

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



---

LBBW Pro-Fund Credit I

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 31. MÄRZ 2024

---

VERWAHRSTELLE:



ASSET MANAGEMENT:



# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensübersicht zum 31.03.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>54.061.798,27</b>	<b>104,96</b>
1. Anleihen	39.434.604,00	76,56
< 1 Jahr	33.021.792,00	64,11
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	6.412.812,00	12,45
2. Investmentanteile EUR	2.187.271,50 2.187.271,50	4,25 4,25
3. Derivate	2.471.235,89	4,80
4. Bankguthaben	1.997.097,96	3,88
5. Sonstige Vermögensgegenstände	7.971.588,92	15,48
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-2.554.195,40</b>	<b>-4,96</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>51.507.602,87</b>	<b>100,00</b>

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>41.621.875,50</b>	<b>80,81</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>37.463.404,00</b>	<b>72,73</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>37.463.404,00</b>	<b>72,73</b>
0,6250 % ASB Bank Ltd. EO-Med.T. Mtg Cov. Nts 17(24)	XS1699732704		EUR	1.500	0	0 %	98,260	1.473.900,00	2,86
0,6250 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2016(24)	ES0413860547		EUR	1.000	0	0 %	99,379	993.790,00	1,93
4,4820 % Bayerische Landesbank FLR-MTN-Inh. Schw. v.24(26)	DE000BLB9V03		EUR	1.300	1.300	0 %	99,868	1.298.284,00	2,52
1,6250 % Berlin, Land Landessch.v.2014(2024)Ausz.435	DE000A11QEJ1		EUR	1.000	0	0 %	99,630	996.300,00	1,93
4,1280 % BMW Finance N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	XS2649033359		EUR	1.000	0	0 %	100,106	1.001.060,00	1,94
0,5000 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 17(24)	BE0002274430		EUR	600	600	0 %	98,415	590.490,00	1,15
0,3750 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(24)	FR0013238797		EUR	900	200	0 %	98,971	890.739,00	1,73
0,5000 % BNZ International Funding Ltd. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2017(24)	XS1639238820		EUR	1.000	0	0 %	99,152	991.520,00	1,92
2,3750 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2014(14/24)	XS1112850125		EUR	500	500	0 %	99,275	496.375,00	0,96
1,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(24)	FR0011993518		EUR	600	0	0 %	99,515	597.090,00	1,16
1,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2015(25)	XS1166201035		EUR	1.000	0	0 %	98,128	981.280,00	1,91
0,0500 % Commerzbank AG MTH S.P15 v.16(24)	DE000CZ40LM6		EUR	800	800	0 %	98,984	791.872,00	1,54
4,0000 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2010(25)	FR0010920900		EUR	1.000	1.000	0 %	100,714	1.007.140,00	1,96
0,3750 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(24)	FR0013263951		EUR	1.000	0	0 %	98,356	983.560,00	1,91
0,0100 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2019(24)	XS2052503872		EUR	1.500	500	0 %	98,227	1.473.405,00	2,86
0,0500 % Deutsche Bank AG Struct.Cov.Bond v.2019(2024)	DE000DL19U15		EUR	1.100	0	0 %	97,670	1.074.370,00	2,09
0,3750 % DNB Boligkreditt A.S. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(24)	XS1719108463		EUR	1.500	1.500	0 %	97,934	1.469.010,00	2,85
4,4780 % Federat.caisses Desjard Quebec EO-FLR Med.-Term Nts 2024(26)	XS2742659738		EUR	1.000	1.000	0 %	100,476	1.004.760,00	1,95
2,8750 % Federat.caisses Desjard Quebec EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(24)	XS2560673662		EUR	500	0	0 %	99,426	497.130,00	0,97
0,3750 % Hamburger Sparkasse AG Pfandbr.Ausz.33 v.2017(2024)	DE000A2DAFL4		EUR	500	0	0 %	99,517	497.585,00	0,97
4,3420 % HSBC Bank PLC EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	XS2595829388		EUR	1.500	1.500	0 %	100,262	1.503.930,00	2,92
0,8750 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2019(19/25)	XS1944456109		EUR	1.000	1.000	0 %	97,733	977.330,00	1,90
0,6500 % Johnson & Johnson EO-Notes 2016(16/24)	XS1411535799		EUR	1.000	1.000	0 %	99,594	995.940,00	1,93
4,2870 % KBC IFIMA S.A. EO-FLR Med.-Term Nts 2024(26)	XS2775174340		EUR	600	600	0 %	100,063	600.378,00	1,17
2,7500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(24)R.832	DE000LB381U7		EUR	800	1.300	500 %	99,510	796.080,00	1,55
0,5000 % Leeds Building Society EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	XS1640668353		EUR	1.500	500	0 %	99,148	1.487.220,00	2,89
3,8930 % Münchener Hypothekenbank FLR-MTN HPF R.2035 v.23(25)	DE000MHB4875		EUR	1.000	1.000	0 %	99,927	999.270,00	1,94
0,7500 % National Bank of Canada EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	XS1790961962		EUR	600	0	0 %	97,375	584.250,00	1,13
0,5000 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	NL0012650477		EUR	1.400	500	0 %	98,285	1.375.990,00	2,67
0,0500 % Nationwide Building Society EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2019(24)	XS2004366287		EUR	500	0	0 %	99,351	496.755,00	0,96

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,5000 % OMV AG EO-Medium-Term Notes 2020(24)	XS2154347293		EUR	1.000	1.000	0 %	99,959	999.590,00	1,94
0,1250 % OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(24)	XS2197342129		EUR	500	0	0 %	99,071	495.355,00	0,96
0,0100 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2021 (2024)	DE000RLP1304		EUR	1.000	0	0 %	99,417	994.170,00	1,93
0,5000 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	XS1748479919		EUR	1.200	400	0 %	97,542	1.170.504,00	2,27
4,1580 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	XS2733106657		EUR	500	500	0 %	100,384	501.920,00	0,97
0,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Cov.Med.-Term Nts 2017(24)	XS1633824823		EUR	1.000	0	0 %	99,243	992.430,00	1,93
0,5000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2017(24)	XS1588284056		EUR	1.000	0	0 %	100,000	1.000.000,00	1,94
1,5000 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG Med.Term Notes v.19(24)	XS1972548231		EUR	1.000	1.000	0 %	98,763	987.630,00	1,92
0,1250 % Yorkshire Building Society EO-Med.-Term Cov. Bds 2019(24)	XS1991186500		EUR	1.400	0	0 %	99,643	1.395.002,00	2,71
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.971.200,00</b>	<b>3,83</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.971.200,00</b>	<b>3,83</b>
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/09 f.21.08.24	DE000BU0E089		EUR	1.500	1.500	0 %	98,602	1.479.030,00	2,87
Frankreich EO-Treasury Bills 2023(24)	FR0127921338		EUR	500	500	0 %	98,434	492.170,00	0,96
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>2.187.271,50</b>	<b>4,25</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>2.187.271,50</b>	<b>4,25</b>
LBBW Absolute Return Strateg.1 Inhaber-Anteile	DE000A1H7227		ANT	22.038	0	0 EUR	99,250	2.187.271,50	4,25
<b>Summe Wertpapiervermögen 2)</b>							<b>EUR</b>	<b>41.621.875,50</b>	<b>80,81</b>

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>2.471.235,89</b>	<b>4,80</b>	
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)										
<b>Optionsrechte</b>							<b>EUR</b>	<b>-381.166,30</b>	<b>-0,74</b>	
<b>Optionsrechte auf Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>-381.166,30</b>	<b>-0,74</b>	
CDSPaySw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	46600000		EUR	0,022	10.442,13	0,02
CDSPaySw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR60		@01	EUR	Anzahl	37200000		EUR	0,013	4.937,18	0,01
CDSPaySw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR75		@01	EUR	Anzahl	30400000		EUR	0,003	835,70	0,00
CDSPaySw/Prt BuyiTraxx Eur. S41 5Y19.06.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	30400000		EUR	0,076	23.135,92	0,04
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR57,5		@01	EUR	Anzahl	-22500000		EUR	0,059	-13.280,63	-0,03
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR60		@01	EUR	Anzahl	-23300000		EUR	0,046	-10.720,56	-0,02
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR72,5		@01	EUR	Anzahl	-10400000		EUR	0,021	-2.132,83	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR72,5		@01	EUR	Anzahl	-6800000		EUR	0,021	-1.394,54	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR72,5		@01	EUR	Anzahl	-2900000		EUR	0,021	-594,73	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR72,5		@01	EUR	Anzahl	-8600000		EUR	0,021	-1.763,69	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR72,5		@01	EUR	Anzahl	-3400000		EUR	0,021	-697,27	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR57,5		@01	EUR	Anzahl	-22500000		EUR	0,022	-4.931,55	-0,01
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR65		@01	EUR	Anzahl	-37200000		EUR	0,004	-1.629,73	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR65		@01	EUR	Anzahl	-15200000		EUR	0,004	-665,91	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	-2900000		EUR	0,003	-88,65	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	-3400000		EUR	0,003	-103,94	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	-10400000		EUR	0,003	-317,93	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	-6800000		EUR	0,003	-207,88	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR70		@01	EUR	Anzahl	-8600000		EUR	0,003	-262,90	0,00
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S40 5Y19.06.24EUR77,5		@01	EUR	Anzahl	-22500000		EUR	0,040	-8.919,90	-0,02
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S41 5Y17.04.24EUR60		@01	EUR	Anzahl	-32100000		EUR	0,031	-9.887,44	-0,02
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S41 5Y19.06.24EUR60		@01	EUR	Anzahl	-15200000		EUR	0,150	-22.761,54	-0,04
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S41 5Y19.06.24EUR65		@01	EUR	Anzahl	-16000000		EUR	0,101	-16.229,12	-0,03
CDSPaySw/Prt SelliTraxx Eur. S41 5Y19.06.24EUR65		@01	EUR	Anzahl	-16000000		EUR	0,101	-16.229,12	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR50		@01	EUR	Anzahl	-12300000		EUR	0,069	-8.548,25	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR50		@01	EUR	Anzahl	-24900000		EUR	0,069	-17.305,00	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR50		@01	EUR	Anzahl	-11500000		EUR	0,069	-7.992,27	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR50		@01	EUR	Anzahl	-17300000		EUR	0,069	-12.023,15	-0,02

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y15.05.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -15000000		EUR 0,069	-10.424,70	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -17300000		EUR 0,042	-7.190,57	-0,01
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -11500000		EUR 0,042	-4.779,86	-0,01
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -15000000		EUR 0,042	-6.234,60	-0,01
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -24900000		EUR 0,042	-10.349,44	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y17.04.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -12300000		EUR 0,042	-5.112,37	-0,01
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y19.06.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -17300000		EUR 0,092	-15.892,13	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y19.06.24EUR50		@01	EUR	Anzahl -11500000		EUR 0,092	-10.564,13	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyiTraxx Eur. S40 5Y19.06.24EUR52,5		@01	EUR	Anzahl -27300000		EUR 0,142	-38.746,34	-0,08
CDSPaySw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD67,5		@02	USD	Anzahl 33000000		USD 0,007	2.224,96	0,00
CDSPaySw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD57,5		@02	USD	Anzahl 26400000		USD 0,003	835,10	0,00
CDSPaySw/Prt BuyCDX NA IG S42 5Y17.04.24USD60		@02	USD	Anzahl 26400000		USD 0,012	2.813,08	0,01
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD57,5		@02	USD	Anzahl -16500000		USD 0,026	-3.995,05	-0,01
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD70		@02	USD	Anzahl -4100000		USD 0,006	-209,42	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD70		@02	USD	Anzahl -12200000		USD 0,006	-623,16	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD70		@02	USD	Anzahl -11300000		USD 0,006	-577,19	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD55		@02	USD	Anzahl -27600000		USD 0,008	-1.954,93	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD57,5		@02	USD	Anzahl -24500000		USD 0,003	-775,00	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD62,5		@02	USD	Anzahl -26400000		USD 0,001	-146,19	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD62,5		@02	USD	Anzahl -24500000		USD 0,001	-135,67	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD67,5		@02	USD	Anzahl -4100000		USD 0,000	-4,48	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD67,5		@02	USD	Anzahl -12200000		USD 0,000	-13,33	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD67,5		@02	USD	Anzahl -11300000		USD 0,000	-12,35	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S42 5Y15.05.24USD60		@02	USD	Anzahl -24500000		USD 0,048	-10.862,22	-0,02
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S42 5Y15.05.24USD60		@02	USD	Anzahl -13800000		USD 0,048	-6.113,20	-0,01
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S42 5Y15.05.24USD60		@02	USD	Anzahl -24500000		USD 0,048	-10.862,22	-0,02
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S42 5Y17.04.24USD65		@02	USD	Anzahl -26400000		USD 0,003	-649,06	0,00
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S42 5Y20.06.24USD60		@02	USD	Anzahl -13800000		USD 0,100	-12.749,19	-0,02
CDSPaySw/Prt SellCDX NA IG S42 5Y20.06.24USD60		@02	USD	Anzahl -13800000		USD 0,100	-12.742,54	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD47,5		@02	USD	Anzahl -19900000		USD 0,092	-16.873,08	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y15.05.24USD47,5		@02	USD	Anzahl -18300000		USD 0,092	-15.516,45	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD47,5		@02	USD	Anzahl -19900000		USD 0,075	-13.810,22	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y17.04.24USD47,5		@02	USD	Anzahl -18300000		USD 0,075	-12.699,85	-0,02
CDSRecSw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y20.06.24USD47,5		@02	USD	Anzahl -18300000		USD 0,105	-17.764,84	-0,03
CDSRecSw/Prt BuyCDX NA IG S41 5Y20.06.24USD47,5		@02	USD	Anzahl -19900000		USD 0,105	-19.318,06	-0,04

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>2.852.402,19</b>	<b>5,54</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsswaps</b>							<b>EUR</b>	<b>624,51</b>	<b>0,00</b>
SWAP 3.0300% FIX / 07.06.2023/07.06.2028		OTC	EUR	1.600.000				-22.420,13	-0,04
SWAP 3.0400% FIX / 07.06.2023/07.06.2028		OTC	EUR	1.600.000				23.044,64	0,04
<b>Credit Default Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>2.851.777,68</b>	<b>5,54</b>
<b>Protection Seller</b>							<b>EUR</b>	<b>12.855.850,97</b>	<b>24,96</b>
iTraxx Europe Series 41 Index (5 Year) 20.03.2024/20.06.2029		OTC	EUR	11.200.000				246.949,87	0,48
iTraxx Europe Series 41 Index (5 Year) 20.03.2024/20.06.2029		OTC	EUR	21.800.000				480.670,27	0,93
iTraxx Europe Series 41 Index (5 Year) 20.03.2024/20.06.2029		OTC	EUR	16.600.000				366.014,98	0,71
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	EUR	7.100.000				153.680,06	0,30
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	EUR	14.400.000				311.689,16	0,61
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.03.2024/20.12.2033		OTC	EUR	6.500.000				37.290,13	0,07
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.03.2024/20.12.2033		OTC	EUR	14.600.000				83.759,38	0,16
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.03.2024/20.12.2033		OTC	EUR	13.200.000				75.727,65	0,15
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.600.000				251.082,94	0,49
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	EUR	31.200.000				675.326,52	1,31
iTraxx Europe Series 40 Index (3 Year) 20.12.2023/20.12.2026		OTC	EUR	10.600.000				200.608,72	0,39
iTraxx Europe Series 40 Index (3 Year) 20.12.2023/20.12.2026		OTC	EUR	25.670.000				485.813,76	0,94
iTraxx Europe Series 40 Index (3 Year) 20.12.2023/20.12.2026		OTC	EUR	10.600.000				200.608,72	0,39
iTraxx Europe Series 40 Index (3 Year) 20.12.2023/20.12.2026		OTC	EUR	10.600.000				200.608,72	0,39
iTraxx Europe Series 40 Index (3 Year) 20.12.2023/20.12.2026		OTC	EUR	12.830.000				242.812,25	0,47
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	7.200.000				155.844,58	0,30
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.800.000				147.186,55	0,29
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	13.700.000				296.537,61	0,58
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	9.400.000				203.463,76	0,40
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	12.800.000				277.057,03	0,54
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.100.000				240.260,40	0,47
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	7.400.000				160.173,60	0,31
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.500.000				248.918,43	0,48
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	9.200.000				199.134,74	0,39

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.600.000			251.082,94	0,49
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	5.100.000			110.389,91	0,21
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	9.700.000			209.957,28	0,41
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	14.500.000			313.853,67	0,61
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.800.000			147.186,55	0,29
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	9.600.000			207.792,78	0,40
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	10.700.000			231.602,36	0,45
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	4.700.000			101.731,88	0,20
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	8.300.000			179.654,17	0,35
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	19.200.000			415.585,55	0,81
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.800.000			147.186,55	0,29
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	22.600.000			489.178,82	0,95
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	13.500.000			292.208,59	0,57
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	10.000.000			216.450,81	0,42
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	8.900.000			192.641,22	0,37
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	7.600.000			164.502,61	0,32
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	8.800.000			190.476,71	0,37
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	9.600.000			207.792,78	0,40
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	18.200.000			393.940,47	0,76
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	10.400.000			225.108,84	0,44
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.100.000			240.260,40	0,47
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	USD	15.400.000			325.142,09	0,63
CDX NA IG Series 33 Index (5 Years) 20.09.2019/20.12.2024		OTC	USD	10.000			61,48	0,00
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	USD	2.100.000			44.337,56	0,09
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	USD	6.700.000			141.457,92	0,27
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	11.500.000			242.800,91	0,47
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	13.100.000			276.581,91	0,54
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	9.200.000			194.240,73	0,38
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	11.700.000			247.023,53	0,48
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	13.300.000			280.804,53	0,55
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	8.500.000			179.461,54	0,35
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	2.564.000			54.134,05	0,11



# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Protection Buyer</b>						<b>EUR</b>	<b>-10.004.073,29</b>	<b>-19,42</b>
iTraxx Europe Series 41 Index (5 Year) 20.03.2024/20.06.2029		OTC	EUR	5.400.000			-119.065,11	-0,23
iTraxx Europe Series 41 Index (10 Year) 20.03.2024/20.06.2034		OTC	EUR	12.700.000			-66.171,09	-0,13
iTraxx Europe Series 41 Index (10 Year) 20.03.2024/20.06.2034		OTC	EUR	5.900.000			-30.740,90	-0,06
iTraxx Europe Series 41 Index (10 Year) 20.03.2024/20.06.2034		OTC	EUR	14.000.000			-72.944,51	-0,14
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	EUR	11.600.000			-251.082,94	-0,49
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	EUR	18.200.000			-393.940,47	-0,76
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	EUR	8.000.000			-173.160,65	-0,34
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	EUR	23.900.000			-517.317,43	-1,00
iTraxx Europe Series 32 Index (5 Years) 20.09.2019/20.12.2024		OTC	EUR	10.000			-67,41	0,00
iTraxx Europe Series 40 Index (3 Year) 20.09.2023/20.12.2026		OTC	EUR	38.500.000			-728.626,01	-1,41
iTraxx Europe Snr.Finan.Ser.40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.600.000			-218.871,57	-0,42
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	EUR	8.000.000			-173.160,65	-0,34
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.09.2023/20.12.2033		OTC	EUR	4.300.000			-24.668,86	-0,05
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	3.900.000			-84.415,81	-0,16
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	10.500.000			-227.273,35	-0,44
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	17.900.000			-387.446,95	-0,75
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	3.200.000			-69.264,26	-0,13
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	9.600.000			-207.792,78	-0,40
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.900.000			-257.576,46	-0,50
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	17.700.000			-383.117,93	-0,74
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	7.800.000			-168.831,63	-0,33
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	14.400.000			-311.689,16	-0,61
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	8.700.000			-188.312,20	-0,37
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	3.000.000			-64.935,24	-0,13
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.800.000			-147.186,55	-0,29
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	7.900.000			-170.996,14	-0,33
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	15.700.000			-339.827,77	-0,66
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.500.000			-140.693,02	-0,27
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.500.000			-140.693,02	-0,27
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	15.800.000			-341.992,28	-0,66
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.500.000			-140.693,02	-0,27
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	8.100.000			-175.325,15	-0,34
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	10.200.000			-220.779,82	-0,43
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	1.900.000			-41.125,65	-0,08

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.500.000				-248.918,43	-0,48
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	1.900.000				-41.125,65	-0,08
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	10.300.000				-222.944,33	-0,43
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	7.500.000				-162.338,11	-0,32
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.900.000				-257.576,46	-0,50
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	6.400.000				-138.528,52	-0,27
iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	EUR	11.500.000				-248.918,43	-0,48
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.12.2023/20.12.2033		OTC	EUR	2.600.000				-14.916,05	-0,03
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.12.2023/20.12.2033		OTC	EUR	10.300.000				-59.090,52	-0,11
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.12.2023/20.12.2033		OTC	EUR	6.500.000				-37.290,13	-0,07
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.12.2023/20.12.2033		OTC	EUR	10.600.000				-60.811,60	-0,12
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.12.2023/20.12.2033		OTC	EUR	6.200.000				-35.569,05	-0,07
iTraxx Europe Series 40 Index (10 Year) 20.12.2023/20.12.2033		OTC	EUR	3.700.000				-21.226,69	-0,04
CDX NA IG Series 42 Index (5 Years) 20.03.2024/20.06.2029		OTC	USD	5.000.000				-104.454,08	-0,20
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.03.2024/20.12.2028		OTC	USD	7.900.000				-166.793,67	-0,32
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	USD	6.900.000				-145.680,54	-0,28
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.09.2023/20.12.2028		OTC	USD	13.916.000				-293.810,21	-0,57
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	12.600.000				-266.025,34	-0,52
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	7.500.000				-158.348,42	-0,31
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	8.000.000				-168.904,98	-0,33
CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028		OTC	USD	8.100.000				-171.016,29	-0,33

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>1.997.097,96</b>	<b>3,88</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.997.097,96</b>	<b>3,88</b>
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			EUR	1.220.833,95			% 100,000	1.220.833,95	2,37
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>									
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			USD	838.287,50			% 100,000	776.264,01	1,51
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>7.971.588,92</b>	<b>15,48</b>
Zinsansprüche			EUR	391.788,53				391.788,53	0,76
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	2.739.766,40				2.739.766,40	5,32
Sonstige Forderungen			EUR	33,99				33,99	0,00
Forderungen aus Cash Collateral			EUR	4.840.000,00				4.840.000,00	9,40
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-2.227.152,50</b>	<b>-4,32</b>
EUR - Kredite			EUR	-2.227.088,44			% 100,000	-2.227.088,44	-4,32
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Banque Centrale de Compensation - LCH S.A. Paris (G) FR (CCP)			USD	-69,18			% 100,000	-64,06	0,00

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-327.042,90</b>	<b>-0,63</b>
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-173.724,67				-173.724,67	-0,34
Verwaltungsvergütung			EUR	-23.833,33				-23.833,33	-0,05
Verwahrstellenvergütung			EUR	-9.995,46				-9.995,46	-0,02
Lagerstellenkosten			EUR	-7.801,13				-7.801,13	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-10.461,11				-10.461,11	-0,02
Veröffentlichungskosten			EUR	-988,89				-988,89	0,00
Portfoliomanagervergütung			EUR	-100.238,31				-100.238,31	-0,19
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>51.507.602,87</b>	<b>100,00 1)</b>
<b>Anteilwert</b>							EUR	112,21	
<b>Ausgabepreis</b>							EUR	112,21	
<b>Anteile im Umlauf</b>							STK	459.028	

### Fußnoten:

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

2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

USD	(USD)	per 28.03.2024 1,0799000	= 1 EUR (EUR)
-----	-------	-----------------------------	---------------

### Marktschlüssel

#### Terminbörsen

@01	OTC EUR
@02	OTC USD

OTC	Over-the-Counter
-----	------------------

## Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

### 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	ISIN	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>					
0,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(24)	FR0013375797	EUR	0	1.000	
0,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2019(24)	EU000A1G0EC4	EUR	0	1.000	
4,1250 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2007(24)	XS0290050524	EUR	0	500	
5,2500 % Imperial Brands Fin.Neth. B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	XS2586739729	EUR	2.300	2.300	
0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H318 v.18(24)	XS1767931477	EUR	0	1.000	
0,2500 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Pref. Med.-T. Nts 2020(25)	XS2106056653	EUR	500	500	
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/06 f.15.05.24	DE000BU0E055	EUR	0	1.000	
<b>Nichtnotierte Wertpapiere *)</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
2,5000 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2014(24)	XS1014018045	EUR	0	1.300	
0,2500 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	XS1933874387	EUR	0	200	
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	XS1897129950	EUR	0	1.000	
0,3750 % Belfius Bank S.A. EO-M.-T.Mortg.Pandbr. 2018(23)	BE0002620012	EUR	0	1.000	
0,1250 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.17(23) Ser.201	DE000BHY0GH2	EUR	0	500	
3,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2013(23)	XS0997775837	EUR	0	1.100	
2,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1045553812	EUR	1.000	1.000	
1,8750 % Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.191 v.14(24)	DE000A11QJU7	EUR	0	500	
0,3750 % Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.203 v.16(24)	DE000A1680L2	EUR	0	1.000	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.21(23)	DE0001104867	EUR	0	1.000	
3,9000 % Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2011(23)	FR0011133008	EUR	0	1.500	
3,6000 % Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2012(24)	FR0011213453	EUR	0	1.000	
0,5000 % Coventry Building Society EO-Asset Covered MTN 2017(24)	XS1529880368	EUR	0	200	

**Halbjahresbericht  
LBBW Pro-Fund Credit I**

**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	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
0,2500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2016(24)	FR0013219573	EUR	0	500	
0,3750 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2018(23)	XS1909061597	EUR	0	1.000	
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN.v.2019 (2024)	DE000A2LQSP7	EUR	0	1.000	
0,2500 % Niedersachsen, Land Landessch.v.17(24) Ausg.869	DE000A2DAJD3	EUR	0	500	
0,0100 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2022 (2024)	DE000RLP1346	EUR	0	1.000	
0,2500 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	XS1942615607	EUR	0	1.000	
4,4000 % Spanien EO-Bonos 2013(23)	ES00000123X3	EUR	0	2.000	
0,3750 % Swedish Covered Bond Corp.,The EO-Medium-Term Notes 2017(24)	XS1550143421	EUR	0	1.000	

## Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

### 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	ISIN	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

##### Rentenindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): Bloomberg MSCI Euro Corporate SRI Index)

EUR

18.887,70

#### Optionsrechte

##### Optionsrechte auf Swaps

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): PrtBuySwap Bar 15.11.23-20.12.28, PrtBuySwap Bar 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap BNP 17.01.24-20.12.28, PrtBuySwap BNP 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap BNP 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap Cit 15.11.23-20.12.28, PrtBuySwap Cit 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap Deu 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap Deu 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap Gol 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap Gol 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap J.P 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap Mor 21.02.2024-20.12.2028, PrtSellSwap Mor 21.02.2024-20.12.2028)

EUR

291,17

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): PrtBuySwap Bar 15.11.23-20.12.28, PrtBuySwap Bar 17.01.24-20.12.28, PrtBuySwap Bar 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap Bar 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap Bar 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap BNP 17.01.24-20.12.28, PrtBuySwap BNP 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap BNP 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap BNP 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap Bof 15.11.23-20.12.28, PrtBuySwap Bof 17.01.24-20.12.28, PrtBuySwap Bof 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap Bof 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap Bof 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap Cit 15.11.23-20.12.28, PrtBuySwap Cit 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap Gol 17.01.24-20.12.28, PrtBuySwap Gol 20.03.24-20.12.28,

EUR

2.271,51



## Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

### 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	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
<p>, PrtBuySwap Gol 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap J.P 15.11.23-20.12.28, PrtBuySwap J.P 17.01.24-20.12.28, PrtBuySwap J.P 20.03.24-20.12.28, PrtBuySwap J.P 20.12.23-20.12.28, PrtBuySwap J.P 21.02.24-20.12.28, PrtBuySwap Mor 15.11.23-20.12.28, PrtSellSwap Bar 15.11.23-20.12.28, PrtSellSwap Bar 17.01.24-20.12.28, PrtSellSwap Bar 20.12.23-20.12.28, PrtSellSwap BNP 15.11.23-20.12.28, PrtSellSwap BNP 17.01.24-20.12.28, PrtSellSwap BNP 20.03.24-20.12.28, PrtSellSwap BNP 20.12.23-20.12.28, PrtSellSwap BNP 21.02.24-20.12.28, PrtSellSwap Bof 15.05.24-20.12.28, PrtSellSwap Bof 15.11.23-20.12.28, PrtSellSwap Bof 17.01.24-20.12.28, PrtSellSwap Bof 20.03.24-20.12.28, PrtSellSwap Bof 20.12.23-20.12.28, PrtSellSwap Bof 21.02.24-20.12.28, PrtSellSwap Cit 15.11.23-20.12.28, PrtSellSwap Deu 17.01.24-20.12.28, PrtSellSwap Deu 20.03.24-20.12.28, PrtSellSwap Deu 21.02.24-20.12.28, PrtSellSwap Gol 15.11.23-20.12.28, PrtSellSwap Gol 17.01.24-20.12.28, PrtSellSwap Gol 17.04.24-20.12.28, PrtSellSwap Gol 20.03.24-20.12.28, PrtSellSwap Gol 20.12.23-20.12.28, PrtSellSwap Gol 21.02.24-20.12.28, PrtSellSwap J.P 17.01.24-20.12.28, PrtSellSwap J.P 20.03.24-20.12.28, PrtSellSwap J.P 20.12.23-20.12.28, PrtSellSwap J.P 21.02.24-20.12.28, PrtSellSwap Mor 21.02.2024-20.12.2028)</p>					

### Swaps (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)

#### Zinsswaps

(Basiswert(e): Payer Zinsswap 13.11.23/13.11.28, Payer Zinsswap 22.11.23/22.11.28, Payer Zinsswap 23.11.23/23.11.28, Payer Zinsswap 27.11.23/15.02.31, Payer Zinsswap 27.11.23/27.11.28, Payer Zinsswap 30.11.23/30.11.28)	EUR	10.632
(Basiswert(e): Receiver Zinsswap 13.11.23/13.11.28, Receiver Zinsswap 22.11.23/22.11.28, Receiver Zinsswap 23.11.23/23.11.28, Receiver Zinsswap 27.11.23/15.02.31, Receiver Zinsswap 27.11.23/27.11.28, Receiver Zinsswap 30.11.23/30.11.28)	EUR	10.632

## Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

### 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	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

#### Credit Default Swaps

##### Protection Seller

(Basiswert(e): CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.09.2023/20.12.2028, CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.12.2023/20.12.2028, iTraxx Europe Series 39 Index (10 Year) 20.09.2023/20.06.2033, iTraxx Europe Series 39 Index (3 Year) 20.09.2023/20.06.2026, iTraxx Europe Series 39 Index (5 Year) 20.09.2023/20.06.2028, iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028, iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028, iTraxx Europe Snr.Finan.Ser.39 Index (5 Year) 20.09.2023/20.06.2028, iTraxx Europe Snr.Finan.Ser.40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028)		EUR			1.131.345
---	--	-----	--	--	-----------

##### Protection Buyer

(Basiswert(e): CDX NA IG Series 40 Index (5 Years) 20.09.2023/20.06.2028, CDX NA IG Series 41 Index (5 Years) 20.09.2023/20.12.2028, Imperial Brands Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/25) 20.09.2023/20.03.2031, iTraxx Europe Series 39 Index (5 Year) 20.09.2023/20.06.2028, iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028, iTraxx Europe Series 40 Index (5 Year) 20.12.2023/20.12.2028, iTraxx Europe Snr.Finan.Ser.40 Index (5 Year) 20.09.2023/20.12.2028)		EUR			1.044.090
---	--	-----	--	--	-----------

Die Gesellschaft sorgt dafür, dass eine unangemessene Beeinträchtigung von Anlegerinteressen durch Transaktionskosten vermieden wird, indem unter Berücksichtigung der Anlageziele dieses Sondervermögens ein Schwellenwert für die Transaktionskosten bezogen auf das durchschnittliche Fondsvolumen sowie für eine Portfolioumschlagsrate festgelegt wurde. Die Gesellschaft überwacht die Einhaltung der Schwellenwerte und ergreift im Falle des Überschreitens weitere Maßnahmen.

\*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

## Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

### Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	80,81
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	4,80

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	112,21
Ausgabepreis	EUR	112,21
Anteile im Umlauf	STK	459.028

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

#### Bewertung

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

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.

**Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

**Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A**

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

Frankfurt am Main, den 2. April 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH  
Die Geschäftsführung

# Halbjahresbericht LBBW Pro-Fund Credit I

## Kurzübersicht über die Partner

### 1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

#### Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70  
60486 Frankfurt am Main

#### Postanschrift:

Postfach 17 05 48  
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0

Telefax: 069 / 710 43-700

[www.universal-investment.com](http://www.universal-investment.com)

Gründung: 1968

Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–

Eigenmittel: EUR 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

#### Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan

Frank Eggloff, München

Mathias Heiß, Langen

Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe

Axel Vespermann, Dreieich

#### Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin

Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf

Ellen Engelhardt, Glauburg

Daniel Fischer, Bad Vilbel

Janet Zirlwagen, Wehrheim

### 2. Verwahrstelle

The Bank of New York Mellon SA/NV,

Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main

#### Hausanschrift:

Friedrich-Ebert-Anlage 49  
60327 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 12014 1000

Telefax: 069 / 12014 1687

[www.bnymellon.com](http://www.bnymellon.com)

Rechtsform: Zweigniederlassung einer Aktiengesellschaft nach belgischem Recht

Haftendes Eigenkapital: € 3.486 Mio (Stand: 31.12.2020)

### 3. Asset Management-Gesellschaft

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

#### Postanschrift:

Parlser Platz 1, Haus 5

70173 Stuttgart

Telefon (0711) 22910-3000

Telefax (0711) 22910-9098

[www.lbbw-am.de](http://www.lbbw-am.de)

### 4. Anlageausschuss

Dr. Peter Oellers

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH, Stuttgart

Matthias Bruckmeir

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH, Stuttgart

WKN / ISIN: A1CU8C / DE000A1CU8C5