

LB≡BW Asset Management

LBBW Renten Short Term
Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 30.09.2021

Inhalt

Vermögensübersicht zum 30.09.2021	8
Vermögensaufstellung zum 30.09.2021	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	16
Übersicht Anteilklassen	18
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	19

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 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 Renten Short Term Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 30.09.2021

Vermögensübersicht zum 30.09.2021

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	369.929.790,66	100,67
1. Anleihen	350.735.927,12	95,44
Bundesrep. Deutschland	89.491.307,78	24,35
Frankreich	42.969.187,00	11,69
USA	30.487.614,70	8,30
Italien	29.597.935,00	8,05
Dänemark	22.873.495,00	6,22
Spanien	19.194.736,00	5,22
Großbritannien	16.941.690,00	4,61
Niederlande	11.317.001,00	3,08
Luxemburg	11.211.302,70	3,05
Jersey	9.975.100,00	2,71
Intern. Investitionsbk	8.968.950,00	2,44
Canada	8.376.374,00	2,28
Schweiz	6.697.615,00	1,82
Schweden	6.498.112,50	1,77
Andean Development Corp.	6.021.750,00	1,64
Guernsey	5.079.500,00	1,38
Portugal	5.048.850,00	1,37
Irland	4.173.480,00	1,14
Rumänien	3.909.200,00	1,06
Slowakei	3.747.526,44	1,02
Australien	3.031.200,00	0,82
Norwegen	2.077.600,00	0,57
Estland	2.023.800,00	0,55
Island	1.022.600,00	0,28
2. Derivate	-145.983,08	-0,04
3. Schuldscheindarlehen	5.004.236,94	1,36
Portugal	5.004.236,94	1,36
4. Bankguthaben	12.867.215,68	3,50
5. Sonstige Vermögensgegenstände	1.468.394,00	0,40
II. Verbindlichkeiten	-2.450.410,45	-0,67
III. Fondsvermögen	367.479.380,21	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	350.735.927,12	95,44
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	325.030.880,42	88,45
Verzinsliche Wertpapiere									
0,3750 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 278 v.19(24)	A2E4CQ		EUR	5.000	3.000		% 101,340	5.067.000,00	1,38
0,3750 % Achmea Bank N.V. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(24)	A19SM8		EUR	2.100	2.100		% 101,864	2.139.144,00	0,58
1,9500 % American Honda Finance Corp. EO-Med.-T.Nts 2020(20/24)Ser.A	A28V99		EUR	4.000	2.500		% 106,386	4.255.440,00	1,16
1,0000 % Apple Inc. EO-Notes 2014(14/22)	A1ZR66		EUR	1.226	1.226		% 101,595	1.245.554,70	0,34
0,8750 % Apple Inc. EO-Notes 2017(17/25)	A19HY4		EUR	3.000	3.000		% 103,744	3.112.320,00	0,85
1,5000 % Aroundtown SA EO-Notes 2016(16/24)	A1839S		EUR	5.000	5.000		% 104,350	5.217.500,00	1,42
2,4000 % AT & T Inc. EO-Notes 2014(14/24)	A1ZKLS		EUR	3.000	3.000		% 105,590	3.167.700,00	0,86
1,7500 % Banco de Sabadell S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R1SN		EUR	7.000	6.000		% 103,350	7.234.500,00	1,97
0,1370 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(26)	A288JJ		EUR	500	500		% 100,945	504.725,00	0,14
0,4520 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(24/25)	A3KRJM		EUR	2.000	5.000	3.000	% 101,745	2.034.900,00	0,55
0,7500 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(17/23)	BA0AG8		EUR	3.000	3.000		% 101,910	3.057.300,00	0,83
0,0000 % Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2021(21/23)	A3KU40		EUR	5.500	5.500		% 100,320	5.517.600,00	1,50
0,1250 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(22)	A2R3EZ		EUR	3.000			% 100,487	3.014.610,00	0,82
2,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(25)	BP457Q		EUR	3.000	3.000		% 107,485	3.224.550,00	0,88
1,5000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(25)	PB1KT9		EUR	3.000	3.000		% 105,951	3.178.530,00	0,86
1,0000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	PB1K0D		EUR	3.000	3.000		% 103,050	3.091.500,00	0,84
0,6250 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R301		EUR	5.000	5.000		% 101,998	5.099.900,00	1,39
1,1250 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2016(16/23)	A18YV4		EUR	500	500		% 102,030	510.150,00	0,14
1,0000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	A19KH4		EUR	6.000	6.000		% 102,611	6.156.660,00	1,68
0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.12(23) *****)	103054		EUR	22.000	22.000		% 103,790	25.287.748,49	6,88
0,1250 % Caixa Económica Montepio Geral EO-Med.-Term Obr. Hip.2019(24)	A2SAAT		EUR	5.000	1.000		% 100,977	5.048.850,00	1,37
1,7500 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	A2RTBL		EUR	3.000	3.000		% 103,806	3.114.180,00	0,85
0,8750 % Caixabank S.A. EO-Preferred Bonos 2019(24)	A2RZQE		EUR	4.500	4.500		% 102,512	4.613.040,00	1,26
0,3750 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25)	A28R49		EUR	2.000	2.000		% 101,225	2.024.500,00	0,55
2,5000 % Capgemini SE EO-Notes 2015(15/23)	A1Z3RG		EUR	4.000	4.000		% 104,165	4.166.600,00	1,13
0,6250 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/25)	A28YX9		EUR	1.600			% 102,521	1.640.336,00	0,45

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,3970 % Cassa Depositi e Prestiti SpA EO-FLR Med.-Term Nts 2019(26)	A2R3L1		EUR	3.000	3.000		% 106,070	3.182.100,00	0,87
0,7500 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)	A18782		EUR	5.000	5.000		% 101,825	5.091.250,00	1,39
0,6250 % Commerzbank AG MTN-IHS S.928 v.19(24)	CZ40N0		EUR	5.000	5.000		% 101,995	5.099.750,00	1,39
0,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.939 v.19(24)	CZ45VB		EUR	1.000			% 100,578	1.005.780,00	0,27
0,1000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.973 v.21(25)	CBOHRY		EUR	3.000			% 100,131	3.003.930,00	0,82
0,0000 % Continental AG MTN v.19(23/23)Reg.S	A2YPE5		EUR	1.000			% 100,335	1.003.350,00	0,27
0,3750 % Continental AG MTN v.19(25/25)	A2YPAE		EUR	700			% 101,044	707.308,00	0,19
0,7500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	A19471		EUR	3.100	3.100		% 101,987	3.161.597,00	0,86
0,5000 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2017(22)	A1988Y		EUR	3.000	3.000		% 100,240	3.007.200,00	0,82
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KLA2		EUR	3.000			% 100,485	3.014.550,00	0,82
1,2500 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Non-Preferred Nts 2017(24)	A19H8T		EUR	4.000	4.000		% 103,415	4.136.600,00	1,13
0,4540 % Credit Suisse Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	A287LY		EUR	1.500		1.500	% 101,341	1.520.115,00	0,41
0,9850 % CS Group Funding (GG) Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 2015(22)	A1Z953		EUR	5.000	5.000		% 101,590	5.079.500,00	1,38
0,2500 % Danmarks Skibskredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2019(22)	A2RZUT		EUR	1.000			% 100,693	1.006.930,00	0,27
0,0000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25)	A3KRXH		EUR	1.000	1.000		% 100,440	1.004.400,00	0,27
0,5000 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref.MTN 19(24/25)	A2R6X4		EUR	3.000	3.000		% 101,080	3.032.400,00	0,83
0,8750 % Danske Bank AS EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	A1904D		EUR	4.000	4.000		% 101,660	4.066.400,00	1,11
0,3960 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.15(25)	DB7XKH		EUR	4.000	4.000		% 99,510	3.980.400,00	1,08
0,0500 % Deutsche Bank AG Struct.Cov.Bond v.2019(2024)	DL19U1		EUR	1.200	1.200		% 100,651	1.207.812,00	0,33
0,6250 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2016(21)	A19AQG		EUR	1.700	1.100		% 100,223	1.703.791,00	0,46
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	GRN001		EUR	7.700	7.200		% 102,360	7.881.720,00	2,14
2,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2024/2024)	A3E5X5		EUR	2.000	2.000		% 101,810	2.036.200,00	0,55
2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2025/2025)	A3H240		EUR	3.000	1.500		% 103,088	3.092.640,00	0,84
0,7500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35304 v.19(23)	A2LQNQ		EUR	1.800			% 101,220	1.821.960,00	0,50
0,8750 % Elering A.S. EO-Bonds 2018(18/23)	A190AW		EUR	2.000			% 101,190	2.023.800,00	0,55
0,0100 % Equitable Bank EO-Med.-Term Cov. Bds 2021(24)	A3KV73		EUR	7.500	7.500		% 100,738	7.555.350,00	2,06
0,0100 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(23/24)	A3KQKA		EUR	3.000	3.000		% 100,185	3.005.550,00	0,82
3,0000 % HSBC Holdings PLC EO-Medium-Term Notes 2015(25)	A1Z3RC		EUR	2.000	2.000		% 110,158	2.203.160,00	0,60

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,7500 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/23)	A3E44U		EUR	1.000			% 101,552	1.015.520,00	0,28
1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Mortg.Cov.MTN 2015(23)	A1Z9GA		EUR	1.500			% 101,889	1.528.335,00	0,42
0,1190 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(24)	A288KE		EUR	9.000	4.000		% 99,655	8.968.950,00	2,44
0,6250 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2020(26)	A28X37		EUR	1.000	1.000		% 102,260	1.022.600,00	0,28
2,1250 % ISS Global A/S EO-Med.-Term Notes 2014(14/24)	A1ZS18		EUR	1.000	1.000		% 106,045	1.060.450,00	0,29
1,3750 % Johnson Controls Internat. PLC EO-Notes 2016(17/25)	A19BCD		EUR	4.000	4.000		% 104,337	4.173.480,00	1,14
0,2500 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/23)	A28W3W		EUR	1.200	1.200		% 100,877	1.210.524,00	0,33
0,1250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24)	HLB2P2		EUR	1.800			% 101,260	1.822.680,00	0,50
0,5000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/25)	A2R99B		EUR	2.000	2.000		% 101,410	2.028.200,00	0,55
0,2500 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/25)	A2R4FH		EUR	1.500	1.500		% 101,320	1.519.800,00	0,41
0,1250 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KSMY		EUR	2.000	2.000		% 99,561	1.991.220,00	0,54
0,0500 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 20(25)	A28SJM		EUR	500	500		% 100,684	503.420,00	0,14
0,1370 % Norddeutsche Landesbank -GZ- FLR-MTN-Inh.Schv.v.18(23)	NLB2UU		EUR	4.000			% 100,378	4.015.120,00	1,09
1,5000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Inh.-Schv. v.2016(2026)	NLB854		EUR	2.000	2.000		% 102,250	2.045.000,00	0,56
0,4570 % Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(24)	A3KNS1		EUR	9.000	9.000		% 101,340	9.120.600,00	2,48
0,2500 % Nykredit Realkredit A/S EO-Medium-Term Notes 2019(23)	A2SA04		EUR	2.000			% 100,667	2.013.340,00	0,55
1,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24)	A2RWEV		EUR	1.100			% 103,471	1.138.181,00	0,31
2,6250 % Orsted A/S EO-Medium-Term Notes 2012(22)	A0VND3		EUR	2.500	500		% 102,935	2.573.375,00	0,70
0,6250 % PSA Banque France S.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/24)	A2R3WH		EUR	5.000	3.000		% 101,675	5.083.750,00	1,38
0,0000 % PSA Banque France S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25)	A287TD		EUR	2.200			% 99,958	2.199.076,00	0,60
0,0000 % Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2021(21/25)	A3KPS1		EUR	3.000	3.000		% 100,055	3.001.650,00	0,82
1,7500 % Rumänien EO-Med.-Term Nts 2021(30)Reg.S	A3KTZA		EUR	4.000	4.000		% 97,730	3.909.200,00	1,06
0,3070 % Santander UK Group Hldgs PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2018(23/24)	A19YE9		EUR	2.000			% 100,905	2.018.100,00	0,55
4,0000 % Société Générale S.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23)	A1HLVP		EUR	2.000	2.000		% 106,761	2.135.220,00	0,58
0,2500 % Société Générale S.A. EO-Preferred MTN 2021(27)	A3KTTH		EUR	2.000	2.000		% 99,770	1.995.400,00	0,54
1,1250 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2017(17/25)	A19EWG		EUR	2.000	1.500		% 103,880	2.077.600,00	0,57
1,1250 % Telecom Italia S.p.A. EO-Obbl. Conv. 2015(22)	A1ZY9F		EUR	13.500	10.700		% 100,300	13.540.500,00	3,68
3,8750 % Telia Company AB EO-Medium-Term Notes 2010(25)	A1A1TH		EUR	5.625	5.625		% 115,522	6.498.112,50	1,77

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,1250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2019(25)	A2R5K9		EUR	7.000	7.000		% 100,780	7.054.600,00	1,92
0,2500 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2R0C8		EUR	3.000	3.000		% 101,040	3.031.200,00	0,82
1,5000 % UBS Group AG EO-Notes 2016(23/24)	A189UP		EUR	5.000	5.000		% 103,550	5.177.500,00	1,41
1,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/25)	A190KM		EUR	3.000	3.000		% 104,234	3.127.020,00	0,85
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	A28VTN		EUR	500			% 107,520	537.600,00	0,15
6,9500 % UniCredit S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2012(22)	A1HBVX		EUR	4.000	4.000		% 107,310	4.292.400,00	1,17
0,5000 % Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 2016(24)	A18635		EUR	2.000			% 101,710	2.034.200,00	0,55
0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/24)	A3E5MF		EUR	5.000	5.000		% 100,250	5.012.500,00	1,36
0,3750 % Vseobecna úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2017(22)	A19PB2		EUR	1.000			% 100,587	1.005.870,00	0,27
0,5000 % Vseobecna úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2018(23)	A1917U		EUR	2.700	2.700		% 101,543	2.741.656,44	0,75
Commerzbank AG 0-Kp-Li-Anl.T.46v.96(20.11.26)	181578		ITL	7.000.000	7.000.000		% 95,335	3.446.549,29	0,94

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere **EUR** **25.239.856,70** **6,87**

Verzinsliche Wertpapiere

0,0580 % ASIF III (Jersey) Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 2004(24)	A0D3W6		EUR	10.000	10.000		% 99,751	9.975.100,00	2,71
0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	A255C2		EUR	2.000	1.300		% 100,179	2.003.580,00	0,55
0,2000 % Deutsche Bank AG, London Br. Festzinsanl. v.2020(2026)	DL8Y3N		EUR	5.000	5.000		% 100,280	5.014.000,00	1,36
1,0000 % Evonik Industries AG Medium Term Notes v.15(22/23)	A14J1H		EUR	500			% 101,294	506.470,00	0,14
0,5000 % Knorr-Bremse AG Medium Term Notes v.16(16/21)	A2DARP		EUR	1.000			% 100,074	1.000.740,00	0,27
1,1250 % Knorr-Bremse AG Medium Term Notes v.18(25/25)	A2LQP5		EUR	700			% 104,100	728.700,00	0,20
3,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr.Anleihe v.15(25)	HLB2DM		EUR	500	500		% 105,850	529.250,00	0,14
0,5000 % Ontario Teachers Finance Trust EO-Notes 2020(25) Reg.S	A28WUY		EUR	800	800		% 102,628	821.024,00	0,22
1,3750 % Tyco International Fin. S.A. EO-Notes 2015(15/25)	A1ZXLQ		EUR	3.955	3.955		% 100,394	3.970.582,70	1,08
2,1250 % Wüstenrot & Württembergische AG FLR-Nachr.-Anl. v.21(31/41)	A3E5VS		EUR	700	700		% 98,630	690.410,00	0,19

Nicht notierte Wertpapiere **EUR** **465.190,00** **0,13**

Verzinsliche Wertpapiere

3,5380 % VPV Lebensversicherungs-AG FLR-Nachr.-Anl. v.06(16/26)	A0KAHT		EUR	500			% 93,038	465.190,00	0,13
--	--------	--	-----	-----	--	--	----------	------------	------

Summe Wertpapiervermögen **EUR** **350.735.927,12** **95,44**

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Schuldscheindarlehen							EUR	5.004.236,94	1,36
0,0000 % Metropolitan de Lisboa SSD EUR 04/24	ODE00074		EUR	5.000	5.000		% 100,085	5.004.236,94	1,36
Derivate							EUR	-145.983,08	-0,04
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate							EUR	120.940,00	0,03
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
Euro Bund Future 08.12.21		185	EUR	-10.000				120.940,00	0,03
Devisen-Derivate							EUR	1.557,44	0,00
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Devisen									
Call USD/CNH 6,55 19.10.21		OTC	USD	5.000				1.557,44	0,00
Swaps							EUR	-498.995,41	-0,14
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Credit Default Swaps									
Protection Buyer									
iTraxx Europe Crossover Ser.35 Index (5 Year) 5% 22.03.2021/20.06.2026 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.000				-588.877,46	-0,16
SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) 1% 14.08.2021/20.06.2023 BNP Paribas S.A.		OTC	JPY	1.300.000				89.882,05	0,02
Optionsrechte auf Swaps							EUR	230.514,89	0,06
Swaption.Pay. 0,517 % EUR /gg.6mth EURIBOR. 01.12.21		OTC	STK	10.000.000				214.750,20	0,06
SwaptPAY.ITR.XOS35.201021.BNP		OTC	STK	5.000.000				15.764,69	0,00
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	12.867.215,68	3,50
Bankguthaben							EUR	12.867.215,68	3,50
EUR-Guthaben bei:									
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	12.867.215,68			% 100,000	12.867.215,68	3,50
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.468.394,00	0,40
Zinsansprüche			EUR	1.468.394,00				1.468.394,00	0,40
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-2.391.205,86	-0,65
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			GBP	-2.001.870,00			% 100,000	-2.328.974,46	-0,63
			JPY	-3.528.346,00			% 100,000	-27.285,98	-0,01
			USD	-40.500,00			% 100,000	-34.945,42	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten *)			EUR	-59.204,59				-59.204,59	-0,02
Fondsvermögen							EUR	367.479.380,21	100,00 ¹⁾

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I									
Fondsvermögen							EUR	231.731.707,55	63,06
Anteilwert							EUR	100,24	
Umlaufende Anteile							STK	2.311.848	
LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R									
Fondsvermögen							EUR	135.747.672,66	36,94
Anteilwert							EUR	40,09	
Umlaufende Anteile							STK	3.386.317	

^{*)} Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwarentgelte, Kostenpauschale

^{****)} Bei diesen Wertpapieren wurde der Kurswert durch einen Inflationskoeffizienten beeinflusst.

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.09.2021	=	
Britische Pfund	(GBP)	0,8595500	=	1 Euro (EUR)
Italienische Lire	(ITL)	1936,2700000	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	129,3098500	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,1589500	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185 Eurex Deutschland

c) OTC

Over-the-Counter

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

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,0000 % ACEA S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/25)	A288DW	EUR		3.000	
0,3500 % Bayerische Landesbank Pfandbr. v.15(22)	BLB6JA	EUR		2.000	
0,6250 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23)	A2RXDQ	EUR	500	500	
0,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(26/27)	BP45SW	EUR	3.000	3.000	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.20(22)	110480	EUR	8.000	18.000	
0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.14(30)	103055	EUR	5.000	5.000	
1,0000 % Cellnex Finance Company S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/27)	A3KVSS	EUR	3.000	3.000	
0,8750 % CEZ AS EO-Medium-Term Nts 2018(22/22)	A2RUF1	EUR		3.100	
0,3750 % CK Hutchison Grp Tele.Fin. SA EO-Notes 2019(23/23)	A2R88D	EUR	3.000	3.000	
1,8260 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2015(25)	A1ZW67	EUR		500	
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(28)	A3KWCF	EUR	20.000	20.000	
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KSXE	EUR	30.000	30.000	
0,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KT6A	EUR	15.000	15.000	
0,2500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(36)	A3KP2Z	EUR	8.000	8.000	
0,4500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(41)	A3KT6B	EUR	35.000	35.000	
0,7500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(47)	A3KRJR	EUR	8.000	8.000	
0,7000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2021(51)	A3KTGW	EUR	17.000	17.000	
0,8750 % Fortum Oyj EO-Medium-Term Nts 2019(19/23)	A2RYDJ	EUR	2.500	2.500	
0,2500 % Frankreich EO-Infl.Index-Lkd OAT 2013(24)	A1HGEZ	EUR		1.500	
0,4530 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2021(23/24)	A3KQKB	EUR	3.000	3.000	
0,1250 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2019(24)	A19NPG	EUR		1.000	
0,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfandbr.16(23)	A18Y74	EUR		1.000	
0,5500 % Irland EO-Treasury Bonds 2021(41)	A3KPSZ	EUR	7.000	7.000	
0,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2020(24)	A2833A	EUR	3.000	3.000	
0,2500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(28)	A287ZA	EUR	5.000	5.000	
0,9500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(31)	A3KSHU	EUR	5.000	5.000	
2,1500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2021(72)	A3KPKQ	EUR	10.000	10.000	
0,6250 % Korea Development Bank, The EO-Medium-Term Notes 2018(23)	A193C9	EUR		1.000	
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.21(31)	A3E5G6	EUR	15.000	15.000	
0,0000 % Niederlande EO-Anl. 2021(31)	A3KLR1	EUR	7.250	7.250	
0,6000 % Nordrhein-Westfalen, Land Med.T.LSA v.21(41) Reihe 1521	NRW0MZ	EUR	5.000	5.000	
0,2500 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(36)	A3KWFB	EUR	20.000	20.000	
0,7000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(71)	A3KPSK	EUR	3.000	3.000	
0,3000 % Portugal, Republik EO-Obr. 2021(31)	A3KPH6	EUR	1.000	1.000	
1,7500 % Rheinland-Pfalz, Land Landessch.v.2012 (2022)	RLP035	EUR		1.000	
0,0000 % Santander Consumer Finance SA EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KL47	EUR		500	
0,5000 % Spanien EO-Bonos 2021(31)	A3KS64	EUR	5.000	5.000	
1,0000 % Spanien EO-Bonos 2021(42)	A3KV2K	EUR	30.000	30.000	
2,0000 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2014(14/25)	A1ZSQW	EUR	3.000	3.000	
0,0500 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 20(20/25)	A28UXB	EUR	2.500	2.500	
5,3750 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 2004(24)	A0BA7Q	EUR	2.233	2.233	
2,8750 % Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2013(2025)	A1TNBV	EUR	3.000	3.000	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	A3KM1G	EUR		3.100	
0,0000 % CCEP Finance (Ireland) DAC EO-Notes 2021(21/25)	A3KP3T	EUR	3.000	3.000	
2,0000 % Kraft Heinz Foods Co. EO-Notes 2015(15/23)	A1Z3Q8	EUR	1.000	1.000	

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Nicht notierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,1370 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Prf. MTN 21(26)Tr.2	A3KMEQ	EUR		500	
0,6250 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2016(2021)	GRN000	EUR		500	
Schuldscheindarlehen					
4,0000 % CIF Euromortgage SSD EUR 09/21	ODE00073	EUR	5.000	5.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Zinsterminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-BOBL, EURO-BUND)					
		EUR			190.684,91
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
GBP/EUR					
		EUR			2.298
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Zins-Derivate					
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Verkaufsoptionen:					
(Basiswert(e): Euro Bund Future 08.12.21)					
		EUR			38,28
Verkaufte Kaufoptionen:					
(Basiswert(e): Bobl Future 08.09.21, Bobl Future 08.12.21, Euro Bund Future 08.09.21, Euro Bund Future 08.12.21)					
		EUR			99,43
Verkaufte Verkaufsoptionen:					
(Basiswert(e): Bobl Future 08.09.21, Bobl Future 08.12.21, Euro Bund Future 08.09.21)					
		EUR			54,00

Übersicht Anteilklassen

Anteil- klasse	Ertrags- verwendung	Zielgruppe	Ausgabeaufschlag		Verwaltungsvergütung		Mindest- anlage- summe EUR	Fonds währung
			Bis-zu- Satz in %	tatsächl. Satz in %	Bis-zu- Satz in % p. a.	tatsächl. Satz in % p. a.		
I	ausschüttend	Institutionelle Anleger	3,00	---	1,20	0,05	50.000	EUR
R	ausschüttend	Privatanleger und Institutionelle Anleger	3,00	---	1,20	0,10	---	EUR

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I

Anteilwert	EUR	100,24
Umlaufende Anteile	STK	2.311.848

LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R

Anteilwert	EUR	40,09
Umlaufende Anteile	STK	3.386.317

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. Oktober 2021

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

30060 [3] 10/2021 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
info@LBBW-AM.de