

Halbjahresbericht zum 30.06.2024

Waiblingen legt an

RM Vermögensstrategie Nachhaltigkeit

Im Ländle zu Hause,
die Zukunft im Blick.

LB≡BW Asset Management



Kreissparkasse
Waiblingen

Inhalt

- 8 Vermögensübersicht zum 30.06.2024
- 9 Vermögensaufstellung zum 30.06.2024
- 19 Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen
- 21 Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Liebe Anlegerin, lieber Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht gibt Ihnen einen Einblick in die Situation Ihres Fonds innerhalb des Berichtszeitraums. Sollten Sie ausführlichere Erläuterungen oder weiter gehende Auskünfte wünschen, wenden Sie sich bitte an Ihren Berater.

Auf unserer Internetseite informieren wir Sie darüber hinaus regelmäßig über die Entwicklung des Fonds. Auf www.LBBW-AM.de finden Sie die aktuellen Fondspreise, umfangreiche Angaben zur Wertentwicklung, die Portfolio-Struktur sowie viele weitere Fakten.

Außerdem stehen Ihnen hier die jeweils aktuellen Basisinformationsblätter, Verkaufsprospekte sowie die Jahres- und Halbjahresberichte als PDF-Dateien zum Download zur Verfügung.


Profitieren Sie auch von unserem kostenlosen E-Mail-Fondspreis- und Factsheetabo: Das Factsheet gibt Ihnen einfach und bequem einen monatlichen Überblick über Ihren Fonds. Diesen E-Mail-Service können Sie auf unserer Internetseite abonnieren.

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH
Geschäftsführung



Uwe Adamla
(Vorsitzender)



Dr. Dirk Franz
(Stellv. Vorsitzender)



Michael Hünseler



Ulrike Modersohn

RM Vermögensstrategie Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 30.06.2024

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	136.380.702,66	100,12
1. Aktien	60.446.642,31	44,37
USA	19.731.656,79	14,48
Bundesrep. Deutschland	8.515.530,00	6,25
Frankreich	7.213.844,20	5,30
Großbritannien	6.335.103,63	4,65
Niederlande	5.286.980,00	3,88
Dänemark	2.808.380,88	2,06
Irland	2.562.119,99	1,88
Canada	1.992.509,32	1,46
Schweden	1.924.519,82	1,41
Andere Länder	4.075.997,68	3,00
2. Anleihen	70.789.019,72	51,97
Frankreich	10.151.535,00	7,45
Bundesrep. Deutschland	9.783.982,00	7,18
Niederlande	8.752.359,22	6,43
Italien	8.297.622,25	6,09
Spanien	5.488.694,00	4,03
Belgien	3.500.550,00	2,57
Großbritannien	3.471.934,00	2,55
Österreich	3.432.022,00	2,52
Portugal	3.148.692,00	2,31
Australien	2.216.350,00	1,63
Finnland	1.733.555,83	1,27
Island	1.604.770,00	1,18
Kroatien	1.483.083,72	1,09
Norwegen	1.458.353,70	1,07
Canada	1.452.580,00	1,07
Schweden	1.277.215,00	0,94
Andere Länder	3.535.721,00	2,60
3. Sonstige Beteiligungswertpapiere	1.398.992,78	1,03
4. Derivate	-46.012,53	-0,03
5. Bankguthaben	2.932.454,93	2,15
6. Sonstige Vermögensgegenstände	859.605,45	0,63
II. Verbindlichkeiten	-157.541,91	-0,12
III. Fondsvermögen	136.223.160,75	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	132.634.654,81	97,37
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	127.346.134,81	93,48
Aktien									
Canadian Paci.Kansas City Ltd. Registered Shares o.N.	A3D9ZG		STK	8.300			CAD 107,740	609.758,96	0,45
Sun Life Financial Inc. Registered Shares o.N.	936039		STK	17.700			CAD 67,080	809.598,04	0,59
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	A0Q4DC		STK	7.100	7.100		CHF 91,720	676.197,50	0,50
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	A3EU6F		STK	19.500	10.500	2.400	DKK 1.005,600	2.629.477,90	1,93
Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10	A0NBLH		STK	3.600			DKK 370,600	178.902,98	0,13
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	850133		STK	4.840	440		EUR 161,280	780.595,20	0,57
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	840400		STK	5.600			EUR 259,500	1.453.200,00	1,07
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	A1J4U4		STK	2.500	800	410	EUR 964,200	2.410.500,00	1,77
ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16	A2AKBT		STK	24.200			EUR 44,510	1.077.142,00	0,79
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	855705		STK	40.000		4.900	EUR 30,570	1.222.800,00	0,90
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49	875773		STK	43.000	43.000		EUR 9,352	402.136,00	0,30
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	887771		STK	15.100			EUR 59,530	898.903,00	0,66
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	606214		STK	18.100	18.100		EUR 54,800	991.880,00	0,73
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	581005		STK	8.000		3.100	EUR 191,100	1.528.800,00	1,12
EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5	A0Q249		STK	21.942	342		EUR 13,050	286.343,10	0,21
ENCAVIS AG Inhaber-Aktien o.N.	609500		STK	21.900			EUR 16,900	370.110,00	0,27
Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.	840221		STK	4.000		4.700	EUR 236,700	946.800,00	0,70
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	853888		STK	2.600			EUR 410,050	1.066.130,00	0,78
LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.	547040		STK	29.000	29.000		EUR 22,980	666.420,00	0,49
Nexans S.A. Actions Port. EO 1	676168		STK	6.100			EUR 102,900	627.690,00	0,46
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	A115DY		STK	27.480			EUR 43,450	1.194.006,00	0,88
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	A2PRDK		STK	18.200	18.200		EUR 33,260	605.332,00	0,44
Prysmian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10	A0MP84		STK	24.900			EUR 57,820	1.439.718,00	1,06
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	920657		STK	8.900			EUR 89,940	800.466,00	0,59
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	860180		STK	2.400			EUR 224,300	538.320,00	0,40
Scout24 SE Namens-Aktien o.N.	A12DM8		STK	6.100			EUR 71,200	434.320,00	0,32
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	A0JNE2		STK	16.780			EUR 51,280	860.478,40	0,63
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	867475		STK	13.000			EUR 98,380	1.278.940,00	0,94
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	A1ML7J		STK	80.000	80.000		EUR 26,550	2.124.000,00	1,56
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	886455		STK	9.900			GBP 123,560	1.442.759,92	1,06
CRH PLC Registered Shares EO -,32	864684		STK	24.090			GBP 58,960	1.675.233,12	1,23
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	923893		STK	85.000			GBP 6,839	685.634,25	0,50
London Stock Exchange Group PLC Reg. Shares LS 0,069186047	A0JEJF		STK	14.000		3.600	GBP 94,000	1.552.161,35	1,14

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Relx PLC Registered Shares LS -,144397	A0M95J		STK	41.800			GBP 36,390	1.794.069,71	1,32
Nomura Research Institute Ltd. Registered Shares o.N.	630026		STK	36.400			JPY 4.521,000	954.540,47	0,70
Tomra Systems ASA Navne-Aksjer NK -,50	A3DHA0		STK	28.400	28.400		NOK 127,400	317.062,61	0,23
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	A3DLE9		STK	64.000	64.000		SEK 199,200	1.123.242,29	0,82
Epiroc AB Namn-Aktier A o.N.	A3CPHU		STK	43.000	43.000		SEK 211,500	801.277,53	0,59
3M Co. Registered Shares DL -,01	851745		STK	6.800			USD 102,190	648.371,36	0,48
Air Products & Chemicals Inc. Registered Shares DL 1	854912		STK	7.500	1.000		USD 258,050	1.805.808,26	1,33
Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001	867900		STK	3.100			USD 312,483	903.844,88	0,66
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	850501		STK	9.000			USD 41,530	348.747,38	0,26
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	897879		STK	5.200			USD 118,130	573.152,32	0,42
Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01	A1H92V		STK	24.700			USD 63,460	1.462.525,78	1,07
Colgate-Palmolive Co. Registered Shares DL 1	850667		STK	9.000			USD 97,040	814.891,53	0,60
CSX Corp. Registered Shares DL 1	865857		STK	13.900			USD 33,450	433.827,85	0,32
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	859034		STK	4.500			USD 59,060	247.977,61	0,18
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	A12FMV		STK	2.600			USD 541,860	1.314.519,24	0,96
GATX Corp. Registered Shares DL -,625	851137		STK	3.500			USD 132,360	432.246,33	0,32
General Mills Inc. Registered Shares DL -,10	853862		STK	13.600	6.800		USD 63,260	802.739,44	0,59
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	853260		STK	10.400			USD 146,160	1.418.300,91	1,04
Johnson Controls Internat. PLC Registered Shares DL -,01	A2AQCA		STK	14.300	14.300		USD 66,470	886.886,87	0,65
Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	A12B6J		STK	3.000			USD 136,750	382.785,16	0,28
Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001	A0F602		STK	2.000			USD 441,160	823.251,69	0,60
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	A0YD8Q		STK	7.350			USD 123,800	849.013,30	0,62
Moody's Corp. Registered Shares DL-,01	915246		STK	2.500			USD 420,930	981.875,44	0,72
MSCI Inc. Registered Shares A DL -,01	A0M63R		STK	1.600			USD 481,750	719.197,57	0,53
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	866993		STK	7.200			USD 75,370	506.334,50	0,37
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	852009		STK	25.300			USD 27,980	660.502,92	0,48
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	852062		STK	7.170			USD 164,920	1.103.313,65	0,81
S&P Global Inc. Registered Shares DL 1	A2AHZ7		STK	2.400		2.400	USD 446,000	998.740,38	0,73
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	A0NC7B		STK	4.400			USD 262,470	1.077.553,53	0,79
Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01	893579		STK	5.000			USD 213,340	995.288,08	0,73

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Verzinsliche Wertpapiere									
4,5000 % A2A S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K9HY		EUR	500			% 103,730	518.650,00	0,38
0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-T. Nts 2021(29)	A3KWNV		EUR	500			% 85,030	425.150,00	0,31
3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LCKZ		EUR	400			% 100,050	400.200,00	0,29
3,5000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2022(29)	A3LAFX		EUR	1.000			% 99,990	999.900,00	0,73
1,6250 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	A28V25		EUR	300			% 90,130	270.390,00	0,20
1,5000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28)	A3K3L0		EUR	200			% 92,635	185.270,00	0,14
4,0000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	A3LHZB		EUR	500			% 101,610	508.052,22	0,37
1,6250 % Alliander N.V. EO-FLR Securit. 2018(25/Und.)	A19VX6		EUR	300			% 97,280	291.840,00	0,21
2,2410 % Allianz SE FLR-Sub.Anl.v.2015(2025/2045)	A14J9N		EUR	500			% 97,930	489.650,00	0,36
3,8750 % Assa-Abloy AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LM37		EUR	500			% 102,039	510.195,00	0,37
3,4370 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LF4D		EUR	500			% 99,950	499.750,00	0,37
5,5000 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2023(33/43)	A3LGGA		EUR	500			% 105,600	528.000,00	0,39
1,1250 % Banco Santander S.A. EO-Non-Pref.MTN 2018(25)	A19UUN		EUR	300			% 98,558	295.674,00	0,22
3,2500 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.T.Obr.Hipotecárias 24(31)	A3LUMT		EUR	300	300		% 99,514	298.542,00	0,22
0,4500 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(26)	A3K29T		EUR	500			% 95,146	475.730,00	0,35
3,2500 % Bank of Nova Scotia, The EO-Med.-T. Cov. Bonds 2023(28)	A3LC1J		EUR	500			% 99,840	499.200,00	0,37
1,2080 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2019(19/26)	A2R2UQ		EUR	300			% 95,540	286.620,00	0,21
3,0000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2023(33)	A3LC2R		EUR	2.500	700		% 99,760	2.494.000,00	1,83
1,7500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(32)	BHY0SB		EUR	500			% 90,720	453.600,00	0,33
3,3750 % BMW US Capital LLC EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LT42		EUR	500	500		% 97,656	488.280,00	0,36
3,0000 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(30)	BP45YQ		EUR	500			% 99,090	495.450,00	0,36
3,8750 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 23(28/29)	BP45Y1		EUR	500			% 100,810	504.050,00	0,37
1,5000 % Brambles Finance PLC EO-Bonds 2017(17/27)	A19P25		EUR	300			% 94,385	283.155,00	0,21
4,2500 % Brambles Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	A3LFL5		EUR	300			% 102,423	307.269,00	0,23
5,1250 % British Telecommunications PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2024(29/54)	A3LWSU		EUR	300	300		% 99,980	299.940,00	0,22
1,1250 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/29)	A2R7MH		EUR	300			% 88,840	266.520,00	0,20
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033)	BU2Z00		EUR	1.000			% 98,860	988.600,00	0,73
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) Grüne	BU3Z00		EUR	1.000	500		% 99,104	991.040,00	0,73
3,1250 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2023(30)	A3LESJ		EUR	500		500	% 99,800	499.000,00	0,37
3,5000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2023(29)	A3LQ4R		EUR	500			% 101,243	506.215,00	0,37

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
2,7500 % Commerzbank AG MTH S.P58 v.22(25)	CZ43ZJ		EUR	300		% 99,200	297.600,00	0,22
0,1000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.973 v.21(25)	CB0HRY		EUR	500		% 95,939	479.695,00	0,35
0,7500 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(28)	A3K2LY		EUR	500		% 91,420	457.100,00	0,34
3,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 23(23/30)	A3LRD7		EUR	500		% 100,940	504.700,00	0,37
3,4620 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2024(34)	A3LU38		EUR	1.000	1.000	% 99,321	993.210,00	0,73
4,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(27/28)	A3LARG		EUR	300		% 102,440	307.320,00	0,23
4,7500 % Covestro AG EO-MTN v.2022(2022/2028)	A30VQX		EUR	500		% 104,797	523.985,00	0,38
0,0100 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2021(28)	A3KTQU		EUR	500		% 88,770	443.850,00	0,33
3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2024(33)	A3LTBQ		EUR	300	300	% 101,210	303.630,00	0,22
3,7500 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF EO-Med.Term Obl.Fonc. 2023(26)	A3LKWC		EUR	300		% 100,870	302.610,00	0,22
0,1250 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Pref.MTN 2020(27)	A2855X		EUR	300		% 88,750	266.250,00	0,20
1,7500 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29)	A2RYPL		EUR	300		% 91,383	274.149,00	0,20
3,7060 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	A3LQUX		EUR	500		% 101,410	507.050,00	0,37
3,4810 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2024(24/30)	A3LX55		EUR	300	300	% 100,090	300.270,00	0,22
0,3750 % Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/29)	A2R7Q1		EUR	300		% 85,820	257.460,00	0,19
2,0000 % Deutsche Börse AG FLR-Sub.Anl.v.2022(2022/2048)	A3MQQV		EUR	500		% 91,870	459.350,00	0,34
4,0000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 23(28/29)	A3LFCX		EUR	400		% 101,520	406.080,00	0,30
0,6250 % DNB Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2019(26)	A2RWAB		EUR	500		% 95,970	479.850,00	0,35
4,3750 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27)	A3LLGZ		EUR	200		% 102,070	204.140,00	0,15
3,3750 % E.ON SE Medium Term Notes v.24(30/31)	A3826T		EUR	500	500	% 98,986	494.930,00	0,36
0,2500 % Elisa Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(27/27)	A282EB		EUR	300		% 90,510	271.530,00	0,20
3,8500 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2023(30/30)	A3LREE		EUR	500		% 101,660	508.300,00	0,37
4,3000 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2023(34/34)	A3LREF		EUR	500		% 103,600	518.000,00	0,38
3,0000 % Essity Capital B.V. EO-Med.-Term Nts 2022(22/26)	A3K9KC		EUR	300		% 99,128	297.384,00	0,22
5,1250 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2023(2030/2030)	A3515F		EUR	350		% 106,680	373.380,00	0,27
1,3750 % Gecina S.A. EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	A19KYG		EUR	300		% 93,830	281.490,00	0,21
3,6500 % General Mills Inc. EO-Notes 2024(24/30)	A3LXTE		EUR	300	300	% 100,027	300.081,00	0,22
4,2500 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2022(22/27)	A3K6HM		EUR	300	300	% 99,997	299.991,00	0,22
5,1250 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2023(23/28)	A3LRD8		EUR	300		% 103,040	309.120,00	0,23
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2022(27)	A3LAH1		EUR	300		% 99,469	298.407,00	0,22

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
2,8750 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(25/ unb.)	A2YN1H		EUR	400			% 98,470	393.880,00	0,29
0,0100 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2021(2028)	A1KRJV		EUR	500			% 87,723	438.615,00	0,32
1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdb.17(27)	A19JLP		EUR	1.000			% 93,539	935.390,00	0,69
0,3750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Mortg.Cov. MTN 2016(26)	A1851S		EUR	500			% 93,499	467.495,00	0,34
4,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30)	A3LHY6		EUR	700			% 105,640	739.480,00	0,54
0,8750 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2019(29/29)	A2R848		EUR	300			% 86,616	259.846,50	0,19
0,0000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2021(28)	A3KLAX		EUR	1.250		750	% 88,023	1.100.287,50	0,81
3,5000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2024(34)	A3LWDK		EUR	500	500		% 100,897	504.482,50	0,37
3,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2022(26)	A3LAKY		EUR	1.000	1.000		% 100,030	1.000.300,00	0,73
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	A3LGGP		EUR	2.000			% 101,730	2.034.600,00	1,49
1,6250 % KION GROUP AG Med.Term.Notes v.20(20/25)	A289QY		EUR	200			% 97,351	194.702,00	0,14
3,0000 % Kroatien, Republik EO-Notes 2017(27)	A19EWH		EUR	1.000			% 99,200	992.000,00	0,73
3,3750 % Kroatien, Republik EO-Notes 2024(34)	A3LVYY		EUR	500	500		% 98,217	491.083,72	0,36
3,1250 % La Poste EO-FLR Notes 2018(26/Und.)	A19Z03		EUR	500			% 96,870	484.350,00	0,36
0,0000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29)	A287PR		EUR	300			% 83,840	251.520,00	0,18
3,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.836 v.23(27)	LB387B		EUR	500			% 100,416	502.080,00	0,37
3,5000 % Legrand S.A. EO-Obl. 2023(23/29)	A3LJBG		EUR	500			% 100,750	503.750,00	0,37
3,5000 % Legrand S.A. EO-Obl. 2024(24/34)	A3L0B9		EUR	200	200		% 99,726	199.452,00	0,15
1,0000 % Mastercard Inc. EO-Notes 2022(22/29)	A3K2J8		EUR	300			% 90,960	272.880,00	0,20
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2020(2026/2080)	A289QM		EUR	300			% 94,705	284.115,00	0,21
2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH EO-Medium-Term Nts 2020(28/28)	A28VAZ		EUR	500			% 95,800	479.000,00	0,35
3,0000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2041 v.24(34)	MHB38J		EUR	500	500		% 99,390	496.950,00	0,36
3,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.18(29/49)	A2TSS7		EUR	500			% 96,260	481.300,00	0,35
0,5530 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/29)	A282LR		EUR	300			% 85,230	255.690,00	0,19
0,7800 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2021(29/30)	A3KMFJ		EUR	200			% 87,100	174.200,00	0,13
1,3750 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K2U9		EUR	300			% 94,710	284.130,00	0,21
3,8750 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	A3LQ06		EUR	300			% 102,644	307.932,00	0,23
2,1250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(27/82)	A2R686		EUR	300			% 92,130	276.390,00	0,20
4,3750 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 23(23/31)	A3LEFB		EUR	300			% 101,267	303.800,83	0,22
0,5000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2021(31)	A3KNMS		EUR	300			% 82,610	247.830,00	0,18

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,3750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30)	A3K3U3		EUR	300		% 90,800	272.400,00	0,20
3,2500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/31)	A3LYX6		EUR	500	500	% 99,829	499.145,00	0,37
5,3750 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 23(23/Und.)	A3LGHK		EUR	300		% 103,460	310.380,00	0,23
0,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/29)	A282GE		EUR	300		% 84,770	254.310,00	0,19
3,8750 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	A3LM16		EUR	500		% 102,326	511.630,00	0,38
5,2500 % Orsted A/S EO-FLR Notes 2022(22/3022)	A3LB0K		EUR	500		% 101,230	506.150,00	0,37
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	A19SNH		EUR	100		% 89,950	89.950,00	0,07
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LGQG		EUR	500		% 100,040	500.200,00	0,37
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LTRT		EUR	500	500	% 98,747	493.735,00	0,36
2,8750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2016(26)	A18W15		EUR	1.000		% 99,860	998.600,00	0,73
2,1250 % Portugal, Republik EO-Obr. 2018(28)	A19UWV		EUR	1.900		% 97,450	1.851.550,00	1,36
3,3750 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2024(24/33)	A3LWCX		EUR	300	300	% 98,272	294.816,00	0,22
0,5000 % REN Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3KPNA		EUR	300		% 87,100	261.300,00	0,19
3,2270 % Roche Finance Europe B.V. EO-Med.-Term Notes 2024(24/30)	A3LX6K		EUR	500	500	% 100,361	501.805,00	0,37
0,6250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(26)	A3K3MC		EUR	500		% 95,530	477.650,00	0,35
4,1250 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2023(28)	A3LG55		EUR	500		% 101,870	509.350,00	0,37
1,1250 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(27)	A3K374		EUR	500		% 94,352	471.760,00	0,35
3,2500 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27)	A3LA5M		EUR	400		% 99,980	399.920,00	0,29
3,3750 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/25)	A3LF6Q		EUR	300		% 99,680	299.040,00	0,22
3,1250 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	A3LC3G		EUR	300		% 99,333	297.999,00	0,22
3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2023(31/31)	A3LEFR		EUR	500		% 100,820	504.100,00	0,37
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LHVU		EUR	500		% 99,860	499.300,00	0,37
0,6250 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2021(31/31)	A3KTBK		EUR	500		% 81,530	407.650,00	0,30
1,6000 % Spanien EO-Bonos 2015(25)	A1ZVCP		EUR	500		% 98,548	492.740,00	0,36
2,8000 % Spanien EO-Bonos 2023(26)	A3LC67		EUR	1.500		% 99,360	1.490.400,00	1,09
2,8750 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	A3K880		EUR	100		% 97,758	97.757,70	0,07
4,0000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LJB7		EUR	300		% 100,428	301.284,00	0,22
0,2500 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2020(20/28)	A28TMG		EUR	300		% 89,540	268.620,00	0,20
4,0000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LN80		EUR	200		% 103,023	206.046,00	0,15
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	A28Z9P		EUR	200		% 97,150	194.300,00	0,14

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,8750 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2024(24/Und.)	A3LWDN		EUR	400	400		% 99,885	399.540,00	0,29
0,5000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/31)	A3KRYC		EUR	500			% 83,110	415.550,00	0,31
2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-FLR Nts 2022(22/Und.)	A3K11Y		EUR	300			% 91,930	275.790,00	0,20
0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3KSW1		EUR	300			% 85,966	257.898,75	0,19
3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LGUC		EUR	300			% 99,934	299.802,00	0,22
3,5000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2024(24/31)	A3LTA8		EUR	500	500		% 98,470	492.350,00	0,36
3,1460 % UBS Switzerland AG EO-Pfbr.-Anl. 2024(31)	A3LYXB		EUR	500	500		% 99,605	498.025,00	0,37
1,5000 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2022(28)	A3K5WE		EUR	500			% 93,630	468.150,00	0,34
3,0000 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2023(26)	A3LC5A		EUR	400			% 99,130	396.520,00	0,29
3,7500 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(28)	A3LJ6R		EUR	500			% 100,358	501.790,00	0,37
4,4500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(28/29)	A3LEBR		EUR	300			% 101,580	304.740,00	0,22
5,3750 % Valéo S.E. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	A3LBTB		EUR	200			% 102,970	205.940,00	0,15
3,2500 % Verbund AG EO-Notes 2024(24/31)	A3LYXW		EUR	500	500		% 100,015	500.075,00	0,37
0,0000 % VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A285JA		EUR	300			% 87,100	261.300,00	0,19
2,6250 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(26/80)	A281WT		EUR	400			% 96,080	384.320,00	0,28
0,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/29)	A3E5MH		EUR	300			% 83,860	251.580,00	0,18
0,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/31)	A3E5FR		EUR	500			% 80,078	400.390,00	0,29
3,4570 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(25)	A3LF5D		EUR	500			% 99,948	499.740,00	0,37
3,1310 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2024(31)	A3LXDG		EUR	500	500		% 99,440	497.200,00	0,36
2,7500 % Wienerberger AG EO-Schuldv. 2020(20/25)	A28XZ9		EUR	300			% 98,645	295.935,00	0,22
3,0000 % ZF Finance GmbH MTN v.2020(2020/2025)	A289EU		EUR	500			% 98,320	491.600,00	0,36
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	855167		STK	5.400	3.900	1.450	CHF 249,500	1.398.992,78	1,03
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	5.288.520,00	3,88
Verzinsliche Wertpapiere									
3,5000 % American Medical Syst.Eu. B.V. EO-Notes 2024(24/32)	A3LU9V		EUR	300	300		% 98,260	294.780,00	0,22
2,2500 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32)	A3K5LQ		EUR	500			% 94,160	470.800,00	0,35
3,5530 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2023(23/29)	A3LD4C		EUR	300			% 99,835	299.505,00	0,22
5,0000 % Crown European Holdings S.A. EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	A3LHVJ		EUR	200			% 102,320	204.640,00	0,15
5,8500 % Elia Group EO-FLR Nts 2023(23/Und.)	A3LFG9		EUR	500			% 102,790	513.950,00	0,38

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
3,7500 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LS5V		EUR	500	500	% 98,520	492.600,00	0,36
3,5000 % Getlink SE EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	A284GU		EUR	300		% 98,920	296.760,00	0,22
6,0000 % Kon. KPN N.V. EO-FLR Notes 2022(22/Und.)	A3K9EV		EUR	300		% 104,430	313.290,00	0,23
3,4000 % Linde PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LUKW		EUR	300	300	% 97,480	292.440,00	0,21
4,6250 % Redeja Corporacion S.A. EO-FLR Notes 23(28/Und.)	A3LDNJ		EUR	700		% 101,060	707.420,00	0,52
4,3750 % Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K6U4		EUR	300		% 103,565	310.695,00	0,23
0,5000 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A283PR		EUR	300		% 88,140	264.420,00	0,19
0,2500 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 2019(24)	A2YN27		EUR	300		% 98,980	296.940,00	0,22
0,0100 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	A28515		EUR	300		% 89,240	267.720,00	0,20
1,0000 % Telstra Corp. Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	A28WEQ		EUR	300		% 87,520	262.560,00	0,19
Summe Wertpapiervermögen						EUR	132.634.654,81	97,37
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)						EUR	-46.012,53	-0,03
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	-24.912,53	-0,02
Optionsrechte Optionsrechte auf Aktienindices								
Call Russell 2000 Index/Old 2240 02.08.24	361		Anzahl	-10000		USD 2,150	-20.060,65	-0,01
Call Russell 2000 Index/Old 2250 16.08.24	361		Anzahl	-10000		USD 4,180	-39.001,63	-0,03
Put Russell 2000 Index/Old 1780 02.08.24	361		Anzahl	-10000		USD 1,920	-17.914,63	-0,01
Put Russell 2000 Index/Old 1790 16.08.24	361		Anzahl	-10000		USD 3,530	-32.936,79	-0,02
Put S&P 500 INDEX 4850 20.12.24	361		Anzahl	2000		USD 45,550	85.001,17	0,06
Zins-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	-21.100,00	-0,02
Zinsterminkontrakte								
Bobl Future 06.09.24	185		EUR	1.000			-2.300,00	0,00
Euro Bund Future 06.09.24	185		EUR	2.000			-13.800,00	-0,01
Optionsrechte Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								
Put Euro Bund Future Sep 24 131,5 26.07.24	185		EUR	Anzahl -100			-5.000,00	0,00

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	2.932.454,93	2,15
Bankguthaben						EUR	2.932.454,93	2,15
EUR-Guthaben bei:								
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	1.142.015,34		% 100,000	1.142.015,34	0,84
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen								
			DKK	54.514,85		% 100,000	7.310,12	0,01
			NOK	4.096.796,73		% 100,000	359.005,98	0,26
			SEK	177.248,08		% 100,000	15.616,57	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
			CHF	9.897,49		% 100,000	10.277,23	0,01
			GBP	70.696,09		% 100,000	83.382,78	0,06
			JPY	1.578.800,00		% 100,000	9.157,68	0,01
			USD	1.399.372,43		% 100,000	1.305.689,23	0,96
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	859.605,45	0,63
Zinsansprüche			EUR	831.411,19			831.411,19	0,61
Dividendenansprüche			EUR	28.194,26			28.194,26	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten ^{*)}			EUR	-157.541,91			-157.541,91	-0,12
Fondsvermögen						EUR	<u>136.223.160,75</u>	<u>100,00 ¹⁾</u>
Anteilwert						EUR	59,34	
Umlaufende Anteile						STK	2.295.596	

^{*)} Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Kreditzinsverbindlichkeiten, Kostenpauschale

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2024		
Canadische Dollar	(CAD)	1,4665500	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9630500	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4574500	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8478500	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	172,4017000	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	11,4115000	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,3500000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0717500	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.

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

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	871981	STK		1.850	
Alstom S.A. Actions Port. EO 7	A0F7BK	STK		38.000	
Blackrock Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	928193	STK		2.400	
Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	A1KAGC	STK		3.000	
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	CBK100	STK	42.500	42.500	
Edenred SE Actions Port. EO 2	A1C0JG	STK		15.900	
Humana Inc. Registered Shares DL -,166	856584	STK		1.600	
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	623100	STK	24.000	24.000	
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	870747	STK		5.700	
Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098	851908	STK		60.400	
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	918422	STK	9.900	9.900	
PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	696960	STK		11.700	
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	716460	STK		2.150	
Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N.	SHL100	STK		9.900	
Solventum Corp. Registered Shares DL-,01	A407ZE	STK	1.700	1.700	
Valéo S.E. Actions Port. EO 1	A2ALDB	STK		47.000	
Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N.	877738	STK		10.900	
Verzinsliche Wertpapiere					
0,7500 % Aareal Bank AG MTN-IHS v.22(28)	AAR032	EUR		500	
3,0000 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2022(26)	A3LAW1	EUR		500	
4,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(30/31)	BP45ZK	EUR		300	
0,6250 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(32)	PB1LCV	EUR		300	
0,2500 % Essity AB EO-Med.-Term Nts 2021(21/31)	A3KLHQ	EUR		300	
0,2500 % Essity Capital B.V. EO-Med.-Term Nts 2021(21/29)	A3KV43	EUR		500	
4,0000 % Estland, Republik EO-Bonds 2022(32)	A3K98Z	EUR		2.000	
3,2500 % Estland, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LTA0	EUR	500	500	
2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H357 v.22(26)	HLB2QL	EUR		300	
2,0000 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 19(19/26)	A2RYXN	EUR		283	
4,3750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2019(25/Und.)	A2RY3G	EUR		500	
4,0000 % UniCredit S.p.A. EO-Preferred MTN 2024(34)	A3LVH2	EUR	300	300	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC EO-Notes 2019(19/27)	A2R7DH	EUR		200	
2,9950 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Securit. 2017(24/Und.)	A19FPY	EUR		300	
Nicht notierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
2,6000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72	A1ZCEN	EUR		1.000	
0,3750 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	A19FWG	EUR		500	
0,3750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Preferred MTN 2020(24)	A28Y1K	EUR		300	
0,5000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2017(24)	A19FF9	EUR		500	
Andere Wertpapiere					
EDP Renováveis S.A. Anrechte	A403SN	STK	21.600	21.600	

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Zinsterminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND)			EUR		6.232,83
Optionsrechte					
Wertpapier-Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktien					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
(Basiswert(e): PALO ALTO NETWKS DL-,0001)			EUR		56,68
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices					
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
(Basiswert(e): RUSSELL 2000)			EUR		355,08
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
(Basiswert(e): RUSSELL 2000)			EUR		452,07
Optionsrechte auf Zins-Derivate					
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
(Basiswert(e): Euro Bund Future 06.06.24, Euro Bund Future 06.09.24, Euro Bund Future 07.03.24)			EUR		531,28

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	59,34
Umlaufende Anteile	STK	2.295.596

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Verantwortung für die Anteilwertermittlung obliegt der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH (im Folgenden: Gesellschaft) unter Kontrolle der Verwahrstelle auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände wird von der Gesellschaft selbst durchgeführt. Unter Vermögensgegenständen versteht die Gesellschaft im Folgenden Wertpapiere, Optionen, Finanzterminkontrakte, Devisentermingeschäfte und Swaps.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, erfolgt grundsätzlich zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Vermögensgegenstände, für welche die Kursstellung auf der Grundlage von Geld- und Briefkursen erfolgt, werden grundsätzlich zum Geldkurs („Bid“) bewertet.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte. Die Gesellschaft nutzt zur Ermittlung der Verkehrswerte grundsätzlich externe Bewertungsmodelle. Die Verkehrswerte können auch von einem Emittenten, Kontrahenten oder sonstigen Dritten ermittelt und mitgeteilt werden.

Die Gesellschaft bewertet Investmentanteile mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis oder mit einem aktuellen Kurs. Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit ihrem Nominalbetrag, die Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Vermögensgegenstände in ausländischer Währung werden zu den von WM-Company (17.00 Uhr) bereitgestellten Devisenkursen des Tages der Preisberechnung in Euro umgerechnet.

Stuttgart

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 1003 51
70003 Stuttgart
Pariser Platz 1, Haus 5
70173 Stuttgart
Telefon 0711 22910-3000
Telefax 0711 22910-9098
www.LBBW-AM.de
info@LBBW-AM.de