

LB≡BW Asset Management

**LBBW Unternehmensanleihen
Euro Select**

Halbjahresbericht zum 31.08.2024

Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.08.2024	8
Vermögensaufstellung zum 31.08.2024	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	15
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	17

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 Basisinformationsblätter, 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
(Stellv. Vorsitzender)



Michael Hünseler

LBBW Unternehmensanleihen Euro Select

Halbjahresbericht zum 31.08.2024

Vermögensübersicht zum 31.08.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	28.568.174,43	100,06
1. Anleihen	25.993.135,08	91,04
Frankreich	4.236.292,06	14,84
Niederlande	4.030.088,76	14,11
USA	3.742.931,02	13,11
Bundesrep. Deutschland	3.129.534,24	10,96
Irland	2.559.117,00	8,96
Großbritannien	1.244.449,50	4,36
Schweden	1.184.472,00	4,15
Italien	1.013.704,00	3,55
Finnland	738.664,00	2,59
Luxemburg	728.915,00	2,55
Canada	716.186,00	2,51
Spanien	635.600,00	2,23
Dänemark	513.380,00	1,80
Österreich	420.340,00	1,47
Belgien	407.455,00	1,43
Norwegen	389.125,00	1,36
Australien	302.881,50	1,06
2. Derivate	16.350,00	0,06
3. Bankguthaben	2.153.138,59	7,54
4. Sonstige Vermögensgegenstände	405.550,76	1,42
II. Verbindlichkeiten	-15.799,79	-0,06
III. Fondsvermögen	28.552.374,64	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	25.993.135,08	91,04
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	20.102.832,58	70,41
Verzinsliche Wertpapiere									
4,1250 % A.P.Moeller-Maersk A/S EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LVHR		EUR	500	500		% 102,676	513.380,00	1,80
4,5000 % A2A S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K9HY		EUR	200		200	% 105,872	211.744,00	0,74
3,3750 % Aéroports de Paris S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/31)	A3LYHP		EUR	500	500		% 100,200	501.000,00	1,75
2,7500 % Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2020(20/30)	A28VK9		EUR	400	600	200	% 97,446	389.784,00	1,37
1,6250 % Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	A28X77		EUR	200	200		% 92,206	184.412,00	0,65
2,3750 % Airbus SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/40)	A28X78		EUR	300	300		% 84,880	254.640,00	0,89
3,1250 % Altria Group Inc. EO-Notes 2019(19/31)	A2RX15		EUR	400			% 94,750	379.000,00	1,33
4,1250 % Anglo American Capital PLC EO-Medium-Term Notes 24(24/32)	A3LV5X		EUR	500	500		% 101,930	509.650,00	1,78
3,9500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/44)	A3LWHA		EUR	100	100		% 100,555	100.555,00	0,35
4,1250 % Assa-Abloy AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	A3LM38		EUR	300	300		% 106,330	318.990,00	1,12
2,6000 % AT & T Inc. EO-Notes 2014(14/29)	A1VHHL		EUR	200			% 97,205	194.410,00	0,68
1,2500 % B.A.T. Intl Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2015(26/27)	A1ZYK4		EUR	150	150		% 95,893	143.839,50	0,50
4,1250 % B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/32)	A3LXD7		EUR	400	400		% 100,550	402.200,00	1,41
3,5190 % Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2024(24/31)	A3LUHG		EUR	400			% 100,371	401.484,00	1,41
4,1250 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2023(23/33)	A3LHS4		EUR	400			% 104,625	418.500,00	1,47
4,3230 % BP Capital Markets B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(35)	A3LHS2		EUR	300			% 104,940	314.820,00	1,10
1,1000 % Coca-Cola Co., The EO-Notes 2016(16/36)	A185V1		EUR	400	700	300	% 78,250	313.000,00	1,10
3,0000 % Compass Group Fin. Netherl. BV EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K81Z		EUR	400			% 99,010	396.040,00	1,39
4,0000 % CRH SMW Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27)	A3LKWG		EUR	300	300		% 102,160	306.480,00	1,07
4,0000 % CRH SMW Finance DAC EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	A3LKWH		EUR	200			% 103,020	206.040,00	0,72
2,2000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(33)	A193RR		EUR	200			% 89,182	178.364,00	0,62
1,0000 % Deutsche Wohnen SE Anleihe v.2020(2020/2025)	A289NE		EUR	300		100	% 98,000	294.000,00	1,03
0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/28)	A2R7HB		EUR	200			% 91,460	182.920,00	0,64

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1.8000 % DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/49)	A2R7HE		EUR	100	100		% 69,480	69.480,00	0,24
3.5000 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(27/28)	A30V8A		EUR	200			% 101,700	203.400,00	0,71
3.3750 % E.ON SE Medium Term Notes v.24(30/31)	A3826T		EUR	300		100	% 100,530	301.590,00	1,06
7.5000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	A3LB2Y		EUR	200	200		% 109,610	219.220,00	0,77
4.2500 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2023(23/32)	A3LDGD		EUR	200	200		% 103,880	207.760,00	0,73
1.1250 % Eli Lilly and Company EO-Notes 2021(21/51)	A3KV41		EUR	100	100		% 61,017	61.017,02	0,21
3.7500 % Elis S.A. EO-Med.-Term Nts 2024(24/30)	A3LWDJ		EUR	300	500	200	% 100,420	301.260,00	1,06
0.3750 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/27)	A2R885		EUR	200			% 93,384	186.768,00	0,65
1.8750 % ENEL S.p.A. EO-FLR Nts. 2021(21/Und.)	A3KM01		EUR	400			% 85,590	342.360,00	1,20
4.2500 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/44)	A3LVRC		EUR	200	200		% 100,525	201.050,00	0,70
4.2500 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	A3LHZE		EUR	200			% 104,580	209.160,00	0,73
3.8750 % Fluvius System Operator CVBA EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	A3LHE3		EUR	300	300		% 102,300	306.900,00	1,07
1.6250 % Fortum Oyj EO-Medium-Term Nts 2019(19/26)	A2RYDK		EUR	200	200		% 97,610	195.220,00	0,68
5.1250 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2023(2030/2030)	A3515F		EUR	200	200	300	% 107,970	215.940,00	0,76
4.6250 % GE Capital Europ.Fund.Unltd.Co EO-Medium-Term Notes 2007(27)	A0LNL5		EUR	200	200	300	% 103,690	207.380,00	0,73
3.6500 % GE Capital Europ.Fund.Unltd.Co EO-Medium-Term Notes 2012(32)	A1G8C5		EUR	100	100		% 98,690	98.690,00	0,35
0.8750 % Gecina S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(21/36)	A3KS46		EUR	300	300		% 73,790	221.369,06	0,78
4.2500 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. EO-Notes 2023(23/35)	A3LH5E		EUR	300	300		% 105,222	315.666,00	1,11
3.3750 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	A3LEL4		EUR	200	200		% 98,220	196.440,00	0,69
3.8750 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2024(24/33)	A3LU3E		EUR	300			% 100,410	301.230,00	1,06
1.4500 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2018(28)	A2RUZG		EUR	200	200		% 93,617	187.234,00	0,66
1.0000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2019(34)	A2R7TK		EUR	300			% 80,155	240.465,00	0,84
4.3750 % Magna International Inc. EO-Notes 2023(23/32)	A3LFCW		EUR	300	300		% 106,490	319.470,00	1,12
2.3750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. EO-Medium-T.Notes 2017(17/29)	A19N7V		EUR	300	300		% 94,920	284.760,00	1,00
1.3750 % Merlin Properties SOCIMI S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/30)	A3KRXC		EUR	400			% 87,710	350.840,00	1,23

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,2500 % Neste Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	A3LFLB		EUR	200	200		% 103,740	207.480,00	0,73
2,0000 % Norsk Hydro ASA EO-Bonds 2019(19/29)	A2R0MB		EUR	200	200		% 94,320	188.640,00	0,66
1,7500 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 20(20/Und.)	A283SA		EUR	300	300		% 91,400	274.200,00	0,96
0,1250 % Philip Morris Internat. Inc. EO-Notes 2019(19/26)	A2R54V		EUR	200			% 94,296	188.592,00	0,66
1,4500 % Philip Morris Internat. Inc. EO-Notes 2019(19/39)	A2R54X		EUR	100			% 69,180	69.180,00	0,24
1,0000 % Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2022(22/29)	A3K1V1		EUR	300			% 90,560	271.680,00	0,95
3,7500 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2023(23/31)	A3LJS3		EUR	200			% 102,807	205.614,00	0,72
1,6250 % Rolls-Royce PLC EO-Med.-Term Nts 2018(28/28)	A190KF		EUR	200	200		% 94,380	188.760,00	0,66
3,6250 % RWE AG Medium Term Notes v.24(31/32)	A3826L		EUR	400			% 100,470	401.880,00	1,41
4,5000 % Schaeffler AG MTN v.2024(2024/2030)	A383HC		EUR	500	500		% 100,820	504.100,00	1,77
3,8750 % Securitas Treasury Ireland DAC EO-Medium-Term Nts 2024(24/30)	A3LU3F		EUR	200			% 101,549	203.098,00	0,71
3,7500 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/30)	A3LG7W		EUR	400			% 102,530	410.120,00	1,44
3,1250 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LSCD		EUR	200	200		% 100,243	200.485,00	0,70
4,2500 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31)	A3LJZZ		EUR	400			% 102,965	411.860,00	1,44
1,0000 % Telefonaktiebolaget L.M.Erics. EO-Med.-Term Nts 2021(21/29)	A3KRNN		EUR	300	300		% 88,340	265.020,00	0,93
0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2020(30/30)	A282XN		EUR	300	300		% 83,480	250.440,00	0,88
4,0000 % THALES S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/25)	A3LPS7		EUR	200	200		% 100,580	201.160,00	0,70
4,2500 % THALES S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31)	A3LPS9		EUR	300	300		% 105,140	315.420,00	1,10
2,8750 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2017(17/37)	A19LYW		EUR	200			% 93,950	187.900,00	0,66
1,8750 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2019(19/49)	A2R8JL		EUR	100	100		% 68,352	68.352,00	0,24
2,3750 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2020(20/32)	A28VL1		EUR	200			% 94,568	189.136,00	0,66
1,4910 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	A28VQ7		EUR	200			% 96,580	193.160,00	0,68
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	A3K00H		EUR	300	300		% 95,180	285.540,00	1,00
0,5000 % UPM Kymmene Corp. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31)	A3KNNM		EUR	400			% 83,991	335.964,00	1,18
0,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/29)	A3KNL2		EUR	200			% 88,340	176.680,00	0,62

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
3.5000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(30/Und.)	A1ZYTK		EUR	200	200		% 91,460	182.920,00	0,64
7.5000 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2023(28/Und.)	A3LMPT		EUR	300			% 108,875	326.623,76	1,14
1.0000 % Vonovia SE EO-Medium-Term Nts 2021(21/41)	A28717		EUR	200	200		% 62,147	124.294,24	0,44
4.7500 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/27)	A30VQA		EUR	400			% 103,653	414.612,00	1,45
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	5.890.302,50	20,63
Verzinsliche Wertpapiere									
5.2500 % A1 Towers Holding GmbH EO-Notes 2023(23/28)	A3LKSF		EUR	400			% 105,085	420.340,00	1,47
3.1250 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/29)	A3LS4Y		EUR	200			% 100,471	200.942,00	0,70
3.6470 % Alimentation Couche-Tard Inc. EO-Notes 2024(24/31) Reg.S	A3LUL9		EUR	400			% 99,179	396.716,00	1,39
3.8750 % Daimler Truck Intl Finance EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	A3LJ6B		EUR	300	300		% 102,605	307.815,00	1,08
1.6250 % Deutsche Wohnen SE Anleihe v.2019(2019/2031)	A2YNQ0		EUR	300	300		% 87,918	263.754,00	0,92
0.5770 % Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2021(21/30)	A3KM08		EUR	600	300		% 86,880	521.280,00	1,83
0.9340 % Highland Holdings S.A.r.L. EO-Notes 2021(21/31)	A3KYWN		EUR	200			% 84,572	169.144,00	0,59
4.1250 % Honeywell International Inc. EO-Notes 2022(22/34)	A3LA1M		EUR	400			% 104,540	418.160,00	1,46
3.2000 % Linde PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/31)	A3LUKV		EUR	400			% 100,600	402.400,00	1,41
3.4000 % Linde PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LUKW		EUR	300	300		% 99,361	298.083,00	1,04
4.2500 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/28)	A3LMWK		EUR	200			% 102,690	205.380,00	0,72
4.2500 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2024(24/34)	A3LZY4		EUR	200	200		% 102,021	204.042,00	0,71
3.6250 % Netflix Inc. EO-Notes 2019(19/30) Reg.S	A2R9SU		EUR	400			% 101,460	405.840,00	1,42
3.6250 % Robert Bosch GmbH MTN v.2023(2023/2030)	A351UJ		EUR	400			% 101,491	405.964,00	1,42
1.3750 % Telia Company AB EO-FLR Securities 2020(26/81)	A28TEC		EUR	200		200	% 95,520	191.040,00	0,67
3.9740 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LVYD		EUR	300	300		% 100,961	302.881,50	1,06
4.2500 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2023(28/28)	A3LHK8		EUR	300	300		% 102,457	307.371,00	1,08
0.8400 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/25)	A2R75B		EUR	200			% 97,145	194.290,00	0,68
1.3320 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/28)	A2R75C		EUR	300	300		% 91,620	274.860,00	0,96
Summe Wertpapiervermögen							EUR	25.993.135,08	91,04

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Derivate						EUR	16.350,00	0,06
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
Zins-Derivate						EUR	16.350,00	0,06
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsterminkontrakte								
Euro Schatz Future 06.09.24		185	EUR	3.000			16.350,00	0,06
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	2.153.138,59	7,54
Bankguthaben						EUR	2.153.138,59	7,54
EUR-Guthaben bei:								
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	2.153.138,59		% 100,000	2.153.138,59	7,54
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	405.550,76	1,42
Zinsansprüche			EUR	405.550,76			405.550,76	1,42
Sonstige Verbindlichkeiten *)						EUR	-15.799,79	-0,06
Fondsvermögen						EUR	28.552.374,64	100,00 ¹⁾
Anteilwert						EUR	102,88	
Umlaufende Anteile						STK	277.543	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Kostenpauschale

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
-----	-------------------

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					
1,5000 % A2A S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28)	A3K3DP	EUR		200	
3,0000 % Abertis Infraestructuras S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/31)	A2RZQV	EUR		200	
1,6250 % Alliander N.V. EO-FLR Securit. 2018(25/Und.)	A19VX6	EUR		400	
4,5000 % Alliander N.V. EO-FLR Securit. 2024(32/Und.)	A3L0N5	EUR	500	500	
2,7000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2014(14/26)	A1ZFGF	EUR		300	
0,3750 % AstraZeneca PLC EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3KRW4	EUR		400	
1,2500 % Autoroutes du Sud de la France EO-Med.-Term Notes 2017(17/27)	A19BLP	EUR		200	
1,2130 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2021(21/36)	A3KLWC	EUR		300	
3,6250 % BP Capital Markets PLC EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	A28Y0Y	EUR		200	
0,3750 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	A28YYD	EUR		400	
4,2500 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	A3LN8C	EUR		300	
4,7770 % Celanese US Holdings LLC EO-Notes 2022(22/26)	A3K7PG	EUR	300	300	
2,3750 % CEZ AS EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	A3K322	EUR		400	
1,7500 % Cie Génle Étis Michelin SCpA EO-Notes 2015(15/27)	A1Z14R	EUR		400	
1,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 22(22/25)	A3K78Y	EUR		200	
3,0710 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32)	A3K810	EUR		400	
3,4700 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31)	A3LHY9	EUR		200	
3,3750 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.23(33/33)	A351WY	EUR		200	
4,5000 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LLG0	EUR	400	400	
3,8750 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(34/35)	A30V8B	EUR		400	
4,7500 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2022(22/34)	A3K982	EUR		200	
4,1250 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2024(24/31)	A3LOAB	EUR	300	300	
5,2500 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR-Anleihe v.24(24/84)	A35117	EUR		400	
3,8750 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	A3LMVV	EUR		200	
2,7500 % ENI S.p.A. EO-FLR Nts 2021(30/Und.)	A3KQR2	EUR		200	
1,2500 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(26)	A28XFU	EUR		200	
3,6250 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/27)	A3LH2D	EUR		200	
1,7500 % Fluvius System Operator CVBA EO-Medium-Term Notes 2014(26)	A1ZTAF	EUR		400	
1,8750 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2019(2024/2025)	A2NBMS	EUR		200	
0,8750 % GE Aerospace EO-Notes 2017(17/25)	A19HNH	EUR		200	
1,6250 % Gecina S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/30)	A19XT3	EUR	600	600	
4,8750 % Heidelberg Mater.Fin.Lux. S.A. EO-Med.-Term Nts 2023(23/33)	A3LQ42	EUR		400	
3,9500 % Heidelberg Materials AG EO-Medium-Term Notes 24(34/34)	A383EX	EUR	1.000	1.000	
3,8120 % Heineken N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LOPX	EUR	1.000	1.000	
3,6250 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(24/34)	A3L1JT	EUR	600	600	
0,6250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.22(22/25)	A3MQS8	EUR		400	
3,7500 % La Poste EO-Med.-Term Notes 23(23/30)	A3LJTB	EUR		200	
3,5000 % Legrand S.A. EO-Obl. 2024(24/34)	A3LOB9	EUR	600	600	
3,5000 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 24(24/34)	A3LZR9	EUR	500	500	
3,4000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2023(25)	A3LGGL	EUR		400	
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2019(2024/2079)	A2LQRZ	EUR		200	
1,6250 % Mondi Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2018(26/26)	A19Z0H	EUR		200	
3,1250 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 20(20/28)	A28W7K	EUR	250	250	
2,5000 % OMV AG EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	A281UC	EUR		200	
0,0000 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/26)	A3KTCX	EUR		400	
0,7500 % Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2021(21/33)	A3KPS2	EUR		400	
1,8750 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. EO-Medium-Term Nts 2017(17/37)	A19QX7	EUR		400	
3,3750 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/34)	A3LC3H	EUR		300	
3,2500 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2024(24/35)	A3LSOY	EUR		400	

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
1,2500 % Securitas AB EO-Med.-Term Nts 2018(24/25)26	A19XBX	EUR		300	
1,8750 % Soc.Autorout.Nord-l'Est France EO-Obl. 2015(15/26)	A18UQQ	EUR		200	
0,7500 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2019(19/26)	A2R20L	EUR		200	
4,8750 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2024(24/Und.)	A3LWDN	EUR	200	200	
1,3750 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2016(16/28)	A18544	EUR		200	
1,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2020(20/27)	A28VL0	EUR		200	
1,4910 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2018(18/30)	A195EE	EUR		200	
2,6250 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	A1ZXH7	EUR		200	
3,7500 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(27/27)	A3LWGE	EUR	300	300	
3,2500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	A3LEL5	EUR		200	
5,9930 % Veolia Environnement S.A. EO-FLR Notes 2023(28/Und.)	A3LQ46	EUR		400	
0,8750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/27)	A2ROGJ	EUR		200	
1,3000 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2020(20/33)	A28XK0	EUR		400	
3,7500 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2024(24/36)	A3LUOP	EUR		400	
3,3750 % VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32)	A3LAEJ	EUR	800	1.000	
1,8750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2017(27)	A19E9U	EUR	100	100	
0,7500 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/32)	A3MP4V	EUR	200	200	
3,7500 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2023(23/31)	A3LF0S	EUR		400	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,8750 % Alimentation Couche-Tard Inc. EO-Notes 2016(26/26) Reg.S	A180Z8	EUR		400	
3,8750 % Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2022(42)	A30VUV	EUR		200	
4,0000 % Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 2023(43)	A3511H	EUR		300	
2,5000 % Digital Euro Finco LLC EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	A2RWMS	EUR		300	
3,5000 % Honeywell International Inc. EO-Notes 2023(23/27)	A3LHYX	EUR		200	
1,5750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 2021(21/Und.)	A3KY3E	EUR		400	
3,0000 % Linde PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/28)	A3LUKU	EUR		400	
3,6250 % Linde plc EO-Notes 2023(23/34)	A3LJS7	EUR		200	
0,8750 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	A2R7AB	EUR		200	
1,8750 % Mölnlycke Holding AB EO-Notes 2017(25)	A19C7F	EUR		400	
1,6250 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2014(27)	A1ZR51	EUR		200	
1,5000 % United Parcel Service Inc. EO-Notes 2017(17/32)	A19R7F	EUR		400	

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND)	EUR	5.111,59
--------------------------------------	-----	----------

SWAPS (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)

Credit Default Swaps

Protection Seller

(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Ser.41 Index (5 Year) 5%		
20.03.2024/20.06.2029 Barclays Bank Ireland PLC)	EUR	3.000

Protection Buyer

(Basiswert(e): iTraxx Europe Series 41 Index (5 Year) 1%		
20.03.2024/20.06.2029 Barclays Bank Ireland PLC)	EUR	10.000

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	102,88
Umlaufende Anteile	STK	277.543

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

30038 [14] 10/2024 55 25% Altpapier

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

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