

Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität

Ein richtlinienkonformes Sondervermögen
deutschen Rechts.

Ungeprüfter Halbjahresbericht
zum 30. Juni 2022



Es können keine Anteile auf der Basis von Finanzberichten gezeichnet werden. Anteilszeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis des Verkaufsprospektes und den wesentlichen Anlegerinformationen mit dem letzten erhältlichen Jahresbericht und dem eventuell danach veröffentlichten Halbjahresbericht vorgenommen werden.

Inhaltsverzeichnis:

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2022	1
Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2022.....	2
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV.....	8

Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität

Vermögensübersicht zum 30 Juni 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		461.960.744,44	100,21
1. Aktien		34.631.365,91	7,51
- Deutschland	4.041.609,33		0,88
- Frankreich	7.208.509,62		1,56
- Großbritannien	2.277.367,04		0,49
- Niederlande	424.395,00		0,09
- Schweiz	5.466.038,78		1,19
- Spanien	1.224.513,70		0,27
- Vereinigte Staaten von Amerika	13.988.932,44		3,03
2. Anleihen		179.200.595,30	38,87
- Belgien	5.083.714,00		1,10
- Deutschland	18.558.427,90		4,03
- Frankreich	38.695.544,00		8,39
- Großbritannien	12.357.014,30		2,68
- Irland	18.283.790,00		3,97
- Italien	23.276.546,30		5,05
- Niederlande	8.101.914,00		1,76
- Norwegen	2.819.364,80		0,61
- Polen	12.246.000,00		2,66
- Portugal	15.942.580,00		3,46
- Spanien	23.835.700,00		5,17
3. Investmentanteile		218.232.590,05	47,34
- Deutschland	22.174.213,80		4,81
- Frankreich	11.899.912,50		2,58
- Irland	137.229.740,25		29,77
- Luxemburg	46.928.723,50		10,18
4. Forderungen		2.917.284,47	0,63
5. Bankguthaben		26.978.908,71	5,85
II. Verbindlichkeiten		-950.695,62	-0,21
III. Fondsvermögen		461.010.048,82	100,00¹⁾

Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität

Vermögensaufstellung zum 30 Juni 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 Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE000BASF111	BASF SE	STK		8.978	0	0	EUR 41,525	372.811,45	0,08
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		17.572	0	0	EUR 35,740	628.023,28	0,14
DE0007164600	SAP SE	STK		15.602	0	0	EUR 86,930	1.356.281,86	0,29
DE0007236101	Siemens AG	STK		10.500	0	0	EUR 97,090	1.019.445,00	0,22
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK		5.250	0	0	EUR 13,985	73.421,25	0,02
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	STK		12.201	0	0	EUR 48,490	591.626,49	0,13
							EUR	4.041.609,33	0,88
Ausland									
US0028241000	Abbott Laboratories	STK		26.015	0	0	USD 108,650	2.703.648,91	0,59
FR0000120073	Air Liquide-SA Et.Expl.P.G.Cl.	STK		12.442	1.131	0	EUR 128,120	1.594.069,04	0,35
US02079K3059	Alphabet Inc.	STK		460	0	0	USD 2.179,260	958.878,57	0,21
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK		15.000	0	0	EUR 45,365	680.475,00	0,15
US20030N1019	Comcast Corp.	STK		41.244	0	0	USD 39,240	1.548.055,44	0,34
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	STK		15.000	0	0	EUR 40,945	614.175,00	0,13
GB0002374006	Diageo PLC	STK		14.810	0	0	GBP 35,305	607.419,90	0,13
US30231G1022	Exxon Mobil Corp.	STK		6.600	0	0	USD 85,640	540.651,39	0,12
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK		45.000	0	0	EUR 9,431	424.395,00	0,09
US4781601046	Johnson & Johnson	STK		3.300	0	0	USD 177,510	560.316,61	0,12
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co.	STK		7.136	0	0	USD 112,610	768.649,83	0,17
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK		1.688	0	0	EUR 581,700	981.909,60	0,21
US5949181045	Microsoft Corp.	STK		15.733	0	0	USD 256,830	3.865.040,31	0,84
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK		18.233	0	0	CHF 111,440	2.030.058,47	0,44
CH0012005267	Novartis AG	STK		10.000	0	0	CHF 80,850	807.773,00	0,18
US7134481081	PepsiCo Inc.	STK		4.250	0	0	USD 166,660	677.512,08	0,15
US7170811035	Pfizer Inc.	STK		28.125	0	0	USD 52,430	1.410.487,11	0,31
US7427181091	Procter & Gamble Co., The	STK		1.800	0	0	USD 143,790	247.569,95	0,05
GB0007099541	Prudential PLC	STK		52.330	0	0	GBP 10,160	617.649,63	0,13
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK		14.681	0	0	GBP 61,700	1.052.297,51	0,23
ES0173516115	Repsol S.A.	STK		87.154	0	0	EUR 14,050	1.224.513,70	0,27
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK		18.847	0	0	EUR 96,340	1.815.719,98	0,39
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK		21.550	0	0	EUR 50,370	1.085.473,50	0,24
FR0000124141	Veolia Environnement S.A.	STK		18.750	0	0	EUR 23,290	436.687,50	0,09
US92826C8394	VISA Inc.	STK		3.760	0	0	USD 196,890	708.122,24	0,15
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK		3.922	0	0	CHF 415,200	1.626.950,14	0,35
							EUR	29.588.499,41	6,42
Verzinsliche Wertpapiere									
Inland									
DE000A2YNZX6	0,7500 % Daimler AG - Anleihe 2019/2030	EUR		4.000	0	0	% 84,636	3.385.452,40	0,73
DE000DB5DCS4	2,3750 % Deutsche Bank AG - Medium Term Notes 2013/2023	EUR		10.000	0	0	% 100,629	10.062.920,00	2,18
XS0862952297	2,8750 % Deutsche Post AG - Medium Term Notes 2012/2024	EUR		5.000	0	0	% 102,201	5.110.055,50	1,11
							EUR	18.558.427,90	4,03
Ausland									
BE6243179650	2,8750 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. - Medium Term Notes 2012/2024	EUR		5.000	0	0	% 101,674	5.083.714,00	1,10
XS1531174388	1,8750 % Barclays PLC - Medium Term Notes 2016/2023	EUR		8.000	0	0	% 99,845	7.987.604,80	1,73
XS0821096418	2,2500 % BNG Bank N.V. - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		3.000	0	0	% 100,393	3.011.784,00	0,65
XS0895249620	2,8750 % BNP Paribas S.A. - Medium Term Notes 2013/2023	EUR		8.000	0	0	% 101,850	8.148.008,80	1,77
FR0011333186	2,5000 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. - Medium Term Notes 2012/2022	EUR		3.000	0	0	% 100,779	3.023.370,00	0,66
FR0011356997	2,3750 % Cie de Financement Foncier - Öff. MT Pfandbriefe 2012/2022	EUR		6.000	0	0	% 100,878	6.052.668,00	1,31
FR0011508332	1,8750 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF - Öff. MT Pfandbriefe 2013/2023	EUR		1.000	0	0	% 101,002	1.010.015,60	0,22
XS0847580353	2,7500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. - Medium Term Notes 2012/2024	EUR		5.000	0	0	% 101,803	5.090.130,00	1,10
XS0856976682	1,8750 % DNB Boligkredit A.S. - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2012/2022	EUR		2.800	0	0	% 100,692	2.819.364,80	0,61
FR0011318658	2,7500 % Electricité de France (E.D.F.) - Medium Term Notes 2012/2023	EUR		5.000	0	0	% 101,208	5.060.400,00	1,10
IE00B6X95T99	3,4000 % Irland - Treasury Bonds 2014/2024	EUR		10.000	0	0	% 104,636	10.463.600,00	2,27
IE00B4TV0D44	5,4000 % Irland - Treasury Bonds 2009/2025	EUR		7.000	0	0	% 111,717	7.820.190,00	1,70
IT0005365165	3,0000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2019/2029	EUR		5.000	0	0	% 100,855	5.042.750,00	1,09
IT0005001547	3,7500 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2014/2024	EUR		6.000	0	0	% 104,802	6.288.090,00	1,36
IT0004644735	4,5000 % Italien, Republik - Buoni del Tes.Polien. 2010/2026	EUR		11.000	0	0	% 108,597	11.945.706,30	2,59

XS1015428821	3,0000 % Polen, Republik - Medium Term Notes 2014/2024	EUR	12.000	0	0	%	102,050	12.246.000,00	2,66
PTOTEKOE0011	2,8750 % Portugal, Republik - Obligaciones 2015/2025	EUR	8.000	0	0	%	105,239	8.419.120,00	1,83
PTOTEQOE0015	5,6500 % Portugal, Republik - Obligaciones 2013/2024	EUR	7.000	0	0	%	107,478	7.523.460,00	1,63
FR0013250693	1,6250 % RCI Banque S.A. - Medium Term Notes 2017/2025	EUR	8.000	0	0	%	94,703	7.576.209,60	1,64
ES00000124C5	5,1500 % Spanien - Bonos 2013/2028	EUR	14.000	0	0	%	119,010	16.661.400,00	3,61
ES00000127G9	2,1500 % Spanien - Obligaciones 2015/2025	EUR	7.000	0	0	%	102,490	7.174.300,00	1,56
FR0013176310	1,8750 % Vivendi S.A. - Bonds 2016/2026	EUR	8.000	0	0	%	97,811	7.824.872,00	1,70
XS1463101680	1,6000 % Vodafone Group PLC - Medium Term Notes 2016/2031	EUR	5.000	0	0	%	87,388	4.369.409,50	0,95
						EUR		160.642.167,40	34,85
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	3.146	0	0	CHF	318,550	1.001.257,17	0,22
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
LU1681038599	AIS-Amundi NASDAQ-100	ANT	41.975	0	13.975	EUR	283,500	11.899.912,50	2,58
LU1737653987	Amundi Index Euro Corporate SRI	ANT	305.750	0	0	EUR	44,498	13.605.263,50	2,95
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
DE0005933998	iSh.ST.Europe Mid 200 U.ETF DE	ANT	52.000	0	0	EUR	44,620	2.320.240,00	0,50
DE0002635307	iSh.STOXX Europe 600 U.ETF DE	ANT	322.000	0	0	EUR	40,415	13.013.630,00	2,82
DE000A0H08D2	iShare.Nikkei 225 UCITS ETF DE	ANT	367.050	0	0	EUR	18,636	6.840.343,80	1,48
IE0031442068	iShs Core S&P 500 UC.ETF USDD	ANT	428.000	0	0	EUR	35,973	15.396.444,00	3,34
IE00B66F4759	iShs EO H. Yield Corp Bd U.ETF	ANT	318.250	0	0	EUR	86,670	27.582.727,50	5,98
IE00B02KXM00	iShs EURO STOXX Small U.ETF	ANT	202.000	0	0	EUR	39,211	7.920.622,00	1,72
IE00B0M63730	iShs MSCI AC F.East.xJap.U.ETF	ANT	54.500	0	0	EUR	49,950	2.722.275,00	0,59
IE00B0M63177	iShs MSCI EM U.ETF USD (D)	ANT	36.500	0	0	EUR	37,155	1.356.157,50	0,29
IE00BYZTVV78	iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF	ANT	5.250.000	0	0	EUR	4,842	25.422.600,00	5,51
IE00B2QWCY14	iShsIII -S&P Sm.Cap 600 U.ETF	ANT	37.500	0	0	EUR	71,760	2.691.000,00	0,58
IE00B3F81R35	iShsIII-Core EO Corp.Bd U.ETF	ANT	230.500	0	0	EUR	117,270	27.030.735,00	5,86
IE00B4L60045	iShsIII-EO Corp Bd 1-5yr U.ETF	ANT	105.675	0	0	EUR	103,130	10.898.262,75	2,36
IE00B3B8Q275	iShsIII-EO Covered Bond U.ETF	ANT	55.400	0	0	EUR	141,760	7.853.504,00	1,70
IE00B428Z604	iShsV-Spain Govt Bd UCITS ETF	ANT	54.300	0	0	EUR	153,875	8.355.412,50	1,81
LU0480132876	UBS(L)FS-MSCI EM UCITS ETF	ANT	18.000	0	0	EUR	95,450	1.718.100,00	0,37
LU0484968812	Xtrackers II ESG EUR Corp.Bond	ANT	232.000	50.000	0	EUR	136,230	31.605.360,00	6,86
						EUR		218.232.590,05	47,34
						EUR		432.064.551,26	93,72
Summe Wertpapiervermögen									
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle		EUR	26.977.690,55			%	100,000	26.977.690,55	5,85
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		GBP	4,93			%	100,000	5,73	5,88
Verwahrstelle		USD	1.267,53			%	100,000	1.212,43	5,55
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenforderungen Aktien		EUR	14.223,00					14.223,00	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche		CHF	162.276,51					162.130,59	0,04
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR	75.221,41					75.221,41	0,02
Zinsansprüche		EUR	2.665.709,47					2.665.709,47	0,58
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Anteilrückkaufe		EUR	-2.831,40					-2.831,40	0,00
Verbindlichkeiten Fondsadministration		EUR	-12.602,26					-12.602,26	0,00
Verbindlichkeiten Fondsmanagement		EUR	-112.047,67					-112.047,67	-0,02
Verbindlichkeiten Prüfungskosten		EUR	-8.295,40					-8.295,40	0,00
Verbindlichkeiten Veröffentlichungskosten		EUR	-3.966,07					-3.966,07	0,00
Verbindlichkeiten Verwahrstelle		EUR	-16.802,99					-16.802,99	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-794.149,83					-794.149,83	-0,17
Fondsvermögen									
Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität A									
Anteiliges Fondsvermögen									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität E									
Anteiliges Fondsvermögen									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
		EUR						461.010.048,82	100,00¹⁾
		EUR						156.619.146,60	
		EUR						94,31	
		STK						1.660.752	
		EUR						304.390.902,22	
		EUR						96,12	
		STK						3.166.937	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2022	
Britische Pfund	GBP	0,860800	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,000900	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,045450	= 1 Euro (EUR)

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzurordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Ausland					
FR00140085J3	Diageo PLC - Anrechte	STK	14.810	14.810	
FR0014008VX5	EuroAPI SAS	STK	819	819	
US46817M1071	Jackson Financial Inc.	STK	0	1.308	
Verzinsliche Wertpapiere					
Ausland					
XS0780267406	3,0000 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG - Öff. MT Pfandbriefe 2012/2022	EUR	0	3.000	

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis zum 30.06.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		152.437,02
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		624.556,07
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		203.052,37
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		2.478.960,63
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		0,68
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,27
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	0,27	
7. Erträge aus Investmentanteilen		1.394.928,69
8. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-22.865,59
9. Abzug ausländischer Quellensteuer		-74.054,83
10. Sonstige Erträge		6.499,29
davon: Sonstiges	6.499,29	
Summe der Erträge		4.763.514,60
II. Aufwendungen		
1. Verwaltungsvergütung		-1.798.601,07
2. Verwahrstellenvergütung		-48.416,20
3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-11.944,39
4. Sonstige Aufwendungen		-181.909,72
davon: Fremde Depotgebühren	-58.217,27	
davon: Bankgebühren	-238,86	
davon: Verwahrtgelt	-122.205,15	
davon: Sonstiges	-1.248,44	
Summe der Aufwendungen		-2.040.871,38
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.722.643,22
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		2.730.990,18
2. Realisierte Verluste		-473.618,63
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		2.257.371,55
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		4.980.014,77
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-25.571.165,09
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-28.750.128,52
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-54.321.293,61
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-49.341.278,84

Entwicklung des Sondervermögens

	EUR	2022 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		515.412.504,37
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-4.853.199,97
2. Mittelzufluss (netto)		-223.874,57
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	12.515.681,87	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-12.739.556,44	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		15.897,83
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-49.341.278,84
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-25.571.165,09	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-28.750.128,52	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		461.010.048,82

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich / Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität A
für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis zum 30.06.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		51.805,11	0,031
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		212.259,53	0,128
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		69.010,93	0,042
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		842.519,58	0,507
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		0,23	0,000
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,09	0,000
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	0,09		0,000
7. Erträge aus Investmentanteilen		474.081,48	0,285
8. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-7.770,79	-0,005
9. Abzug ausländischer Quellensteuer		-25.170,50	-0,015
10. Sonstige Erträge		2.209,21	0,001
davon: Sonstiges	2.209,21		0,001
Summe der Erträge		1.618.944,87	0,975
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-719.916,15	-0,433
2. Verwahrstellenvergütung		-16.455,21	-0,010
3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-4.059,47	-0,002
4. Sonstige Aufwendungen		-61.825,22	-0,037
davon: Fremde Depotgebühren	-19.786,35		-0,012
davon: Bankgebühren	-81,17		0,000
davon: Verwahrtgelt	-41.533,53		-0,025
davon: Sonstiges	-424,17		0,000
Summe der Aufwendungen		-802.256,05	-0,483
III. Ordentlicher Nettoertrag		816.688,82	0,492
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		928.458,01	0,559
2. Realisierte Verluste		-160.934,10	-0,097
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		767.523,91	0,462
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.584.212,73	0,954
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-8.630.747,82	-5,197
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-9.725.602,24	-5,856
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-18.356.350,06	-11,053
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-16.772.137,33	-10,099

Entwicklung der Anteilklasse Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität A

	2021 EUR	2022 EUR
I. I.Wert der Anteilklasse am Beginn des Geschäftsjahres		173.177.137,22
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.663.511,74
2. Mittelzufluss (netto)		1.885.335,61
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	8.600.200,15	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-6.714.864,54	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-7.677,16
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-16.772.137,33
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-8.630.747,82	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-9.725.602,24	
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres		156.619.146,60

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich / Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität E
für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis zum 30.06.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		100.631,91	0,032
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		412.296,54	0,130
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		134.041,44	0,042
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		1.636.441,05	0,517
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		0,45	0,000
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,18	0,000
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	0,18		0,000
7. Erträge aus Investmentanteilen		920.847,21	0,291
8. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-15.094,80	-0,005
9. Abzug ausländischer Quellensteuer		-48.884,33	-0,015
10. Sonstige Erträge		4.290,08	0,001
davon: Sonstiges	4.290,08		0,001
Summe der Erträge		3.144.569,73	0,993
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-1.078.684,92	-0,341
2. Verwahrstellenvergütung		-31.960,99	-0,010
3. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-7.884,92	-0,002
4. Sonstige Aufwendungen		-120.084,50	-0,038
davon: Fremde Depotgebühren	-38.430,92		-0,012
davon: Bankgebühren	-157,69		0,000
davon: Verwahrtgelt	-80.671,62		-0,025
davon: Sonstiges	-824,27		0,000
Summe der Aufwendungen		-1.238.615,33	-0,391
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.905.954,40	0,602
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.802.532,17	0,569
2. Realisierte Verluste		-312.684,53	-0,099
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.489.847,64	0,470
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		3.395.802,04	1,072
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-16.940.417,27	-5,349
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-19.024.526,28	-6,007
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-35.964.943,55	-11,356
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-32.569.141,51	-10,284

Entwicklung der Anteilklasse Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität E

	2022 EUR	2022 EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		342.235.367,15
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-3.189.688,23
2. Mittelzufluss (netto)		-2.109.210,18
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	3.915.481,72	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-6.024.691,90	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		23.574,99
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-32.569.141,51
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-16.940.417,27	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-19.024.526,28	
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres		304.390.902,22

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität A

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A1XADA2

Anteilwert	EUR	94,31
Umlaufende Anteile	STK	1.660.752
Anleger		Private und Institutionelle Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	2,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung inkl. Fondsmanagervergütung p. a.	%	0,86
Ertragsverwendung		ausschüttend

Commerzbank Stiftungsfonds Stabilität E

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A1XADB0

Anteilwert	EUR	96,12
Umlaufende Anteile	STK	3.166.937
Anleger		Private und Institutionelle Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	1,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung inkl. Fondsmanagervergütung p. a.	%	0,66
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

93,72

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt.

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Klassifizierung nach SFDR-Verordnung (EU 2019/2088)

Der Fonds ist ein Produkt im Sinne des Artikels 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor).

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Zum 1. Juli 2022 wurde die Lyxor Funds Solutions S.A. (LFS) auf die Amundi Luxembourg S.A. verschmolzen. Seit dem 01. Juli 2022 ist die Verwaltungsgesellschaft des Fonds Amundi Luxembourg S.A.

Luxemburg, den 10.08.2022

Amundi Luxembourg S.A.