

LB≡BW Asset Management

W&W Nachhaltige Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2024

Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.08.2024	8
Vermögensaufstellung zum 31.08.2024	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)



Michael Hünseler

W&W Nachhaltige Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2024

Vermögensübersicht zum 31.08.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	101.974.970,63	100,09
1. Anleihen	32.138.675,12	31,55
Frankreich	4.058.681,44	3,98
Niederlande	3.642.584,13	3,58
Spanien	2.752.482,00	2,70
Bundesrep. Deutschland	2.737.669,10	2,69
Italien	2.080.811,40	2,04
Dänemark	1.413.004,50	1,39
Österreich	1.411.773,00	1,39
Belgien	1.248.957,00	1,23
Schweden	1.092.226,00	1,07
USA	940.574,14	0,92
Weltbank	924.744,12	0,91
Slowenien	841.744,00	0,83
Übrige intern. Organismen	753.707,85	0,74
Irland	684.991,00	0,67
Japan	585.509,12	0,57
Australien	498.433,00	0,49
Südkorea	490.425,66	0,48
Tschechische Republik	474.390,00	0,47
Ver. Arabische Emirate	459.388,29	0,45
Andorra	451.230,00	0,44
IFFIm	443.126,42	0,43
Großbritannien	411.798,00	0,40
Polen	326.459,78	0,32
Zypern	323.996,82	0,32
Norwegen	316.350,00	0,31
Interam. Investment-Corp.	304.380,00	0,30
Andean Development Corp.	283.500,00	0,28
Asiat. Infrastrukturinv.	268.419,11	0,26
Europ. Investitionsbank	260.620,19	0,26
Andere Länder	1.656.699,05	1,63
2. Investmentanteile	59.512.172,00	58,41
3. Bankguthaben	9.877.348,53	9,70
4. Sonstige Vermögensgegenstände	446.774,98	0,44
II. Verbindlichkeiten	-95.268,27	-0,09
III. Fondsvermögen	101.879.702,36	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	91.650.847,12	89,96
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	28.456.223,34	27,93
Verzinsliche Wertpapiere									
4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2023(28)	A3LCXL		EUR	400			% 102,190	408.760,00	0,40
3,5000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2022(29)	A3LAFX		EUR	200			% 101,810	203.620,00	0,20
3,9000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LGZN		EUR	300			% 104,050	312.150,00	0,31
1,3750 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZPVK		EUR	300			% 99,920	299.760,00	0,29
3,5000 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2022(33)	A3LAHU		EUR	300			% 102,750	308.250,00	0,30
5,7010 % Alperia S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/28)	A3LKSU		EUR	200			% 105,826	211.651,40	0,21
1,2500 % Andorra EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KQMN		EUR	300			% 87,390	262.170,00	0,26
1,2500 % Andorra EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3K2LX		EUR	200			% 94,530	189.060,00	0,19
3,7500 % Arab Bank f.Eco. Dev.in Africa EO-Medium-Term Notes 2024(27)	A3LTSY		EUR	300			% 100,590	301.770,00	0,30
5,3750 % Argenta Spaarbank N.V. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3LBTJ		EUR	300			% 103,919	311.757,00	0,31
3,1250 % Argenta Spaarbank N.V. EO-Med.-Term Pandbr. 2024(34)	A3LT80		EUR	200			% 101,188	202.376,00	0,20
3,0000 % Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LV5G		EUR	200	200		% 99,852	199.704,00	0,20
4,6250 % Banco BPM S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(27)	A3LRTA		EUR	200			% 103,890	207.780,00	0,20
0,5000 % Bank Gospodarstwa Krajowego EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KTQT		EUR	400			% 81,615	326.459,78	0,32
4,8750 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(27/28)	A3LCXU		EUR	300			% 104,053	312.159,00	0,31
7,0000 % Bayerische Landesbank FLR-Sub.Anl.v.2023(2028/2034)	BLB8DT		EUR	200			% 108,040	216.080,00	0,21
4,2500 % Bayerische Landesbank Med.Term.Inh.-Schv.23(27)	BLB6JZ		EUR	300			% 102,580	307.740,00	0,30
1,2500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(33) Ser. 86	A19W9B		EUR	300	300		% 88,930	266.790,00	0,26
2,7500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2022(39)	A3K9KL		EUR	300			% 95,830	287.490,00	0,28
2,7500 % BNG Bank N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(34)	A3LS36		EUR	200			% 99,535	199.070,00	0,20
4,2500 % Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/29)	A3LKSV		EUR	200			% 103,640	207.280,00	0,20
5,6250 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2022(22/27)	A3LADJ		EUR	450			% 105,420	474.390,00	0,47
1,6250 % Communauté française Belgique EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K43K		EUR	200			% 90,272	180.544,00	0,18
1,8750 % Comun. Autónoma del País Vasco EO-Obligaciones 2022(33)	A3K4WM		EUR	300			% 90,140	270.420,00	0,27
0,4200 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2021(31)	A3KNNW		EUR	400			% 84,515	338.060,00	0,33
1,7230 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2022(32)	A3K324		EUR	300			% 91,055	273.165,00	0,27

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,6250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2019(26)	A2SANG		EUR	300			% 94,500	283.500,00	0,28
3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2024(33)	A3LTBQ		EUR	200			% 103,430	206.860,00	0,20
3,2500 % Credito Emiliano S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2024(29)	A3LTE1		EUR	200			% 101,040	202.080,00	0,20
1,3750 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3K2DH		EUR	500			% 97,140	485.700,00	0,48
2,3750 % De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27)	A3K41N		EUR	300			% 97,850	293.550,00	0,29
3,0000 % Deutsche Kreditbank AG Hyp.Pfandbrief 2023(2035)	SCB004		EUR	300			% 101,024	303.072,00	0,30
3,7500 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(28/29)	A351VG		EUR	200			% 102,523	205.046,00	0,20
4,1250 % Ferrovie dello Stato Ital.SpA EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LH5M		EUR	300			% 103,410	310.230,00	0,30
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2017(39)	A19CGY		EUR	400			% 82,930	331.720,00	0,33
4,1250 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LD6D		EUR	300			% 100,584	301.752,00	0,30
3,2000 % Île de France, Région EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LTXV		EUR	300			% 99,793	299.379,23	0,29
0,4000 % Ile-de-France Mobilités EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KRXY		EUR	400			% 84,136	336.544,00	0,33
4,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.T.Nts 22(28/33)	A3K8PP		EUR	200			% 100,350	200.700,00	0,20
2,3750 % ING-DiBa AG MTN-Hyp.-Pfand. v.22(30)	A2YNWB		EUR	300			% 98,159	294.477,00	0,29
3,0500 % Instituto de Credito Oficial EO-Medium-Term Nts 2024(31)	A3LWHU		EUR	200	200		% 101,202	202.404,00	0,20
3,1250 % Inter-Amer. Invest. Corp.-IIC- EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3LBDR		EUR	300			% 101,460	304.380,00	0,30
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	A2RS2Q		EUR	400			% 93,208	372.832,00	0,37
3,5000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2024(34)	A3LWDK		EUR	160	160		% 102,830	164.528,00	0,16
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	A3LGGP		EUR	300			% 104,400	313.200,00	0,31
0,5000 % Junta de Andalucia EO-Obl. 2021(31)	A3KPJS		EUR	300			% 84,409	253.227,00	0,25
0,2680 % Junta de Galicia EO-Obl. 2021(28)	A3KZK3		EUR	200			% 90,500	181.000,00	0,18
3,7140 % Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2023(27)Reg.S	A3LF65		EUR	300			% 101,940	305.820,00	0,30
1,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(32)	A3E5J6		EUR	300			% 91,800	275.400,00	0,27
1,3750 % La Banque Postale EO-Non-Pref. M.-T.Nts 2019(29)	A2R056		EUR	400			% 91,153	364.612,00	0,36
2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27)	HLB2QJ		EUR	200			% 98,090	196.180,00	0,19
0,2500 % Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(30)	A3KZ18		EUR	200			% 85,573	171.146,00	0,17
4,6250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-FLR Preferred MTN 22(28/29)	A3LBY6		EUR	300			% 104,400	313.200,00	0,31
1,8750 % Nationale-Niederlanden Bank NV EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	A3K5D7		EUR	200			% 93,230	186.460,00	0,18

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,0670 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28)	A3K81M		EUR	200			% 102,259	204.518,00	0,20
4,1250 % NBN Co Ltd. EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LE6R		EUR	200			% 103,820	207.640,00	0,20
0,7500 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/36)	A3KW75		EUR	300			% 72,805	218.415,00	0,21
3,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	A3K66V		EUR	200			% 101,250	202.500,00	0,20
0,2500 % NIBC Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KVYN		EUR	300			% 93,970	281.910,00	0,28
2,8750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-Pfbr.v.24(2031)	NLB4Y3		EUR	300			% 100,200	300.600,00	0,30
7,1250 % Nova Ljubljanska Banka d.d. EO-FLR Pref. Nts 2023(26/27)	A3LKGM		EUR	200			% 105,221	210.442,00	0,21
2,3750 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	A3K5N4		EUR	300			% 94,614	283.842,00	0,28
3,6250 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LEU1		EUR	200			% 100,686	201.372,00	0,20
3,7500 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LEU2		EUR	200			% 101,608	203.216,00	0,20
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LGQG		EUR	500			% 101,820	509.100,00	0,50
4,1250 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Preferred Med.-T.Nts 22(25)	A3K81Y		EUR	200			% 100,580	201.160,00	0,20
5,6250 % Rumänien EO-Med.-Term Nts 2024(36)Reg.S	A3LU3C		EUR	200			% 98,310	196.620,00	0,19
3,7500 % S-Pankki Oyj EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(28)	A3LNS6		EUR	200			% 103,520	207.040,00	0,20
4,8750 % SBAB Bank AB (publ) EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	A3LKGC		EUR	200			% 100,809	201.618,00	0,20
1,8750 % SBAB Bank AB (publ) EO-Preferred MTN 2022(25)	A3K6HP		EUR	200			% 98,396	196.792,00	0,19
4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 2022(26)	A3LA5R		EUR	200			% 101,468	202.936,00	0,20
3,5000 % Slovenská Sporitelna AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 22(28)	A3K90M		EUR	200			% 101,350	202.700,00	0,20
3,6250 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2023(33)	A3LCWG		EUR	600			% 105,217	631.302,00	0,62
0,7500 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 2019(36)	A2R4MT		EUR	500			% 74,750	373.750,00	0,37
3,1250 % SNCF S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3LAW2		EUR	300			% 100,440	301.320,00	0,30
5,2500 % Société Générale S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/32)	A3K84C		EUR	300			% 103,324	309.971,56	0,30
1,0000 % Spanien EO-Bonos 2021(42)	A3KV2K		EUR	300			% 67,000	201.000,00	0,20
4,8750 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Non-Pref. Med.-T.Nts 23(28)	A3LMBU		EUR	300			% 105,450	316.350,00	0,31
2,0000 % Svensk Exportkredit, AB EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K63X		EUR	300			% 98,040	294.120,00	0,29
5,6180 % TDC Net A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LDQA		EUR	300			% 105,060	315.178,50	0,31
5,1860 % TDC Net A/S EO-Medium-Term Nts 2024(24/29)	A3LX1N		EUR	200	200		% 103,769	207.538,00	0,20
3,6980 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2024(24/32)	A3LTN3		EUR	300			% 100,812	302.436,00	0,30

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
2,3760 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	A3KLMN		EUR	400		% 90,627	362.508,00	0,36
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	A28Z9P		EUR	200		% 97,760	195.520,00	0,19
1,6250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/26)	A3K48X		EUR	200		% 96,315	192.630,00	0,19
2,8750 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2024(28)	A3LS1T		EUR	200		% 99,970	199.940,00	0,20
5,8500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3LBDE		EUR	300		% 105,270	315.810,00	0,31
1,7500 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K5NK		EUR	300		% 91,940	275.820,00	0,27
4,2500 % V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/29)	A3LEVN		EUR	200		% 98,370	196.740,00	0,19
0,9000 % Verbund AG EO- Notes 2021(21/41)	A3KNZ9		EUR	300		% 66,607	199.821,00	0,20
4,1250 % Zypern, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LGGM		EUR	300		% 107,999	323.996,82	0,32
5,5000 % Abu Dhabi Commercial Bank DL-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LM4G		USD	200		% 103,594	187.178,97	0,18
4,0500 % American Express Co. DL-Notes 2022(29/29)	A3K47Q		USD	200		% 99,636	180.027,10	0,18
3,1250 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2018(28)	A2RR9D		USD	145		% 97,470	127.682,69	0,13
3,3750 % Asian Infrastruct.Invest.Bank DL-Medium-Term Notes 22(25)	A3K612		USD	300		% 99,038	268.419,11	0,26
3,5000 % BNG Bank N.V. DL-Med.-Term Nts 2023(28)Reg.S	A3LHYU		USD	300		% 98,653	267.376,46	0,26
1,3750 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. DL-Med.-T.Nts 2021(31) Reg.S	A287TH		USD	200		% 85,017	153.613,44	0,15
1,2500 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. DL-Med.-Term Nts 2021(26)Reg.S	A3KX3N		USD	200		% 94,220	170.241,21	0,17
5,4310 % EI Sukuk Company Ltd. DL-Medium-Term Nts 2024(29)	A3LZAQ		USD	200	200	% 103,050	186.196,36	0,18
2,3750 % European Investment Bank DL-Bonds 2017(27)	A19HOE		USD	300		% 96,160	260.620,19	0,26
1,7500 % Henkel AG & Co. KGaA DL-Med. Term Nts. v.21(21/26)	A3MQMB		USD	200		% 93,806	169.492,85	0,17
2,1250 % International Bank Rec. Dev. DL-Medium-Term Notes 2015(25)	A1ZXG1		USD	400		% 98,688	356.627,63	0,35
1,3750 % International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2021(28)	A3KPR8		USD	500		% 91,774	414.554,72	0,41
1,2500 % International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2021(31)	A3KLLS		USD	200		% 84,989	153.561,77	0,15
1,0000 % Intl.Fin.Fac.for Immunisation DL-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KPVS		USD	200		% 94,827	171.337,79	0,17
5,3570 % KODIT Global 2024-1 Co. Ltd. DL-Bonds 2024(27) Reg.S	A3LZFA		USD	200	200	% 102,170	184.605,66	0,18
2,0000 % Landesbank Baden-Württemberg DL-MTN-Pfandbr.S.828 v.22(25)	LB2ZTL		USD	300		% 98,559	267.121,25	0,26
5,6309 % New Development Bank DL-FLR Med.-Term Nts 2021(24)	A3KZU8		USD	200		% 99,825	180.368,60	0,18
5,1250 % New Development Bank DL-Medium-Term Notes 2023(26)	A3LG3K		USD	300		% 100,200	271.569,25	0,27

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	3.682.451,78	3,61
Verzinsliche Wertpapiere									
0,3750 % Action Logement Services SAS EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KW10		EUR	300			% 83,286	249.858,00	0,25
3,6250 % Amprion GmbH MTN v. 2024 (2031/2031)	A383BP		EUR	200	200		% 101,230	202.460,00	0,20
2,1250 % Development Bank of Japan EO-Medium-Term Notes 2022(26)	A3K8VT		EUR	200			% 98,590	197.180,00	0,19
3,9760 % East Japan Railway Co. EO-Medium-Term Notes 2023(32)	A3LMP1		EUR	200			% 105,152	210.304,00	0,21
5,2500 % FCC Serv.Medio Ambiente Hld.SA EO-Notes 2023(23/29)	A3LQGF		EUR	200			% 107,500	215.000,00	0,21
3,4570 % Federat.caisses Desjard Quebec EO-Medium-Term Notes 2024(29)	A3L28K		EUR	200	200		% 100,541	201.082,00	0,20
0,6250 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV EO-Notes 2021(21/32) Reg.S	A3KVZV		EUR	300			% 81,690	245.070,00	0,24
2,1250 % National Australia Bank Ltd. EO-Medium-Term Nts 2022(28)	A3K5XA		EUR	300			% 96,931	290.793,00	0,29
4,8750 % REWE International Finance BV EO-Notes 2023(23/30)	A3LM2K		EUR	200			% 106,392	212.784,00	0,21
2,6250 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2022(29)	A3K8VF		EUR	200			% 98,380	196.760,00	0,19
4,8750 % Abu Dhabi Future Energy Comp. DL-Medium-Term Notes 2024(29)	A3L1XY		USD	300	600	300	% 100,436	272.209,32	0,27
2,2500 % General Mills Inc. DL-Notes 2021(21/31)	A3KXB7		USD	300			% 85,814	232.579,28	0,23
2,2710 % Honda Motor Co. Ltd. DL-Notes 2022(22/25)	A3K29A		USD	200			% 98,528	178.025,12	0,17
1,4000 % ING Groep N.V. DL-FLR Notes 2020(25/26) Reg.S	A28ZD1		USD	200			% 97,037	175.330,67	0,17
4,7500 % Intl.Fin.Fac.for Immunisation DL-Medium-Term Notes 2022(25)	A3LAXD		USD	300			% 100,281	271.788,63	0,27
2,6250 % Pfizer Inc. DL-Notes 2020(20/30)	A28VAY		USD	200			% 91,786	165.843,35	0,16
0,7500 % VISA Inc. DL-Notes 2020(20/27)	A2807T		USD	200			% 91,532	165.384,41	0,16
Investmentanteile							EUR	59.512.172,00	58,41
KVG-eigene Investmentanteile									
LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	A2N67X		ANT	40.000			EUR 181,530	7.261.200,00	7,13
Gruppenfremde Investmentanteile									
Algebris UCITS Fd.-Al.Fin.Equ. Regist. Shs. B EUR Acc. o.N.	A2DVGQ		ANT	5.000	5.000		EUR 237,790	1.188.950,00	1,17
BNP P.E.ESG Eur.Bid.Lead.PAB Act.Nom. U.ETF EUR Acc. oN	A3DT3F		ANT	420.000			EUR 13,332	5.599.440,00	5,50
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.Ldrs Namens-Ant. UCITS ETF CAP o.N.	A2PHCA		ANT	320.000			EUR 19,053	6.096.896,00	5,98
Br.Mil.Cap.UC.-BMC GIBI Sel.Fd Act.Nom. 4 EUR Acc. oN	A3EWTX		ANT	35.000	35.000		EUR 108,140	3.784.900,00	3,72
InvescoM2-IQS Global Eq ETF Registered Acc.Shs USD o.N.	A2PHJT		ANT	60.000	60.000		EUR 68,760	4.125.600,00	4,05

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
L&G-L&G Clean Water UCITS ETF Registered Shares o.N.	A2PM52		ANT	385.000			EUR 16,518	6.359.430,00	6,24
Rob.Cap.Gr-Rob.G.Gender Equal. Act. Nom. I EUR Acc. oN	A2QD2H		ANT	10.100			EUR 254,750	2.572.975,00	2,53
TBF SMART POWER Inhaber-Anteile EUR I	A2AQZX		ANT	50.000			EUR 73,600	3.680.000,00	3,61
UI I-Montrusco Bol.Glbl Eq.Fd Act. Nom. IX EUR Acc. oN	A3CTNT		ANT	33.000		17.500	EUR 133,240	4.396.920,00	4,32
UI I-Montrusco Bolton US Eq.Fd Act.Nom. IX A EUR Acc. oN	A3EBOX		ANT	37.000	6.000		EUR 121,430	4.492.910,00	4,41
Xtr.(IE)-MSCI World ESG Registered Shares 1C o.N.	A2AQST		ANT	80.000	80.000		EUR 38,160	3.052.800,00	3,00
Xtr.IE-USA Biodv.Foc.SRI U.ETF Reg.Shs 1C USD Acc. oN	DBX0UN		ANT	25.000	25.000		EUR 33,635	840.875,00	0,83
Xtr.IE-Wld Biodv.Foc.SRI U.ETF Reg.Shs 1C USD Acc. oN	DBX0UK		ANT	25.000	25.000		EUR 44,560	1.114.000,00	1,09
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. C USD Acc. oN	A2PNKQ		ANT	30.000			USD 182,464	4.945.276,00	4,85
Summe Wertpapiervermögen							EUR	91.650.847,12	89,96
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	9.877.348,53	9,70
Bankguthaben							EUR	9.877.348,53	9,70
EUR-Guthaben bei:									
HSBC Continental Europe S.A.,Germany (Düsseldorf)			EUR	3.532.481,72			% 100,000	3.532.481,72	3,47
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			USD	7.023.133,07			% 100,000	6.344.866,81	6,23
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	446.774,98	0,44
Zinsansprüche			EUR	446.774,98				446.774,98	0,44
Sonstige Verbindlichkeiten *)							EUR	-95.268,27	-0,09
Fondsvermögen							EUR	101.879.702,36	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	59,23	
Umlaufende Anteile							STK	1.720.139	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.08.2024		
US-Dollar	(USD)	1,1069000	=	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					
4,5000 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 317 v.22(25)	AAR035	EUR		300	
4,2500 % Permanent TSB Group Hldgs PLC EO-FLR Med.-Term Nts 24(29/30)	A3LW3S	EUR	300	300	
4,1250 % Sydbank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 24(26/27)	A3LZHM	EUR	400	400	
Nicht notierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,3750 % Kommuninvest i Sverige AB DL-Medium-Term Nts 21(24)Reg.S	A3KM09	USD		500	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
ASSENAGON Green Economy Act. Nom. I2 EUR Acc. oN	A3C505	ANT		2.000	
BNP PARIBAS EASY-E.GI.E.B.Eco. Act. au Port. UE EUR Acc. oN	A2QCJJ	ANT		250.000	
H.C.F.HC Bos.Com.GI.Eq.Imp. Reg. Shs Founder EUR Dis. oN	A2QRYB	ANT		17.000	
Wellingt.M.Fds Ir.-W.GI.Impact Regist.Acc.Shs S USD Unh.o.N.	A2DGFF	ANT		165.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): EURO-BUND)					
		EUR			1.299,01

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	59,23
Umlaufende Anteile	STK	1.720.139

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Verantwortung für die Anteilwertermittlung obliegt der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH (im Folgenden: Gesellschaft) unter Kontrolle der Verwahrstelle auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände wird von der Gesellschaft selbst durchgeführt. Unter Vermögensgegenständen versteht die Gesellschaft im Folgenden Wertpapiere, Optionen, Finanzterminkontrakte, Devisentermingeschäfte und Swaps.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, erfolgt grundsätzlich zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Vermögensgegenstände, für welche die Kursstellung auf der Grundlage von Geld- und Briefkursen erfolgt, werden grundsätzlich zum Geldkurs („Bid“) bewertet.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte. Die Gesellschaft nutzt zur Ermittlung der Verkehrswerte grundsätzlich externe Bewertungsmodelle. Die Verkehrswerte können auch von einem Emittenten, Kontrahenten oder sonstigen Dritten ermittelt und mitgeteilt werden.

Die Gesellschaft bewertet Investmentanteile mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis oder mit einem aktuellen Kurs. Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit ihrem Nominalbetrag, die Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Vermögensgegenstände in ausländischer Währung werden zu den von WM-Company (17.00 Uhr) bereitgestellten Devisenkursen des Tages der Preisberechnung in Euro umgerechnet.

Stuttgart

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

30070 [4] 10/2024 55 25 % Altpapier

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