

**LB≡BW Asset Management**

**LBBW Absolute Return Strategie 1**

**Halbjahresbericht zum 31.03.2022**



# Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.03.2022	8
Vermögensaufstellung zum 31.03.2022	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	23
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	26



**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 wesentlichen Anlegerinformationen, 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



Dr. Bernhard Scherer



# LBBW Absolute Return Strategie 1

## Halbjahresbericht zum 31.03.2022

## Vermögensübersicht zum 31.03.2022

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>75.154.398,64</b>	<b>104,27</b>
<b>1. Anleihen</b>	<b>66.209.387,69</b>	<b>91,86</b>
Frankreich	13.186.530,00	18,29
Bundesrep. Deutschland	9.826.595,00	13,63
USA	6.553.730,00	9,09
Norwegen	6.517.625,00	9,04
Canada	5.924.190,69	8,22
Großbritannien	4.017.585,00	5,57
Finnland	3.495.365,00	4,85
Spanien	3.295.754,00	4,57
Italien	3.065.680,00	4,25
Dänemark	3.004.425,00	4,17
Niederlande	3.003.170,00	4,17
Schweden	2.008.800,00	2,79
Schweiz	1.007.900,00	1,40
Australien	1.003.400,00	1,39
Österreich	298.638,00	0,41
<b>2. Derivate</b>	<b>1.131.764,13</b>	<b>1,57</b>
<b>3. Bankguthaben</b>	<b>2.096.829,79</b>	<b>2,91</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>5.716.417,03</b>	<b>7,93</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-3.074.332,64</b>	<b>-4,27</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>72.080.066,00</b>	<b>100,00</b>



# Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>66.209.387,69</b>	<b>91,86</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>66.209.387,69</b>	<b>91,86</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.222 v.2018(2023)	AAR022		EUR	1.500	500		% 100,015	1.500.225,00	2,08
1,1250 % Achmea Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2015(22)	A1Z0JK		EUR	1.000	1.000		% 100,091	1.000.910,00	1,39
0,5500 % American Honda Finance Corp. EO-Med.-Term Nts 2018(18/23) A	A19X06		EUR	1.000			% 100,458	1.004.580,00	1,39
0,3500 % American Honda Finance Corp. EO-Med.-Term Nts 2019(19/22)	A2RYKK		EUR	1.000			% 100,236	1.002.360,00	1,39
2,7500 % AT & T Inc. EO-Notes 2016(16/23)	A18ZJR		EUR	1.000	600		% 103,060	1.030.600,00	1,43
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(22)	A2RUY5		EUR	1.000			% 100,340	1.003.400,00	1,39
0,1770 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2019(2022)	A14JZE		EUR	500			% 100,190	500.950,00	0,69
3,8750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Cédulas Hip. 2013(23)	A1HFAM		EUR	600	600		% 103,285	619.710,00	0,86
0,7500 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(22)	A1Z555		EUR	600			% 100,424	602.544,00	0,84
0,7500 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 15(22)	A1Z6Y8		EUR	1.000			% 100,519	1.005.186,69	1,39
0,2000 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(23)	A19RAG		EUR	1.000			% 100,270	1.002.700,00	1,39
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 16(23)	A18YVW		EUR	1.900	1.000		% 100,476	1.909.044,00	2,65
0,8750 % Bankinter S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(22)	A1Z4T2		EUR	1.000			% 100,380	1.003.800,00	1,39
0,7500 % Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2015(15/23)	A1ZYF0		EUR	500	500		% 100,614	503.070,00	0,70
0,2500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.18(23) Ser.209	BHY015		EUR	1.500	1.500		% 100,306	1.504.590,00	2,09
0,1770 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2024)A.515	A2NB9W		EUR	300			% 101,475	304.425,00	0,42
0,0000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2020(23)	A28RTN		EUR	2.000	2.000		% 100,113	2.002.260,00	2,78
0,3630 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 2017(22)	PB1KTF		EUR	2.000	1.000		% 100,330	2.006.600,00	2,78
3,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2013(23)	A1ZAES		EUR	1.000	1.000		% 104,410	1.044.100,00	1,45
0,2000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2015(23)	A1Z0JL		EUR	2.000	2.000		% 100,261	2.005.220,00	2,78
0,2500 % Canadian Imperial Bk of Comm. EO-Med.-T. Cov.Bonds 2018(23)	A19U8S		EUR	1.000	1.000		% 100,357	1.003.570,00	1,39
0,3250 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2017(23)	A19BN0		EUR	500	500		% 100,155	500.775,00	0,69
0,2500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2018(23)	A19YYX		EUR	1.500	1.500		% 100,325	1.504.875,00	2,09
1,8750 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF EO-Med.Term Obl.Fonc. 2013(23)	A1HLTA		EUR	2.000	2.000		% 102,175	2.043.500,00	2,84
2,5000 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2013(23)	A1HQQB		EUR	1.000	1.000		% 103,295	1.032.950,00	1,43
0,4720 % Credit Suisse AG (Ldn Br.) EO-FLR Med.-Term Nts 2021(23)	A3KVKQ		EUR	1.000	1.000		% 100,790	1.007.900,00	1,40

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,7500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35304 v.19(23)	A2LQNQ		EUR	1.500	500		% 100,370	1.505.550,00	2,09
0,1980 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 2019(22)	A2RWP7		EUR	1.000			% 100,175	1.001.750,00	1,39
0,3750 % DNB Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2018(23)	A2RT9B		EUR	1.000	1.000		% 100,068	1.000.680,00	1,39
0,0000 % Dt.Apotheker- u. Ärztebank FLR-MTN HPF Nts.A.1476 19(22)	A2G808		EUR	1.500			% 100,119	1.501.785,00	2,08
0,3750 % Eika Boligkredit A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2016(23)	A180C8		EUR	1.000	1.000		% 100,473	1.004.730,00	1,39
2,7500 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Medium-Term Notes 2012(23)	A1G89U		EUR	1.500	1.500		% 102,685	1.540.275,00	2,14
0,8750 % Fortum Oyj EO-Medium-Term Nts 2019(19/23)	A2RYDJ		EUR	2.000			% 99,649	1.992.980,00	2,76
0,4570 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-Term Nts 2015(22)F	A1ZU77		EUR	2.000			% 100,246	2.004.920,00	2,78
0,3750 % Hamburg Commercial Bank AG HYPF v.16(23) DIP S.2580	HSH5Y2		EUR	2.000	1.000		% 100,270	2.005.400,00	2,78
0,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2017(22)	A19QN6		EUR	500	500		% 100,490	502.450,00	0,70
5,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2012(22)	A1G83V		EUR	1.500			% 103,422	1.551.330,00	2,15
0,9500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2016(23)	A18Y27		EUR	1.000	500		% 101,190	1.011.900,00	1,40
0,0720 % Jyske Bank A/S EO-FLR Med.-Term Nts 2017(22)	A19SYV		EUR	1.500			% 100,234	1.503.510,00	2,09
0,5000 % La Banq. Postale Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2016(23)	A18WS2		EUR	1.500	500		% 100,549	1.508.235,00	2,09
0,2500 % Lloyds Bank Corporate Markets EO-Medium-Term Notes 2019(22)	A2R8TD		EUR	500			% 100,243	501.215,00	0,70
0,6250 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2015(22)	A1Z6LB		EUR	1.000			% 100,403	1.004.030,00	1,39
0,5000 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	A18ZXQ		EUR	500	500		% 100,490	502.450,00	0,70
1,0000 % Morgan Stanley EO-Medium-Term Notes 2016(22)	MSQGYE		EUR	1.000			% 100,820	1.008.200,00	1,40
0,2500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.461 v.16(23)	DHY461		EUR	1.000	1.000		% 100,367	1.003.670,00	1,39
0,0370 % Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Med.-T.Res.Nts 2017(22)	A19JCQ		EUR	1.500			% 100,061	1.500.915,00	2,08
0,1250 % Oberösterr. Landesbank EO-M.-T.Hyp.Pfandb.2016(23)	A1879X		EUR	300	300		% 99,546	298.638,00	0,41
0,2450 % OP Yrityspankki Oyj EO-FLR Med.-Term Nts 2017(22)	A19JWR		EUR	1.500			% 100,159	1.502.385,00	2,08
4,4000 % Spanien EO-Bonos 2013(23)	A1HK7U		EUR	1.000	1.000		% 106,970	1.069.700,00	1,48
0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	A1917P		EUR	1.500	1.500		% 100,380	1.505.700,00	2,09
0,2500 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2015(22)	A1Z0UQ		EUR	500			% 100,051	500.255,00	0,69
0,1250 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2018(23)	A19271		EUR	1.000	1.000		% 100,244	1.002.440,00	1,39
0,5000 % Sparebanken Vest EO-Medium-Term Notes 2017(22)	A19SSH		EUR	500	500		% 100,414	502.070,00	0,70
0,3750 % Stadshypotek AB EO-Med.-T. Hyp.-Pfandbr.16(23)	A18X5R		EUR	1.000			% 100,455	1.004.550,00	1,39

# Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,4500 % Swedbank Hypotek AB EO-M.-T. Mortg.Cov.Nts 18(23)	A19WR0		EUR	1.000	1.000		% 100,425	1.004.250,00	1,39
0,3750 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2016(23)	A180L4		EUR	500			% 100,428	502.140,00	0,70
0,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2018(23)	A19XNA		EUR	500			% 100,310	501.550,00	0,70
0,7500 % Yorkshire Building Society EO-Med.-Term Cov. Bds 2015(22)	A1Z92S		EUR	1.000	1.000		% 100,610	1.006.100,00	1,40
0,3750 % Yorkshire Building Society EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(23)	A19FYA		EUR	1.000	500		% 100,379	1.003.790,00	1,39
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>66.209.387,69</b>	<b>91,86</b>
<b>Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>1.131.764,13</b>	<b>1,57</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
<b>Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>2.824.653,82</b>	<b>3,92</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsswaps</b>									
PAYER SWAP 0,02% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 22.02.2019/27.02.2023 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000				-4.585,10	-0,01
PAYER SWAP 0,24% EUR / EURIBOR (EUR) 3 Monate 31.07.2018/31.07.2023 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	3.040				-13.126,22	-0,02
RECEIVER SWAP 0,209% EUR / EURIBOR (EUR) 3 Monate 14.07.2018/31.07.2023 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.040				11.240,77	0,02
<b>Varianz Swaps</b>									
Eurostoxx 50 Volatilitätsindex 24.03.2022/20.05.2022 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	5				9.688,84	0,01
Eurostoxx 50 Volatilitätsindex 28.03.2022/20.05.2022 Credit Suisse Bank [Europe] S.A.		OTC	EUR	5				2.494,15	0,00
<b>Credit Default Swaps</b>									
<b>Protection Seller</b>									
iTraxx Europe Series 33 Index (5 Years) 1% 20.03.2020/20.06.2025 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.000				81.221,05	0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	10.300				166.880,41	0,23
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.500				24.302,97	0,03
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.100				17.822,18	0,02
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.000				16.201,98	0,02
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.500				56.706,93	0,08
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800				45.365,55	0,06
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.100				34.024,16	0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.500				24.302,97	0,03
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	400				6.480,79	0,01
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	9.600				155.539,02	0,22
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.900				79.389,71	0,11

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Verkäufe / Zugänge / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.500			72.908,92	0,10
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	31.460			509.714,33	0,71
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.600			58.327,13	0,08
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.600			58.327,13	0,08
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			48.605,94	0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	23.080			373.941,73	0,52
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000			32.403,96	0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.500			24.302,97	0,03
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300			53.466,54	0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300			53.466,54	0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800			29.163,57	0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	9.600			155.539,02	0,22
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	8.900			144.197,63	0,20
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	8.700			140.957,24	0,20
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	7.700			124.755,26	0,17
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.700			76.149,31	0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.200			68.048,32	0,09
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.800			61.567,53	0,09
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.100			50.226,14	0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			40.504,95	0,06
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			51.846,34	0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.700			43.745,35	0,06
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.900			476.043,79	0,66
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.600			58.327,13	0,08
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.100			66.428,12	0,09
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	8.000			129.615,85	0,18
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			51.846,34	0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	10.000			162.019,81	0,22
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	22.800			369.405,17	0,51
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.100			330.810,09	0,46

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	3.800				306.604,48	0,43
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	1% OTC	EUR	4.400				71.288,72	0,10
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	1% OTC	EUR	4.800				77.769,51	0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	1% OTC	EUR	5.500				89.110,90	0,12
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	3.700				298.535,94	0,41
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	1% OTC	EUR	10.300				166.880,41	0,23
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	3.500				282.398,86	0,39
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	1% OTC	EUR	5.800				93.971,49	0,13
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	1% OTC	EUR	2.600				42.125,15	0,06
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	800				64.548,31	0,09
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.300				185.576,39	0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.700				217.850,55	0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	3.000				242.056,16	0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	4.200				338.878,63	0,47
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	8.700				701.962,88	0,97
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	8.800				710.031,42	0,99
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	1.700				137.165,16	0,19
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.100				169.439,32	0,24
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.200				177.507,85	0,25
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.200				177.507,85	0,25
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.400				193.644,93	0,27
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.500				201.713,47	0,28
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.700				217.850,55	0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.700				217.850,55	0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.800				225.919,09	0,31
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	2.800				225.919,09	0,31
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	3.000				242.056,16	0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	3.300				266.261,78	0,37
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	1.300				104.891,00	0,15
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026	BNP Paribas S.A.	5% OTC	EUR	1.400				112.959,54	0,16

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Verkäufe / Zugänge / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800			145.233,70	0,20
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.900			153.302,24	0,21
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300			266.261,78	0,37
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.400			274.330,32	0,38
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.500			282.398,86	0,39
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.700			298.535,94	0,41
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.200			419.564,02	0,58
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	6.200			500.249,41	0,69
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.300			104.891,00	0,15
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.900			153.302,24	0,21
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			201.713,47	0,28
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.800			306.604,48	0,43
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.400			112.959,54	0,16
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800			145.233,70	0,20
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.400			112.959,54	0,16
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.200			177.507,85	0,25
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300			185.576,39	0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.700			217.850,55	0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.700			217.850,55	0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800			225.919,09	0,31
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.900			233.987,63	0,32
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			242.056,16	0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300			266.261,78	0,37
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.100			330.810,09	0,46
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			242.056,16	0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			242.056,16	0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800			145.233,70	0,20
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300			185.576,39	0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			201.713,47	0,28
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			258.193,24	0,36

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200				258.193,24	0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200				258.193,24	0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200				258.193,24	0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300				266.261,78	0,37
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.400				274.330,32	0,38
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.500				282.398,86	0,39
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.500				282.398,86	0,39
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.000				322.741,55	0,45
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	7.600				123.135,06	0,17
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.600				290.467,40	0,40
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.400				274.330,32	0,38
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.100				250.124,70	0,35
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800				145.233,70	0,20
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.100				169.439,32	0,24
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300				266.261,78	0,37
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.900				476.043,79	0,66
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000				242.056,16	0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300				185.576,39	0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.400				193.644,93	0,27
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.400				193.644,93	0,27
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.700				217.850,55	0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800				225.919,09	0,31
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800				225.919,09	0,31
iTraxx Europe Series 36 Index (10 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2031 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.000				-7.836,92	-0,01
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Morgan Stanley Europe SE		OTC	USD	2.800				43.681,05	0,06
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Morgan Stanley Europe SE		OTC	USD	500				7.800,19	0,01
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Morgan Stanley Europe SE		OTC	USD	2.100				32.760,79	0,05
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BofA Securities Europe S.A.		OTC	USD	2.000				31.200,75	0,04
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BofA Securities Europe S.A.		OTC	USD	100				1.560,04	0,00
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Barclays Bank Ireland PLC		OTC	USD	1.700				26.520,64	0,04

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Verkäufe / Zugänge / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% Barclays Bank Ireland PLC	20.09.2021/20.12.2026	OTC	USD	2.100			32.760,79	0,05
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% Barclays Bank Ireland PLC	20.09.2021/20.12.2026	OTC	USD	1.100			17.160,41	0,02
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% Barclays Bank Ireland PLC	20.09.2021/20.12.2026	OTC	USD	3.300			51.481,24	0,07
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% Citigroup Global Markets Europe AG	20.09.2021/20.12.2026	OTC	USD	995			15.522,37	0,02
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% Citigroup Global Markets Europe AG	20.09.2021/20.12.2026	OTC	USD	2.300			35.880,86	0,05

### Protection Buyer

iTraxx Europe Snr.Finan.Ser.33 Index (5 Years) 1% 20.03.2020/20.06.2025 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.000			-78.255,08	-0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (3 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2024 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			-39.966,45	-0,06
iTraxx Europe Series 36 Index (3 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2024 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	24.520			-391.990,90	-0,54
iTraxx Europe Series 36 Index (3 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2024 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			-39.966,45	-0,06
iTraxx Europe Series 36 Index (3 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2024 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			-39.966,45	-0,06
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.400			-22.682,77	-0,03
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000			-32.403,96	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	8.300			-134.476,44	-0,19
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	7.400			-119.894,66	-0,17
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300			-53.466,54	-0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			-51.846,34	-0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.400			-38.884,75	-0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.900			-30.783,76	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			-48.605,94	-0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000			-32.403,96	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.400			-38.884,75	-0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.200			-84.250,30	-0,12
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.300			-69.668,52	-0,10
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.800			-61.567,53	-0,09
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300			-37.264,56	-0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.300			-53.466,54	-0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000			-32.403,96	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800			-29.163,57	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.400			-22.682,77	-0,03



## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.200				-68.048,32	-0,09
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.400				-38.884,75	-0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800				-45.365,55	-0,06
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.200				-35.644,36	-0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	7.700				-124.755,26	-0,17
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.200				-68.048,32	-0,09
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	8.700				-140.957,24	-0,20
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.900				-79.389,71	-0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.900				-79.389,71	-0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	9.800				-158.779,42	-0,22
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.700				-76.149,31	-0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800				-29.163,57	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	700				-11.341,39	-0,02
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800				-29.163,57	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300				-37.264,56	-0,05
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000				-32.403,96	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.900				-30.783,76	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800				-29.163,57	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	13.000				-210.625,76	-0,29
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.100				-88.753,93	-0,12
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.500				-72.908,92	-0,10
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000				-32.403,96	-0,04
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.300				-104.891,00	-0,15
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.900				-153.302,24	-0,21
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300				-185.576,39	-0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300				-185.576,39	-0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800				-225.919,09	-0,31
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.700				-27.543,37	-0,04
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.700				-27.543,37	-0,04
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800				-225.919,09	-0,31

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Verkäufe / Zugänge / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			-242.056,16	-0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			-258.193,24	-0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.500			-282.398,86	-0,39
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.600			-290.467,40	-0,40
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.000			-322.741,55	-0,45
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.400			-355.015,71	-0,49
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.200			-35.644,36	-0,05
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.500			-363.084,25	-0,50
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	22.800			-369.405,17	-0,51
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	7.100			-572.866,26	-0,79
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.100			-169.439,32	-0,24
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	700			-56.479,77	-0,08
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.000			-80.685,39	-0,11
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	6.100			-98.832,09	-0,14
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.400			-112.959,54	-0,16
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.500			-121.028,08	-0,17
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300			-185.576,39	-0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			-242.056,16	-0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.100			-250.124,70	-0,35
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.100			-250.124,70	-0,35
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			-258.193,24	-0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			-258.193,24	-0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.400			-274.330,32	-0,38
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.500			-282.398,86	-0,39
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.800			-29.163,57	-0,04
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.700			-298.535,94	-0,41
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	500			-40.342,69	-0,06
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	900			-72.616,85	-0,10
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.300			-104.891,00	-0,15
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.500			-201.713,47	-0,28

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	3.700				-298.535,94	-0,41
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	3.000				-242.056,16	-0,34
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	1.100				-88.753,93	-0,12
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.100				-169.439,32	-0,24
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.900				-233.987,63	-0,32
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	4.200				-338.878,63	-0,47
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	1.800				-145.233,70	-0,20
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	1.900				-153.302,24	-0,21
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.295				-185.172,97	-0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	3.200				-258.193,24	-0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	3.200				-258.193,24	-0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	3.700				-298.535,94	-0,41
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	6.500				-524.455,02	-0,73
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	1.000				-80.685,39	-0,11
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.000				-161.370,78	-0,22
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.100				-169.439,32	-0,24
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.100				-169.439,32	-0,24
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.300				-185.576,39	-0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.600				-209.782,01	-0,29
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.600				-209.782,01	-0,29
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.900				-233.987,63	-0,32
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	4.100				-330.810,09	-0,46
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	4.500				-363.084,25	-0,50
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	5.100				-411.495,48	-0,57
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	6.200				-500.249,41	-0,69
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	1.400				-112.959,54	-0,16
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	1.700				-137.165,16	-0,19
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.700				-217.850,55	-0,30
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.800				-225.919,09	-0,31
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		5% OTC	EUR	2.800				-225.919,09	-0,31

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Verkäufe / Zugänge / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.800			-225.919,09	-0,31
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.900			-233.987,63	-0,32
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.900			-233.987,63	-0,32
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.200			-258.193,24	-0,36
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.400			-274.330,32	-0,38
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.800			-306.604,48	-0,43
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.300			-185.576,39	-0,26
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.500			-121.028,08	-0,17
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.100			-250.124,70	-0,35
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.100			-330.810,09	-0,46
iTraxx Europe Crossover Ser.36 Index (5 Year) 5% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	4.800			-387.289,86	-0,54
iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	3.000			-48.605,94	-0,07
iTraxx Europe Series 36 Index (10 Year) 1% 20.09.2021/20.12.2031 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	22.500			44.082,68	0,06
Fortum Oyj EO-Med.-Term Notes 2012(22) 1% 20.12.2018/20.03.2023 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	2.000			1.361,92	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	19.800			-270.761,33	-0,38
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 J.P. Morgan SE		OTC	USD	3.400			-53.041,27	-0,07
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 J.P. Morgan SE		OTC	USD	1.400			-21.840,52	-0,03
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	USD	2.800			-43.681,05	-0,06
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	USD	600			-9.360,22	-0,01
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Deutsche Bank AG		OTC	USD	2.410			-37.596,90	-0,05
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	USD	3.500			-54.601,31	-0,08
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	USD	1.600			-24.960,60	-0,03
<b>Optionsrechte auf Swaps</b>						<b>EUR</b>	<b>-1.692.889,69</b>	<b>-2,35</b>
SwaptPAY.ITR.EURS36.200422.CIT11		OTC	STK	-117.000.000			-22.818,85	-0,03
SwaptPAY.ITR.EURS36.200422.ML1		OTC	STK	-8.900.000			-1.952,40	0,00
SwaptPAY.ITR.EURS37.180522.GS1		OTC	STK	-35.450.000			-43.377,46	-0,06
SwaptPAY.ITR.EURS37.180522.MS1		OTC	STK	-92.000.000			-102.120,00	-0,14
SwaptPAY.ITR.XOS36.200422.BARC1		OTC	STK	-23.625.000			-17.219,53	-0,02
SwaptPAY.ITR.XOS36.200422.BARC4		OTC	STK	-16.000.000			-16.822,70	-0,02
SwaptPAY.ITR.XOS36.200422.JPM1		OTC	STK	-9.300.000			-11.511,74	-0,02
SwaptPAY.ITR.XOS36.200422.ML2		OTC	STK	23.625.000			17.219,53	0,02
SwaptPAY.ITR.XOS37.180522.BARC1		OTC	STK	-23.625.000			-98.906,98	-0,14
SwaptPAY.ITR.XOS37.180522.BARC2		OTC	STK	-22.200.000			-117.834,59	-0,16
SwaptPAY.ITR.XOS37.180522.ML1		OTC	STK	-23.625.000			-111.033,53	-0,15
SwaptREC.ITR.EURS36.200422.CIT11		OTC	STK	-11.600.000			-8.049,39	-0,01
SwaptREC.ITR.EURS36.200422.CIT12		OTC	STK	-21.000.000			-40.954,40	-0,06

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
SwaptREC.ITR.EURS36.200422.CIT13		OTC	STK	-117.000.000				-81.187,86	-0,11
SwaptREC.ITR.EURS36.200422.MS1		OTC	STK	-17.600.000				-34.323,69	-0,05
SwaptREC.ITR.XOS36.200422.BARC1		OTC	STK	-26.850.000				-165.516,51	-0,23
SwaptREC.ITR.XOS36.200422.BARC5		OTC	STK	-18.000.000				-246.244,85	-0,34
SwaptREC.ITR.XOS37.180522.BARC1		OTC	STK	-20.925.000				-196.946,59	-0,27
SwaptREC.ITR.XOS37.180522.BARC2		OTC	STK	-47.925.000				-303.786,99	-0,42
SwaptREC.ITR.XOS37.180522.BARC3		OTC	STK	6.700.000				6.919,45	0,01
SwaptREC.ITR.XOS37.180522.MS1		OTC	STK	-16.000.000				-33.097,78	-0,05
SwaptPAY.CDX.NAIGS37.200422.JPM2		OTC	STK	-24.000.000				-4.258,31	-0,01
SwaptPAY.CDX.NAIGS38.180522.DB1		OTC	STK	-22.400.000				-18.070,11	-0,03
SwaptREC.CDX.NAIGS37.200422.BNP1		OTC	STK	-9.000.000				-18.728,41	-0,03
SwaptREC.CDX.NAIGS37.200422.CIT11		OTC	STK	-10.700.000				-22.266,00	-0,03
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>2.096.829,79</b>	<b>2,91</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>2.096.829,79</b>	<b>2,91</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Bank of New York Mellon Asset Servicing GmbH (Frankfurt)			EUR	176.355,80		%	100,000	176.355,80	0,24
Barclays Bank Ireland plc (Dublin)			EUR	1.010.000,00		%	100,000	1.010.000,00	1,40
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
			USD	1.013.038,88		%	100,000	910.473,99	1,26
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>5.716.417,03</b>	<b>7,93</b>
Zinsansprüche			EUR	227.903,64				227.903,64	0,32
Ansprüche aus Kapitalmaßnahmen			EUR	1.852,69				1.852,69	0,00
Einschüsse (Initial Margins)			EUR	5.215.899,37				5.215.899,37	7,24
CDS Prämien			EUR	270.761,33				270.761,33	0,38
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-3.020.296,06</b>	<b>-4,19</b>
EUR - Kredite			EUR	-3.020.296,06		%	100,000	-3.020.296,06	-4,19
<b>Sonstige Verbindlichkeiten *)</b>							<b>EUR</b>	<b>-54.036,58</b>	<b>-0,07</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>72.080.066,00</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>96,49</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>747.013</b>	

\*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwahrtgelte, CDS Prämie, Kostenpauschale

### Fußnoten:

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

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.03.2022		
US-Dollar	(USD)	1,1126500	=	1 Euro (EUR)

### Marktschlüssel

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>					
0,8750 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2014(21)	A1ZR60	EUR		1.000	
4,1250 % CIF Euromortgage EO-Med.-T.Obl.Foncières 11(22)	A1GRSV	EUR		1.300	
0,7500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-T.Cov.Bds 2014(21)	A1ZRQ4	EUR		1.000	
0,2500 % Westpac Sec. NZ Ltd. (Ldn Br.) EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2017(22)	A19FR1	EUR		1.500	
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,0000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-FLR Preferred MTN 2018(21)	A2RUZ4	EUR		1.000	
1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2016(22)	A18YKM	EUR		1.700	
0,0000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-FLR Med.-Term Nts 2019(22)	A2RWF3	EUR		1.700	
0,6250 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2016(21)	A19AQG	EUR		2.000	
0,0000 % DNB Boligkreditt A.S. EO-FLR M.-T. Pfandbr. 2014(21)	A1ZSB1	EUR		700	
0,7500 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2017(22)	A19DZC	EUR		1.500	
0,0000 % Schleswig-Holstein, Land FLR-Landesschatz.v.16(22) A.1	SHFM51	EUR		1.000	

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

**SWAPS (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)**

**Varianz Swaps**

(Basiswert(e): Eurostoxx 50 Volatilitätsindex 21.01.2022/18.02.2022 J.P. Morgan SE,	EUR	32
Eurostoxx 50 Volatilitätsindex 24.01.2022/18.02.2022 Société Générale S.A.,		
Eurostoxx 50 Volatilitätsindex 24.03.2022/20.05.2022 Goldman Sachs Bank Europe SE,		
Eurostoxx 50 Volatilitätsindex 28.03.2022/20.05.2022 Credit Suisse Bank [Europe] S.A.,		
S&P 500 Volatilitätsindex 19.01.2022/18.03.2022 Credit Suisse Bank [Europe] S.A.,		
S&P 500 Volatilitätsindex 23.11.2021/21.01.2022 Barclays Bank Ireland PLC,		
S&P 500 Volatilitätsindex 26.01.2022/18.03.2022 Credit Suisse Bank [Europe] S.A.,		
S&P 500 Volatilitätsindex 28.01.2022/18.03.2022 J.P. Morgan SE)		

## 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
---------------------	-----	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

### Credit Default Swaps

#### Protection Seller

(Basiswert(e): CDX NA IG Series 36 Index (5 Years) 1% 22.03.2021/20.06.2026 Citigroup Global Markets Europe AG,			EUR		112.201
CDX NA IG Series 36 Index (5 Years) 1% 22.03.2021/20.06.2026 J.P. Morgan SE,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Barclays Bank Ireland PLC,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Citigroup Global Markets Europe AG,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 J.P. Morgan SE,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Morgan Stanley Europe SE,					
iTraxx Europe Crossover Ser.35 Index (5 Year) 5% 22.03.2021/20.06.2026 BNP Paribas S.A.,					
iTraxx Europe Series 35 Index (10 Year) 1% 22.03.2021/20.06.2031 BNP Paribas S.A.,					
iTraxx Europe Series 35 Index (3 Year) 1% 22.03.2021/20.06.2024 BNP Paribas S.A.)					

#### Protection Buyer

(Basiswert(e): CDX NA IG Series 36 Index (5 Years) 1% 22.03.2021/20.06.2026 BofA Securities Europe S.A.,			EUR		146.397
CDX NA IG Series 36 Index (5 Years) 1% 22.03.2021/20.06.2026 Citigroup Global Markets Europe AG,					
CDX NA IG Series 36 Index (5 Years) 1% 22.03.2021/20.06.2026 J.P. Morgan SE,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Barclays Bank Ireland PLC,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BNP Paribas S.A.,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 BofA Securities Europe S.A.,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Citigroup Global Markets Europe AG,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Goldman Sachs Bank Europe SE,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 J.P. Morgan SE,					
CDX NA IG Series 37 Index (5 Years) 1% 20.09.2021/20.12.2026 Morgan Stanley Europe SE,					
iTraxx Europe Crossover Ser.35 Index (5 Year) 5% 22.03.2021/20.06.2026 BNP Paribas S.A.,					
iTraxx Europe Series 31 Index (5 Years) 1% 20.03.2019/20.06.2024 BNP Paribas S.A.,					
iTraxx Europe Series 35 Index (3 Year) 1% 22.03.2021/20.06.2024 BNP Paribas S.A.,					
iTraxx Europe Series 35 Index (5 Year) 1% 22.03.2021/20.06.2026 BNP Paribas S.A.)					



## 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>Optionsrechte auf Swaps</b>					
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): ITRAXX EUROPE S.36 5 YRS)					31,01
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): CDX NA IG SE.37 5 Y, ITRAXX EUROPE S.36 5 YRS, ITRX EURO.CROSS.S.36 5 YR)					348,53
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): CDX NA IG SE.37 5 Y, ITRAXX EUROPE S.36 5 YRS, ITRX EURO.CROSS.S.36 5 YR)					2.016,56
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): CDX NA IG SE.37 5 Y, ITRAXX EUROPE S.36 5 YRS, ITRX EURO.CROSS.S.36 5 YR)					2.692,59

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>96,49</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>747.013</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, den 1. April 2022

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH



# LB≡BW Asset Management

30039 [10] 04/2022 55 25% Altpapier

**LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH**

Postfach 100351  
70003 Stuttgart  
Fritz-Elsas-Straße 31  
70174 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)