

HALBJAHRESBERICHT STIFTUNGSFONDS STU

Ein OGAW deutschen Rechts
zum 30.06.2022

INHALTSVERZEICHNIS

| | |
|------------------------------------|-----------|
| VERMÖGENSÜBERSICHT | 3 |
| VERMÖGENSAUFSTELLUNG | 4 |
| ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV | 12 |

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

| | | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|------------|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 151.029.998,47 | 100,17 |
| 1. Aktien | | 6.038.524,10 | 4,00 |
| - Deutschland | EUR | 2.335.445,30 | 1,55 |
| - Euro-Länder | EUR | 3.703.078,80 | 2,46 |
| 2. Anleihen | | 141.773.531,00 | 94,03 |
| - Pfandbriefe | EUR | 93.711.522,50 | 62,15 |
| - Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden | EUR | 29.272.083,50 | 19,41 |
| - Unternehmensanleihen | EUR | 18.789.925,00 | 12,46 |
| 3. Derivate | | 239.235,00 | 0,16 |
| - Futures (Verkauf) | EUR | 239.235,00 | 0,16 |
| 4. Bankguthaben | | 2.842.593,55 | 1,89 |
| - Bankguthaben in EUR | EUR | 2.842.593,55 | 1,89 |
| 5. Sonstige Vermögensgegenstände | | 136.114,82 | 0,09 |
| II. Verbindlichkeiten | | -251.548,68 | -0,17 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | | -251.548,68 | -0,17 |
| III. Fondsvermögen | EUR | 150.778.449,79 | 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 | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|-------------------------------------|---|-------|--|-----------------------|--------------------|--|----------------|-----------------------|------------------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 138.087.184,60 | 91,58 |
| Aktien | | | | | | | EUR | 6.038.524,10 | 4,00 |
| DE000A1EWWW0 | adidas AG | | STK | 580 | 0 | 0 | EUR 168,7600 | 97.880,80 | 0,06 |
| NL0012969182 | Adyen N.V. | | STK | 180 | 120 | 0 | EUR 1.388,0000 | 249.840,00 | 0,17 |
| FR0000120073 | Air Liquide S.A. Ét. Expl. P. G. Cl. | | STK | 1.540 | 340 | 0 | EUR 128,1200 | 197.304,80 | 0,13 |
| DE0008404005 | Allianz SE | | STK | 1.000 | 120 | 0 | EUR 182,1200 | 182.120,00 | 0,12 |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | | STK | 1.000 | 200 | 0 | EUR 455,8500 | 455.850,00 | 0,30 |
| DE000BASF111 | BASF SE | | STK | 6.000 | 0 | 0 | EUR 41,5250 | 249.150,00 | 0,17 |
| DE0005313704 | Carl Zeiss Meditec AG | | STK | 1.000 | 0 | 0 | EUR 113,9000 | 113.900,00 | 0,08 |
| FR0000120644 | Danone S.A. | | STK | 7.000 | 0 | 0 | EUR 53,2600 | 372.820,00 | 0,25 |
| DE0005552004 | Deutsche Post AG | | STK | 3.250 | 0 | 0 | EUR 35,7400 | 116.155,00 | 0,08 |
| FR0000121667 | EssilorLuxottica S.A. | | STK | 2.500 | 0 | 0 | EUR 142,9000 | 357.250,00 | 0,24 |
| FR0014000MR3 | Eurofins Scientific S.E. | | STK | 3.700 | 0 | 0 | EUR 75,0800 | 277.796,00 | 0,18 |
| BE0003797140 | Groupe Bruxelles Lambert S.A. (GBL) | | STK | 2.000 | 0 | 0 | EUR 79,6800 | 159.360,00 | 0,11 |
| DE0006048432 | Henkel AG & Co. KGaA VZ | | STK | 2.500 | 0 | 0 | EUR 58,7800 | 146.950,00 | 0,10 |
| FR0000052292 | Hermes International S.A. | | STK | 250 | 100 | 0 | EUR 1.067,0000 | 266.750,00 | 0,18 |
| FR0000121485 | Kering S.A. | | STK | 250 | 0 | 0 | EUR 490,1000 | 122.525,00 | 0,08 |
| DE000KGX8881 | Kion Group AG | | STK | 2.050 | 0 | 0 | EUR 39,5900 | 81.159,50 | 0,05 |
| NL0000009538 | Koninklijke Philips N.V. | | STK | 10.600 | 0 | 0 | EUR 20,5550 | 217.883,00 | 0,14 |
| FR0000120321 | L'Oréal S. A. | | STK | 1.100 | 0 | 0 | EUR 329,3000 | 362.230,00 | 0,24 |
| FR0000121014 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | | STK | 750 | 0 | 0 | EUR 581,7000 | 436.275,00 | 0,29 |
| DE0007100000 | Mercedes-Benz Group AG | | STK | 2.500 | 0 | 0 | EUR 55,2200 | 138.050,00 | 0,09 |
| DE0008430026 | Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG | | STK | 1.200 | 0 | 0 | EUR 224,2000 | 269.040,00 | 0,18 |
| DE0007164600 | SAP SE | | STK | 2.900 | 1.600 | 0 | EUR 86,9300 | 252.097,00 | 0,17 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE | | STK | 950 | 0 | 0 | EUR 112,9000 | 107.255,00 | 0,07 |
| DE0007236101 | Siemens AG | | STK | 3.500 | 0 | 0 | EUR 97,0900 | 339.815,00 | 0,23 |
| DE000SHL1006 | Siemens Healthineers AG | | STK | 7.200 | 0 | 0 | EUR 48,4900 | 349.128,00 | 0,23 |
| NL0000226223 | STMicroelectronics N.V. | | STK | 4.000 | 0 | 0 | EUR 29,9850 | 119.940,00 | 0,08 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 132.048.660,50 | 87,58 |
| XS2224621347 | 0,000% adidas Nts. 09.09.24 | | EUR | 500 | 0 | 0 | % 96,2335 | 481.167,50 | 0,32 |
| EU000A3KWCF4 | 0,000% European Union MTN 04.10.28 | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 90,0745 | 900.745,00 | 0,60 |
| XS2293755125 | 0,000% Island MTN 15.04.28 | | EUR | 500 | 0 | 0 | % 88,0805 | 440.402,50 | 0,29 |
| XS2383886947 | 0,000% LANXESS MTN 08.09.27 | | EUR | 700 | 0 | 0 | % 85,0350 | 595.245,00 | 0,39 |
| DE000A2YNZV0 | 0,000% Mercedes-Benz International Finance MTN 08.02.24 | | EUR | 700 | 0 | 0 | % 97,5300 | 682.710,00 | 0,45 |
| FR00140005B8 | 0,000% Societe Du Grand Paris MTN 25.11.30 | | EUR | 4.600 | 600 | 0 | % 84,8945 | 3.905.147,00 | 2,59 |
| XS2056395606 | 0,000% Telenor MTN 25.09.23 | | EUR | 500 | 0 | 0 | % 98,3180 | 491.590,00 | 0,33 |

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 |
|--------------|--|-------|--|-----------------------|---|-----------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| FR0014000667 | 0,000% Unedic MTN 25.11.28 | | EUR | 5.400 | 0 | 0 % | 89,4635 | 4.831.029,00 | 3,20 |
| XS2380748439 | 0,010% Bawag P.S.K. MTN 03.09.29 | | EUR | 3.500 | 1.000 | 0 % | 86,4185 | 3.024.647,50 | 2,01 |
| DE000BHY0GL4 | 0,010% Berlin Hyp HPF 19.07.27 | | EUR | 2.600 | 0 | 0 % | 91,5150 | 2.379.390,00 | 1,58 |
| FR0013514502 | 0,010% BPCE SFH PF 27.05.30 | | EUR | 2.000 | 0 | 0 % | 84,7300 | 1.694.600,00 | 1,12 |
| FR0014001MO8 | 0,010% BPCE SFH PF 29.01.29 | | EUR | 3.000 | 0 | 0 % | 87,9095 | 2.637.285,00 | 1,75 |
| FR0014004EJ9 | 0,010% Crédit Agricole Home Loan PF12.04.28 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 89,7135 | 448.567,50 | 0,30 |
| XS2058989489 | 0,010% Danske Martgage Bank PF 14.01.28 | | EUR | 2.000 | 0 | 0 % | 90,3510 | 1.807.020,00 | 1,20 |
| XS2289128162 | 0,010% Komerčni banka MTN 20.01.26 | | EUR | 1.000 | 500 | 0 % | 94,0770 | 940.770,00 | 0,62 |
| XS2133077383 | 0,010% Luminor Bank MTN 11.03.25 | | EUR | 800 | 200 | 0 % | 95,6950 | 765.560,00 | 0,51 |
| SK4000016069 | 0,010% Prima Banka Slovensko PF 01.10.26 | | EUR | 5.000 | 0 | 0 % | 92,5425 | 4.627.125,00 | 3,07 |
| XS2243314528 | 0,010% Yorkshire Building Society PF 13.10.27 | | EUR | 2.900 | 0 | 0 % | 90,4600 | 2.623.340,00 | 1,74 |
| FR0013432069 | 0,050% AXA Home Loan PF 05.07.27 | | EUR | 5.000 | 0 | 0 % | 91,5335 | 4.576.675,00 | 3,04 |
| XS1445725218 | 0,050% BNG Bank MTN 13.07.24 | | EUR | 700 | 700 | 0 % | 97,7005 | 683.903,50 | 0,45 |
| EU000A1G0EE0 | 0,050% European Financial Stability Facility MTN 17.10.29 | | EUR | 1.500 | 0 | 0 % | 87,8120 | 1.317.180,00 | 0,87 |
| XS2004366287 | 0,050% Nationwide Building Society PF 03.06.24 | | EUR | 4.000 | 0 | 0 % | 97,5660 | 3.902.640,00 | 2,59 |
| XS2102283814 | 0,050% Santander UK MTN 21.01.27 | | EUR | 4.500 | 0 | 0 % | 92,3050 | 4.153.725,00 | 2,75 |
| XS2014370915 | 0,050% SP Mortgage Bank MTN 19.06.26 | | EUR | 4.700 | 0 | 0 % | 93,8105 | 4.409.093,50 | 2,92 |
| XS2404591161 | 0,050% SpareBank 1 Boligkreditt PF 03.11.28 | | EUR | 1.500 | 1.000 | 0 % | 88,4800 | 1.327.200,00 | 0,88 |
| XS2002504194 | 0,050% Swedbank Hypotek PF 28.05.25 | | EUR | 2.900 | 400 | 0 % | 95,8630 | 2.780.027,00 | 1,84 |
| DE000CB0HRY3 | 0,100% Commerzbank MTN 11.09.25 | | EUR | 1.000 | 0 | 0 % | 92,1670 | 921.670,00 | 0,61 |
| XS1995645287 | 0,100% Santander UK PF 12.05.24 | | EUR | 700 | 0 | 0 % | 97,8045 | 684.631,50 | 0,45 |
| PTCMGAOM0038 | 0,125% Caixa Económica Montepio Geral PF 14.11.24 | | EUR | 1.000 | 500 | 0 % | 96,7185 | 967.185,00 | 0,64 |
| XS2015230365 | 0,125% Coventry Building Society MTN 20.06.26 | | EUR | 4.500 | 500 | 0 % | 93,8565 | 4.223.542,50 | 2,80 |
| FR0013505575 | 0,125% Credit Agricole Home Loan PF 16.12.24 | | EUR | 2.000 | 500 | 0 % | 96,9035 | 1.938.070,00 | 1,29 |
| FR0013444544 | 0,125% Dassault Systemes Nts. 16.09.26 | | EUR | 1.000 | 0 | 0 % | 91,5310 | 915.310,00 | 0,61 |
| XS2181347183 | 0,125% Estland MTN 10.06.30 | | EUR | 600 | 200 | 0 % | 82,1990 | 493.194,00 | 0,33 |
| XS2102916793 | 0,125% Merck Financial Services MTN 16.07.25 | | EUR | 1.000 | 0 | 0 % | 94,6360 | 946.360,00 | 0,63 |
| DE000A2TSB40 | 0,125% Niedersachsen LSA 08.04.27 | | EUR | 1.000 | 0 | 0 % | 93,4355 | 934.355,00 | 0,62 |
| XS2176715584 | 0,125% SAP IHS 18.05.26 | | EUR | 1.000 | 500 | 0 % | 92,9685 | 929.685,00 | 0,62 |
| XS1995620967 | 0,125% SpareBank Vest Boligkreditt PF 14.05.26 | | EUR | 4.000 | 0 | 0 % | 94,2955 | 3.771.820,00 | 2,50 |
| XS2374595044 | 0,125% Volkswagen Financial Services MTN 12.02.27 | | EUR | 1.500 | 500 | 0 % | 85,5505 | 1.283.257,50 | 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 |
|--------------|---|-------|--|-----------------------|---|-----------------------|----------|--------------------|------------------------------|
| XS1991186500 | 0,125% Yorkshire Building Society PF 08.05.24 | | EUR | 3.000 | 0 | 0 % | 97,7470 | 2.932.410,00 | 1,94 |
| XS2264977146 | 0,200% Coca Cola European Partners Nts. 02.12.28 | | EUR | 800 | 0 | 0 % | 83,1205 | 664.964,00 | 0,44 |
| FR0013431137 | 0,250% Agence Francaise de Developpement MTN 29.06.29 | | EUR | 4.000 | 0 | 0 % | 89,6680 | 3.586.720,00 | 2,38 |
| XS1701458017 | 0,250% ASFINAG MTN v. 18.10.24 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 97,5505 | 487.752,50 | 0,32 |
| XS1227748214 | 0,250% BNG Bank MTN 07.05.25 | | EUR | 2.400 | 0 | 0 % | 97,0460 | 2.329.104,00 | 1,54 |
| DE000DHY4648 | 0,250% Deutsche Hypothekenbank HPF 17.05.24 | | EUR | 3.000 | 0 | 0 % | 98,1135 | 2.943.405,00 | 1,95 |
| XS1575991358 | 0,250% EIB MTN 14.10.24 | | EUR | 1.500 | 0 | 0 % | 98,2310 | 1.473.465,00 | 0,98 |
| XS1845161790 | 0,250% Erste Group Bank PF 26.06.24 | | EUR | 2.500 | 0 | 0 % | 97,8820 | 2.447.050,00 | 1,62 |
| XS1999728394 | 0,250% Hypo Vorarlberg Bank HPF 21.05.27 | | EUR | 700 | 0 | 0 % | 92,5245 | 647.671,50 | 0,43 |
| DE000A1KRJR4 | 0,250% ING-DiBA HPF 09.10.23 | | EUR | 2.000 | 0 | 0 % | 99,0775 | 1.981.550,00 | 1,31 |
| XS1435774903 | 0,250% Jyske Realkredit PF 01.07.23 | | EUR | 2.000 | 1.000 | 0 % | 99,4355 | 1.988.710,00 | 1,32 |
| XS1689595830 | 0,250% Oesterreichische Kontrollbank MTN 26.09.24 | | EUR | 1.600 | 300 | 0 % | 97,6785 | 1.562.856,00 | 1,04 |
| FR0013358496 | 0,250% Société Générale SFH PF 11.09.23 | | EUR | 1.700 | 0 | 300 % | 99,2195 | 1.686.731,50 | 1,12 |
| XS2404027935 | 0,250% Swedbank MTN 02.11.26 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 90,5060 | 452.530,00 | 0,30 |
| SK4120015108 | 0,250% Vseobecna Uverova Banka PF 26.03.24 | | EUR | 3.200 | 200 | 0 % | 98,1935 | 3.142.192,00 | 2,08 |
| BE6313645127 | 0,250% Wallonne MTN 03.05.26 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 95,5985 | 477.992,50 | 0,32 |
| XS2063247915 | 0,300% Banco Santander MTN 04.10.26 | | EUR | 400 | 0 | 0 % | 90,3725 | 361.490,00 | 0,24 |
| FR0013231081 | 0,325% Cie de Financement Foncier PF 12.09.23 | | EUR | 2.000 | 0 | 0 % | 99,2880 | 1.985.760,00 | 1,32 |
| XS2289133915 | 0,325% UniCredit MTN 19.01.26 | | EUR | 600 | 0 | 0 % | 89,2395 | 535.437,00 | 0,36 |
| BE0002620012 | 0,375% Belfius Bank PF 24.10.23 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 99,1635 | 495.817,50 | 0,33 |
| FR0013263951 | 0,375% Credit Agricole Home Loan PF 30.09.24 | | EUR | 1.500 | 0 | 0 % | 97,8240 | 1.467.360,00 | 0,97 |
| XS1725524471 | 0,375% Eika BoligKreditt PF 26.02.25 | | EUR | 2.500 | 0 | 0 % | 97,1700 | 2.429.250,00 | 1,61 |
| DE000LB2CRG6 | 0,375% Landesbank Baden-Württemberg MTN 18.02.27 | | EUR | 1.200 | 0 | 0 % | 88,4745 | 1.061.694,00 | 0,70 |
| DE000A3E5MG8 | 0,375% Vonovia MTN 16.06.27 | | EUR | 700 | 0 | 0 % | 84,4090 | 590.863,00 | 0,39 |
| XS2176686546 | 0,450% Credit Suisse (London Branch) REG 19.05.2025 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 93,5090 | 187.018,00 | 0,12 |
| XS2152932542 | 0,500% Deutsche Bahn Finance MTN 09.04.27 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 93,9070 | 187.814,00 | 0,12 |
| DE000A13SWC0 | 0,500% Deutsche Pfandbriefbank MTN 19.01.23 | | EUR | 1.000 | 0 | 0 % | 100,1085 | 1.001.085,00 | 0,66 |
| XS1875268689 | 0,500% HYPO NOE LB f Niederösterreich u. Wien PF 04.09.25 | | EUR | 1.500 | 0 | 0 % | 96,5895 | 1.448.842,50 | 0,96 |
| IT0005419848 | 0,500% Italien B.T.P. 01.02.26 | | EUR | 2.200 | 0 | 0 % | 94,7245 | 2.083.939,00 | 1,38 |
| XS2013677864 | 0,500% Litauen MTN 19.06.29 | | EUR | 300 | 300 | 0 % | 85,6890 | 257.067,00 | 0,17 |

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 |
|---|--|-------|--|-----------------------|---|-----------------------|------------|---------------------|------------------------------|
| XS1612958253 | 0,500% National Westminster Bank MTN 15.05.24 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 98,4800 | 492.400,00 | 0,33 |
| FR0014007KL5 | 0,500% RCI Banque MTN 14.07.25 | | EUR | 500 | 500 | 0 % | 90,2590 | 451.295,00 | 0,30 |
| ES0205032040 | 0,540% Ferrovial Emisiones Nts. 12.11.28 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 84,3935 | 421.967,50 | 0,28 |
| XS1948612905 | 0,625% BMW Finance MTN 06.10.23 | | EUR | 500 | 200 | 0 % | 98,9490 | 494.745,00 | 0,33 |
| DE000A2RYD83 | 0,625% Daimler International Finance MTN 27.02.23 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 99,9235 | 499.617,50 | 0,33 |
| XS2182399274 | 0,625% Iceland Government Int. Nts. 03.06.26 | | EUR | 300 | 0 | 0 % | 94,7870 | 284.361,00 | 0,19 |
| XS1942708873 | 0,625% Länsförsäkringar Hypotek PF 29.01.26 | | EUR | 2.500 | 500 | 0 % | 96,4730 | 2.411.825,00 | 1,60 |
| DE000NWB18D6 | 0,625% NRW.BANK IHS Nts. 04.01.28 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 94,1105 | 470.552,50 | 0,31 |
| AT000B092622 | 0,625% Raiffeisen-Landesbank Steiermark MTN 20.01.23 | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 % | 100,1335 | 1.001.335,00 | 0,66 |
| AT0000A1ZGE4 | 0,750% Österreich MTN 20.02.28 | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 96,3710 | 192.742,00 | 0,13 |
| ES0000101966 | 0,827% Comunidad Autónoma de Madrid Nts. 30.07.27 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 95,2140 | 190.428,00 | 0,13 |
| PTBSRIOE0024 | 0,875% Banco Santander Totta MTOH 25.04.24 | | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 % | 99,1615 | 991.615,00 | 0,66 |
| XS1685653302 | 0,875% London Stock Exchange Group MTN 19.06.24 | | EUR | 700 | 0 | 0 % | 97,9060 | 685.342,00 | 0,45 |
| XS1428769738 | 1,000% Credit Suisse (London Branch) MTN 07.06.23 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 99,4630 | 497.315,00 | 0,33 |
| XS2081018629 | 1,000% Intesa Sanpaolo MTN 19.11.26 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 90,1340 | 450.670,00 | 0,30 |
| XS1936139770 | 1,125% Deutsche Bahn Finance MTN 18.12.28 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 93,6920 | 187.384,00 | 0,12 |
| DE000DB7XJP9 | 1,125% Deutsche Bank MTN 17.03.25 | | EUR | 700 | 0 | 0 % | 95,5400 | 668.780,00 | 0,44 |
| XS1529559525 | 1,125% Euroclear Investments Nts. 07.12.26 | | EUR | 200 | 200 | 0 % | 95,1225 | 190.245,00 | 0,13 |
| FR0013396512 | 1,125% Orange MTN 15.07.24 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 98,7485 | 493.742,50 | 0,33 |
| DE000A189ZX0 | 1,250% Vonovia Finance MTN 06.12.24 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 96,0090 | 192.018,00 | 0,13 |
| IT0005282527 | 1,450% Italien B.T.P. 15.11.24 | | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 % | 99,6975 | 1.993.950,00 | 1,32 |
| XS1991190361 | 1,500% Ceske Drahy Nts. 23.05.26 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 93,3470 | 466.735,00 | 0,31 |
| XS1785340172 | 1,750% Intesa Sanpaolo MTN 20.03.28 | | EUR | 200 | 0 | 0 % | 89,7885 | 179.577,00 | 0,12 |
| XS0856976682 | 1,875% DnB NOR Boligkreditt PF 21.11.22 | | EUR | 800 | 0 | 0 % | 100,7015 | 805.612,00 | 0,53 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | | EUR | 9.724.870,50 | 6,45 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 9.724.870,50 | 6,45 |
| XS2186093410 | 0,010% Nordlb Lux COV Bnd BK Mtn 10.06.27 | | EUR | 5.400 | 0 | 0 % | 90,8705 | 4.907.007,00 | 3,25 |
| SK4000015400 | 0,125% Slovenska Sporitelna PF 12.06.26 | | EUR | 2.200 | 200 | 0 % | 93,7070 | 2.061.554,00 | 1,37 |
| DE000CZ40MN2 | 0,625% Commerzbank HPF 13.03.25 | | EUR | 1.800 | 0 | 0 % | 97,8200 | 1.760.760,00 | 1,17 |
| DE000GRN0016 | 0,750% Deutsche Kreditbank IHS 26.09.24 | | EUR | 500 | 0 | 0 % | 96,3605 | 481.802,50 | 0,32 |

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 | |
|---|--------------------------------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|------|
| DE000A2SBDE0 | 1,000% JAB Holdings Bds. 19.12.27 | | EUR | 600 | 0 | 0 | % | 85,6245 | 513.747,00 | 0,34 |
| Summe Wertpapiervermögen ³⁾ | | | | | | | EUR | 147.812.055,10 | 98,03 | |
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | | EUR | 239.235,00 | 0,16 | |
| Aktienindex-Derivate | | | | | | | EUR | 153.400,00 | 0,10 | |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | 153.400,00 | 0,10 | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | | | | EUR | 153.400,00 | 0,10 | |
| EURO STOXX 50 Index Future 09/22 | | EDT | EUR Anzahl | -650 | | | | 153.400,00 | 0,10 | |
| Zins-Derivate | | | | | | | EUR | 85.835,00 | 0,06 | |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | 85.835,00 | 0,06 | |
| Zinsterminkontrakte | | | | | | | EUR | 85.835,00 | 0,06 | |
| 6,000% Euro Bobl Future 09/22 | | EDT | EUR | -15.000 | | | | 12.800,00 | 0,01 | |
| 6,000% Euro Bund Future 09/22 | | EDT | EUR | -4.300 | | | | 84.440,00 | 0,06 | |
| 6,000% Euro Schatz Future 09/22 | | EDT | EUR | -22.000 | | | | -11.405,00 | -0,01 | |

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 | 2.842.593,55 | 1,89 |
| EUR - Guthaben bei: | | | | | | EUR | 2.842.593,55 | 1,89 |
| | CACEIS Bank S.A. [Germany Branch] (Verwahrstelle) | | EUR | 2.842.593,55 | % | 100,0000 | 2.842.593,55 | 1,89 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | EUR | 136.114,82 | 0,09 |
| Zinsansprüche | | | | | | EUR | 135.289,82 | 0,09 |
| | | | EUR | 135.289,82 | | | 135.289,82 | 0,09 |
| Quellensteueransprüche | | | | | | EUR | 825,00 | 0,00 |
| | | | EUR | 825,00 | | | 825,00 | 0,00 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | EUR | -251.548,68 | -0,17 |
| Kostenabgrenzung | | | | | | EUR | -12.313,68 | -0,01 |
| | | | EUR | -12.313,68 | | | -12.313,68 | -0,01 |
| Variation Margin | | | | | | EUR | -239.235,00 | -0,16 |
| | | | EUR | -239.235,00 | | | -239.235,00 | -0,16 |
| Fondsvermögen | | | | | | EUR | 150.778.449,79 | 100,00²⁾ |
| Anteilwert Stiftungsfonds STU | | | | | | EUR | 1.028,96 | |
| Umlaufende Anteile Stiftungsfonds STU | | | | | | STK | 146.535,00 | |

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 | | | | |
| XS1508351357 | 0,125% PKO Bank Hipotecny PF 24.06.2022 | EUR | 0 | 2.000 |
| DE000HV2AMD0 | 0,125% UniCredit Bank PF 01.03.22 | EUR | 0 | 1.500 |
| XS1210338015 | 0,250% Aktia Bank PF 31.03.22 | EUR | 0 | 1.750 |
| XS1369268534 | 0,375% Bawag MTB 23.02.22 | EUR | 0 | 2.000 |
| XS1200837836 | 0,375% Swedbank Hypotek PF 11.03.22 | EUR | 0 | 1.000 |
| IT0005445306 | 0,500% Italien B.T.P. 15.07.28 | EUR | 0 | 2.000 |
| XS2010447238 | 0,750% BMW Finance MTN 13.07.26 | EUR | 0 | 300 |
| XS2148372696 | 1,125% Nestlé Finance International MTN 01.04.26 | EUR | 0 | 300 |
| DE000DL19TA6 | 1,500% Deutsche Bank MTN 20.01.22 | EUR | 0 | 400 |
| XS0827597351 | 2,125% Raiffeisenlandesbank Niederöster.-Wien PF 12.09.22 | EUR | 0 | 2.000 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE000A1RQCT2 | 0,375% Hessen SA 04.07.22 | EUR | 0 | 1.700 |

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 | | | 9.494 |
|--|-----|--|--|-------|

Zinsterminkontrakte

| | | | | |
|--|-----|--|--|--------|
| Verkaufte Kontrakte (Basiswerte: Euro Bobl Future Euro Bund Future Euro Schatz Future) | EUR | | | 62.208 |
|--|-----|--|--|--------|

Sondervermögen Stiftungsfonds STU

| | | | | |
|-----------------------------|--|--|--------------------------------------|--------------|
| 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 | | | | Globalkunde |
| Ertragsverwendung | | | | Ausschüttend |
| Währung | | | | Euro |
| ISIN | | | | DE000A0RL0L8 |

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 STU | EUR | 1.028,96 |
| Umlaufende Anteile Stiftungsfonds STU | STK | 146.535,00 |

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

98,03% 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