

**LB≡BW Asset Management**

**LBBW Renten Short Term  
Nachhaltigkeit**

**Halbjahresbericht zum 30.09.2024**



# Inhalt

Vermögensübersicht zum 30.09.2024	8
Vermögensaufstellung zum 30.09.2024	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	17
Übersicht Anteilklassen	19
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	20



**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 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



# LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit

## Halbjahresbericht zum 30.09.2024

# Vermögensübersicht zum 30.09.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>458.583.048,43</b>	<b>100,03</b>
<b>1. Anleihen</b>	<b>449.983.130,10</b>	<b>98,16</b>
Bundesrep. Deutschland	161.348.896,21	35,20
Frankreich	54.821.270,57	11,96
Niederlande	32.317.196,00	7,05
USA	17.958.712,50	3,92
Italien	15.824.495,00	3,45
Norwegen	15.281.057,59	3,33
Luxemburg	15.025.785,25	3,28
Jersey	14.808.750,00	3,23
Dänemark	14.498.343,85	3,16
Australien	12.557.325,00	2,74
Schweden	11.094.152,00	2,42
Portugal	10.768.650,00	2,35
Tschechische Republik	10.285.216,00	2,24
Spanien	9.456.017,00	2,06
Finnland	5.661.720,00	1,24
Litauen	5.639.169,45	1,23
Österreich	5.363.188,00	1,17
Canada	4.640.762,00	1,01
Intern. Investitionsbk	4.500.000,00	0,98
Neuseeland	4.493.682,00	0,98
Großbritannien	3.903.260,00	0,85
Slowakei	3.001.200,00	0,65
Belgien	2.963.910,00	0,65
Slowenien	2.918.461,30	0,64
Andean Development Corp.	2.892.900,00	0,63
Curaçao	2.827.942,38	0,62
Schweiz	2.505.025,00	0,55
Polen	2.160.468,00	0,47
Irland	465.575,00	0,10
<b>2. Derivate</b>	<b>-26.156,48</b>	<b>-0,01</b>
<b>3. Bankguthaben</b>	<b>4.036.732,58</b>	<b>0,88</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>4.589.342,23</b>	<b>1,00</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-159.956,04</b>	<b>-0,03</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>458.423.092,39</b>	<b>100,00</b>



# Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>449.983.130,10</b>	<b>98,16</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>375.578.676,44</b>	<b>81,93</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
1,7500 % A.P.Møller-Mærsk A/S EO-Medium-Term Nts 2018(18/26)	A19XNN		EUR	1.000			% 98,336	983.360,00	0,21
4,5000 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 317 v.22(25)	AAR035		EUR	6.000			% 100,971	6.058.260,00	1,32
3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LCKZ		EUR	5.000			% 100,940	5.047.000,00	1,10
0,6250 % ASB Bank Ltd. EO-Med.T. Mtg Cov. Nts 17(24)	A19QN3		EUR	4.500			% 99,860	4.493.682,00	0,98
3,4370 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LF4D		EUR	8.000			% 100,167	8.013.360,00	1,75
4,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	A3LHE2		EUR	1.700			% 100,485	1.708.245,00	0,37
3,6250 % Banco BPI S.A. EO-Covered MTN 2023(28)	A3LKL9		EUR	7.500	2.500		% 102,910	7.718.250,00	1,68
0,6250 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25)	A2R912		EUR	1.500			% 99,773	1.496.595,00	0,33
4,3660 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(26)	A288JJ		EUR	1.000			% 100,370	1.003.700,00	0,22
1,3750 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26)	A28WYB		EUR	2.000			% 98,332	1.966.640,00	0,43
3,7500 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.T.Obr.Hipotecárias 23(26)	A3LM12		EUR	3.000			% 101,680	3.050.400,00	0,67
4,1340 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2023(28/28)	A3LJS4		EUR	3.000			% 103,825	3.114.750,00	0,68
2,7500 % Bank of Montreal EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K6H7		EUR	1.000	1.000		% 99,567	995.670,00	0,22
4,2060 % Bayerische Landesbank FLR-MTN-Inh.Schv. v.24(26)	BLB9V0		EUR	5.000			% 100,140	5.007.000,00	1,09
3,0000 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.22(24)	BLB9SY		EUR	2.000			% 100,030	2.000.600,00	0,44
4,1250 % Bca Pop. di Sondrio S.p.A. EO-M.-T. Mortg.Cov.Nts 23(28)	A3LP33		EUR	1.900			% 104,680	1.988.920,00	0,43
2,7500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.24(27)	BHYOGY		EUR	7.400			% 100,946	7.470.004,00	1,63
1,2500 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.109 v.15(25)	BHYOA5		EUR	5.000			% 99,280	4.964.000,00	1,08
3,7490 % BMW Finance N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2024(26)	A3LUTG		EUR	5.000			% 100,040	5.002.000,00	1,09
3,5000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(24)	A3LGRW		EUR	500			% 99,980	499.900,00	0,11
3,0000 % BMW Internat. Investment B.V. EO-Medium-Term Notes 2024(27)	A3L23P		EUR	6.600	6.600		% 100,516	6.634.056,00	1,45
1,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(25)	BP459T		EUR	5.000			% 98,370	4.918.500,00	1,07
1,5000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(28)	PB1KXQ		EUR	3.000	3.000		% 94,850	2.845.500,00	0,62
1,2500 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	PB1KZX		EUR	3.000			% 99,040	2.971.200,00	0,65
0,2500 % BPCE S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(26)	A28R2M		EUR	1.000			% 96,647	966.470,00	0,21
2,8750 % BPCE S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	A180FE		EUR	2.000			% 99,433	1.988.660,00	0,43

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,6250 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(26)	A3LGHR		EUR	3.000		3.200	% 101,119	3.033.570,00	0,66
BPCE S.A. EO-Zo Obl. 2023(28)	A3LRBX		EUR	3.000	3.000		% 107,602	3.228.060,00	0,70
1,9000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-FLR Med.-T.Obl.Fonc.05(25)	A0D3XJ		EUR	10.000			% 99,513	9.951.280,00	2,17
0,3750 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25)	A28R49		EUR	2.000			% 99,023	1.980.460,00	0,43
0,6250 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/25)	A28YX9		EUR	1.600			% 98,100	1.569.600,00	0,34
3,2500 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/25)	A3K99U		EUR	1.100			% 100,150	1.101.650,00	0,24
5,6250 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2022(22/27)	A3LADJ		EUR	3.000			% 105,370	3.161.100,00	0,69
0,1000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.973 v.21(25)	CBOHRY		EUR	4.000			% 97,450	3.898.000,00	0,85
4,0000 % Continental AG MTN v.23(27/27)	A35138		EUR	4.200			% 102,116	4.288.872,00	0,94
3,9130 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LQJT		EUR	3.000			% 102,486	3.074.580,00	0,67
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KLA2		EUR	3.000			% 96,430	2.892.900,00	0,63
1,8750 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Prefer.FLM 2022(26/27)	A3K4NX		EUR	500			% 98,360	491.800,00	0,11
2,1000 % Danaher Corp. EO-Notes 2020(20/26)	A28VFQ		EUR	2.000			% 98,950	1.979.000,00	0,43
0,3000 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN.-ANL A.150 v.19(26)	DK0JTH		EUR	10.000			% 95,350	9.535.000,00	2,08
4,5110 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.15(25)	DB7XKH		EUR	4.000			% 99,885	3.995.400,00	0,87
2,2500 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.22(27)	A30VPC		EUR	4.700	4.700		% 99,386	4.671.142,00	1,02
0,0500 % Deutsche Bank AG Struc.Cov.Bond SCB v.19(24)	DL19U1		EUR	1.200			% 99,550	1.194.600,00	0,26
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35413 v.22(25)	A3T0X9		EUR	3.000			% 98,642	2.959.260,00	0,65
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	A30WVU		EUR	3.200			% 99,617	3.187.744,00	0,70
4,1820 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. FLR-MTN-IHS A.2339 v.23(26)	DJ9ABK		EUR	15.000			% 100,682	15.102.270,00	3,29
0,3750 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/26)	A28X4M		EUR	2.000			% 97,165	1.943.300,00	0,42
4,8750 % Hamburg Commercial Bank AG IHS v. 2023(2025) S.2755	HCB0BS		EUR	6.500			% 100,610	6.539.650,00	1,43
0,1000 % HSBC Continental Europe S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(27)	A2R68Q		EUR	5.000	5.000		% 92,913	4.645.650,00	1,01
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfbr. 2023(28)	A3LHPR		EUR	1.300			% 101,916	1.324.908,00	0,29
3,8670 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 2007(27)	A0V0TR		EUR	1.600			% 95,560	1.528.960,00	0,33
4,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(25)	A3LN8E		EUR	5.000			% 101,260	5.063.010,00	1,10
2,8750 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2013(13/25)	A1HS4E		EUR	2.000			% 99,868	1.997.360,00	0,44
1,2500 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2019(19/27)	A2RW4R		EUR	2.000	2.000		% 96,798	1.935.960,00	0,42

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,9500 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2018(25/25)	A2RRU3		EUR	1.000			% 98,990	989.900,00	0,22
2,1250 % ISS Global A/S EO-Med.-Term Notes 2014(14/24)	A1ZS18		EUR	2.339			% 99,715	2.332.333,85	0,51
0,2500 % Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28Y1D		EUR	500			% 97,852	489.260,00	0,11
0,3750 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. EO-Notes 2020(20/27)	A282G6		EUR	500			% 93,115	465.575,00	0,10
1,5000 % JPMorgan Chase & Co. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	JPM5J6		EUR	4.000			% 97,871	3.914.840,00	0,85
0,5000 % Koninklijke Philips N.V. EO-Notes 2019(19/26)	A2R2K7		EUR	1.000			% 96,420	964.200,00	0,21
0,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2027)	A2DAR6		EUR	10.000	10.000		% 96,100	9.610.000,00	2,10
0,0100 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.19(27)	A2TED0		EUR	10.000	10.000		% 94,460	9.446.000,00	2,06
4,3480 % Lb.Hessen-Thüringen GZ FLR-MTN IHS S. H370 v.23(26)	HLB2QZ		EUR	6.800			% 100,060	6.804.080,00	1,48
0,1250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24)	HLB2P2		EUR	1.800			% 99,540	1.791.720,00	0,39
0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H344 v.20(25)	HLB2P7		EUR	10.000			% 98,180	9.818.000,00	2,14
2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27)	HLB2QJ		EUR	1.000			% 99,235	992.350,00	0,22
0,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF Ser.H296 v.17(27)	HLB13E		EUR	3.600	3.600		% 96,065	3.458.340,00	0,75
2,1000 % Litauen, Republik EO-Bonds 2014(24)	A1VJHK		EUR	500			% 99,874	499.370,00	0,11
2,3000 % Litauen, Republik EO-Bonds 2022(27)	A3K7M9		EUR	5.000	5.000		% 97,895	4.894.774,45	1,07
0,2500 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28WWK		EUR	250			% 98,010	245.025,00	0,05
1,0730 % mBank Hipoteczny S.A. EO-Med.-T.Hyp.-Pf.-Br.2018(25)	A19ZWS		EUR	1.000			% 99,090	990.900,00	0,22
0,2420 % mBank Hipoteczny S.A. EO-Med.-T.Hyp.-Pf.-Br.2019(25)	A2R902		EUR	1.200			% 97,464	1.169.568,00	0,26
1,1250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-Non-Preferred MTN 2020(25)	A28SHV		EUR	500			% 98,794	493.970,00	0,11
0,0000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/25)	A28292		EUR	2.000			% 96,988	1.939.760,00	0,42
2,1030 % Morgan Stanley EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/26)	MS0G49		EUR	3.000	3.000		% 99,310	2.979.300,00	0,65
0,8750 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1794 v.18(25)	MHB60L		EUR	1.000			% 97,410	974.100,00	0,21
3,2627 % National Australia Bank Ltd. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Bds 23(26)	A3LDG5		EUR	4.500			% 100,977	4.543.965,00	0,99
0,0100 % National Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(26)	A3KWU5		EUR	3.000			% 95,230	2.856.900,00	0,62
0,4100 % National Grid North Amer. Inc. EO-Med.-Term Nts 2022(22/26)	A3K1DM		EUR	1.000			% 96,700	967.000,00	0,21
0,1250 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KSMY		EUR	2.000			% 95,704	1.914.080,00	0,42
0,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2020(25/25)	A285PB		EUR	3.000			% 97,000	2.910.000,00	0,63
0,0500 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 20(25)	A28SJM		EUR	2.500	1.000		% 98,884	2.472.100,00	0,54

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,5000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Inh.-Schv. v.2015(2026)	NLB854		EUR	6.000			% 97,140	5.828.400,00	1,27
3,6250 % Nordea Bank Abp EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	A3LDX3		EUR	3.500			% 99,960	3.498.600,00	0,76
0,1250 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2019(27)	A2R3NS		EUR	1.000	1.000		% 93,960	939.600,00	0,20
3,5000 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(26)	A3LMEO		EUR	1.200			% 101,960	1.223.520,00	0,27
3,6250 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LEU1		EUR	10.000			% 100,810	10.081.000,00	2,20
1,0000 % Sanofi S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(18/26)	A19X5L		EUR	400			% 97,720	390.880,00	0,09
0,1250 % SID Banka d.d. EO-Bonds 2020(25)	A28ZG3		EUR	3.000			% 97,282	2.918.461,30	0,64
3,7500 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/26)	A3LG7V		EUR	2.400			% 101,940	2.446.560,00	0,53
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LHVU		EUR	10.000			% 100,670	10.067.000,00	2,20
3,2500 % Slovenská Sporitelna AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 23(26)	A3LDG4		EUR	3.000			% 100,040	3.001.200,00	0,65
0,8750 % Snam S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	A187QC		EUR	3.000	3.000		% 96,280	2.888.400,00	0,63
4,2500 % Société Générale S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(26)	A3LNZA		EUR	2.000	2.000		% 102,656	2.053.118,00	0,45
1,1250 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	A19U5Y		EUR	1.000			% 99,301	993.005,00	0,22
0,5000 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2019(26)	A2RXRU		EUR	5.000			% 97,280	4.864.000,00	1,06
3,1250 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LSCD		EUR	6.000	1.000		% 100,750	6.045.000,00	1,32
4,6250 % Swedbank AB EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	A3LH56		EUR	1.019			% 100,800	1.027.152,00	0,22
1,3750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2018(18/28)	A191EK		EUR	3.000	3.000		% 94,900	2.847.000,00	0,62
2,1250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	A3K48Y		EUR	1.000	1.000		% 96,075	960.750,00	0,21
4,6640 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	A287LY		EUR	2.500			% 100,201	2.505.025,00	0,55
1,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/25)	A190KM		EUR	3.000			% 98,020	2.940.600,00	0,64
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	A28VTN		EUR	500			% 99,280	496.400,00	0,11
2,8750 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2024(28)	A3LS1T		EUR	4.000		3.000	% 100,957	4.038.280,00	0,88
3,6250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(26)	A3LD5L		EUR	4.700			% 100,580	4.727.260,00	1,03
2,2000 % Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 2016(26)	A18YCQ		EUR	2.000			% 99,459	1.989.180,00	0,43
1,7500 % Vonovia SE EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	A19B8E		EUR	1.000	1.000		% 97,370	973.700,00	0,21
0,2500 % Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2019(26)	A2R1LF		EUR	2.300			% 96,270	2.214.210,00	0,48
Commerzbank AG 0-Kp-LI-Anl.T.46v.96(20.11.26)	181578		ITL	16.910.000			% 92,389	8.068.595,75	1,76

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,7500 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2015(25)	A1VJX6		NOK	52.000			% 98,834	4.372.057,59	0,95
5,0000 % Citigroup Glob.Mkts Hldgs Inc. DL-FLR Med.-Term Nts 2016(26)	A1V2CV		USD	1.200			% 99,561	1.070.502,50	0,23
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>56.092.189,13</b>	<b>12,24</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,1000 % Allianz Banque S.A. EO-Bons Moy.T.Nég. 2021(25)	A1V76J		EUR	5.000			% 96,659	4.832.950,00	1,05
2,0080 % ASIF III (Jersey) Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 2004(24)	A0D3W6		EUR	15.000			% 98,725	14.808.750,00	3,23
0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	A255C2		EUR	2.000			% 98,152	1.963.040,00	0,43
0,2000 % Deutsche Bank AG Festzinsanl. v.2020(2026)	DL8Y3N		EUR	5.000			% 96,082	4.804.100,00	1,05
1,4230 % Deutsche Bank AG FLR-Notes v.2016(2026)	DB1ZDT		EUR	2.000			% 96,581	1.931.620,00	0,42
4,5000 % Landesbank Berlin AG IHS S.568 v.23(26)	A162BJ		EUR	7.300	1.500		% 101,651	7.420.523,00	1,62
3,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr.Anleihe v.15(25)	HLB2DM		EUR	500			% 97,509	487.544,50	0,11
3,2500 % Naturgy Finance Iberia S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/30)	A3L3XH		EUR	1.300	1.300		% 100,029	1.300.377,00	0,28
0,5000 % Ontario Teachers Finance Trust EO-Notes 2020(25) Reg.S	A28WUY		EUR	800			% 98,524	788.192,00	0,17
0,0000 % Thermo Fisher Scient.(Fin.)BV EO-Notes 2021(21/25)	A3KY3D		EUR	5.000			% 96,823	4.841.150,00	1,06
1,3750 % Tyco International Fin. S.A. EO-Notes 2015(15/25)	A1ZXLQ		EUR	7.805			% 98,705	7.703.925,25	1,68
0,6000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(25/26)	A3KL4S		EUR	2.500			% 95,283	2.382.075,00	0,52
UBS Finance (Curaçao) N.V. LI-Zero-Bonds 1997(27)	135414		ITL	6.000.000			% 91,261	2.827.942,38	0,62
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>18.312.264,53</b>	<b>3,99</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
2,8750 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2014(24)	A1ZRT1		EUR	2.400			% 99,869	2.396.856,00	0,52
3,8500 % Communauté française Belgique EO-Medium-Term Notes 2012(24)	A1UB2S		EUR	750			% 99,960	749.700,00	0,16
0,0000 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(23)	A3KXKH		EUR	6.000			% 30,000	1.800.000,00	0,39
0,0000 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(24)	A288KE		EUR	9.000			% 30,000	2.700.000,00	0,59
5,1250 % BPCE S.A. DL-Preferred MTN 23(28) Reg.S	A3LC5T		USD	5.000			% 101,800	4.560.727,57	0,99
6,9309 % Deutsche Bank AG FLR-DL- MTN 18(25)	A2LQFZ		USD	6.800			% 100,198	6.104.980,96	1,33
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>449.983.130,10</b>	<b>98,16</b>

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Derivate</b>							EUR	-26.156,48	-0,01
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Zins-Derivate</b>							EUR	429.250,00	0,09
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
Euro Schatz Future 06.12.24		185	EUR	85.000				429.250,00	0,09
<b>Devisen-Derivate</b>							EUR	20.422,56	0,00
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>									
<b>Offene Positionen</b>									
USD/EUR 15,0 Mio.		OTC						20.422,56	0,00
<b>Swaps</b>							EUR	-475.829,04	-0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Credit Default Swaps</b>									
<b>Protection Seller</b>									
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	2.100				38.874,20	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.000				18.511,52	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	2.200				40.725,35	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	2.000				37.023,05	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	1.700				31.469,59	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	2.300				42.576,50	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	500				9.255,76	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.600				29.618,44	0,01
<b>Protection Buyer</b>									
iTraxx Europe Crossover Ser.39 Index (5 Year) 5% 20.03.2023/20.06.2028 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	5.000				-475.829,03	-0,10
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	400				-7.404,61	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	1.000				-18.511,52	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	1.500				-27.767,29	-0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	2.600				-48.129,96	-0,01

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	100				-1.851,15	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.100				-20.362,68	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.500				-27.767,29	-0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.900				-35.171,89	-0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	3.300				-61.088,03	-0,01
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>4.036.732,58</b>	<b>0,88</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>4.036.732,58</b>	<b>0,88</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	1.461.094,67			% 100,000	1.461.094,67	0,32
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
			NOK	3.575.919,86			% 100,000	304.204,16	0,07
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
			GBP	66.572,85			% 100,000	80.010,64	0,02
			JPY	20.691.421,00			% 100,000	129.613,17	0,03
			USD	2.301.082,98			% 100,000	2.061.809,94	0,45
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>4.589.342,23</b>	<b>1,00</b>
Zinsansprüche			EUR	4.589.342,23				4.589.342,23	1,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten *)</b>							<b>EUR</b>	<b>-159.956,04</b>	<b>-0,03</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>458.423.092,39</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>
<b>LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I</b>									
Fondsvermögen							EUR	310.155.132,92	67,66
Anteilwert							EUR	100,15	
Umlaufende Anteile							STK	3.097.032	
<b>LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R</b>									
Fondsvermögen							EUR	148.267.959,47	32,34
Anteilwert							EUR	39,64	
Umlaufende Anteile							STK	3.739.960	

\*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Kreditzinsverbindlichkeiten, Kostenpauschale

## Fußnoten:

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

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.09.2024		
Britische Pfund	(GBP)	0,8320500	=	1 Euro (EUR)
Italienische Lire	(ITL)	1936,2700000	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	159,6398000	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	11,7550000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,1160500	=	1 Euro (EUR)

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

185                      Eurex Deutschland

#### c) OTC

Over-the-Counter



## 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>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
3,5000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2024(32)	A3LXSL	EUR	4.000	4.000	
3,6500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LTE9	EUR		1.000	
3,0000 % Crelan Home Loan SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2022(26)	A3LAW1	EUR	12.900	12.900	
3,2000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2024(24/31)	A3L1ZL	EUR	800	800	
0,5000 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref.MTN 19(24/25)	A2R6X4	EUR		3.000	
3,2500 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-IHS S.A-164 v.24(29)	DK0YUX	EUR		3.000	
3,0000 % Deutsche Kreditbank AG Öff.Pfdbr. v.2024(2030)	DKB053	EUR	6.800	6.800	
3,3750 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2024(39)	A3LZ0X	EUR	5.000	5.000	
3,3750 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2024(54)	A3K4EY	EUR	24.500	24.500	
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2017(39)	A19CGY	EUR	25.000	25.000	
3,5000 % Frankreich EO-OAT 2023(33)	A3LPJ7	EUR	31.250	31.250	
2,7500 % Frankreich EO-OAT 2024(30)	A3LXWA	EUR	35.000	35.000	
3,0000 % Frankreich EO-OAT 2024(34)	A3LZW4	EUR	56.250	56.250	
1,7500 % Goldman Sachs Internatl EO-Medium-Term Nts 2015(24)	A162WX	EUR		347	
1,3750 % Johnson Controls Internat. PLC EO-Notes 2016(17/25)	A19BCD	EUR		4.000	
3,4000 % Junta de Andalucía EO-Obl. 2024(34)	A3LV5N	EUR		3.000	
3,0000 % Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(32)	A3L3RM	EUR	1.100	1.100	
3,5000 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LUD5	EUR		5.100	
6,2500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Nachr.DL-IHS.S.1748 v.14(24)	NLB8B3	USD		5.200	
3,0000 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2024(34)	A3LXDB	EUR	1.000	1.000	
2,2500 % Portugal, Republik EO-Obr. 2018(34)	A19ZEK	EUR	25.000	25.000	
3,6250 % Portugal, Republik EO-Obr. 2024(54)	A3LZCG	EUR	13.500	13.500	
3,0000 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2024(24/34)	A3LSOM	EUR		3.000	
1,2500 % Santander UK PLC EO-Med.-T.Cov. Bds 2014(24)	A1ZPYK	EUR		2.000	
3,0000 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2024(34)	A3LSYX	EUR		1.400	
2,5000 % Spanien EO-Bonos 2024(27)	A3LSVG	EUR	10.000	10.000	
4,1250 % V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/26)	A3LEVVM	EUR	1.000	1.000	
0,2500 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/28)	A3MP4U	EUR		500	
3,2500 % Zypern, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(31)	A3LOB8	EUR	2.700	2.700	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

**Verzinsliche Wertpapiere**

3,0000 % Knorr-Bremse AG MTN v.2024(2029/2029)	A383RX	EUR	800	800	
--	--------	-----	-----	-----	--

**Nicht notierte Wertpapiere**

**Verzinsliche Wertpapiere**

0,3750 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 278 v.19(24)	A2E4CQ	EUR		6.000	
0,8750 % Bco di Desio e della Brianza EO-Mortg.Cov. MTN 2017(24)	A19NVU	EUR		2.750	
0,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 19(24/25)	PB1K6Q	EUR		1.200	
0,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.939 v.19(24)	CZ45VB	EUR		1.000	
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	GRN001	EUR		15.000	
2,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2024/2024)	A3E5X5	EUR		2.000	
0,3750 % Erste Group Bank AG EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24)	EB0JJN	EUR		1.500	
3,2500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(24) Cl.X 144A	A2R744	USD		2.000	
1,1250 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2016(16/24)	A18YPL	EUR		1.000	
0,2500 % RaiffeisenL.Niederöst.-Wien AG EO-Preferred MTN 2019(24)	A2R88P	EUR		1.500	
1,5000 % Société Générale S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(24/25)	A3K535	EUR		2.500	
0,8500 % U.S. Bancorp EO-Med.-Term Nts 2017(24)	A19JLL	EUR		3.100	
1,2500 % UBS Group AG EO-FLR Notes 2018(24/25)	A19ZCD	EUR		5.000	

## 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>Schuldscheindarlehen</b>					
5,6550 % Generalitat de Catalunya SSD EUR 09/24	ODE00109	EUR		11.000	
3,9280 % Metropolitan de Lisboa SSD EUR 04/24	ODE00074	EUR		5.000	

**Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)**

### Terminkontrakte

#### Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BUND, EURO-SCHATZ)

EUR

458.946,75

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN)

EUR

56.683,35

#### Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:

USD/EUR

EUR

27.688

#### Devisenterminkontrakte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin:

USD/EUR

EUR

39.870

### Optionsrechte

#### Optionsrechte auf Zins-Derivate

#### Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): Euro Bund Future 06.09.24)

EUR

105,73

## Übersicht Anteilklassen

Anteilklasse	Ertrags- verwendung	Ausgabeaufschlag in %		Verwaltungsvergütung in % p. a.		Mindest- anlage- summe EUR	Fonds- währung
		Bis-zu- Satz	tatsächl. Satz	Bis-zu- Satz	tatsächl. Satz		
Anteilklasse I	ausschüttend	3,00	---	1,20	0,20	50.000	EUR
Anteilklasse R	ausschüttend	3,00	0,50	1,20	0,50	---	EUR

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

#### LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I

<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>100,15</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>3.097.032</b>

#### LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R

<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>39,64</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>3.739.960</b>

### 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







# LB≡BW Asset Management

## LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 100351  
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)