

Halbjahresbericht zum 30.06.2023

# Waiblingen legt an

**RM Vermögensstrategie Nachhaltigkeit**

Im Ländle zu Hause,  
die Zukunft im Blick.

LB≡BW Asset Management



Kreissparkasse  
Waiblingen



## Inhalt

- 8 Vermögensübersicht zum 30.06.2023
- 9 Vermögensaufstellung zum 30.06.2023
- 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](http://www.LBBW-AM.de) finden Sie die aktuellen Fondspreise, umfangreiche Angaben zur Wertentwicklung, die Portfoliostruktur 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)



Dr. Bernhard Scherer



# RM Vermögensstrategie Nachhaltigkeit

## Halbjahresbericht zum 30.06.2023

## Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>125.610.237,92</b>	<b>100,18</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>53.534.312,22</b>	<b>42,70</b>
USA	21.273.482,96	16,97
Frankreich	8.335.645,52	6,65
Bundesrep. Deutschland	8.023.798,00	6,40
Großbritannien	4.917.316,90	3,92
Niederlande	2.125.330,80	1,70
Dänemark	2.061.402,51	1,64
Schweiz	1.717.413,25	1,37
Irland	1.521.824,00	1,21
Canada	1.304.251,57	1,04
Japan	816.376,29	0,65
Andere Länder	1.437.470,42	1,14
<b>2. Anleihen</b>	<b>69.651.293,70</b>	<b>55,55</b>
Frankreich	10.625.699,74	8,47
Bundesrep. Deutschland	8.522.212,96	6,80
Niederlande	7.020.699,84	5,60
Italien	6.713.704,50	5,35
Spanien	5.926.609,51	4,73
Belgien	4.233.744,00	3,38
Portugal	3.928.880,00	3,13
Großbritannien	2.828.626,00	2,26
Österreich	2.684.424,32	2,14
Canada	2.338.290,00	1,86
Australien	2.169.457,00	1,73
Estland	2.061.000,00	1,64
Irland	1.978.710,00	1,58
Island	1.669.820,00	1,33
Finnland	1.653.072,83	1,32
Andere Länder	5.296.343,00	4,24
<b>3. Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>	<b>1.485.118,59</b>	<b>1,18</b>
<b>4. Derivate</b>	<b>83.796,14</b>	<b>0,07</b>
<b>5. Bankguthaben</b>	<b>144.057,10</b>	<b>0,11</b>
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>711.660,17</b>	<b>0,57</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-231.084,71</b>	<b>-0,18</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>125.379.153,21</b>	<b>100,00</b>



## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>124.670.724,51</b>	<b>99,43</b>	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>121.196.871,00</b>	<b>96,66</b>	
<b>Aktien</b>										
Canadian Paci.Kansas City Ltd. Registered Shares o.N.	A3D9ZG		STK	7.400	8.200	800	CAD	107,000	548.451,89	0,44
Sun Life Financial Inc. Registered Shares o.N.	936039		STK	15.800		1.800	CAD	69,060	755.799,68	0,60
Meyer Burger Technology AG Nam.-Aktien SF -,05	A0YJZX		STK	2.775.300		316.200	CHF	0,604	1.717.413,25	1,37
Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	A1KAGC		STK	9.000	6.000	1.000	DKK	853,200	1.031.272,03	0,82
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20	A1XA8R		STK	5.100		600	DKK	1.099,400	753.018,76	0,60
Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10	A0NBLH		STK	3.200		400	DKK	644,800	277.111,72	0,22
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	850133		STK	3.900		500	EUR	164,200	640.380,00	0,51
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	840400		STK	9.600	3.000	1.100	EUR	213,200	2.046.720,00	1,63
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	A1J4U4		STK	610		2.540	EUR	663,000	404.430,00	0,32
ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16	A2AKBT		STK	21.600		2.500	EUR	41,240	890.784,00	0,71
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	855705		STK	40.100		4.600	EUR	27,025	1.083.702,50	0,86
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	887771		STK	13.500		16.400	EUR	57,720	779.220,00	0,62
Bouygues S.A. Actions Port. EO 1	858821		STK	25.270		2.900	EUR	30,760	777.305,20	0,62
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	606214		STK	20.000	37.800	17.800	EUR	47,580	951.600,00	0,76
CRH PLC Registered Shares EO -,32	864684		STK	21.490		2.400	EUR	50,500	1.085.245,00	0,87
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	581005		STK	9.900		1.100	EUR	169,100	1.674.090,00	1,34
Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien o.N.	577330		STK	2.500	2.800	300	EUR	48,860	122.150,00	0,10
Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.	840221		STK	7.800		900	EUR	194,350	1.515.930,00	1,21
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	850605		STK	179.500	100.000	295.500	EUR	2,400	430.800,00	0,34
KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N.	KGX888		STK	5.600		12.600	EUR	36,860	206.416,00	0,16
Nexans S.A. Actions Port. EO 1	676168		STK	5.400	6.000	600	EUR	79,350	428.490,00	0,34
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	A115DY		STK	24.480		2.800	EUR	33,910	830.116,80	0,66
Orange S.A. Actions Port. EO 4	906849		STK	87.160		9.900	EUR	10,702	932.786,32	0,74
Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2	853888		STK	2.300		1.800	EUR	427,100	982.330,00	0,78
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	716460		STK	3.800		3.400	EUR	125,140	475.532,00	0,38
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	860180		STK	2.100		200	EUR	166,460	349.566,00	0,28
Scout24 SE Namens-Aktien o.N.	A12DM8		STK	9.900		1.100	EUR	58,080	574.992,00	0,46
Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N.	SHL100		STK	8.800		1.000	EUR	51,860	456.368,00	0,36

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001	A0MLCS		STK	14.300		1.600	EUR 30,530	436.579,00	0,35
Téléperformance SE Actions Port. EO 2,5	889287		STK	7.350	2.200	800	EUR 153,450	1.127.857,50	0,90
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	A0JNE2		STK	14.980		1.700	EUR 47,710	714.695,80	0,57
Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N.	877738		STK	9.700		1.100	EUR 73,450	712.465,00	0,57
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	867475		STK	11.600		1.300	EUR 106,380	1.234.008,00	0,98
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	923893		STK	173.900		19.800	GBP 6,217	1.259.845,37	1,00
London Stock Exchange Group PLC Reg. Shares LS 0,069186047	A0JEJF		STK	18.500	8.000	7.200	GBP 83,660	1.803.542,50	1,44
Relx PLC Registered Shares LS -,144397	A0M95J		STK	37.300		4.200	GBP 26,210	1.139.233,23	0,91
Nomura Research Institute Ltd. Registered Shares o.N.	630026		STK	32.500		3.700	JPY 3.961,000	816.376,29	0,65
Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098	851908		STK	53.900		6.100	NOK 63,800	294.205,42	0,23
3M Co. Registered Shares DL -,01	851745		STK	6.100		700	USD 100,090	559.623,28	0,45
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	871981		STK	1.650		3.050	USD 488,910	739.414,76	0,59
Air Products & Chemicals Inc. Registered Shares DL 1	854912		STK	5.800		700	USD 299,530	1.592.368,47	1,27
Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001	867900		STK	2.800	3.000	200	USD 221,995	569.739,69	0,45
Blackrock Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	928193		STK	2.100		200	USD 691,140	1.330.333,64	1,06
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	850501		STK	8.000	8.000		USD 63,950	468.927,59	0,37
Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01	A1H92V		STK	22.000		2.500	USD 46,040	928.395,97	0,74
CSX Corp. Registered Shares DL 1	865857		STK	12.400		1.400	USD 34,079	387.332,36	0,31
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	859034		STK	8.200	9.100	900	USD 69,130	519.583,87	0,41
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	A12FMV		STK	2.300		300	USD 444,290	936.633,36	0,75
GATX Corp. Registered Shares DL -,625	851137		STK	3.100		400	USD 128,740	365.805,68	0,29
Johnson & Johnson Registered Shares DL 1	853260		STK	9.300	5.900	1.100	USD 165,520	1.410.940,42	1,13
Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	A12B6J		STK	2.700		300	USD 167,450	414.404,22	0,33
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	A0YD8Q		STK	6.550		800	USD 115,390	692.763,06	0,55
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	870747		STK	5.100		4.100	USD 340,385	1.591.167,28	1,27
Moody's Corp. Registered Shares DL-,01	915246		STK	2.200		300	USD 347,720	701.176,90	0,56
Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60	853823		STK	18.850		2.100	USD 42,660	737.067,83	0,59
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	866993		STK	6.400		700	USD 110,370	647.450,05	0,52
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	871460		STK	4.900		16.100	USD 119,090	534.868,01	0,43
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	852009		STK	22.600	25.200	2.600	USD 36,680	759.824,01	0,61

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	852062		STK	6.370		700	USD 151,740	885.961,32	0,71
S&P Global Inc. Registered Shares DL 1	A2AHZ7		STK	4.300		500	USD 400,890	1.580.043,08	1,26
SolarEdge Technologies Inc. Registered Shares DL -,0001	A14QVM		STK	5.500		600	USD 268,870	1.355.439,96	1,08
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	A0NC7B		STK	3.900		400	USD 237,480	848.920,26	0,68
Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01	893579		STK	4.500		500	USD 173,420	715.297,89	0,57
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
4,5000 % A2A S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K9HY		EUR	500			% 100,581	502.905,00	0,40
0,7500 % Aareal Bank AG MTN-IHS v.22(28)	AAR032		EUR	500			% 76,680	383.400,00	0,31
0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-T. Nts 2021(29)	A3KWNV		EUR	500			% 79,835	399.175,00	0,32
3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LCKZ		EUR	400	400		% 98,866	395.464,00	0,32
3,5000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2022(29)	A3LAFX		EUR	1.000	700		% 98,630	986.300,00	0,79
0,2500 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2016(26)	A184BH		EUR	500			% 90,720	453.600,00	0,36
1,6250 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	A28V25		EUR	300			% 85,810	257.430,00	0,21
1,5000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28)	A3K3L0		EUR	200			% 89,801	179.602,00	0,14
4,0000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	A3LH2B		EUR	500	500		% 96,479	482.395,00	0,38
2,2410 % Allianz SE FLR-Sub.Anl.v.2015(2025/2045)	A14J9N		EUR	500			% 94,030	470.150,00	0,37
0,1250 % Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2019(29)	A2R8AW		EUR	500			% 81,670	408.350,00	0,33
3,4370 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LF4D		EUR	500	500		% 99,075	495.375,00	0,40
3,0000 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2022(26)	A3LAW1		EUR	500			% 97,777	488.885,00	0,39
5,5000 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2023(33/43)	A3LGGA		EUR	500	500		% 100,000	500.000,00	0,40
1,1250 % Banco Santander S.A. EO-Non-Pref.MTN 2018(25)	A19UUN		EUR	300			% 95,262	285.786,00	0,23
0,4500 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(26)	A3K29T		EUR	500			% 91,156	455.780,00	0,36
3,2500 % Bank of Nova Scotia, The EO-Med.-T. Cov. Bonds 2023(28)	A3LC1J		EUR	500	500		% 98,370	491.850,00	0,39
1,2080 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2019(19/26)	A2R2UQ		EUR	300			% 92,577	277.731,00	0,22
0,1000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2020(30)	A28SFQ		EUR	2.000			% 82,650	1.653.000,00	1,32
2,6000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2014(24) Ser. 72	A1ZCEN		EUR	2.000	2.000		% 99,104	1.982.080,00	1,58
1,7500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.22(32)	BHY0SB		EUR	500			% 89,340	446.700,00	0,36
0,3750 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(27)	A28RTP		EUR	300			% 89,330	267.990,00	0,21
3,0000 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(30)	BP45YQ		EUR	500	500		% 98,240	491.200,00	0,39
3,8750 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 23(28/29)	BP45Y1		EUR	500	500		% 98,570	492.850,00	0,39

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
4,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(30/31)	BP45ZK		EUR	300	300	% 98,460	295.378,50	0,24
0,6250 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(32)	PB1LCV		EUR	300		% 71,710	215.130,00	0,17
1,5000 % Brambles Finance PLC EO-Bonds 2017(17/27)	A19P25		EUR	300		% 91,900	275.700,00	0,22
4,2500 % Brambles Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	A3LFL5		EUR	300	300	% 100,085	300.255,00	0,24
1,1250 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/29)	A2R7MH		EUR	300		% 85,200	255.600,00	0,20
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030)	103070		EUR	1.500	1.000	% 84,577	1.268.655,00	1,01
3,1250 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2023(30)	A3LESJ		EUR	1.000	1.000	% 100,033	1.000.330,00	0,80
2,7500 % Commerzbank AG MTH S.P58 v.22(25)	CZ43ZJ		EUR	300		% 97,817	293.451,69	0,23
0,1000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.973 v.21(25)	CB0HRY		EUR	500		% 91,980	459.900,00	0,37
0,3750 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	A19FWG		EUR	500		% 97,313	486.565,00	0,39
0,7500 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(28)	A3K2LY		EUR	500		% 87,755	438.775,00	0,35
4,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(27/28)	A3LARG		EUR	300		% 100,933	302.799,00	0,24
0,0100 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2021(28)	A3KTQU		EUR	500		% 85,012	425.062,45	0,34
0,1250 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Pref.MTN 2020(27)	A2855X		EUR	300		% 84,423	253.269,00	0,20
1,7500 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29)	A2RYPL		EUR	300		% 87,265	261.795,00	0,21
0,3750 % Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/29)	A2R7Q1		EUR	300		% 83,485	250.455,00	0,20
0,5000 % De Volksbank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(26)	A2RWY9		EUR	500		% 92,080	460.400,00	0,37
0,0100 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-OPF.R.A154 v.21(26)	DK0YUJ		EUR	500		% 89,680	448.400,00	0,36
2,0000 % Deutsche Börse AG FLR-Sub.Anl.v.2022(2022/2048)	A3MQQV		EUR	500		% 87,714	438.570,00	0,35
0,0100 % Deutsche Kreditbank AG Öff.Pfdr. v.2019(2029)	SCB002		EUR	300		% 81,970	245.910,00	0,20
4,0000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 23(28/29)	A3LFCX		EUR	400	400	% 99,768	399.072,00	0,32
0,6250 % DNB Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2019(26)	A2RWAB		EUR	500		% 92,420	462.100,00	0,37
0,2500 % Elisa Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(27/27)	A282EB		EUR	300		% 85,760	257.280,00	0,21
0,2500 % Essity AB EO-Med.-Term Nts 2021(21/31)	A3KLHQ		EUR	300		% 76,794	230.382,00	0,18
0,2500 % Essity Capital B.V. EO-Med.-Term Nts 2021(21/29)	A3KV43		EUR	500		% 81,120	405.600,00	0,32
3,0000 % Essity Capital B.V. EO-Med.-Term Nts 2022(22/26)	A3K9KC		EUR	300		% 97,379	292.137,00	0,23
4,0000 % Estland, Republik EO-Bonds 2022(32)	A3K98Z		EUR	2.000	1.700	% 103,050	2.061.000,00	1,64
1,3750 % Gecina S.A. EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	A19KYG		EUR	300		% 90,990	272.970,00	0,22
0,0100 % HSBC Bank Canada EO-Mortg. Cov. Bonds 2021(26)	A3KV4N		EUR	500		% 88,817	444.085,00	0,35
0,3750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Preferred MTN 2020(24)	A28Y1K		EUR	300		% 95,925	287.775,00	0,23

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2022(27)	A3LAH1		EUR	300			% 98,380	295.140,00	0,24
2,8750 % Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	A2YN1H		EUR	400			% 94,898	379.592,00	0,30
0,0100 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.2021(2028)	A1KRJV		EUR	500			% 84,240	421.200,00	0,34
1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdbr.17(27)	A19JLP		EUR	1.000			% 90,647	906.470,00	0,72
0,3750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Mortg.Cov. MTN 2016(26)	A1851S		EUR	500			% 89,731	448.655,00	0,36
4,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30)	A3LHY6		EUR	700	700		% 100,040	700.280,00	0,56
0,8750 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2019(29/29)	A2R848		EUR	300			% 82,020	246.060,00	0,20
0,2000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(27)	A28V33		EUR	2.000			% 89,970	1.799.400,00	1,44
0,0000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2021(28)	A3KLAX		EUR	2.000		500	% 83,491	1.669.820,00	1,33
0,0000 % Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2021(28)	A3KLRN		EUR	500			% 83,884	419.417,50	0,33
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	A3LGGP		EUR	2.000	2.000		% 100,920	2.018.400,00	1,61
0,7500 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A28W3X		EUR	300			% 89,284	267.852,00	0,21
1,6250 % KION GROUP AG Med.Term.Notes v.20(20/25)	A289QY		EUR	200			% 92,976	185.951,93	0,15
1,3750 % Koninklijke Philips N.V. EO-Medium-Term Nts.2020(20/25)	A28VAM		EUR	300			% 95,707	287.121,00	0,23
3,0000 % Kroatien, Republik EO-Notes 2017(27)	A19EWH		EUR	1.000	1.000		% 98,630	986.300,00	0,79
3,1250 % La Poste EO-FLR Notes 2018(26/Und.)	A19Z03		EUR	500			% 92,676	463.379,29	0,37
0,0000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29)	A287PR		EUR	300			% 79,490	238.470,00	0,19
2,7500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(24)R.832	LB381U		EUR	500			% 98,807	494.035,00	0,39
3,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.836 v.23(27)	LB387B		EUR	500	500		% 99,565	497.825,00	0,40
2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H357 v.22(26)	HLB2QL		EUR	300			% 96,420	289.260,00	0,23
3,5000 % Legrand S.A. EO-Obl. 2023(23/29)	A3LJBG		EUR	500	500		% 99,827	499.135,00	0,40
1,0000 % Mastercard Inc. EO-Notes 2022(22/29)	A3K2J8		EUR	300			% 87,328	261.984,00	0,21
2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH EO-Medium-Term Nts 2020(28/28)	A28VAZ		EUR	500			% 93,060	465.300,00	0,37
3,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.18(29/49)	A2TSS7		EUR	500			% 90,788	453.939,74	0,36
0,5530 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/29)	A282LR		EUR	300			% 80,890	242.670,00	0,19
0,7800 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2021(29/30)	A3KMFJ		EUR	200			% 79,835	159.670,00	0,13
1,3750 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K2U9		EUR	300			% 89,760	269.280,00	0,21
3,8750 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LFLA		EUR	300	300		% 99,647	298.941,00	0,24
2,1250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(27/82)	A2R686		EUR	300			% 86,283	258.849,00	0,21
2,0000 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 19(19/26)	A2RYXN		EUR	283		217	% 94,301	266.871,83	0,21

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
4,3750 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 23(23/31)	A3LEFB		EUR	300	300		% 98,280	294.840,00	0,24
0,5000 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 2021(31)	A3KNMS		EUR	300			% 78,810	236.430,00	0,19
5,2500 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	A1ZC7L		EUR	300			% 99,887	299.661,00	0,24
5,3750 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 23(23/Und.)	A3LGHK		EUR	300	300		% 99,330	297.990,00	0,24
0,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/29)	A282GE		EUR	300			% 81,480	244.440,00	0,19
5,2500 % Orsted A/S EO-FLR Notes 2022(22/3022)	A3LB0K		EUR	300	100		% 99,253	297.759,00	0,24
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	A19SNH		EUR	100			% 87,035	87.035,00	0,07
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LGQG		EUR	500	500		% 99,695	498.475,00	0,40
4,9500 % Portugal, Republik EO-Obr. 2008(23)	A0TWJE		EUR	2.000	2.000		% 100,394	2.007.880,00	1,60
2,1250 % Portugal, Republik EO-Obr. 2018(28)	A19UWV		EUR	2.000	2.000		% 96,050	1.921.000,00	1,53
0,5000 % REN Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3KPNA		EUR	300			% 83,240	249.720,00	0,20
0,6250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(26)	A3K3MC		EUR	500			% 91,750	458.750,00	0,37
4,1250 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 2023(28)	A3LG55		EUR	500	500		% 98,890	494.450,00	0,39
1,1250 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(27)	A3K374		EUR	500			% 91,120	455.600,00	0,36
3,2500 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27)	A3LA5M		EUR	400			% 98,796	395.184,00	0,32
3,3750 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/25)	A3LF6Q		EUR	300	300		% 99,035	297.105,00	0,24
3,1250 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	A3LC3G		EUR	300	300		% 98,250	294.750,00	0,24
3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2023(31/31)	A3LEFR		EUR	500	500		% 99,864	499.320,00	0,40
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LHVU		EUR	500	500		% 98,734	493.667,50	0,39
0,6250 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2021(31/31)	A3KTBK		EUR	500			% 76,330	381.650,00	0,30
0,0100 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2020(30)	A28S36		EUR	500			% 80,240	401.200,00	0,32
5,4250 % Solvay Finance S.A. EO-FLR Notes 2013(23/Und.)	A1HS31		EUR	300			% 99,711	299.133,00	0,24
4,2500 % Solvay S.A. EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	A2RU3N		EUR	400			% 99,450	397.800,00	0,32
4,4000 % Spanien EO-Bonos 2013(23)	A1HK7U		EUR	2.000	2.000		% 100,164	2.003.280,00	1,60
1,6000 % Spanien EO-Bonos 2015(25)	A1ZVCP		EUR	500			% 96,811	484.055,00	0,39
2,8000 % Spanien EO-Bonos 2023(26)	A3LC67		EUR	1.500	1.500		% 98,420	1.476.300,00	1,18
2,8750 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	A3K880		EUR	100			% 96,400	96.400,00	0,08
4,0000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LJB7		EUR	300	300		% 99,570	298.710,00	0,24
4,3750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2019(25/Und.)	A2RY3G		EUR	500			% 97,760	488.800,00	0,39
0,2500 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2020(20/28)	A28TMG		EUR	300			% 85,250	255.750,00	0,20

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	A28Z9P		EUR	200			% 94,452	188.903,00	0,15
2,9950 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Securit. 2017(24/Und.)	A19FPY		EUR	200			% 98,452	196.903,84	0,16
0,5000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/31)	A3KRYC		EUR	500			% 82,536	412.680,00	0,33
2,1250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	A3K48Y		EUR	200		300	% 93,635	187.270,00	0,15
2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-FLR Nts 2022(22/Und.)	A3K11Y		EUR	300			% 85,554	256.662,00	0,20
0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3KSW1		EUR	300			% 82,149	246.447,00	0,20
3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LGUC		EUR	300	300		% 98,636	295.908,00	0,24
0,5000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2017(24)	A19FF9		EUR	500			% 97,565	487.825,00	0,39
1,5000 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2022(28)	A3K5WE		EUR	500			% 91,180	455.900,00	0,36
3,0000 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2023(26)	A3LC5A		EUR	400	400		% 97,850	391.400,00	0,31
3,7500 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(28)	A3LJ6R		EUR	500	500		% 98,815	494.075,00	0,39
4,4500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(28/29)	A3LEBR		EUR	300	300		% 96,950	290.850,00	0,23
1,6250 % Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2016(16/26)	A18Y75		EUR	300			% 93,249	279.747,00	0,22
5,3750 % Valéo S.E. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	A3LBTB		EUR	200			% 100,002	200.004,00	0,16
0,0000 % VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A285JA		EUR	300			% 83,975	251.925,00	0,20
2,6250 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(26/80)	A281WT		EUR	400			% 89,995	359.980,00	0,29
0,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/29)	A3E5MH		EUR	300			% 75,500	226.500,00	0,18
0,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/31)	A3E5FR		EUR	500			% 72,008	360.040,78	0,29
3,4570 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(25)	A3LF5D		EUR	500	500		% 99,100	495.500,00	0,40
2,7500 % Wienerberger AG EO-Schuldv. 2020(20/25)	A28XZ9		EUR	300			% 96,811	290.434,32	0,23
3,0000 % ZF Finance GmbH MTN v.2020(2020/2025)	A289EU		EUR	500			% 94,656	473.281,82	0,38
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>									
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	855167		STK	5.300		600	CHF 273,500	1.485.118,59	1,18
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>3.473.853,51</b>	<b>2,77</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
2,2500 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32)	A3K5LQ		EUR	500			% 91,847	459.235,00	0,37
3,5530 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2023(23/29)	A3LD4C		EUR	300	300		% 98,123	294.367,50	0,23
5,0000 % Crown European Holdings S.A. EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	A3LHVJ		EUR	200	200		% 100,723	201.446,00	0,16
5,8500 % Elia Group EO-FLR Nts 2023(23/Und.)	A3LFG9		EUR	200	200		% 100,432	200.864,00	0,16



## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
3,5000 % Getlink SE EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	A284GU		EUR	300			% 97,785	293.353,50	0,23
6,0000 % Kon. KPN N.V. EO-FLR Notes 2022(22/Und.)	A3K9EV		EUR	300	100		% 101,129	303.387,00	0,24
4,6250 % Redeia Corporacion S.A. EO-FLR Notes 23(28/Und.)	A3LDNJ		EUR	200	200		% 98,219	196.438,51	0,16
4,3750 % Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K6U4		EUR	300			% 101,456	304.368,00	0,24
0,5000 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A283PR		EUR	300			% 83,674	251.022,00	0,20
0,2500 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 2019(24)	A2YN27		EUR	300			% 95,150	285.450,00	0,23
1,5000 % Smurfit Kappa Treasury PUC EO-Notes 2019(19/27)	A2R7DH		EUR	200			% 89,655	179.310,00	0,14
0,0100 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	A28515		EUR	300			% 83,790	251.370,00	0,20
1,0000 % Telstra Corp. Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	A28WEQ		EUR	300			% 84,414	253.242,00	0,20
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>124.670.724,51</b>	<b>99,43</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>83.796,14</b>	<b>0,07</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>-23.866,36</b>	<b>-0,02</b>
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>									
Call Covestro AG 58 18.08.23 K100		185	STK	-20.000			EUR 0,510	-10.200,00	-0,01
Put Target Corp 130 21.07.23		361	STK	-7.000			USD 2,130	-13.666,36	-0,01
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>107.662,50</b>	<b>0,09</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
DAX Index Future 15.09.23		185	EUR	Anzahl -33				107.662,50	0,09
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>144.057,10</b>	<b>0,11</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>144.057,10</b>	<b>0,11</b>
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
			DKK	83.848,16			% 100,000	11.260,91	0,01
			NOK	6.561,20			% 100,000	561,34	0,00
			SEK	66.508,28			% 100,000	5.643,83	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
			CHF	60.956,95			% 100,000	62.452,69	0,05
			GBP	39.887,19			% 100,000	46.480,44	0,04
			JPY	38.124,00			% 100,000	241,77	0,00
			USD	19.000,99			% 100,000	17.416,12	0,01



## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						EUR	711.660,17	0,57
Zinsansprüche			EUR	654.538,85			654.538,85	0,52
Dividendenansprüche			EUR	57.121,32			57.121,32	0,05
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>						EUR	-85.063,48	-0,07
EUR-Kredite			EUR	-85.063,48		% 100,000	-85.063,48	-0,07
<b>Sonstige Verbindlichkeiten <sup>*)</sup></b>			EUR	-146.021,23			-146.021,23	-0,12
<b>Fondsvermögen</b>						EUR	125.379.153,21	100,00 <sup>1)</sup>
<b>Anteilwert</b>						EUR	56,88	
<b>Umlaufende Anteile</b>						STK	2.204.417	

<sup>\*)</sup> Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwahrenentgelte, Kostenpauschale

### Fußnoten:

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

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2023		
Canadische Dollar	(CAD)	1,4437000	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9760500	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4459500	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8581500	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	157,6877000	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	11,6885000	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,7842500	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0910000	=	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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)EO-,12	A0JL2Y	STK		106.700	
Boston Scientific Corp. Registered Shares DL -,01	884113	STK		15.500	
Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.	531370	STK		5.100	
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	CBK100	STK		100.000	
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	555200	STK		4.000	
EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5	A0Q249	STK		13.500	
ENCAVIS AG Inhaber-Aktien o.N.	609500	STK		900	
GSK PLC Registered Shares LS-,3125	A3DMB5	STK		51.400	
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	A2ANV3	STK	56.500	56.500	
KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	854943	STK		6.100	
Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20	940602	STK		46.700	
LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.	547040	STK		5.000	
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	843002	STK		7.000	
Norfolk Southern Corp. Registered Shares DL 1	867028	STK		4.800	
ON Semiconductor Corp. Registered Shares DL -,01	930124	STK		14.300	
SIG Group AG Namens-Aktien SF-,01	A2N5NU	STK		24.800	
Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05	893484	STK		750	
Stora Enso Oyj Reg. Shares Cl.R EO 1,70	871004	STK	25.000	25.000	
Sunnova Energy International I Registered Shares DL -,0001	A2PNYK	STK		50.000	
Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	SYM999	STK		3.500	
V.F. Corp. Registered Shares o.N.	857621	STK		7.300	
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	A1ML7J	STK		19.000	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,0000 % adidas AG Anleihe v.2020(2020/2028)	A289Q8	EUR		300	
1,6250 % Alliander N.V. EO-FLR Securit. 2018(25/Und.)	A19VX6	EUR	100	400	
0,0100 % Baden-Württemberg, Land Landessch.v.2021(2031)	A14JZS	EUR		500	
0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(27)	A3KZ6V	EUR		500	
0,0340 % Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2021(21/25)	A3KU4Z	EUR		200	
1,1250 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	PB1K04	EUR		300	
0,6250 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R760	EUR		300	
0,3750 % Continental AG MTN v.19(25/25)	A2YPAE	EUR		300	
0,3750 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.20(26/26)	A289XD	EUR		300	
2,7500 % Elia Group EO-FLR Nts 2018(23/Und.)	A195EM	EUR	100	600	
1,1250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/26)	A3E44V	EUR		300	
0,6250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.22(22/25)	A3MQS8	EUR		200	
0,8750 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/31)	A2844L	EUR		300	
0,7500 % La Banque Postale EO-Non-Preferred MTN 2021(31)	A3KSZD	EUR		500	
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2020(2026/2080)	A289QM	EUR		300	
0,7500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/25)	A3K3U0	EUR		300	
2,3750 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(25/Und.)	A2R0G8	EUR		200	
1,3750 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.)	A3KQMK	EUR		300	
0,0000 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/26)	A3KTCX	EUR		300	
0,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A28R5E	EUR		300	
0,0500 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2020(27)	A28R4R	EUR		500	
0,0100 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 2021(26)	A3KZKN	EUR		500	
0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/26)	A3K2SV	EUR		300	

## 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
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,0000 % ABB Finance B.V. EO-Medium-T. Notes 2021(21/30)	A287Q8	EUR		300	
2,0000 % Kon. KPN N.V. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	A2R93C	EUR		300	
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Canadian Pacific Railway Ltd. Registered Shares o.N.	798292	STK		8.200	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
1,7500 % Danone S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 17(23/Und.)	A19RCU	EUR		300	
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
Verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX)		EUR			16.446,70
<b>Zinsterminkontrakte</b>					
Verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND)		EUR			12.122,26
<b>Optionsrechte</b>					
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>					
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>					
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
(Basiswert(e): KONINKL. PHILIPS EO -,20, MUENCH.RUECKVERS.VNA O.N., ON SEMICOND. DL-,01, SOLAREEDGE TECHN. DL-,0001, SUNNOVA ENERGY INT.-,0001)		EUR			1.138,67
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
(Basiswert(e): STANLEY BL. + DECK.DL2,50, TARGET CORP. DL-,0833)		EUR			44,09
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>					
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)		EUR			233,14

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	56,88
Umlaufende Anteile	STK	2.204.417

### 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, den 3. Juli 2023

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](http://www.LBBW-AM.de)  
[info@LBBW-AM.de](mailto:info@LBBW-AM.de)