

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:



LIGA Stiftungsfonds

HALBJAHRESBERICHT

ZUM 29. FEBRUAR 2024

VERWAHRSTELLE:



BERATUNG UND VERTRIEB:



Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensübersicht zum 29.02.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	101.863.325,81	100,25
1. Aktien	26.432.323,30	26,01
Bundesrep. Deutschland	3.701.873,00	3,64
Canada	650.046,89	0,64
Finnland	146.677,50	0,14
Frankreich	5.901.919,05	5,81
Großbritannien	709.643,60	0,70
Irland	1.242.616,67	1,22
Italien	253.540,00	0,25
Jersey	443.352,43	0,44
Niederlande	1.089.172,00	1,07
Österreich	513.324,00	0,51
Schweiz	544.238,21	0,54
USA	11.235.919,95	11,06
2. Anleihen	70.896.654,58	69,77
< 1 Jahr	12.332.977,00	12,14
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	23.656.304,80	23,28
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	14.678.719,15	14,45
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	15.032.291,74	14,79
>= 10 Jahre	5.196.361,89	5,11
3. Bankguthaben	4.030.980,56	3,97
4. Sonstige Vermögensgegenstände	503.367,37	0,50
II. Verbindlichkeiten	-253.375,59	-0,25
III. Fondsvermögen	101.609.950,22	100,00

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	97.328.977,88	95,79
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	86.913.852,84	85,54
Aktien							EUR	26.432.323,30	26,01
BCE Inc. Registered Shares new o.N.	CA05534B7604		STK	4.590	0	0 CAD	50,360	157.525,15	0,16
Royal Bank of Canada Registered Shares o.N.	CA7800871021		STK	2.760	0	0 CAD	131,800	247.899,69	0,24
Sun Life Financial Inc. Registered Shares o.N.	CA8667961053		STK	4.980	0	0 CAD	72,080	244.622,05	0,24
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	CH0038863350		STK	3.800	0	0 CHF	91,760	366.038,21	0,36
Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO0,5	NL0013267909		STK	4.300	0	0 EUR	67,340	289.562,00	0,28
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008404005		STK	1.000	0	0 EUR	253,850	253.850,00	0,25
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	FR0000120628		STK	12.000	0	0 EUR	32,880	394.560,00	0,39
BASF SE Namens-Aktien o.N.	DE000BASF111		STK	3.000	0	0 EUR	47,075	141.225,00	0,14
Bayerische Motoren Werke AG Vorzugsaktien o.St. EO 1	DE0005190037		STK	2.400	0	0 EUR	101,300	243.120,00	0,24
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	FR0000131104		STK	3.000	0	0 EUR	55,380	166.140,00	0,16
Brenntag SE Namens-Aktien o.N.	DE000A1DAH0		STK	6.300	0	0 EUR	84,380	531.594,00	0,52
Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4	FR0000125007		STK	9.600	0	0 EUR	71,200	683.520,00	0,67
Danone S.A. Actions Port. EO-,25	FR0000120644		STK	9.800	0	0 EUR	59,020	578.396,00	0,57
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	DE0005552004		STK	13.600	0	0 EUR	42,910	583.576,00	0,57
DSM-Firmenich AG Namens-Aktien EO -,01	CH1216478797		STK	1.800	0	0 EUR	99,000	178.200,00	0,18
Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N.	FR0000052292		STK	330	0	0 EUR	2.313,000	763.290,00	0,75
ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01	NL0011821202		STK	37.000	0	0 EUR	12,690	469.530,00	0,46
K+S AG	DE000KSAG888		STK	14.000	0	0 EUR	12,900	180.600,00	0,18
Kering S.A. Actions Port. EO 4	FR0000121485		STK	581	0	0 EUR	425,050	246.954,05	0,24
Klépierre S.A. Actions Port. EO 1,40	FR0000121964		STK	6.000	0	0 EUR	23,480	140.880,00	0,14
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	FR0000120321		STK	1.320	0	0 EUR	441,700	583.044,00	0,57
LEG Immobilien SE Namens-Aktien o.N.	DE000LEG1110		STK	2.600	0	0 EUR	68,020	176.852,00	0,17
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	DE0008430026		STK	2.090	0	0 EUR	430,400	899.536,00	0,89
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	NL0010773842		STK	8.000	0	0 EUR	41,260	330.080,00	0,32
Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06	FI0009000681		STK	45.000	0	0 EUR	3,260	146.677,50	0,14
OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	AT0000743059		STK	12.600	0	0 EUR	40,740	513.324,00	0,51
Orange S.A. Actions Port. EO 4	FR0000133308		STK	40.000	0	0 EUR	10,606	424.240,00	0,42
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	DE0007164600		STK	4.000	0	0 EUR	172,880	691.520,00	0,68
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	FR0000121972		STK	4.500	0	0 EUR	209,800	944.100,00	0,93
Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001	IE00B1RR8406		STK	13.630	0	0 EUR	39,430	537.430,90	0,53

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -,22	IT0003242622		STK	35.000	0	0 EUR	7,244	253.540,00	0,25
Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-,05	FR0013326246		STK	5.000	0	0 EUR	67,580	337.900,00	0,33
Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5	FR0000124141		STK	22.300	0	0 EUR	28,650	638.895,00	0,63
Burberry Group PLC Registered Shares LS-,0005	GB0031743007		STK	12.000	0	0 GBP	12,850	180.308,70	0,18
Ferguson PLC Reg.Shares LS 0,1	JE00BJVNSS43		STK	2.300	0	0 GBP	164,850	443.352,43	0,44
Mondi PLC Registered Shares EO -,22	GB00BMWC6P49		STK	6.363	6.364	1 GBP	14,085	104.797,54	0,10
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	GB00B10RZP78		STK	9.390	0	0 GBP	38,665	424.537,36	0,42
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	US02079K3059		STK	6.400	0	0 USD	138,460	818.987,06	0,81
Amazon.com Inc. Registered Shares DL -,01	US0231351067		STK	4.000	0	0 USD	176,760	653.456,56	0,64
Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001	US0311621009		STK	1.852	0	0 USD	273,830	468.699,78	0,46
Apple Inc. Registered Shares o.N.	US0378331005		STK	4.000	0	0 USD	180,750	668.207,02	0,66
AT & T Inc. Registered Shares DL 1	US00206R1023		STK	15.000	0	0 USD	16,930	234.704,25	0,23
CBRE Group Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	US12504L1098		STK	5.388	0	0 USD	91,890	457.581,63	0,45
Cisco Systems Inc. Registered Shares DL-,001	US17275R1023		STK	6.000	0	0 USD	48,370	268.225,51	0,26
Coca-Cola Co., The Registered Shares DL -,25	US1912161007		STK	8.500	0	0 USD	60,020	471.506,47	0,46
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	US0367521038		STK	1.000	0	0 USD	501,250	463.262,48	0,46
General Mills Inc. Registered Shares DL -,10	US3703341046		STK	7.250	0	0 USD	64,180	430.041,59	0,42
Gilead Sciences Inc. Registered Shares DL -,001	US3755581036		STK	6.313	0	0 USD	72,100	420.672,18	0,41
Hilton Worldwide Holdings Inc. Registered Shares DL -,01	US43300A2033		STK	4.400	0	0 USD	204,320	830.876,16	0,82
Linde plc Registered Shares EO -,001	IE000S9YS762		STK	1.700	0	0 USD	448,830	705.185,77	0,69
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	US5949181045		STK	2.140	0	0 USD	413,640	818.104,99	0,81
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	US68389X1054		STK	6.000	0	0 USD	111,680	619.297,60	0,61
Stryker Corp. Registered Shares DL -,10	US8636671013		STK	1.800	0	0 USD	349,070	580.707,95	0,57
Synopsys Inc. Registered Shares DL -,01	US8716071076		STK	1.900	0	0 USD	573,730	1.007.474,12	0,99
Texas Instruments Inc. Registered Shares DL 1	US8825081040		STK	2.500	0	0 USD	167,330	386.622,00	0,38
U.S. Bancorp Registered Shares DL -,01	US9029733048		STK	3.600	0	0 USD	41,960	139.608,13	0,14
United Parcel Service Inc. Reg. Shares Class B DL -,01	US9113121068		STK	2.500	0	0 USD	148,260	342.560,07	0,34
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	US92826C8394		STK	2.400	0	0 USD	282,640	626.927,91	0,62
Xylem Inc. Registered Shares DL -,01	US98419M1009		STK	4.500	0	0 USD	127,050	528.396,49	0,52

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	60.481.529,54	59,52
1,1250 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/28)	XS2055651918		EUR	400	0	0 %	90,269	361.076,00	0,36
4,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34)	XS2557084733		EUR	500	0	0 %	105,308	526.540,00	0,52
0,9500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2019(27)	ES0200002048		EUR	400	0	0 %	93,064	372.256,00	0,37
0,5500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2020(30)	ES0200002055		EUR	1.000	0	0 %	84,243	842.430,00	0,83
0,2500 % AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/26)	XS2051361264		EUR	1.200	0	0 %	93,767	1.125.204,00	1,11
3,0500 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(24)	XS2550897651		EUR	2.000	0	0 %	99,476	1.989.520,00	1,96
1,0000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(24)	XS1910245676		EUR	800	0	0 %	98,155	785.240,00	0,77
1,3750 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(26)	XS2013574038		EUR	1.000	0	0 %	94,584	945.840,00	0,93
0,6250 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/25)	FR0013519048		EUR	500	0	0 %	96,154	480.770,00	0,47
1,1250 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/30)	FR0013519071		EUR	1.000	0	0 %	87,149	871.490,00	0,86
0,7500 % Commerzbank AG FLR-MTN Ser.965 v.20(25/26)	DE000CB0HRQ9		EUR	1.500	0	0 %	96,459	1.446.885,00	1,42
1,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 22(22/25)	XS2517103250		EUR	1.500	0	0 %	97,061	1.455.915,00	1,43
1,1250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2018(25)	XS1770927629		EUR	1.000	0	0 %	97,290	972.900,00	0,96
0,6250 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(26)	IT0005316788		EUR	300	0	0 %	94,716	284.148,00	0,28
0,6250 % Crédit Agricole Publ.Sect.SCF EO-Med.Term Obl.Fonc. 2019(29)	FR0013411600		EUR	1.000	0	0 %	88,530	885.300,00	0,87
4,8750 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2023(29/30)	XS2592240712		EUR	1.000	0	0 %	103,770	1.037.700,00	1,02
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	DE000GRN0016		EUR	400	0	0 %	98,003	392.012,00	0,39
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	DE000A30WVF1		EUR	1.000	0	0 %	92,725	927.250,00	0,91
0,1250 % Euronext N.V. EO-Notes 2021(21/26)	DK0030485271		EUR	1.000	0	0 %	92,609	926.090,00	0,91
0,5000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2017(25)	EU000A1G0DV6		EUR	2.000	0	0 %	96,384	1.927.680,00	1,90
2,2500 % Eutelsat S.A. EO-Bonds 2019(19/27)	FR0013422623		EUR	400	0	0 %	74,154	296.616,00	0,29
0,4500 % General Mills Inc. EO-Notes 2020(20/26)	XS2100788780		EUR	1.000	0	0 %	94,362	943.620,00	0,93
2,2500 % Heidelberg Materials AG Medium Term Notes v.16(16/24)	XS1425274484		EUR	800	0	0 %	99,582	796.656,00	0,78
2,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(25/26)	XS2483607474		EUR	1.000	0	0 %	97,843	978.430,00	0,96
4,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30)	XS2625196352		EUR	500	0	0 %	105,044	525.220,00	0,52
4,0000 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2023(23/43)	XS2583742668		EUR	1.000	0	0 %	101,315	1.013.150,00	1,00
1,2500 % Intl. Distributions Svcs. PLC EO-Notes 2019(19/26)	XS2063268754		EUR	600	0	0 %	93,073	558.438,00	0,55
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2005(37)	IT0003934657		EUR	1.000	0	0 %	100,344	1.003.440,00	0,99
3,2500 % K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.2018 (2024/2024)	XS1854830889		EUR	200	0	0 %	99,641	199.282,00	0,20
0,8750 % Kon. KPN N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/33)	XS2406890066		EUR	1.000	0	0 %	78,045	780.450,00	0,77
5,6250 % Kon. KPN N.V. EO-Medium-Term Notes 2009(24)	XS0454773713		EUR	800	0	0 %	100,938	807.504,00	0,79
0,0100 % Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2020(25)Reg.S	XS2100269088		EUR	1.000	0	0 %	96,456	964.560,00	0,95
0,2580 % Korea Housing Fin.Corp. EO-Mortg.Cov.Bds 2021(28)Reg.S	XS2388377827		EUR	1.000	0	0 %	86,900	869.000,00	0,86
3,0000 % Kroatien, Republik EO-Notes 2015(25)	XS1117298916		EUR	300	0	0 %	99,374	298.122,00	0,29

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 811 v.19(27)	DE000LB2CNE0		EUR	1.000	0	0 %	87,057	870.570,00	0,86
3,5000 % Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(28)	XS2576364371		EUR	800	0	0 %	101,270	810.160,00	0,80
3,5000 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)	XS2765498717		EUR	1.000	1.000	0 %	98,336	983.360,00	0,97
1,7500 % London Stock Exchange Group PLC EO-Med.-Term Notes 2018(27/27)	XS1918000107		EUR	500	0	0 %	94,588	472.940,00	0,47
0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/28)	XS2238789460		EUR	1.500	0	0 %	87,464	1.311.960,00	1,29
0,6250 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(25)	NL0013019375		EUR	1.000	0	0 %	95,703	957.030,00	0,94
1,0000 % NIBC Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(28)	XS1877512258		EUR	1.000	0	0 %	90,958	909.580,00	0,90
0,0100 % NIBC Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2019(29)	XS2065698834		EUR	500	0	0 %	84,013	420.065,00	0,41
0,2500 % NIBC Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2384734542		EUR	1.500	0	0 %	91,289	1.369.335,00	1,35
1,4420 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2015(27)	XS1263007350		EUR	2.000	0	0 %	94,138	1.882.760,00	1,85
0,5000 % Nordic Investment Bank EO-Med.-Term Nts 2018(25)	XS1815070633		EUR	170	0	0 %	95,634	162.577,80	0,16
0,7500 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2020(27)	DK0009526998		EUR	1.500	0	0 %	91,571	1.373.565,00	1,35
4,2500 % Polen, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(43)	XS2586944147		EUR	400	0	0 %	101,743	406.972,00	0,40
0,5000 % Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2021(21/32)	XS2296204444		EUR	1.000	0	0 %	77,361	773.610,00	0,76
0,0100 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 20(27)	XS2104915207		EUR	2.000	0	0 %	90,898	1.817.960,00	1,79
2,0000 % Rumänien EO-Med.-Term Nts 2019(26)Reg.S	XS1934867547		EUR	700	0	0 %	94,578	662.046,00	0,65
2,8750 % Rumänien EO-Medium-Term Notes 2014(24)	XS1129788524		EUR	300	0	0 %	99,247	297.741,00	0,29
3,0000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(33/33)	XS2526839506		EUR	600	600	0 %	97,157	582.942,00	0,57
3,2500 % Slovenská Sporitelna AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 23(26)	SK4000022398		EUR	1.000	0	0 %	99,165	991.650,00	0,98
0,8750 % Snam S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	XS1505573482		EUR	400	0	0 %	93,498	373.992,00	0,37
2,6250 % SPP Infrastructure Fing B.V. EO-Notes 2015(25)	XS1185941850		EUR	500	0	0 %	97,237	486.185,00	0,48
0,0100 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2021(31)	XS2312584779		EUR	1.500	0	0 %	80,314	1.204.710,00	1,19
0,1250 % Stadshypotek AB EO-Med.-T. Hyp.-Pfandbr.16(26)	XS1499574991		EUR	600	0	0 %	92,233	553.398,00	0,54
1,6250 % Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2017(26/27)	XS1693281617		EUR	400	0	0 %	94,231	376.924,00	0,37
0,8500 % Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2020(27/28)	XS2102360315		EUR	1.000	0	0 %	91,453	914.530,00	0,90
0,2500 % Stryker Corp. EO-Notes 2019(19/24)	XS2087622069		EUR	900	0	0 %	97,329	875.961,00	0,86
1,8750 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. EO-Med.-Term Nts 17(17/24)	XS1571293684		EUR	400	0	0 %	100,000	400.000,00	0,39
0,5000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2017(24)	XS1588284056		EUR	800	0	0 %	99,727	797.816,00	0,79
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	XS2508690612		EUR	1.200	0	0 %	97,482	1.169.784,00	1,15
0,5000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(24)	XS1403014936		EUR	1.000	0	0 %	99,500	995.000,00	0,98
1,2500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/31)	XS2450200741		EUR	500	0	0 %	87,763	438.815,00	0,43
0,0100 % United Overseas Bank Ltd. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 20(27)	XS2264978623		EUR	2.000	0	0 %	88,378	1.767.560,00	1,74
0,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/29)	XS2320759538		EUR	800	0	0 %	85,826	686.608,00	0,68

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,2500 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/28)	DE000A3MP4U9		EUR	1.500	0	0 %	84,729	1.270.935,00	1,25
0,0100 % Yorkshire Building Society EO-Med.-Term Cov. Bds 2021(28)	XS2406578059		EUR	1.200	0	0 %	85,754	1.029.048,00	1,01
1,7500 % Norwegen, Königreich NK-Anl. 2019(29)	NO0010844079		NOK	10.000	0	0 %	90,150	786.066,18	0,77
3,7500 % European Investment Bank DL-Notes 2023(33)	US298785JV96		USD	800	0	0 %	95,573	706.639,56	0,70
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	9.087.525,04	8,94
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	9.087.525,04	8,94
1,8750 % American International Grp Inc EO-Notes 2017(17/27)	XS1627602201		EUR	639	0	361 %	94,185	601.842,15	0,59
1,1250 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC EO-Notes 2019(19/29)	XS1981054221		EUR	800	0	0 %	89,099	712.792,00	0,70
0,2000 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC EO-Notes 2020(20/28)	XS2264977146		EUR	450	0	0 %	85,824	386.208,00	0,38
0,6970 % Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2019(19/25)	XS1996269061		EUR	500	0	0 %	96,531	482.655,00	0,48
0,9000 % Harley Davidson Finl Serv.Inc. EO-Notes 2019(19/24)	XS2075185228		EUR	800	0	0 %	97,911	783.288,00	0,77
3,7500 % Metropolitan Life Global Fdg I EO-Medium-Term Notes 2022(30)	XS2561748711		EUR	1.000	0	0 %	101,248	1.012.480,00	1,00
0,3390 % Mitsubishi UFJ Finl Grp Inc. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	XS2028899727		EUR	800	0	0 %	98,664	789.312,00	0,78
1,7500 % Nasdaq Inc. EO-Notes 2019(19/29)	XS1843442622		EUR	500	0	0 %	91,295	456.475,00	0,45
0,8750 % Nasdaq Inc. EO-Notes 2020(20/30)	XS2010032881		EUR	100	0	0 %	85,469	85.469,00	0,08
0,0000 % Quebec, Provinz EO-Medium-Term Notes 2020(30)	XS2250201329		EUR	1.000	0	0 %	81,878	818.780,00	0,81
2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1849518276		EUR	1.000	0	0 %	98,200	982.000,00	0,97
0,2670 % Sumitomo Mitsui Banking Corp. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 19(26)	XS2008801297		EUR	500	0	0 %	92,384	461.920,00	0,45
0,4090 % Sumitomo Mitsui Banking Corp. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 19(29)	XS2066652897		EUR	500	0	0 %	84,178	420.890,00	0,41
0,5000 % Whirlpool EMEA Finance S.à r.l EO-Notes 2020(20/28)	XS2115092954		EUR	200	0	0 %	87,377	174.754,00	0,17
1,9000 % Alphabet Inc. DL-Notes 2020(20/40)	US02079KAE73		USD	1.500	1.500	0 %	66,266	918.659,89	0,90
Nichtnotierte Wertpapiere							EUR	1.327.600,00	1,31
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	1.327.600,00	1,31
0,0100 % LIGA Bank eG Regensburg Öff.Pfandbrief Ser.5 v.21(36)	DE000A3H2VG3		EUR	2.000	0	0 %	66,380	1.327.600,00	1,31
Summe Wertpapiervermögen							EUR	97.328.977,88	95,79

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	4.030.980,56	3,97	
Bankguthaben							EUR	4.030.980,56	3,97	
EUR - Guthaben bei:										
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	659.478,95			%	100,000	659.478,95	0,65
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:										
Landesbank Baden-Württemberg			NOK	6.789.966,50			%	100,000	592.053,58	0,58
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:										
Landesbank Baden-Württemberg			CAD	183.159,86			%	100,000	124.819,31	0,12
Landesbank Baden-Württemberg			CHF	282.748,28			%	100,000	296.817,43	0,29
Landesbank Baden-Württemberg			GBP	253.982,83			%	100,000	296.986,47	0,29
Landesbank Baden-Württemberg			USD	2.229.812,46			%	100,000	2.060.824,82	2,03
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	503.367,37	0,50	
Zinsansprüche			EUR	455.689,30					455.689,30	0,45
Dividendenansprüche			EUR	14.907,38					14.907,38	0,01
Quellensteueransprüche			EUR	38.287,22					38.287,22	0,04
Sonstige Forderungen			EUR	-5.516,53					-5.516,53	-0,01
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-253.375,59	-0,25	
Verwaltungsvergütung			EUR	-223.405,65					-223.405,65	-0,22
Verwahrstellenvergütung			EUR	-16.969,94					-16.969,94	-0,02
Prüfungskosten			EUR	-12.000,00					-12.000,00	-0,01
Veröffentlichungskosten			EUR	-1.000,00					-1.000,00	0,00
Fondsvermögen							EUR	101.609.950,22	100,00 1)	

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Vermögensaufstellung zum 29.02.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
LIGA Stiftungsfonds AK S									
Anteilwert							EUR	95,85	
Ausgabepreis							EUR	98,73	
Rücknahmepreis							EUR	95,85	
Anzahl Anteile							STK	515.912	
LIGA Stiftungsfonds AK P									
Anteilwert							EUR	94,53	
Ausgabepreis							EUR	97,37	
Rücknahmepreis							EUR	94,53	
Anzahl Anteile							STK	149.730	
LIGA Stiftungsfonds AK SI									
Anteilwert							EUR	96,37	
Ausgabepreis							EUR	97,82	
Rücknahmepreis							EUR	96,37	
Anzahl Anteile							STK	394.360	

Fußnoten:

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

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.02.2024	
CAD	(CAD)	1,4674000	= 1 EUR (EUR)
CHF	(CHF)	0,9526000	= 1 EUR (EUR)
GBP	(GBP)	0,8552000	= 1 EUR (EUR)
NOK	(NOK)	11,4685000	= 1 EUR (EUR)
USD	(USD)	1,0820000	= 1 EUR (EUR)

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Nichtnotierte Wertpapiere *)					
Aktien					
Mondi PLC Registered Shares EO -,20	GB00B1CRLC47	STK	0	7.000	
Verzinsliche Wertpapiere					
0,1250 % ANZ New Zealand (Intl) Ltd. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2016(23)	XS1492834806	EUR	0	800	
2,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.2019 (2024)	US500769HX53	USD	0	2.000	
0,5500 % Sumitomo Mitsui Banking Corp. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 18(23)	XS1899009705	EUR	0	800	

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

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

**Halbjahresbericht
LIGA Stiftungsfonds**

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Anteilklasse	Mindestanlagesumme in Währung	Ausgabeaufschlag bis zu 3,00%, derzeit (Angabe in %)	Verwaltungsvergütung bis zu 1,500% p.a., derzeit (Angabe in % p.a.)	Ertragsverwendung	Währung
LIGA Stiftungsfonds AK S	keine	3,00	0,950	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR
LIGA Stiftungsfonds AK P	keine	3,00	1,300	Ausschüttung mit Zwischenausschüttung	EUR
LIGA Stiftungsfonds AK SI	keine	1,50	0,670	Ausschüttung ohne Zwischenausschüttung	EUR

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	95,79
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

LIGA Stiftungsfonds AK S

Anteilwert	EUR	95,85
Ausgabepreis	EUR	98,73
Rücknahmepreis	EUR	95,85
Anzahl Anteile	STK	515.912

LIGA Stiftungsfonds AK P

Anteilwert	EUR	94,53
Ausgabepreis	EUR	97,37
Rücknahmepreis	EUR	94,53
Anzahl Anteile	STK	149.730

LIGA Stiftungsfonds AK SI

Anteilwert	EUR	96,37
Ausgabepreis	EUR	97,82
Rücknahmepreis	EUR	96,37
Anzahl Anteile	STK	394.360

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

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

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

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

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

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

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

Frankfurt am Main, den 1. März 2024

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Die Geschäftsführung

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Anteilklassen im Überblick

Erstausgabedatum

Anteilklasse S*	18. September 2018
Anteilklasse P	2. Mai 2019
Anteilklasse SI*	15. März 2019

Erstausgabepreise

Anteilklasse S	€ 100,- zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse P	€ 100,- zzgl. Ausgabeaufschlag
Anteilklasse SI	€ 100,- zzgl. Ausgabeaufschlag

Ausgabeaufschlag

Anteilklasse S	3,00%
Anteilklasse P	3,00%
Anteilklasse SI	1,50%

Mindestanlagesumme

Anteilklasse S	keine
Anteilklasse P	keine
Anteilklasse SI	keine

Verwaltungsvergütung

Anteilklasse S	0,95 % p.a.
Anteilklasse P	1,30 % p.a.
Anteilklasse SI	0,67 % p.a.

Verwahrstellenvergütung

Anteilklasse S	0,045 % p.a.
Anteilklasse P	0,045 % p.a.
Anteilklasse SI	0,045 % p.a.

Währung

Anteilklasse S	EUR
Anteilklasse P	EUR
Anteilklasse SI	EUR

Ertragsverwendung

Anteilklasse S	ausschüttend
Anteilklasse P	ausschüttend
Anteilklasse SI	ausschüttend

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

Anteilklasse S	A2JF78 / DE000A2JF782
Anteilklasse P	A2JF79 / DE000A2JF790
Anteilklasse SI	A2PB55 / DE000A2PB556

*nur erwerbbar von steuerbegünstigten Anlegern im Sinne von § 5 Abs. 2 der Besonderen Anlagebedingungen

Halbjahresbericht LIGA Stiftungsfonds

Kurzübersicht über die Partner

1. Kapitalverwaltungsgesellschaft

Universal-Investment-Gesellschaft mbH

Hausanschrift:

Theodor-Heuss-Allee 70
60486 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Postfach 17 05 48
60079 Frankfurt am Main

Telefon: 069 / 710 43-0
Telefax: 069 / 710 43-700
www.universal-investment.com

Gründung: 1968
Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EUR 10.400.000,–
Eigenmittel: EUR 71.352.000,00 (Stand: Oktober 2022)

Geschäftsführer:

David Blumer, Schaan
Frank Eggloff, München
Mathias Heiß, Langen
Katja Müller, Bad Homburg v. d. Höhe
Axel Vespermann, Dreieich

Aufsichtsrat:

Prof. Dr. Harald Wiedmann (Vorsitzender), Berlin
Dr. Axel Eckhardt, Düsseldorf
Ellen Engelhardt, Glauburg
Daniel Fischer, Bad Vilbel
Janet Zirlewagen, Wehrheim

2. Verwahrstelle

Landesbank Baden-Württemberg

Hausanschrift:

Am Hauptbahnhof 2
70173 Stuttgart

Postanschrift:

Postfach 10 60 49
70049 Stuttgart

Telefon: 0711 / 1 27-0
Telefax: 0711 / 1 27-435 44
www.lbbw.de

Rechtsform: Anstalt des öffentlichen Rechts
Haftendes Eigenkapital: € Mio 14.197 (Stand: 31.12.2021)

3. Beratungsgesellschaft und Vertrieb

LIGA Bank eG

Postanschrift:

Dr.-Theobald-Schrems-Straße 3
93055 Regensburg

Telefon 0941 4095-0
Telefax 0941 4095-139
www.ligabank.de