xtrackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF	ANT	62.600	41.900	69.300	EUR 36,5550	2.288.343,00	4,18
LU0490618542	Xtrackers - Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF	ANT	85.400	0	0	EUR 46,9840	4.012.433,60	7,32
LU0328475792	Xtrackers - Xtrackers Stoxx Europe 600 UCITS ETF	ANT	14.000	0	0	EUR 82,5400	1.155.560,00	2,11
IE00BTJRM35	Xtrackers MSCI Emerging Markets UCITS ETF	ANT	58.200	18.600	0	EUR 43,0910	2.507.896,20	4,58
LU0290355717	Xtrackers II Eurozone Government Bond UCITS ETF	ANT	11.200	4.150	0	EUR 244,6600	2.740.192,00	5,00
LU0321462953	Xtrackers II USD Emerging Markets Bond UCITS ETF	ANT	3.750	3.750	0	EUR 330,8500	1.240.687,50	2,26
Summe Wertpapiervermögen²						EUR	53.115.478,74	96,91

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2019	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	-474.300,00	-0,87
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Optionsrechte								
Optionsrechte auf Aktienindices								
CALL Euro Stoxx 50 Index 3200,00 03/20	EDT	STK Anzahl	-800			EUR 301,2000	-240.960,00	-0,44
CALL Euro Stoxx 50 Index 3300,00 09/19	EDT	STK Anzahl	-360			EUR 179,5000	-64.620,00	-0,12
CALL Euro Stoxx 50 Index 3300,00 12/19	EDT	STK Anzahl	-800			EUR 210,9000	-168.720,00	-0,31
Zins-Derivate						EUR	-8.550,00	-0,02
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsterminkontrakte								
6,000% Euro Bund Future 09/19	EDT	EUR	-500.000				-8.550,00	-0,02
Bankguthaben						EUR	1.406.135,66	2,57
EUR-Guthaben bei:								
BNP PARIBAS Securities Services S.C.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	1.001.480,97			% 100,0000	1.001.480,97	1,83
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)		USD	460.031,68			% 100,0000	404.654,69	0,74
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	878.743,94	1,61
Einschüsse (Initial Margin)		EUR	860.808,20				860.808,20	1,57
Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR	9.385,74				9.385,74	0,02
Variation Margin		EUR	8.550,00				8.550,00	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-107.052,09	-0,20
Kostenabgrenzung		EUR	-82.225,86				-82.225,86	-0,15
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR	-24.826,23				-24.826,23	-0,05
Fondsvermögen						EUR	54.810.456,25	100,00 ³
Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Chance						EUR	173,87	
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Chance						STK	315.239	

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 28.06.2019		
US-Dollar	(USD)	1,136850	=	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
Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
LU1681039134	AIS - JPX-NIKKEI 400 ETF	ANT	0	20.200
DE000A1JM6F5	Invesco Markets - Invesco S&P 500 UCITS ETF	ANT	0	13.550
IE00B1FZS798	iShares II \$ Treasury Bond 7-10yr ETF	ANT	0	12.200
DE000A0H08M3	iShares STOXX Europe 600 Oil & Gas ETF (DE)	ANT	0	42.800

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			8.289
DAX Index Future,				
E-Mini S&P 500 Index Future,				
EURO STOXX 50 Index Future)				
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			816
Euro Bund Future)				
Devisenterminkontrakte				
Devisenfutures				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			1.889
EUR/USD)				
Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate				
Optionsrechte auf Aktienindices				
Verkaufte Kaufoptionen (Call)				
(Basiswerte:	EUR			241
ESTX 50 Price Index (EUR))				

Sondervermögen Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Chance

Mindestanlagesumme	keine
Fondsaufgabe	25.03.2008
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%; derzeit 5,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	bis zu 2,65%, mindestens 30.000,00 EUR; derzeit 1,65%, mindestens 30.000,00 EUR
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend
Währung	EUR
ISIN	DE000A0NBG34

ANHANG GEM. §7 NR. 9 KARBV

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

Anteilwert Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Chance	EUR	173,87
Umlaufende Anteile Stadtparkasse Düsseldorf TOP-Chance	STK	315.239

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

96,91% 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.
