

HALBJAHRESBERICHT STIFTUNGSFONDS STS

Ein OGAW deutschen Rechts
zum 30.06.2022

INHALTSVERZEICHNIS

VERMÖGENSÜBERSICHT	3
VERMÖGENSAUFSTELLUNG	4
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	11

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		69.158.192,70	100,23
1. Aktien		4.832.574,11	7,00
- Deutschland	EUR	1.609.371,68	2,33
- Euro-Länder	EUR	3.073.878,39	4,45
- Nicht EU/EWR-Länder	EUR	149.324,04	0,22
2. Anleihen		61.569.958,75	89,23
- Pfandbriefe	EUR	18.853.964,00	27,32
- Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	37.684.737,50	54,62
- Unternehmensanleihen	EUR	5.031.257,25	7,29
3. Derivate		153.520,00	0,22
- Futures (Verkauf)	EUR	153.520,00	0,22
4. Bankguthaben		2.537.469,54	3,68
- Bankguthaben in EUR	EUR	2.537.469,54	3,68
5. Sonstige Vermögensgegenstände		64.670,30	0,09
II. Verbindlichkeiten		-159.013,22	-0,23
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-159.013,22	-0,23
III. Fondsvermögen	EUR	68.999.179,48	100,00¹⁾

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	64.289.144,36	93,17
Aktien							EUR	4.832.574,11	7,00
FR000120404	Accor S.A.		STK	3.512	0	0	EUR 25,8300	90.714,96	0,13
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	325	0	0	EUR 168,7600	54.847,00	0,08
NL0012969182	Adyen N.V.		STK	100	100	0	EUR 1.388,0000	138.800,00	0,20
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.		STK	1.171	0	0	EUR 62,6200	73.328,02	0,11
DE0008404005	Allianz SE		STK	350	0	860	EUR 182,1200	63.742,00	0,09
FR0010220475	Alstom S.A.		STK	3.447	0	0	EUR 21,5900	74.420,73	0,11
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev SA/NV		STK	3.000	1.049	0	EUR 51,3600	154.080,00	0,22
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	520	65	0	EUR 455,8500	237.042,00	0,34
ES0113900J37	Banco Santander S.A.		STK	30.000	0	20.726	EUR 2,6880	80.640,00	0,12
FR0001311104	BNP Paribas S.A.		STK	2.500	0	947	EUR 45,3650	113.412,50	0,16
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	650	0	0	EUR 113,9000	74.035,00	0,11
NL0010545661	CNH Industrial N.V.		STK	4.877	4.877	4.877	EUR 11,0200	53.744,54	0,08
IE0001827041	CRH PLC		STK	1.821	0	0	EUR 33,0000	60.093,00	0,09
FR000120644	Danone S.A.		STK	3.900	1.169	0	EUR 53,2600	207.714,00	0,30
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	500	0	2.101	EUR 159,6000	79.800,00	0,12
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	5.800	2.418	0	EUR 35,7400	207.292,00	0,30
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	10.405	0	0	EUR 18,9460	197.133,13	0,29
ES0171996087	Grifols S.A.		STK	5.203	0	0	EUR 18,0350	93.836,11	0,14
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	4.600	1.153	0	EUR 23,0900	106.214,00	0,15
NL0011821202	ING Groep N.V.		STK	9.000	0	3.616	EUR 9,4310	84.879,00	0,12
FR000121485	Kering S.A.		STK	169	0	0	EUR 490,1000	82.826,90	0,12
IE0004906560	Kerry Group PLC A		STK	1.650	479	0	EUR 91,3400	150.711,00	0,22
NL0000009082	Koninklijke (Royal) KPN N.V.		STK	20.000	0	19.670	EUR 3,4010	68.020,00	0,10
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.V.		STK	2.500	2.500	0	EUR 24,8600	62.150,00	0,09
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.		STK	3.447	0	0	EUR 20,5550	70.853,09	0,10
FR000120321	L'Oreal S. A.		STK	390	0	0	EUR 329,3000	128.427,00	0,19
FR000121014	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE		STK	429	0	0	EUR 581,7000	249.549,30	0,36
DE0006599905	Merck KGaA		STK	1.000	675	0	EUR 161,0000	161.000,00	0,23
IT0005366767	Nexi S.p.A.		STK	2.276	0	0	EUR 7,9040	17.989,50	0,03
FI0009000681	Nokia Corp.		STK	10.405	0	0	EUR 4,4395	46.193,00	0,07
NL0012169213	Qiagen N.V.		STK	689	0	0	EUR 44,7000	30.798,30	0,04
FR000120578	Sanofi S.A.		STK	1.951	0	0	EUR 96,3400	187.959,34	0,27
DE0007164600	SAP SE		STK	1.500	99	1.200	EUR 86,9300	130.395,00	0,19
DE0007165631	Sartorius AG VZ		STK	169	0	0	EUR 333,4000	56.344,60	0,08
FR000121972	Schneider Electric SE		STK	858	0	0	EUR 112,9000	96.868,20	0,14
DE0007236101	Siemens AG		STK	1.405	0	0	EUR 97,0900	136.411,45	0,20

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	6.500	2.208	0	EUR 13,9850	90.902,50	0,13
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	1.500	1.000	0	EUR 48,4900	72.735,00	0,11
ES0165386014	Solaria Energia Y Medio Ambiente S.A.		STK	5.000	708	0	EUR 20,2500	101.250,00	0,15
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Holding AG		STK	30.000	30.000	0	EUR 2,7400	82.200,00	0,12
BE0974320526	Umicore S.A.		STK	1.730	0	0	EUR 33,3200	57.643,60	0,08
GB00B10RZP78	Unilever PLC		STK	3.447	0	0	EUR 43,3200	149.324,04	0,22
AT0000746409	Verbund AG A		STK	1.210	0	0	EUR 93,3500	112.953,50	0,16
FR0000125486	Vinci S.A.		STK	1.730	0	0	EUR 84,9600	146.980,80	0,21
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG		STK	700	310	0	EUR 137,6000	96.320,00	0,14
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	59.456.570,25	86,17
XS2240505268	0,000% adidas Nts. 05.10.28		EUR	1.500	0	0	% 86,7830	1.301.745,00	1,89
XS2102355588	0,000% BMW Finance MTN 14.04.23		EUR	350	0	0	% 99,3310	347.658,50	0,50
FR0014000UG9	0,000% Caisse d'Amortissement Dette Sociale MTN 25.02.26		EUR	1.000	0	0	% 95,0555	950.555,00	1,38
XS1509006208	0,000% EIB MTN 13.03.26		EUR	3.100	0	0	% 95,1545	2.949.789,50	4,28
FR0014002WK3	0,000% Frankreich OAT 25.11.31		EUR	500	500	0	% 84,2785	421.392,50	0,61
DE000A1RQDR4	0,000% Hessen SA 10.03.25		EUR	2.000	0	0	% 96,6300	1.932.600,00	2,80
DE000A1RQDY0	0,000% Hessen SA 22.09.27		EUR	1.000	0	0	% 91,8600	918.600,00	1,33
IT0005437147	0,000% Italien B.T.P. 01.04.26		EUR	2.500	1.300	0	% 92,3170	2.307.925,00	3,34
IT0005474330	0,000% Italien B.T.P. 15.12.24		EUR	2.200	2.200	0	% 96,0105	2.112.231,00	3,06
BE0002707884	0,000% KBC Bank MTN 03.12.25		EUR	500	0	0	% 94,7720	473.860,00	0,69
XS2170362326	0,000% Nestle Finance Intl. MTN 12.11.24		EUR	300	0	0	% 96,4480	289.344,00	0,42
DE000NWB0AJ5	0,000% NRW.Bank MTN 18.02.30		EUR	200	0	0	% 86,3870	172.774,00	0,25
DE000A14JZN7	0,010% Baden-Württemberg LSA 04.08.27		EUR	500	0	0	% 92,3165	461.582,50	0,67
XS2106563161	0,010% Bawag P.S.K. PF 21.01.28		EUR	1.000	0	0	% 90,0915	900.915,00	1,31
BE6324720299	0,010% Belfius Bank MTN 15.10.25		EUR	200	0	0	% 92,8455	185.691,00	0,27
FR0013519568	0,010% Caisse Francaise de Financementl Nts. 24.06.30		EUR	1.000	0	0	% 84,7100	847.100,00	1,23
FR0013451796	0,010% CRH-Caisse Refinancement de ,Habitat Nts. 08.10.29		EUR	4.000	0	0	% 86,3965	3.455.860,00	5,01
DE000A1RQD43	0,010% Hessen SA 18.06.31		EUR	600	0	0	% 84,0030	504.018,00	0,73
XS1999841445	0,010% KfW MTN 05.05.27		EUR	450	0	0	% 93,1110	418.999,50	0,61
DE000LB2CMY0	0,010% LBBW ÖPF 18.09.28		EUR	1.400	0	0	% 88,9955	1.245.937,00	1,81
DE000A14JOL1	0,010% NATIXIS Pfandbriefbank HPF 20.11.24		EUR	500	0	0	% 96,6155	483.077,50	0,70
DE000SHFM741	0,010% Schleswig-Holstein LSA 22.05.30		EUR	1.400	0	0	% 86,2585	1.207.619,00	1,75
FR0014002P50	0,010% UNEDIC MTN 25.05.31		EUR	500	0	0	% 84,0025	420.012,50	0,61
DE000WBPOA79	0,010% Wuestenrot Bausparkasse PF 20.10.27		EUR	500	0	0	% 90,9175	454.587,50	0,66

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
XS1445725218	0,050% BNG Bank MTN 13.07.24		EUR	200	0	0 %	97,7005	195.401,00	0,28
FR0013465010	0,050% Credit Agricole Home Loan SFH 06.12.29		EUR	4.000	0	0 %	86,1335	3.445.340,00	4,99
DE000A2BN5X6	0,100% Bundesländer Nr.51 LSA 07.10.26		EUR	2.100	0	0 %	94,2335	1.978.903,50	2,87
FR0013459757	0,100% Caisse Francaise de Financement Local PF 13.11.29		EUR	3.000	0	0 %	86,7015	2.601.045,00	3,77
FR0013521382	0,100% Region of Ile de France Nts. 02.07.30		EUR	200	0	0 %	86,4915	172.983,00	0,25
DE000RLP0777	0,100% Rheinland-Pfalz LSA 18.08.26		EUR	200	0	0 %	94,4340	188.868,00	0,27
FR0126221896	0,100% Unedic MTN 25.11.26		EUR	1.000	0	0 %	93,8320	938.320,00	1,36
DE000BLB6JJ0	0,125% Bayerische Landesbank MTN 10.02.28		EUR	400	0	0 %	84,7545	339.018,00	0,49
DE000NRW0MY1	0,125% Nordrhein-Westfalen MTN 04.06.31		EUR	500	0	0 %	84,9675	424.837,50	0,62
DE000NWB2KW3	0,125% NRW.Bank IHS 12.04.27		EUR	500	0	0 %	93,1345	465.672,50	0,67
DE000RLP0736	0,125% Rheinland-Pfalz LSA 01.03.23		EUR	1.500	0	0 %	99,8625	1.497.937,50	2,17
XS1499574991	0,125% Stadshypotek PF 05.10.26		EUR	3.500	0	0 %	93,5070	3.272.745,00	4,74
EU000A1G0DE2	0,200% European Financial Stability Facility MTN 28.04.25		EUR	2.000	0	0 %	97,1270	1.942.540,00	2,82
FR0013431137	0,250% Agence Francaise de Developpement MTN 29.06.29		EUR	2.500	0	0 %	89,6680	2.241.700,00	3,25
FR0013190188	0,250% Agence Française Développement MTN 21.07.26		EUR	3.500	0	0 %	95,1900	3.331.650,00	4,83
XS2018636600	0,250% Koninklijke Ahold Delhaize Nts. 26.06.25		EUR	400	0	0 %	93,9065	375.626,00	0,54
XS1576693110	0,250% OP- Asuntoluottopankki Oyj MTN 13.03.24		EUR	1.700	0	0 %	98,4410	1.673.497,00	2,43
XS2029574634	0,375% ALD MTN 18.07.23		EUR	700	0	0 %	98,7690	691.383,00	1,00
XS2102357014	0,375% BMW Finance MTN 14.01.27		EUR	200	0	0 %	92,0660	184.132,00	0,27
XS2177122541	0,375% Deutsche Post MTN 20.05.26		EUR	150	0	0 %	94,3915	141.587,25	0,21
XS2125426796	0,375% DSV Panalpina Nts. 26.02.27		EUR	100	0	0 %	89,7725	89.772,50	0,13
FR0013407236	0,500% Frankreich OAT 25.05.29		EUR	1.500	0	0 %	93,2840	1.399.260,00	2,03
DE000A289NX4	0,625% Evonik Finance MTN 18.09.25		EUR	200	0	0 %	93,0405	186.081,00	0,27
XS1485532896	0,625% Koninklijke KPN MTN 09.04.25		EUR	200	0	0 %	96,1050	192.210,00	0,28
ES0000012K20	0,700% Spanien Bos. 30.04.32		EUR	300	500	200 %	85,1355	255.406,50	0,37
BE0002266352	0,750% KBC Groep MTN 18.10.23		EUR	200	0	0 %	98,6515	197.303,00	0,29
BE0000334434	0,800% Belgien OBL 22.06.25		EUR	1.000	1.000	0 %	99,3785	993.785,00	1,44
XS1788605936	1,250% Securitas MTN 06.03.25		EUR	150	0	0 %	95,8420	143.763,00	0,21
FR001400A3H2	1,500% Caisse d'Amortissement Dette Sociale MTN 25.05.32		EUR	2.300	2.300	0 %	94,4725	2.172.867,50	3,15
FR0012993103	1,500% Frankreich OAT 25.05.31		EUR	600	700	400 %	98,0270	588.162,00	0,85

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FR0013320249	1,800% Mercialis Bds. 27.02.26		EUR	200	0	0	%	89,8655	179.731,00	0,26
IT0005365165	3,000% Italien B.T.P. 01.08.29		EUR	1.000	100	100	%	101,1470	1.011.470,00	1,47
IT0005024234	3,500% Italien B.T.P. 01.03.30		EUR	1.000	2.000	1.000	%	104,5280	1.045.280,00	1,51
DE0001135176	5,500% BRD Anl. 04.01.31		EUR	100	1.000	1.900	%	134,4185	134.418,50	0,19
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								EUR	2.113.388,50	3,06
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	2.113.388,50	3,06
DE000A3H24E1	0,010% Niedersachsen LSA 19.02.29		EUR	1.000	0	0	%	89,1285	891.285,00	1,29
DE000A13SL75	0,250% Investitionsbank Schleswig-Holstein IHS 06.09.24		EUR	700	0	0	%	97,7605	684.323,50	0,99
XS2082333787	0,300% DekaBank Deutsche Girozentrale MTN 20.11.26		EUR	200	0	0	%	93,1060	186.212,00	0,27
XS2193666042	0,375% Deutsche Bahn Finance MTN 23.06.29		EUR	400	0	0	%	87,8920	351.568,00	0,51
Summe Wertpapiervermögen ³⁾								EUR	66.402.532,86	96,24
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								EUR	153.520,00	0,22
Aktienindex-Derivate								EUR	76.875,00	0,11
Forderungen/Verbindlichkeiten								EUR	76.875,00	0,11
Aktienindex-Terminkontrakte								EUR	76.875,00	0,11
EURO STOXX 50 Index Future 09/22		EDT	EUR Anzahl	-1.200					76.875,00	0,11
Zins-Derivate								EUR	76.645,00	0,11
Forderungen/Verbindlichkeiten								EUR	76.645,00	0,11
Zinsterminkontrakte								EUR	76.645,00	0,11
6,000% Euro Bobl Future 09/22		EDT	EUR	-15.800					23.420,00	0,03
6,000% Euro Bund Future 09/22		EDT	EUR	-4.700					56.720,00	0,08
6,000% Euro Schatz Future 09/22		EDT	EUR	-4.000					-30.075,00	-0,04
6,000% Euro-BTP Future 09/22		EDT	EUR	-4.800					-41.070,00	-0,06
6,000% Long Term Euro OAT Future 09/22		EDT	EUR	-2.800					67.650,00	0,10

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe / Verkäufe / Zugänge Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben						EUR	2.537.469,54	3,68
EUR - Guthaben bei:						EUR	2.537.469,54	3,68
	CACEIS Bank S.A. [Germany Branch] (Verwahrstelle)		EUR	2.537.469,54	%	100,0000	2.537.469,54	3,68
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	64.670,30	0,09
Zinsansprüche						EUR	64.130,30	0,09
			EUR	64.130,30			64.130,30	0,09
Quellensteueransprüche						EUR	540,00	0,00
			EUR	540,00			540,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-159.013,22	-0,23
Kostenabgrenzung						EUR	-5.493,22	-0,01
			EUR	-5.493,22			-5.493,22	-0,01
Variation Margin						EUR	-153.520,00	-0,22
			EUR	-153.520,00			-153.520,00	-0,22
Fondsvermögen						EUR	68.999.179,48	100,00²⁾
Anteilwert Stiftungsfonds STS						EUR	1.021,86	
Umlaufende Anteile Stiftungsfonds STS						STK	67.523,00	

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				
Aktien				
FR0000120073	Air Liquide S.A. Ét. Expl. P. G. Cl.	STK	0	845
DE0005190003	BMW AG	STK	0	1.886
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	0	2.081
FR0000125338	Capgemini SE	STK	0	845
FR0014008VX5	EuroAPI SAS	STK	84	84
NL0015000LU4	Iveco Group N.V.	STK	975	975
PTJMT0AE0001	Jeronimo Martins, SGPS, S.A.	STK	0	4.292
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	0	429
Verzinsliche Wertpapiere				
FR0013219177	0,000% Frankreich OAT 25.05.22	EUR	0	1.000
XS2082345955	0,625% Coca-Cola HBC Finance MTN 21.11.29	EUR	0	500

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: EURO STOXX 50 Index Future)	EUR			9.857
--	-----	--	--	-------

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte (Basiswerte: Euro-BTP Future)	EUR			504
Verkaufte Kontrakte (Basiswerte: Euro Bobl Future Euro Bund Future Euro Schatz Future Euro-BTP Future Long Term Euro OAT Future)	EUR			102.150

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	1.021,86
Umlaufende Anteile Stiftungsfonds STS	STK	67.523,00

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:

96,24% 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 2022

Société Générale Securities Services GmbH

Die Geschäftsführung