

LB≡BW Asset Management

W&W Nachhaltige Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2023

Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.08.2023	8
Vermögensaufstellung zum 31.08.2023	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	16
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	17

Liebe Anlegerin, lieber Anleger,

wir danken Ihnen für das Vertrauen, das Sie uns entgegenbringen.

Seit unserer Gründung legen wir Fonds für private und institutionelle Anleger auf. Dadurch bieten wir Ihnen die Möglichkeit, an den Entwicklungen der Märkte teilzunehmen. Detailinformationen erhalten Sie von Ihrem Berater.

In diesem Halbjahresbericht können Sie sich ein Bild von der Situation Ihres Fonds verschaffen. Sollten Sie weitergehende Auskünfte zu Ihrem Fonds benötigen, sprechen Sie bitte Ihren Berater an.

Tagesaktuelle Informationen zu Fondspreisen finden Sie im Internet unter www.LBBW-AM.de und in der überregionalen Tagespresse.

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH
Geschäftsführung



Uwe Adamla
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz
(Stellv. Vorsitzender)

W&W Nachhaltige Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2023

Vermögensübersicht zum 31.08.2023

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	87.397.404,27	100,10
1. Anleihen	28.803.002,75	32,99
Frankreich	3.645.201,91	4,18
Niederlande	3.357.938,21	3,85
Bundesrep. Deutschland	2.731.327,45	3,13
Spanien	1.926.743,38	2,21
Schweden	1.505.885,29	1,72
Dänemark	1.417.518,05	1,62
Italien	1.414.720,24	1,62
Österreich	1.282.087,01	1,47
USA	1.085.000,16	1,24
Belgien	1.011.935,00	1,16
Großbritannien	1.011.371,00	1,16
Weltbank	904.333,67	1,04
Irland	664.553,00	0,76
Tschechische Republik	634.571,13	0,73
Slowenien	616.266,74	0,71
Japan	569.034,82	0,65
Andean Development Corp.	535.800,00	0,61
Australien	481.210,00	0,55
Übrige intern. Organis.	454.767,59	0,52
IFFIm	441.348,10	0,51
Andorra	425.543,11	0,49
Zypern	307.608,00	0,35
Norwegen	302.421,00	0,35
Südkorea	298.530,00	0,34
Interam.Investment-Corp.	297.705,00	0,34
Polen	294.720,00	0,34
Asiat. Infrastrukturinv.	267.745,12	0,31
Europ. Investitionsbank	256.682,05	0,29
Slowakei	199.000,00	0,23
Andere Länder	461.435,72	0,52
2. Investmentanteile	53.510.088,93	61,29
3. Bankguthaben	4.716.438,71	5,40
4. Sonstige Vermögensgegenstände	367.873,88	0,42
II. Verbindlichkeiten	-88.536,28	-0,10
III. Fondsvermögen	87.308.867,99	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	82.313.091,68	94,28
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	25.849.380,67	29,61
Verzinsliche Wertpapiere									
4,5000 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 317 v.22(25)	AAR035		EUR	300			% 98,257	294.771,06	0,34
4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28)	A3LCXL		EUR	400			% 98,672	394.688,00	0,45
3,5000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2022(29)	A3LAFX		EUR	200			% 99,020	198.039,09	0,23
3,9000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LGZN		EUR	300	300		% 100,945	302.835,00	0,35
1,3750 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZPVK		EUR	300			% 97,980	293.940,00	0,34
3,5000 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2022(33)	A3LAHU		EUR	300			% 101,313	303.939,00	0,35
5,7010 % Alperia S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/28)	A3LKSU		EUR	200	200		% 99,540	199.080,00	0,23
1,2500 % Andorra EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KQMN		EUR	300			% 81,320	243.960,00	0,28
1,2500 % Andorra EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3K2LX		EUR	200			% 90,792	181.583,11	0,21
5,3750 % Argenta Spaarbank N.V. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3LBTJ		EUR	300			% 101,240	303.720,00	0,35
0,5000 % Bank Gospodarstwa Krajowego EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KTQT		EUR	400			% 73,680	294.720,00	0,34
4,8750 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(27/28)	A3LCXU		EUR	300			% 101,451	304.353,00	0,35
4,2500 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.23(27)	BLB6JZ		EUR	300	300		% 100,410	301.230,00	0,35
1,2500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86	A19W9B		EUR	300	300		% 85,630	256.890,00	0,29
2,7500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2022(39)	A3K9KL		EUR	300	300		% 92,485	277.455,00	0,32
4,2500 % Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/29)	A3LKSU		EUR	200	200		% 100,469	200.938,00	0,23
0,5000 % Česká Sporitelna AS EO-FLR Non-Pref.MTN 21(27/28)	A3KV1A		EUR	200			% 81,688	163.376,13	0,19
5,6250 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2022(22/27)	A3LADJ		EUR	450			% 104,710	471.195,00	0,54
1,6250 % Communauté française Belgique EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K43K		EUR	200			% 86,935	173.870,00	0,20
1,8750 % Comun. Autónoma del País Vasco EO-Obligaciones 2022(33)	A3K4WM		EUR	300			% 85,520	256.560,00	0,29
0,4200 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2021(31)	A3KNNW		EUR	400			% 79,060	316.240,00	0,36
1,7230 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2022(32)	A3K324		EUR	300			% 86,008	258.024,00	0,30
0,6250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2019(26)	A2SANG		EUR	600			% 89,300	535.800,00	0,61
1,3750 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3K2DH		EUR	500			% 92,775	463.875,00	0,53
2,3750 % De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27)	A3K41N		EUR	300			% 94,163	282.489,00	0,32
3,0000 % Deutsche Kreditbank AG Hyp.Pfandbrief 2023(2035)	SCB004		EUR	300			% 97,620	292.860,00	0,34

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
5,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35424 v.23(27)	A30WF8		EUR	300			% 102,850	308.550,00	0,35
3,7500 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(28/29)	A351VG		EUR	200	200		% 100,231	200.461,00	0,23
4,1250 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LH5M		EUR	300	300		% 99,757	299.272,02	0,34
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2017(39)	A19CGY		EUR	400	200		% 81,790	327.160,00	0,37
1,3750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Med.-Term Nts 2022(25)	A3K4F3		EUR	300			% 95,257	285.771,01	0,33
4,1250 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LD6D		EUR	300			% 98,755	296.265,00	0,34
0,4000 % Ile-de-France Mobilités EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KRXY		EUR	400			% 80,940	323.760,00	0,37
4,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.T.Nts 22(28/33)	A3K8PP		EUR	200			% 94,720	189.440,00	0,22
2,3750 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(30)	A2YNWB		EUR	300			% 95,250	285.750,00	0,33
3,1250 % Inter-Amer. Invest. Corp.-IIC- EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3LBDR		EUR	300			% 99,235	297.705,00	0,34
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	A2RS2Q		EUR	400			% 90,050	360.200,00	0,41
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	A3LGGP		EUR	300	300		% 100,890	302.670,00	0,35
0,5000 % Junta de Andalucia EO-Obl. 2021(31)	A3KPJS		EUR	300			% 79,237	237.711,00	0,27
0,2680 % Junta de Galicia EO-Obl. 2021(28)	A3KZK3		EUR	200			% 85,740	171.480,00	0,20
3,7140 % Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2023(27)Reg.S	A3LF65		EUR	300	300		% 99,510	298.530,00	0,34
1,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(32)	A3E5J6		EUR	300			% 87,958	263.874,00	0,30
1,3750 % La Banque Postale EO-Non-Pref. M.-T.Nts 2019(29)	A2R056		EUR	400			% 86,810	347.240,00	0,40
0,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 825 v.21(28)	LB2V7C		EUR	200		300	% 83,456	166.912,58	0,19
2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27)	HLB2QJ		EUR	200			% 95,050	190.100,00	0,22
0,2500 % Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(30)	A3KZ18		EUR	200			% 80,355	160.710,00	0,18
4,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-FLR Preferred MTN 22(28/29)	A3LBY6		EUR	300			% 101,100	303.300,00	0,35
1,8750 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	A3K5D7		EUR	200			% 89,580	179.160,00	0,21
4,0670 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28)	A3K81M		EUR	200			% 98,250	196.500,00	0,23
4,1250 % NBN Co Ltd. EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LE6R		EUR	200	200		% 100,538	201.076,00	0,23
0,7500 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/36)	A3KW75		EUR	300			% 68,516	205.548,00	0,24
3,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	A3K66V		EUR	200			% 96,670	193.340,00	0,22
0,2500 % NIBC Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KVYN		EUR	300			% 87,112	261.336,00	0,30
7,1250 % Nova Ljubljanska Banka d.d. EO-FLR Pref. Nts 2023(26/27)	A3LKGM		EUR	200	200		% 103,430	206.860,00	0,24

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,6250 % OP Yrityspankki Oyj EO-Non-Preferred MTN 2022(27)	A3K1M0		EUR	200			% 87,350	174.700,00	0,20
2,3750 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	A3K5N4		EUR	300			% 91,146	273.437,12	0,31
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	A19SNH		EUR	300			% 87,381	262.143,00	0,30
3,6250 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LEU1		EUR	200			% 99,560	199.120,00	0,23
3,7500 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LEU2		EUR	200			% 99,501	199.001,05	0,23
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LGQG		EUR	300	300		% 100,120	300.360,00	0,34
4,1250 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25)	A3K81Y		EUR	200			% 99,134	198.268,00	0,23
4,8750 % SBAB Bank AB (publ) EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	A3LKGC		EUR	200	200		% 99,910	199.820,00	0,23
1,8750 % SBAB Bank AB (publ) EO-Preferred MTN 2022(25)	A3K6HP		EUR	200			% 95,527	191.054,00	0,22
4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26)	A3LA5R		EUR	200			% 99,667	199.334,00	0,23
3,5000 % Slovenská Sporitelna AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 22(28)	A3K90M		EUR	200			% 99,500	199.000,00	0,23
3,6250 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2023(33)	A3LCWG		EUR	400			% 102,352	409.406,74	0,47
0,7500 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 2019(36)	A2R4MT		EUR	500			% 71,580	357.900,00	0,41
3,1250 % SNCF S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3LAW2		EUR	300			% 98,995	296.985,00	0,34
5,2500 % Société Générale S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/32)	A3K84C		EUR	300			% 99,718	299.152,50	0,34
1,0000 % Spanien EO-Bonos 2021(42)	A3KV2K		EUR	300	300		% 61,951	185.854,29	0,21
4,8750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Non-Pref. Med.-T.Nts 23(28)	A3LMBU		EUR	300	300		% 100,807	302.421,00	0,35
0,8000 % Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(28/29)	A3KY2U		EUR	400			% 82,990	331.960,00	0,38
2,0000 % Svensk Exportkredit, AB EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K63X		EUR	300			% 95,327	285.981,00	0,33
5,6180 % TDC Net A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LDQA		EUR	300			% 97,793	293.379,00	0,34
2,3760 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	A3KLMN		EUR	400			% 79,400	317.600,00	0,36
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	A28Z9P		EUR	200			% 94,683	189.366,00	0,22
1,6250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/26)	A3K48X		EUR	200			% 95,125	190.249,05	0,22
4,3750 % Thames Water Utilities Fin.PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/31)	A3LCYZ		EUR	300			% 93,991	281.973,00	0,32
5,8500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3LBDE		EUR	300			% 103,466	310.398,22	0,36
1,7500 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K5NK		EUR	300			% 89,390	268.170,00	0,31
4,2500 % V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/29)	A3LEVN		EUR	200			% 98,680	197.360,00	0,23
0,9000 % Verbund AG EO- Notes 2021(21/41)	A3KNZ9		EUR	300			% 67,141	201.423,00	0,23

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe / Verkäufe / Zugänge / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,1250 % Zypern, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LGGM		EUR	300	300	% 102,536	307.608,00	0,35
4,0500 % American Express Co. DL-Notes 2022(29/29)	A3K47Q		USD	200		% 95,028	175.110,33	0,20
3,1250 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2018(28)	A2RR9D		USD	145		% 94,332	126.025,72	0,14
3,3750 % Asian Infrastruct.Invest.Bank DL-Medium-Term Notes 22(25)	A3K612		USD	300		% 96,866	267.745,12	0,31
3,5000 % BNG Bank N.V. DL-Med.-Term Nts 2023(28)Reg.S	A3LHYU		USD	300	300	% 95,817	264.846,36	0,30
1,3750 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. DL-Med.-T.Nts 2021(31) Reg.S	A287TH		USD	200		% 80,605	148.532,01	0,17
1,2500 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. DL-Med.-Term Nts 2021(26)Reg.S	A3KX3N		USD	200		% 89,840	165.550,28	0,19
2,3750 % European Investment Bank DL-Bonds 2017(27)	A19H0E		USD	300	300	% 92,863	256.682,05	0,29
1,7500 % Henkel AG & Co. KGaA DL-Med. Term Nts. v.21(21/26)	A3MQMB		USD	200		% 89,164	164.305,04	0,19
2,1250 % International Bank Rec. Dev. DL-Medium-Term Notes 2015(25)	A1ZXG1		USD	400		% 95,679	352.621,55	0,40
1,3750 % International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2021(28)	A3KPR8		USD	500		% 87,454	402.885,00	0,46
1,2500 % International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2021(31)	A3KLLS		USD	200		% 80,765	148.827,12	0,17
1,0000 % Intl.Fin.Fac.for Immunisation DL-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KPVS		USD	200		% 90,389	166.561,47	0,19
0,3750 % Kommuninvest i Sverige AB DL-Medium-Term Nts 21(24)Reg.S	A3KM09		USD	500		% 95,917	441.871,29	0,51
2,0000 % Landesbank Baden-Württemberg DL-MTN-Pfandbr.S.828 v.22(25)	LB2ZTL		USD	300		% 94,973	262.513,77	0,30
5,1393 % New Development Bank DL-FLR Med.-Term Nts 2021(24)	A3KZU8		USD	200		% 98,666	181.814,16	0,21
5,1250 % New Development Bank DL-Medium-Term Notes 2023(26)	A3LG3K		USD	300	300	% 98,750	272.953,43	0,31
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	2.752.526,08	3,15
Verzinsliche Wertpapiere								
0,3750 % Action Logement Services SAS EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KW10		EUR	300		% 79,812	239.436,00	0,27
0,3000 % Colgate-Palmolive Co. EO-Bonds 2021(21/29)	A3KYQK		EUR	200		% 83,780	167.560,00	0,19
2,1250 % Development Bank of Japan EO-Medium-Term Notes 2022(26)	A3K8VT		EUR	200		% 95,843	191.686,00	0,22
0,6250 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV EO-Notes 2021(21/32) Reg.S	A3KVZV		EUR	300		% 76,917	230.749,67	0,26
2,1250 % National Australia Bank Ltd. EO-Medium-Term Nts 2022(28)	A3K5XA		EUR	300		% 93,378	280.134,00	0,32
4,2500 % Siemens Energy Finance B.V. EO-Notes 2023(23/29)	A3LFSH		EUR	300	300	% 96,584	289.751,93	0,33
2,6250 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2022(29)	A3K8VF		EUR	200		% 93,913	187.825,00	0,22
2,2500 % General Mills Inc. DL-Notes 2021(21/31)	A3KXB7		USD	300		% 80,873	223.539,87	0,26
2,2710 % Honda Motor Co. Ltd. DL-Notes 2022(22/25)	A3K29A		USD	200		% 95,648	176.252,82	0,20

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,4000 % ING Groep N.V. DL-FLR Notes 2020(25/26) Reg.S	A28ZD1		USD	200			% 91,915	169.374,20	0,19
4,7500 % Intl.Fin.Fac.for Immunisation DL-Medium-Term Notes 2022(25)	A3LAXD		USD	300			% 99,413	274.786,63	0,31
2,6250 % Pfizer Inc. DL-Notes 2020(20/30)	A28VAY		USD	200			% 88,013	162.183,63	0,19
0,7500 % VISA Inc. DL-Notes 2020(20/27)	A2807T		USD	200			% 86,419	159.246,33	0,18
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	201.096,00	0,23
Verzinsliche Wertpapiere									
3,9760 % East Japan Railway Co. EO-Medium-Term Notes 2023(32)	A3LMP1		EUR	200	200		% 100,548	201.096,00	0,23
Investmentanteile							EUR	53.510.088,93	61,29
KVG-eigene Investmentanteile									
LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	A2N67X		ANT	40.000	40.000		EUR 141,260	5.650.400,00	6,47
Gruppenfremde Investmentanteile									
ASSENAGON Green Economy Act. Nom. I2 EUR Acc. oN	A3C505		ANT	2.000			EUR 882,340	1.764.680,00	2,02
BNP P.E.ESG Eur.Bid.Lead.PAB Act.Nom. U.ETF EUR Acc. oN	A3DT3F		ANT	320.000	320.000		EUR 11,572	3.703.040,00	4,24
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.Ldrs Namens-Ant.UCITS ETF CAP o.N.	A2PHCA		ANT	320.000	70.000		EUR 16,604	5.313.280,00	6,09
BNP PARIBAS EASY-E.GI.E.B.Eco. Act. au Port. UE EUR Acc. oN	A2QCJJ		ANT	250.000			EUR 14,012	3.503.000,00	4,01
COELI SICAV I-Global Select Fd Actions Nom. I Cap.EUR o.N.	A2DW59		ANT	25.000	25.000		EUR 168,000	4.200.000,00	4,81
H.C.F.HC Bos.Com.GI.Eq.Imp. Reg. Shs Founder EUR Dis. oN	A2QRYB		ANT	17.000			EUR 129,480	2.201.160,00	2,52
L&G-L&G Clean Water UCITS ETF Registered Shares o.N.	A2PM52		ANT	310.000	235.000		EUR 14,342	4.446.020,00	5,09
Robeco Cap.Gr.F-GI.Ge.E.Im.Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	A2QD2H		ANT	10.100			EUR 209,140	2.112.314,00	2,42
TBF SMART POWER Inhaber-Anteile EUR I	A2AQZX		ANT	76.000	32.000		EUR 62,150	4.723.400,00	5,41
UI I-Montrusco Bol.Glbl Eq.Fd Act. Nom. IX EUR Acc. oN	A3CTNT		ANT	50.500	25.000		EUR 113,750	5.744.375,00	6,58
UI I-Montrusco Bolton US Eq.Fd Act.Nom. IX A EUR Acc. oN	A3EBOX		ANT	31.000	31.000		EUR 101,790	3.155.490,00	3,61
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. C USD Acc. oN	A2PNKQ		ANT	30.000	15.000		USD 155,781	4.305.908,69	4,93
Wellingt.M.Fds Ir.-W.GI.Impact Regist.Acc.Shs S USD Unh.o.N.	A2DGFF		ANT	165.000			USD 17,675	2.687.021,24	3,08
Summe Wertpapiervermögen							EUR	82.313.091,68	94,28

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2023	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	4.716.438,71	5,40
Bankguthaben						EUR	4.716.438,71	5,40
EUR-Guthaben bei:								
HSBC Continental Europe S.A., Germany (Düsseldorf)			EUR	594.570,91		% 100,000	594.570,91	0,68
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
			USD	4.473.669,22		% 100,000	4.121.867,80	4,72
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	367.873,88	0,42
Zinsansprüche			EUR	367.873,88			367.873,88	0,42
Sonstige Verbindlichkeiten *)						EUR	-88.536,28	-0,10
Fondsvermögen						EUR	87.308.867,99	100,00 ¹⁾
Anteilwert						EUR	54,81	
Umlaufende Anteile						STK	1.592.901	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.08.2023		
US-Dollar	(USD)	1,0853500	=	1 Euro (EUR)

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

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,5500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KWYZ	EUR		200	
1,3750 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2021(31/41)	A3KN91	EUR		300	
7,6250 % Banca Comerciala Româna S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(26/27)	A3LHTS	EUR	300	300	
5,0000 % Centr. Am. Bk Ec.Integr.CABEI DL-Med.-Term Nts 2023(26)Reg.S	A3LDXC	USD		300	
1,2500 % Hyundai Capital Services Inc. DL-Med.-Term Nts2021(26) Reg.S	A3KLCQ	USD		400	
0,8750 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 21(27/32)	A3KR71	EUR		200	
0,3500 % Intl Development Association EO-Med.-Term Nts 2021(36)	A3KPV1	EUR		300	
1,7500 % Intl Development Association EO-Med.-Term Nts 2022(37)	A3K41V	EUR		200	
0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 822 v.21(31)	LB2CW1	EUR		300	
1,0000 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.21(31/42)	A3E5WY	EUR		200	
3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27)	A3LDC1	EUR		300	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,6690 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 21(26/31)	A3KK88	EUR		300	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
Algebris UCITS Fd.-Al.Fin.Equ. Regist. Shs. B EUR Acc. o.N.	A2DVGQ	ANT		10.000	
Aviva Inv.-Climt.Trans.Eur.Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	A2PHX5	ANT		22.300	
BNP Paribas Energy Transition Act. Nom. I Cap o.N.	A1T8W4	ANT		100	
BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Nam.-Ant.UCITS ETF CAP USD o.N	A2AL1U	ANT		200.000	
Climate Smart Europe LS Inhaber-Anteile I	A2QMEK	ANT		4.000	
Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ETFL57	ANT		80.000	
Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg. Shs Y EUR Acc. oN	A2PS1C	ANT		80.000	
iShsIV-MSCI WLD.ESG.Enh.U.ETF Reg. Shares USD Acc. o.N.	A2PCB4	ANT	100.000	470.000	
JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF Reg.S. (ESG) UCITS DL Acc.oN	A2DWM7	ANT	50.000	160.000	
JSS Ifds II-JSS Sus.Bd Gl Mul. Act. Nom. I USD Acc. oN	A2PAXS	ANT		20.000	
UBS(L)FS-MSCI Wld Soc.Rsp.UETF Namens-Anteile A Acc. USD o.N.	A1W3CQ	ANT		160.000	

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	54,81
Umlaufende Anteile	STK	1.592.901

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. September 2023

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 100351
70003 Stuttgart
Pariser Platz 1, Haus 5
70173 Stuttgart
Telefon 0711 22910-3000
Telefax 0711 22910-9098
www.LBBW-AM.de
info@LBBW-AM.de