

**LB≡BW Asset Management**

**RW Rentenstrategie**

**Halbjahresbericht zum 30.06.2024**



# Inhalt

|  |    |
|--|----|
| Vermögensübersicht zum 30.06.2024  | 8  |
| Vermögensaufstellung zum 30.06.2024  | 9  |
| Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,<br>soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen | 14 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV  | 15 |



**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](http://www.LBBW-AM.de) und in der überregionalen Tagespresse.

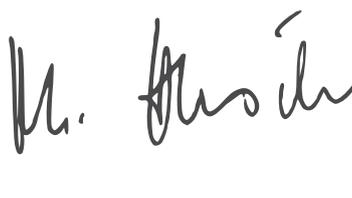
Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH  
Geschäftsführung



Uwe Adamla  
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz  
(Stellv. Vorsitzender)



Michael Hünseler

Ulrike Modersohn



# RW Rentenstrategie

## Halbjahresbericht zum 30.06.2024

## Vermögensübersicht zum 30.06.2024

| Anlageschwerpunkte                       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>           | <b>50.452.059,27</b> | <b>100,08</b>        |
| <b>1. Anleihen</b>                       | <b>43.708.234,02</b> | <b>86,71</b>         |
| Bundesrep. Deutschland                   | 20.895.308,27        | 41,45                |
| Niederlande                              | 9.092.758,92         | 18,04                |
| Großbritannien                           | 2.841.920,00         | 5,64                 |
| USA                                      | 2.039.022,00         | 4,04                 |
| Frankreich                               | 1.530.611,23         | 3,04                 |
| Italien                                  | 1.513.262,60         | 3,00                 |
| Luxemburg                                | 1.461.190,00         | 2,90                 |
| Österreich                               | 1.314.990,00         | 2,61                 |
| Belgien                                  | 1.211.847,00         | 2,40                 |
| Irland                                   | 598.170,00           | 1,19                 |
| Schweden                                 | 457.394,00           | 0,91                 |
| Spanien                                  | 303.750,00           | 0,60                 |
| Australien                               | 284.190,00           | 0,56                 |
| Dänemark                                 | 163.820,00           | 0,32                 |
| <b>2. Sonstige Forderungswertpapiere</b> | <b>911.089,16</b>    | <b>1,81</b>          |
| <b>3. Investmentanteile</b>              | <b>3.098.668,00</b>  | <b>6,15</b>          |
| <b>4. Bankguthaben</b>                   | <b>2.330.256,42</b>  | <b>4,62</b>          |
| <b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>  | <b>403.811,67</b>    | <b>0,80</b>          |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>             | <b>-42.752,82</b>    | <b>-0,08</b>         |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                | <b>50.409.306,45</b> | <b>100,00</b>        |

# Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2024 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens |
|---|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--|------------|----------------------|----------------------|
| <b>Bestandspositionen</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |  | <b>EUR</b> | <b>47.717.991,18</b> | <b>94,66</b>         |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>                                       |        |       |                                       |                    |                                     |  | <b>EUR</b> | <b>35.804.610,62</b> | <b>71,03</b>         |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |  |            |                      |                      |
| 0,7500 % A.P.Moeller-Maersk A/S<br>EO-Medium-Term Nts 2021(21/31)         | A3KZE3 |       | EUR                                   | 200                |                                     |  | % 81,910   | 163.820,00           | 0,32                 |
| 4,8510 % Allianz SE<br>FLR-Sub.Anl.v.2024(2034/2054)                      | A3823H |       | EUR                                   | 1.000              | 1.000                               |  | % 102,480  | 1.024.800,00         | 2,03                 |
| 1,7000 % Altria Group Inc.<br>EO-Notes 2019(19/25)                        | A2RX06 |       | EUR                                   | 250                |                                     |  | % 98,080   | 245.200,00           | 0,49                 |
| 0,2500 % BASF SE<br>MTN v.2020(2020/2027)                                 | A289DC |       | EUR                                   | 700                |                                     |  | % 91,850   | 642.950,00           | 1,28                 |
| 1,3750 % Bayer AG<br>EO-Anleihe v.20(20/32)                               | A289QH |       | EUR                                   | 500                |                                     |  | % 81,170   | 405.850,00           | 0,81                 |
| 1,0000 % Bayer AG<br>EO-Anleihe v.21(21/36)                               | A3H3EX |       | EUR                                   | 500                |                                     |  | % 70,170   | 350.850,00           | 0,70                 |
| 3,1250 % Bayer AG<br>FLR-Sub.Anl.v.2019(2027/2079)                        | A255C9 |       | EUR                                   | 500                |                                     |  | % 90,880   | 454.400,00           | 0,90                 |
| 7,0000 % Bayer AG<br>FLR-Sub.Anl.v.2023(2031/2083)                        | A3514X |       | EUR                                   | 300                |                                     |  | % 103,330  | 309.990,00           | 0,61                 |
| 3,2500 % BP Capital Markets PLC<br>EO-FLR Notes 2020(26/Und.)             | A28Y0X |       | EUR                                   | 2.500              | 1.300                               |  | % 97,680   | 2.442.000,00         | 4,84                 |
| 5,1250 % British Telecommunications PLC<br>EO-FLR Med.-T. Nts 2024(29/54) | A3LWSU |       | EUR                                   | 400                | 400                                 |  | % 99,980   | 399.920,00           | 0,79                 |
| 0,1000 % Bundesrep.Deutschland<br>Inflationsindex. Anl.v.15(26) ****)     | 103056 |       | EUR                                   | 2.200              |                                     |  | % 97,620   | 2.710.987,45         | 5,38                 |
| 1,0000 % Danone S.A.<br>EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.)                    | A3KV4A |       | EUR                                   | 200                |                                     |  | % 92,586   | 185.171,23           | 0,37                 |
| 4,1250 % Deutsche Bank AG<br>FLR-MTN v.24(29/30)                          | A3829D |       | EUR                                   | 500                | 500                                 |  | % 99,461   | 497.305,00           | 0,99                 |
| 4,3820 % Deutsche Lufthansa AG<br>FLR-Sub.Anl.v.2015(2021/2075)           | A161YP |       | EUR                                   | 400                |                                     |  | % 98,510   | 394.040,00           | 0,78                 |
| 2,0000 % Deutsche Lufthansa AG<br>Wandelanleihe v.20(25)                  | A3H2UK |       | EUR                                   | 1.600              | 1.000                               |  | % 97,921   | 1.566.736,00         | 3,11                 |
| 1,2500 % Deutsche Post AG<br>Medium Term Notes v.16(26/26)                | A2AASL |       | EUR                                   | 200                |                                     |  | % 96,725   | 193.450,00           | 0,38                 |
| 0,0500 % Deutsche Post AG<br>Wandelschuldv.v.17(25)                       | A2G87D |       | EUR                                   | 1.000              | 1.000                               |  | % 96,236   | 962.360,00           | 1,91                 |
| 5,2500 % EnBW Energie Baden-Württem. AG<br>FLR-Anleihe v.24(24/84)        | A35117 |       | EUR                                   | 300                | 300                                 |  | % 102,630  | 307.890,00           | 0,61                 |
| 6,3750 % ENEL S.p.A.<br>EO-FLR Nts. 2023(23/Und.)                         | A3LC1N |       | EUR                                   | 350                |                                     |  | % 105,390  | 368.865,00           | 0,73                 |
| 4,7500 % ENEL S.p.A.<br>EO-FLR Nts. 2024(24/Und.)                         | A3LU4B |       | EUR                                   | 800                | 800                                 |  | % 99,475   | 795.800,00           | 1,58                 |
| 0,3750 % Engie S.A.<br>EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)                     | A3KX6B |       | EUR                                   | 400                |                                     |  | % 84,940   | 339.760,00           | 0,67                 |
| 0,5000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A.<br>EO-Notes 20(20/31) Reg.S        | A285HR |       | EUR                                   | 1.000              |                                     |  | % 80,290   | 802.900,00           | 1,59                 |
| 4,8710 % Iberdrola Finanzas S.A.<br>EO-FLR M.-T. Nts 2024(24/Und.)        | A3LTAK |       | EUR                                   | 300                | 300                                 |  | % 101,250  | 303.750,00           | 0,60                 |
| 1,6250 % Infineon Technologies AG<br>Medium Term Notes v.20(20/29)        | A3E44W |       | EUR                                   | 800                |                                     |  | % 92,020   | 736.160,00           | 1,46                 |
| 2,8750 % Infineon Technologies AG<br>Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)           | A2YN1H |       | EUR                                   | 400                |                                     |  | % 98,470   | 393.880,00           | 0,78                 |
| 3,6250 % Infineon Technologies AG<br>Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)           | A2YN1J |       | EUR                                   | 1.000              |                                     |  | % 96,760   | 967.600,00           | 1,92                 |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

| Gattungsbezeichnung  | WKN    | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.06.2024 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs      | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|--|--------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 3,8750 % ING Groep N.V.<br>EO-FLR Med.-T. Nts 2024(28/29)                | A3LUDU |       | EUR   | 100                   | 100                                       |                       | % 100,390 | 100.390,00         | 0,20                         |
| 5,0000 % ING Groep N.V.<br>EO-FLR Med.T.Nts 23(29/35)                    | A3LEFN |       | EUR   | 400                   |   |                       | % 102,500 | 410.000,00         | 0,81                         |
| 3,6500 % Medtronic Inc.<br>EO-Notes 2024(24/29)                          | A3LZRN |       | EUR   | 400                   | 400                                       |                       | % 101,110 | 404.440,00         | 0,80                         |
| 3,0000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V.<br>EO-Medium-Term Notes 2024(27)    | A3LSYG |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 99,024  | 297.072,00         | 0,59                         |
| 4,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG<br>FLR-Anleihe v.24(33/44)          | A383PL |       | EUR   | 800                   | 800                                       |                       | % 98,422  | 787.376,00         | 1,56                         |
| 1,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG<br>FLR-Nachr.-Anl. v.20(30/41)      | A289EQ |       | EUR   | 200                   |   |                       | % 83,350  | 166.700,00         | 0,33                         |
| 1,0000 % Münchener Rückvers.-Ges. AG<br>FLR-Nachr.-Anl. v.21(31/42)      | A3E5WY |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 79,676  | 398.380,00         | 0,79                         |
| 6,2500 % OMV AG<br>EO-FLR Notes 2015(25/Und.)                            | A1Z6ZR |       | EUR   | 800                   |   |                       | % 102,330 | 818.640,00         | 1,62                         |
| 2,0310 % Prosus N.V.<br>EO-Med.-T.Nts 2020(20/32)Reg.S                   | A280T8 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 81,160  | 405.800,00         | 0,81                         |
| RAG-Stiftung<br>Umtauschanl. v.18(02.10.24)                              | A2LQRA |       | EUR   | 2.300                 |   |                       | % 98,863  | 2.273.849,00       | 4,51                         |
| 0,5000 % RWE AG<br>Medium Term Notes v.21(28/28)                         | A3MP70 |       | EUR   | 400                   |   |                       | % 88,558  | 354.232,00         | 0,70                         |
| 4,2200 % Sandoz Finance B.V.<br>EO-Notes 2023(23/30)                     | A3LQ01 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 102,394 | 511.970,00         | 1,02                         |
| 0,2500 % Securitas AB<br>EO-Med.-T. Nts 21(27/28) Reg.S                  | A3KL3W |       | EUR   | 200                   |   |                       | % 89,227  | 178.454,00         | 0,35                         |
| 3,1250 % Siemens Finan.maatschappij NV<br>EO-Med.-Term Nts 2024(32/32)   | A3LU03 |       | EUR   | 600                   | 600                                       |                       | % 98,730  | 592.380,00         | 1,18                         |
| 2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV<br>EO-Medium-Term Nts 2022(25/25) | A3K8X0 |       | EUR   | 700                   |   |                       | % 98,998  | 692.986,00         | 1,37                         |
| 3,7500 % Sixt SE<br>MTN v.2024(2028/2029)                                | A3827R |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 100,550 | 301.650,00         | 0,60                         |
| 0,7500 % Snam S.p.A.<br>EO-Med.-T. Nts 2022(22/29)                       | A3K06E |       | EUR   | 400                   |   |                       | % 87,149  | 348.597,60         | 0,69                         |
| 3,3750 % Stryker Corp.<br>EO-Notes 2023(23/28)                           | A3LSCB |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 99,341  | 298.023,00         | 0,59                         |
| 5,1250 % Südzucker Intl Finance B.V.<br>EO-Sustain.Lkd Nts 2022(22/27)   | A3LAWH |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 103,785 | 518.925,00         | 1,03                         |
| 0,8750 % Swedish Match AB<br>EO-Medium-Term Nts 2020(26/27)              | A28T19 |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 92,980  | 278.940,00         | 0,55                         |
| 1,2500 % Symrise AG<br>Anleihe v.2019(2025/2025)                         | SYM772 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 96,560  | 482.800,00         | 0,96                         |
| 1,3750 % Symrise AG<br>Anleihe v.2020(2027/2027)                         | SYM773 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 94,453  | 472.265,00         | 0,94                         |
| 3,8750 % Telefónica Europe B.V.<br>EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)            | A19X5W |       | EUR   | 700                   |   |                       | % 98,530  | 689.710,00         | 1,37                         |
| 3,2000 % Thermo Fisher Scientific Inc.<br>EO-Notes 2022(22/26)           | A3LBJ5 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 99,405  | 497.025,00         | 0,99                         |
| 3,3690 % TotalEnergies SE<br>EO-FLR Med.-T. Nts 16(26/Und.)              | A1869J |       | EUR   | 400                   |   |                       | % 97,660  | 390.640,00         | 0,77                         |
| 2,0000 % TotalEnergies SE<br>EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)              | A3K00H |       | EUR   | 400                   |   |                       | % 93,370  | 373.480,00         | 0,74                         |
| 0,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A.<br>EO-Med.-Term Nts 2021(24/24)  | A3KYMA |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 98,650  | 493.250,00         | 0,98                         |
| 0,5000 % VINCI S.A.<br>EO-Med.-Term Notes 2021(21/32)                    | A3KTRD |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 80,520  | 241.560,00         | 0,48                         |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2024 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR     | % des Fondsvermögens |
|---|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|------------|---------------------|----------------------|
| 1,3750 % voestalpine AG<br>EO-Medium-Term Notes 2017(24)                          | A19PQR |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 99,270   | 496.350,00          | 0,98                 |
| 4,6250 % Volkswagen Intl Finance N.V.<br>EO-FLR Notes 2018(28/Und.)               | A192QF |       | EUR                                   | 400                |                                     | 300                | % 97,973   | 391.892,00          | 0,78                 |
| 3,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V.<br>EO-FLR Notes 2020(29/Und.)               | A28YTC |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 92,893   | 464.464,80          | 0,92                 |
| 4,2500 % Vonovia SE<br>Medium Term Notes v.24(24/34)                              | A3829J |       | EUR                                   | 400                | 400                                 |                    | % 98,458   | 393.832,00          | 0,78                 |
| 2,0000 % Wells Fargo & Co.<br>EO-Medium-Term Notes 2015(26)                       | A1Z72U |       | EUR                                   | 250                |                                     |                    | % 97,088   | 242.720,00          | 0,48                 |
| Qiagen N.V.<br>DL-Zero Exch. Bonds 2020(27)                                       | A286LP |       | USD                                   | 800                |                                     |                    | % 92,413   | 689.810,12          | 1,37                 |
| 6,6250 % RWE AG<br>FLR-Nachr.-Anl. v.15(26/75)                                    | A13SHX |       | USD                                   | 500                |                                     |                    | % 100,419  | 468.483,26          | 0,93                 |
| <b>Sonstige Forderungswertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                     |                      |
| Bertelsmann SE & Co. KGaA<br>Genußscheine   | 522990 |       | EUR                                   | 264                | 76                                  |                    | % 130,000  | 343.499,16          | 0,68                 |
| Bertelsmann SE & Co. KGaA<br>Genußscheine 2001                                    | 522994 |       | EUR                                   | 211                |                                     |                    | % 269,000  | 567.590,00          | 1,13                 |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>8.814.712,56</b> | <b>17,49</b>         |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                     |                      |
| 2,6250 % Allianz SE<br>FLR-Sub.Ter.Nts.v.20(30/unb.)                              | A289FK |       | EUR                                   | 200                |                                     |                    | % 77,742   | 155.484,92          | 0,31                 |
| 2,6000 % Allianz SE<br>FLR-Sub.Ter.Nts.v.21(31/unb.)                              | A3E5TR |       | EUR                                   | 600                |                                     |                    | % 75,503   | 453.019,64          | 0,90                 |
| 1,5000 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd.<br>EO-Med.-Term Nts 2015(15/27)           | A1ZW6G |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 94,730   | 284.190,00          | 0,56                 |
| 2,0000 % Bechtle AG<br>Wandelanleihe v.23(29/30)                                  | A38229 |       | EUR                                   | 600                | 200                                 | 200                | % 103,727  | 622.362,00          | 1,23                 |
| 0,1000 % Booking Holdings Inc.<br>EO-Notes 2021(21/25)                            | A3KM1G |       | EUR                                   | 200                |                                     |                    | % 97,612   | 195.224,00          | 0,39                 |
| 1,1250 % Brenntag Finance B.V.<br>EO-Notes 2017(17/25)                            | A19PDB |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 96,850   | 290.550,00          | 0,58                 |
| 3,8750 % Daimler Truck Intl Finance<br>EO-Med.-Term Notes 2023(23/26)             | A3LJ6A |       | EUR                                   | 400                |                                     |                    | % 100,591  | 402.364,00          | 0,80                 |
| 1,8750 % Encavis Finance B.V.<br>EO-FLR Conv. Nts 2021(27/Und.)                   | A3MQE8 |       | EUR                                   | 300                | 300                                 |                    | % 95,552   | 286.656,00          | 0,57                 |
| 0,9340 % Highland Holdings S.A.r.L.<br>EO-Notes 2021(21/31)                       | A3KYWN |       | EUR                                   | 200                |                                     |                    | % 82,520   | 165.040,00          | 0,33                 |
| 0,8750 % Kerry Group Financial Services<br>EO-Notes 2021(22/31)                   | A3KZMH |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 83,610   | 250.830,00          | 0,50                 |
| 0,9000 % Nasdaq Inc.<br>EO-Notes 2021(21/33)                                      | A3KUPC |       | EUR                                   | 200                |                                     |                    | % 78,195   | 156.390,00          | 0,31                 |
| 2,7780 % Prosus N.V.<br>EO-Med.-T.Nts 2022(22/34)Reg.S                            | A3K05H |       | EUR                                   | 400                |                                     |                    | % 83,370   | 333.480,00          | 0,66                 |
| Redcare Pharmacy N.V.<br>EO-Zero Conv. Notes 2021(28)                             | A287RE |       | EUR                                   | 400                | 400                                 |                    | % 92,451   | 369.804,00          | 0,73                 |
| Sagerpar S.A.<br>EO-Zero Conv. Obl.2021(26)                                       | A3KN1H |       | EUR                                   | 1.300              |                                     |                    | % 93,219   | 1.211.847,00        | 2,40                 |
| 4,3750 % Sartorius Finance B.V.<br>EO-Notes 2023(23/29)                           | A3LNB2 |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 102,400  | 512.000,00          | 1,02                 |
| 2,7500 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co.<br>EO-Notes 2015(15/25) Reg.S             | A1ZWOP |       | EUR                                   | 350                |                                     |                    | % 99,240   | 347.340,00          | 0,69                 |

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2024 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens        |
|---|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|------------|----------------------|-----------------------------|
| 0,6250 % TAG Immobilien AG Wandelschuldv.v.20(24/26)                          | A3E46Y |       | EUR                                   | 400                |                                     | %                  | 91,548     | 366.192,00           | 0,73                        |
| 5,7522 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2024(24/Und.)                    | A3LVY6 |       | EUR                                   | 500                | 500                                 | %                  | 102,129    | 510.645,00           | 1,01                        |
| 4,0000 % Vossloh AG Sub.-FLR-Nts.v.21(26/unb.)                                | A3H2VA |       | EUR                                   | 1.300              |                                     | %                  | 98,418     | 1.279.434,00         | 2,54                        |
| 3,0000 % Wintershall Dea Finance 2 B.V. EO-FLR Bonds 2021(21/Und.)            | A287SY |       | EUR                                   | 500                |                                     | %                  | 88,520     | 442.600,00           | 0,88                        |
| 1,3320 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/28)                    | A2R75C |       | EUR                                   | 200                |                                     | %                  | 89,630     | 179.260,00           | 0,36                        |
| <b>Investmentanteile</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>3.098.668,00</b>  | <b>6,15</b>                 |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                             |
| Anaxis Short Duration Actions au Port.I4 3 Déc.o.N.                           | A2DLYP |       | ANT                                   | 1.200              | 1.200                               | EUR                | 1.060,440  | 1.272.528,00         | 2,52                        |
| iShsIII-EO Cor.Bd ex-Fin.U.ETF Registered Shares EUR o.N.                     | AORPWN |       | ANT                                   | 17.000             | 6.000                               | EUR                | 107,420    | 1.826.140,00         | 3,62                        |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>47.717.991,18</b> | <b>94,66</b>                |
| <b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b> |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>2.330.256,42</b>  | <b>4,62</b>                 |
| <b>Bankguthaben</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>2.330.256,42</b>  | <b>4,62</b>                 |
| <b>EUR-Guthaben bei:</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                             |
| Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)                                      |        |       | EUR                                   | 1.239.567,72       |                                     | %                  | 100,000    | 1.239.567,72         | 2,46                        |
| <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>                                 |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                             |
|   |        |       | NOK                                   | 952,14             |                                     | %                  | 100,000    | 83,44                | 0,00                        |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                                     |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                             |
|   |        |       | GBP                                   | 2.996,70           |                                     | %                  | 100,000    | 3.534,47             | 0,01                        |
|   |        |       | JPY                                   | 175.000.000,00     |                                     | %                  | 100,000    | 1.015.071,20         | 2,01                        |
|   |        |       | USD                                   | 77.165,56          |                                     | %                  | 100,000    | 71.999,59            | 0,14                        |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>403.811,67</b>    | <b>0,80</b>                 |
| Zinsansprüche   |        |       | EUR                                   | 403.811,67         |                                     |                    |            | 403.811,67           | 0,80                        |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten *)</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>-42.752,82</b>    | <b>-0,08</b>                |
| <b>Fondsvermögen</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>50.409.306,45</b> | <b>100,00 <sup>1)</sup></b> |
| <b>Anteilwert</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>115,69</b>        |                             |
| <b>Umlaufende Anteile</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>STK</b> | <b>435.713</b>       |                             |

\*) Beratungsvergütung, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Kostenpauschale

\*\*\*\*) Bei diesen Wertpapieren wurde der Kurswert durch einen Inflationskoeffizienten beeinflusst.

## Fußnoten:

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

# Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

|                    |       | per 28.06.2024 | = |              |
|--------------------|-------|----------------|---|--------------|
| Britische Pfund    | (GBP) | 0,8478500      | = | 1 Euro (EUR) |
| Japanische Yen     | (JPY) | 172,4017000    | = | 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Kronen | (NOK) | 11,4115000     | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar          | (USD) | 1,0717500      | = | 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<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|---|--------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| 0,5000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.14(30)                      | 103055 | EUR                                 |                          | 750                         |                     |
| 4,7500 % Covestro AG EO-MTN v.2022(2022/2028)                                     | A30VQX | EUR                                 |                          | 400                         |                     |
| 1,3750 % Evonik Industries AG FLR-Nachr.-Anl. v.21(26/81)                         | A3E5WW | EUR                                 |                          | 1.000                       |                     |
| 4,3420 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. FLR-Med.Term Nts. v.17(24)                   | A2GSCY | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| 5,2500 % Südzucker Intl Finance B.V. EO-FLR Bonds 2005(15/Und.)                   | A0E6FU | EUR                                 |                          | 750                         |                     |
| 2,2500 % ZF Finance GmbH MTN v.2021(2021/2028)                                    | A3MP6J | EUR                                 |                          | 200                         |                     |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b> |        |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| 1,6250 % Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS v. 2020 (2024/2024)                    | A3E443 | EUR                                 |                          | 200                         |                     |
| 3,0000 % Holcim Finance (Luxembg) S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)                 | A2R0DL | EUR                                 |                          | 600                         |                     |
| Prysmian S.p.A. EO-Zero Conv. Bonds 2021(26)                                      | A3KK7E | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| <b>Nicht notierte Wertpapiere</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| América Móvil B.V. EO-Zero Exch. Bonds 2021(24)                                   | A3KL62 | EUR                                 |                          | 400                         |                     |
| 1,5000 % Bel S.A. EO-Obl. 2017(17/24)   | A19F4H | EUR                                 |                          | 200                         |                     |
| 1,3000 % Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2016(16/24)                             | A18Y3M | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| Fresenius SE & Co. KGaA Unverz.Wandelschv. 17(31.1.24)                            | A2DAHU | EUR                                 |                          | 300                         |                     |
| 0,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2020(24)              | A28XZ4 | EUR                                 |                          | 400                         |                     |
| 3,1000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2018(23/79)                           | A2RSG2 | EUR                                 |                          | 500                         |                     |

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

|                           |            |                |
|---------------------------|------------|----------------|
| <b>Anteilwert</b>         | <b>EUR</b> | <b>115,69</b>  |
| <b>Umlaufende Anteile</b> | <b>STK</b> | <b>435.713</b> |

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

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

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

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

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

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

Stuttgart

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH









# LB≡BW Asset Management

30019 [14] 08/2024 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](http://www.LBBW-AM.de)  
[info@LBBW-AM.de](mailto:info@LBBW-AM.de)