

HALBJAHRESBERICHT STIFTUNGSFONDS STS

Ein OGAW deutschen Rechts
zum 30.06.2021

INHALTSVERZEICHNIS

VERMÖGENSÜBERSICHT	3
VERMÖGENSAUFSTELLUNG	4
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	10

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		64.793.018,32	100,01
1. Anleihen		60.996.598,75	94,15
- Pfandbriefe	EUR	21.301.333,00	32,88
- Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	33.692.743,75	52,00
- Unternehmensanleihen	EUR	6.002.522,00	9,26
2. Derivate		-97.940,00	-0,15
- Futures (Verkauf)	EUR	-97.940,00	-0,15
3. Bankguthaben		3.763.951,51	5,81
- Bankguthaben in EUR	EUR	3.763.951,51	5,81
4. Sonstige Vermögensgegenstände		130.408,06	0,20
II. Verbindlichkeiten		-3.488,84	-0,01
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-3.488,84	-0,01
III. Fondsvermögen	EUR	64.789.529,48	100,00¹⁾

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	58.661.711,75	90,54	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	58.661.711,75	90,54	
XS2240505268	0,000% adidas Nts. 05.10.28	EUR		1.500	0	0	%	99,3500	1.490.250,00	2,30
XS2102355588	0,000% BMW Finance MTN 14.04.23	EUR		350	0	0	%	100,6190	352.166,50	0,54
FR0014000UG9	0,000% Caisse d'Amortissement Dette Sociale MTN 25.02.26	EUR		1.000	0	0	%	101,5110	1.015.110,00	1,57
XS1509006208	0,000% EIB MTN 13.03.26	EUR		3.100	0	0	%	101,9205	3.159.535,50	4,88
FR0013219177	0,000% Frankreich OAT 25.05.22	EUR		5.000	2.000	0	%	100,5835	5.029.175,00	7,76
DE000A1RQDR4	0,000% Hessen SA 10.03.25	EUR		2.000	0	0	%	101,6045	2.032.090,00	3,14
DE000A1RQDY0	0,000% Hessen SA 22.09.27	EUR		1.000	0	0	%	101,4375	1.014.375,00	1,57
BE0002707884	0,000% KBC Bank MTN 03.12.25	EUR		500	0	0	%	101,4615	507.307,50	0,78
XS2170362326	0,000% Nestle Finance Intl. MTN 12.11.24	EUR		300	0	0	%	100,8125	302.437,50	0,47
DE000NWBOAJ5	0,000% NRW.Bank MTN 18.02.30	EUR		200	0	0	%	100,0765	200.153,00	0,31
DE000A14JZN7	0,010% Baden-Württemberg LSA 04.08.27	EUR		500	0	0	%	101,5215	507.607,50	0,78
XS2106563161	0,010% Bawag P.S.K. PF 21.01.28	EUR		1.000	0	0	%	101,0085	1.010.085,00	1,56
BE6324720299	0,010% Belfius Bank MTN 15.10.25	EUR		200	0	0	%	100,0905	200.181,00	0,31
FR0013519568	0,010% Caisse Francaise de Financementl Nts. 24.06.30	EUR		1.000	0	0	%	99,7285	997.285,00	1,54
FR0013451796	0,010% CRH-Caisse Refinancement de ,Habitat Nts. 08.10.29	EUR		4.000	0	0	%	100,2010	4.008.040,00	6,19
DE000A1RQD43	0,010% Hessen SA 18.06.31	EUR		600	600	0	%	99,8100	598.860,00	0,92
XS1999841445	0,010% KfW MTN 05.05.27	EUR		450	0	2.000	%	101,7975	458.088,75	0,71
DE000LB2CMY0	0,010% LBBW ÖPF 18.09.28	EUR		1.400	0	0	%	100,8815	1.412.341,00	2,18
DE000A14JOL1	0,010% NATIXIS Pfandbriefbank HPF 20.11.24	EUR		500	0	0	%	101,1390	505.695,00	0,78
DE000SHFM741	0,010% Schleswig-Holstein LSA 22.05.30	EUR		1.000	0	0	%	100,2155	1.002.155,00	1,55
FR0014002P50	0,010% UNEDIC MTN 25.05.31	EUR		500	2.500	2.000	%	98,6300	493.150,00	0,76
DE000WBPOA79	0,010% Wuestenrot Bausparkasse PF 20.10.27	EUR		500	0	0	%	101,1495	505.747,50	0,78
XS1445725218	0,050% BNG Bank MTN 13.07.24	EUR		200	0	0	%	101,5510	203.102,00	0,31
FR0013465010	0,050% Credit Agricole Home Loan SFH 06.12.29	EUR		4.000	0	0	%	100,5635	4.022.540,00	6,21
DE000A2BN5X6	0,100% Bundesländer Nr.51 LSA 07.10.26	EUR		2.100	0	0	%	102,1560	2.145.276,00	3,31
FR0013459757	0,100% Caisse Francaise de Financement Local PF 13.11.29	EUR		3.000	0	0	%	100,9715	3.029.145,00	4,68
FR0013521382	0,100% Region of Ile de France Nts. 02.07.30	EUR		200	0	0	%	99,3790	198.758,00	0,31
DE000RLP0777	0,100% Rheinland-Pfalz LSA 18.08.26	EUR		200	0	0	%	102,1295	204.259,00	0,32
FR0126221896	0,100% Unedic MTN 25.11.26	EUR		1.000	0	0	%	101,8450	1.018.450,00	1,57

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
DE000BLB6JJ0	0,125% Bayerische Landesbank MTN 10.02.28		EUR	400	1.000	600	%	99,0025	396.010,00	0,61
DE000NRW0MY1	0,125% Nordrhein-Westfalen MTN 04.06.31		EUR	500	500	0	%	100,9420	504.710,00	0,78
DE000NWB2KW3	0,125% NRW.Bank IHS 12.04.27		EUR	500	0	0	%	102,0405	510.202,50	0,79
DE000RLP0736	0,125% Rheinland-Pfalz LSA 01.03.23		EUR	1.500	0	0	%	101,1325	1.516.987,50	2,34
XS1499574991	0,125% Stadshypotek PF 05.10.26		EUR	3.500	0	0	%	101,9885	3.569.597,50	5,51
EU000A1G0DE2	0,200% European Financial Stability Facility MTN 28.04.25		EUR	2.000	0	0	%	102,4150	2.048.300,00	3,16
FR0013431137	0,250% Agence Francaise de Developpement MTN 29.06.29		EUR	2.500	0	0	%	101,6245	2.540.612,50	3,92
FR0013190188	0,250% Agence Française Développement MTN 21.07.26		EUR	3.500	0	0	%	102,4830	3.586.905,00	5,54
XS2018636600	0,250% Koninklijke Ahold Delhaize Nts. 26.06.25		EUR	400	0	0	%	101,1000	404.400,00	0,62
XS1576693110	0,250% OP-Asuntoluottopankki Oyj MTN 13.03.24		EUR	1.700	0	0	%	101,9735	1.733.549,50	2,68
XS2029574634	0,375% ALD MTN 18.07.23		EUR	700	0	0	%	101,0595	707.416,50	1,09
XS2102357014	0,375% BMW Finance MTN 14.01.27		EUR	200	0	0	%	101,9370	203.874,00	0,31
XS2177122541	0,375% Deutsche Post MTN 20.05.26		EUR	150	0	0	%	102,0480	153.072,00	0,24
XS2125426796	0,375% DSV Panalpina Nts. 26.02.27		EUR	100	0	0	%	101,2705	101.270,50	0,16
FR0013407236	0,500% Frankreich OAT 25.05.29		EUR	1.500	1.500	0	%	104,9355	1.574.032,50	2,43
XS2082345955	0,625% Coca-Cola HBC Finance MTN 21.11.29		EUR	500	0	0	%	101,4130	507.065,00	0,78
DE000A289NX4	0,625% Evonik Finance MTN 18.09.25		EUR	200	0	0	%	102,4765	204.953,00	0,32
XS1485532896	0,625% Koninklijke KPN MTN 09.04.25		EUR	200	0	0	%	102,2085	204.417,00	0,32
BE0002266352	0,750% KBC Groep MTN 18.10.23		EUR	200	0	0	%	102,3430	204.686,00	0,32
XS1788605936	1,250% Securitas MTN 06.03.25		EUR	150	0	0	%	104,1340	156.201,00	0,24
FR0013320249	1,800% Mercialis Bds. 27.02.26		EUR	200	0	0	%	105,0420	210.084,00	0,32
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								EUR	2.334.887,00	3,60
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	2.334.887,00	3,60
DE000A3H24E1	0,010% Niedersachsen LSA 19.02.29		EUR	1.000	0	0	%	100,9050	1.009.050,00	1,56
DE000A13SL75	0,250% Investitionsbank Schleswig-Holstein IHS 06.09.24		EUR	700	0	0	%	102,1170	714.819,00	1,10
XS2082333787	0,300% DekaBank Deutsche Girozentrale MTN 20.11.26		EUR	200	0	0	%	102,0190	204.038,00	0,31
XS2193666042	0,375% Deutsche Bahn Finance MTN 23.06.29		EUR	400	0	0	%	101,7450	406.980,00	0,63
Summe Wertpapiervermögen ²⁾								EUR	60.996.598,75	94,15

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe / Verkäufe / Zugänge Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate						EUR	-97.940,00	-0,15
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
Zins-Derivate						EUR	-97.940,00	-0,15
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	-97.940,00	-0,15
Zinsterminkontrakte						EUR	-97.940,00	-0,15
6,000% Euro Bobl Future 09/21		EDT	EUR	-4.900.000			-7.840,00	-0,01
6,000% Euro Bund Future 09/21		EDT	EUR	-8.500.000			-90.100,00	-0,14

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe / Verkäufe / Zugänge Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben						EUR	3.763.951,51	5,81
EUR - Guthaben bei:						EUR	3.763.951,51	5,81
	CACEIS Bank S.A. [Germany Branch] (Verwahrstelle)		EUR	3.763.951,51	%	100,0000	3.763.951,51	5,81
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	130.408,06	0,20
Zinsansprüche						EUR	32.468,06	0,05
			EUR	32.468,06			32.468,06	0,05
Variation Margin						EUR	97.940,00	0,15
			EUR	97.940,00			97.940,00	0,15
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-3.488,84	-0,01
Kostenabgrenzung						EUR	-3.488,84	-0,01
			EUR	-3.488,84			-3.488,84	-0,01
Fondsvermögen						EUR	64.789.529,48	100,00²⁾
Anteilwert Stiftungsfonds STS						EUR	1.086,20	
Umlaufende Anteile Stiftungsfonds STS						STK	59.648,00	

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

³⁾ Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Marktschlüssel

a) Terminbörse

EDT EUREX

Während des Berichtszeitraums 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				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS2234568983	0,010% SpareBank 1 Boligkredit Nts. 22.09.27	EUR	0	700
XS2291901994	0,010% Sparebanken Sør Boligkredit PF 26.01.28	EUR	1.000	1.000
XS2076139166	0,125% Sparebanken Soer Boligkredit PF 05.11.29	EUR	0	2.000
BE0000339482	0,200% Belgien OBL 22.10.23	EUR	0	1.000
DE000DHY4648	0,250% Deutsche Hypothekenbank HPF 17.05.24	EUR	0	1.000
XS1999728394	0,250% Hypo Vorarlberg Bank HPF 21.05.27	EUR	0	300
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
DE000GRN0024	0,010% Deutsche Kreditbank IHS 23.02.26	EUR	650	650

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

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte (Basiswerte:	EUR			24.705
Euro Bobl Future				
Euro Bund Future)				

Sondervermögen Stiftungsfonds STS

Mindestanlagesumme				keine
Fondsaufgabe				03.12.2003
Ausgabeaufschlag				0,00%
Rücknahmeabschlag				0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)			bis zu 0,2% p.a; derzeit 0,055% p.a,	
Stückelung				Globalurkunde
Ertragsverwendung				Ausschüttend
Währung				Euro
ISIN				DE000A0RL0K0

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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

Sonstige Angaben

Anteilwert Stiftungsfonds STS	EUR	1.086,20
Umlaufende Anteile Stiftungsfonds STS	STK	59.648,00

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 Stiftungsfonds STS zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

94,15% 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.

Aschheim, Juli 2021

Société Générale Securities Services GmbH

Die Geschäftsführung