

LB≡BW Asset Management

W&W

Vermögensverwaltende Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2024

Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.08.2024	8
Vermögensaufstellung zum 31.08.2024	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	17
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	20

Liebe Anlegerin, lieber Anleger,

wir danken Ihnen für das Vertrauen, das Sie uns entgegenbringen.

Seit unserer Gründung legen wir Fonds für private und institutionelle Anleger auf. Dadurch bieten wir Ihnen die Möglichkeit, an den Entwicklungen der Märkte teilzunehmen. Detailinformationen erhalten Sie von Ihrem Berater.

In diesem Halbjahresbericht können Sie sich ein Bild von der Situation Ihres Fonds verschaffen. Sollten Sie weitergehende Auskünfte zu Ihrem Fonds benötigen, sprechen Sie bitte Ihren Berater an.

Tagesaktuelle Informationen zu Fondspreisen finden Sie im Internet unter www.LBBW-AM.de und in der überregionalen Tagespresse.

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH
Geschäftsführung



Uwe Adamla
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz
(Stellv. Vorsitzender)



Michael Hünseler

W&W Vermögensverwaltende Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2024

Vermögensübersicht zum 31.08.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	74.505.487,59	100,09
1. Aktien	5.743.207,57	7,72
USA	2.608.520,76	3,50
Großbritannien	428.637,63	0,58
Dänemark	385.593,65	0,52
Italien	380.356,77	0,51
Schweden	357.500,32	0,48
Bundesrep. Deutschland	350.937,18	0,47
Schweiz	291.286,50	0,39
Niederlande	251.354,45	0,34
Österreich	145.447,00	0,20
Spanien	137.848,15	0,19
Irland	104.455,69	0,14
Belgien	72.682,80	0,10
Finnland	71.945,50	0,10
Andere Länder	156.641,17	0,22
2. Anleihen	18.999.126,13	25,52
USA	4.736.397,83	6,36
Österreich	2.568.540,00	3,45
Spanien	2.454.000,00	3,30
Estland	2.116.200,00	2,84
Frankreich	1.668.774,10	2,24
Slowakei	1.049.700,00	1,41
Canada	1.005.773,20	1,35
Bundesrep. Deutschland	833.455,00	1,12
Großbritannien	782.872,00	1,05
Italien	413.720,00	0,56
Norwegen	410.440,00	0,55
Andere Länder	959.254,00	1,29
3. Zertifikate	3.968.289,81	5,33
4. Investmentanteile	36.197.431,03	48,63
5. Derivate	612.165,50	0,82
6. Bankguthaben	7.966.942,28	10,70
7. Sonstige Vermögensgegenstände	1.018.325,27	1,37
II. Verbindlichkeiten	-70.187,16	-0,09
III. Fondsvermögen	74.435.300,43	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		64.908.054,54	87,20
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR		23.597.625,68	31,70
Aktien										
ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12	919730		STK	1.400	1.708	308	CHF	48,630	72.493,21	0,10
Accelleron Industries Ltd. Namens-Aktien SF 0,01	A3DRSU		STK	1.530	1.530		CHF	44,360	72.268,33	0,10
Novartis AG Namens-Aktien SF 0,49	904278		STK	666	666		CHF	102,120	72.418,59	0,10
Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -,01	A0JJY6		STK	57	122	65	CHF	1.221,000	74.106,37	0,10
ALK-Abelló AS Navne-Aktier DK -,50	A3DHX9		STK	3.322	3.322		DKK	179,000	79.720,87	0,11
Ambu A/S Navne-Aktier B DK -,50	A2JAHY		STK	4.028	166	1.076	DKK	127,950	69.095,40	0,09
FLSmidth & Co. AS Navne-Aktier B DK 20	860885		STK	1.497	1.497		DKK	344,200	69.079,96	0,09
Rockwool A/S Navne-Aktier B DK 10	889488		STK	181	441	260	DKK	2.924,000	70.953,75	0,10
Zealand Pharma A/S Navne-Aktier DK 1	A0YJW7		STK	814		297	DKK	886,500	96.743,67	0,13
A2A S.p.A. Azioni nom. EO 0,52	915445		STK	35.716	35.716		EUR	2,062	73.646,39	0,10
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	A1J4U4		STK	85	85		EUR	812,000	69.020,00	0,09
Bank of Ireland Group PLC Registered Shares EO 1	A2DR6L		STK	7.213	7.213		EUR	10,370	74.798,81	0,10
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	519000		STK	809	809	745	EUR	83,820	67.810,38	0,09
Bca Monte dei Paschi di Siena Azioni nom. o.N.	A3DU7S		STK	15.591	16.497	906	EUR	5,258	81.977,48	0,11
BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01	A2JLD1		STK	461	461	501	EUR	117,800	54.305,80	0,07
Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -,12	A0M45W		STK	2.409	2.409		EUR	29,840	71.884,56	0,10
Caixabank S.A. Acciones Port. EO 1	A0MZR4		STK	14.172	17.139	2.967	EUR	5,460	77.379,12	0,10
Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.	850605		STK	19.694	44.106	24.412	EUR	3,765	74.138,06	0,10
Konecranes Oyj Registered Shares o.N.	899827		STK	1.133	1.133		EUR	63,500	71.945,50	0,10
Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N.	710000		STK	1.120	1.120	1.129	EUR	62,340	69.820,80	0,09
OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	874341		STK	1.796	6		EUR	39,380	70.726,48	0,10
Prosus N.V. Registered Shares EO -,05	A2PRDK		STK	2.142	2.142		EUR	33,530	71.821,26	0,10
Raiffeisen Bank Intl AG Inhaber-Aktien o.N.	A0D9SU		STK	4.172	8.670	4.498	EUR	17,910	74.720,52	0,10
Repsol S.A. Acciones Port. EO 1	876845		STK	4.855	93	599	EUR	12,455	60.469,03	0,08
Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -,01	A2QL01		STK	3.713	3.900	187	EUR	15,138	56.207,39	0,08
TUI AG Namens-Aktien o.N.	TUAG50		STK	12.578	24.206	11.628	EUR	5,958	74.939,72	0,10
UCB S.A. Actions Nom. o.N.	852738		STK	444	444		EUR	163,700	72.682,80	0,10
UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N.	A2DJV6		STK	2.082	2.397	315	EUR	37,380	77.825,16	0,10
Unipol Gruppo S.p.A. Azioni nom. o. N.	A1JWCF		STK	7.596	7.596		EUR	9,580	72.769,68	0,10

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
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.	766403		STK	678	81	5	EUR 96,180	65.210,04	0,09
Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.	ZAL111		STK	3.121	3.121		EUR 23,440	73.156,24	0,10
Auto Trader Group PLC Registered Shares LS 0,01	A14PY2		STK	7.384	1.090	2.060	GBP 8,510	74.607,11	0,10
Compass Group PLC Registered Shares LS -,1105	A2DR6K		STK	2.486	5.438	2.952	GBP 23,990	70.809,31	0,10
Hargreaves Lansdown PLC Registered Shares DL -,004	A0MR1A		STK	5.516	13.788	16.100	GBP 11,110	72.760,77	0,10
Informa PLC Registered Shares LS -,001	A114PL		STK	7.218	7.218	7.826	GBP 8,340	71.472,98	0,10
Softcat PLC Registered Shares LS -,0005	A1430G		STK	3.375	111	888	GBP 15,610	62.551,20	0,08
Standard Chartered PLC Registered Shares DL -,50	859123		STK	8.260	8.260		GBP 7,794	76.436,26	0,10
Fortnox AB Namn-Aktier o.N.	A3DWAB		STK	12.270	368	2.093	SEK 58,460	63.279,45	0,09
Hemnet Group AB Namn-Aktier o.N.	A2PPYL		STK	2.031	2.031		SEK 376,000	67.368,53	0,09
Indutrade AB Aktier SK 1	A0HFVY		STK	2.563	2.563	3.005	SEK 322,800	72.986,32	0,10
Lifco AB Namn-Aktier B o.N.	A3CN22		STK	2.551	2.551		SEK 343,000	77.190,51	0,10
Nordnet AB Namn-Aktier AK o.N.	A2QHT3		STK	3.708	3.708		SEK 234,400	76.675,51	0,10
Accenture PLC Reg.Shares Class A DL-,0000225	A0YAQA		STK	96	96		USD 341,950	29.656,88	0,04
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	871981		STK	115	115		USD 574,110	59.646,45	0,08
Akamai Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	928906		STK	579	579		USD 101,810	53.255,03	0,07
Albemarle Corp. Registered Shares DL -,01	890167		STK	245	245		USD 90,250	19.975,83	0,03
Align Technology Inc. Registered Shares DL -,0001	590375		STK	100	100		USD 237,220	21.431,02	0,03
Allstate Corp., The Registered Shares DL -,01	886429		STK	283	283		USD 188,940	48.306,10	0,06
Alphabet Inc. Reg. Shs Cl. A DL-,001	A14Y6F		STK	263		55	USD 163,310	38.802,54	0,05
American Airlines Group Inc. Registered Shares DL -,01	A1W97M		STK	2.582	896		USD 10,622	24.776,61	0,03
APA Corp. Registered Shares DL -,625	A2QQVE		STK	1.264		867	USD 28,495	32.539,24	0,04
Assurant Inc. Registered Shares DL -,01	A0BLRP		STK	311	8		USD 196,350	55.167,45	0,07
Autodesk Inc. Registered Shares o.N.	869964		STK	262	89		USD 258,355	61.151,87	0,08
Axon Enterprise Inc. Registered Shares DL -,00001	A2DPZU		STK	180	180		USD 364,950	59.346,82	0,08
Baker Hughes Co. Reg. Shares Class A DL -,0001	A2DUAY		STK	1.293	1.293		USD 35,155	41.065,51	0,06
Baxter International Inc. Registered Shares DL 1	853815		STK	1.292	1.292		USD 37,940	44.284,47	0,06
Bio-Rad Laboratories Inc. Reg. Shares Class A DL-,0001	865406		STK	179	25		USD 337,320	54.548,99	0,07
BorgWarner Inc. Registered Shares DL -,01	887320		STK	1.492	498		USD 34,070	45.923,25	0,06
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	850501		STK	1.034	1.034		USD 49,950	46.660,31	0,06

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
Builders Firstsource Inc. Registered Shares DL -,01	A0ER15		STK	189	189		USD 174,000	29.710,00	0,04
Caesars Entertainment Inc. Registered Shares DL -,01	A2P92E		STK	813	813		USD 37,645	27.649,64	0,04
Cardinal Health Inc. Registered Shares o.N.	880206		STK	454	454		USD 112,720	46.232,61	0,06
CDW Corp. Registered Shares DL -,01	A1WOKL		STK	118	118		USD 225,620	24.052,00	0,03
Cencora Inc. Registered Shares DL -,01	766149		STK	156	156		USD 239,570	33.763,59	0,05
Comerica Inc. Registered Shares DL 5	864861		STK	641	165		USD 57,110	33.072,10	0,04
Dayforce Inc. Registered Shares o.N.	A2JHZH		STK	621	621		USD 57,170	32.073,87	0,04
DexCom Inc. Registered Shares DL -,001	A0D9T1		STK	354	96		USD 69,311	22.166,37	0,03
Dollar General Corp. (New) Registered Shares DL -,875	A0YEES		STK	291	291		USD 82,970	21.812,51	0,03
Dollar Tree Inc. Registered Shares DL -,01	A0NFQC		STK	418	418		USD 84,490	31.906,06	0,04
Enphase Energy Inc. Registered Shares DL -,01	A1JC82		STK	198		114	USD 120,970	21.638,87	0,03
EPAM Systems Inc. Registered Shares DL -,001	A1JS9Q		STK	195	108		USD 200,760	35.367,42	0,05
Etsy Inc. Registered Shares DL -,001	A14P98		STK	454		177	USD 55,090	22.595,41	0,03
Fortinet Inc. Registered Shares DL -,001	A0YEFE		STK	597		39	USD 76,695	41.365,00	0,06
Globe Life Inc. Registered Shares DL 1	A2PP68		STK	489	162		USD 105,050	46.408,39	0,06
Grail Inc. Registered Shares DL -,01	A40F8M		STK	37	38	1	USD 14,105	471,48	0,00
Halliburton Co. Registered Shares DL 2,50	853986		STK	725	725		USD 31,090	20.363,40	0,03
Hasbro Inc. Registered Shares DL -,50	859888		STK	864		129	USD 68,155	53.198,95	0,07
Healthpeak Properties Inc. Registered Shares DL 1	A2N5NP		STK	2.275			USD 22,280	45.791,85	0,06
Henry Schein Inc. Registered Shares DL -,01	897961		STK	713	713		USD 70,560	45.450,61	0,06
Host Hotels & Resorts Inc. Registered Shares DL 0,01	918239		STK	2.838	2.838		USD 17,705	45.394,15	0,06
Illumina Inc. Registered Shares DL -,01	927079		STK	225	225		USD 131,430	26.715,83	0,04
Incyte Corp. Registered Shares DL -,001	896133		STK	811	11		USD 65,675	48.118,55	0,06
Insulet Corporation Registered Shares DL -,001	A0MQX8		STK	248	56		USD 202,690	45.412,52	0,06
Intel Corp. Registered Shares DL -,001	855681		STK	861	861		USD 22,045	17.147,66	0,02
Interpublic Group of Comp.Inc. Registered Shares DL -,10	851781		STK	881		458	USD 32,610	25.954,84	0,03
Intuit Inc. Registered Shares DL -,01	886053		STK	50	50		USD 631,030	28.504,38	0,04
Invesco Ltd. Registered Shares DL -,10	A0M6U7		STK	2.196	32		USD 17,090	33.905,18	0,05

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Jabil Inc. Registered Shares DL -,001	886423		STK	312	39		USD 109,280	30.802,57	0,04
Keycorp Registered Shares DL 1	869353		STK	1.881	231		USD 17,060	28.990,75	0,04
Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	A12B6J		STK	354	117		USD 154,120	49.289,44	0,07
Lamb Weston Holdings Inc. Registered Shares DL 1	A2ATEK		STK	513	270		USD 61,920	28.697,23	0,04
Live Nation Entertainment Inc. Registered Shares DL -,01	A0HOVZ		STK	593	107		USD 97,670	52.324,79	0,07
LKQ Corp. Registered Shares DL -,01	254570		STK	1.231	1.231		USD 41,580	46.241,74	0,06
MarketAxess Holdings Inc. Registered Shares DL -,001	A0B897		STK	262	101		USD 242,550	57.410,88	0,08
Match Group Inc. Registered Shares New DL-,001	A2P75D		STK	1.759	325		USD 37,220	59.147,15	0,08
MetLife Inc. Registered Shares DL -,01	934623		STK	371	371		USD 77,480	25.968,99	0,03
MGM Resorts International Registered Shares DL -,01	880883		STK	684	684		USD 37,590	23.228,44	0,03
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	870747		STK	60		44	USD 417,040	22.605,84	0,03
Molina Healthcare Inc. Registered Shares DL -,001	157781		STK	167	167		USD 349,790	52.773,45	0,07
Molson Coors Beverage Co. Registered Shares B DL 0,01	A0DPTB		STK	827	827		USD 53,970	40.322,69	0,05
Norwegian Cruise Line Holdings Registered Shares o.N.	A1KBL8		STK	1.848	1.848		USD 17,890	29.867,85	0,04
Omnicom Group Inc. Registered Shares DL -,15	871706		STK	501	501		USD 100,430	45.456,17	0,06
Palo Alto Networks Inc. Registered Shares DL -,0001	A1JZ0Q		STK	170	30		USD 362,770	55.714,97	0,07
Paycom Software Inc. Registered Shares DL -,01	A1XFVG		STK	222	90		USD 162,780	32.647,18	0,04
Salesforce Inc. Registered Shares DL -,001	A0B87V		STK	109		35	USD 252,900	24.903,88	0,03
Schlumberger N.V. (Ltd.) Reg. Shares DL -,01	853390		STK	528	528		USD 43,990	20.983,58	0,03
ServiceNow Inc. Registered Shares DL-,001	A1JX4P		STK	44	44		USD 855,000	33.986,81	0,05
Skyworks Solutions Inc. Registered Shares DL -,25	857760		STK	298		83	USD 109,585	29.502,51	0,04
State Street Corp. Registered Shares DL 1	864777		STK	345		15	USD 87,100	27.147,44	0,04
Super Micro Computer Inc. Registered Shares DL -,01	A0MKJF		STK	46	46		USD 437,500	18.181,41	0,02
Synopsys Inc. Registered Shares DL -,01	883703		STK	48	48		USD 519,130	22.511,74	0,03
Trimble Inc. Registered Shares o.N.	882295		STK	580	46		USD 56,700	29.710,00	0,04
Truist Financial Corp. Registered Shares DL 5	A2PWMZ		STK	726	726		USD 44,460	29.160,68	0,04
Tyson Foods Inc. Reg. Shares Cl.A DL -,10	870625		STK	804		71	USD 64,310	46.711,75	0,06
Uber Technologies Inc. Registered Shares DL-,00001	A2PHHG		STK	358	358		USD 73,130	23.652,13	0,03

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
Ultra Beauty Inc. Registered Shares DL -,01	A0M240		STK	69	69		USD 352,780	21.990,98	0,03
United Airlines Holdings Inc. Registered Shares DL-,01	A1C6TV		STK	464		192	USD 44,050	18.465,26	0,02
Warner Bros. Discovery Inc. Reg. Shares Series A DL-,01	A3DJQZ		STK	7.307	2.804		USD 7,840	51.754,34	0,07
Verzinsliche Wertpapiere									
0,1250 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.240 v.2022(2030)	AAR031		EUR	500	500		% 85,715	428.575,00	0,58
3,2500 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.261 v.2024(2029)	AAR042		EUR	400	400		% 101,220	404.880,00	0,54
1,3750 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2021(31/41)	A3KN91		EUR	400			% 84,474	337.894,10	0,45
0,8750 % Banco Santander S.A. EO-Mortg.Cov.M.-T.Nts 2019(31)	A2R1SB		EUR	400	400		% 87,500	350.000,00	0,47
0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(29)	A3KV2R		EUR	300	300		% 86,868	260.604,00	0,35
0,6250 % BAWAG P.S.K. EO-Medium-Term Bonds 2019(34)	A2R3RC		EUR	200			% 79,610	159.220,00	0,21
3,2500 % BP Capital Markets PLC EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	A28Y0X		EUR	400			% 98,430	393.720,00	0,53
3,1250 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2024(36)	A3LUM1		EUR	400	400		% 100,915	403.660,00	0,54
3,2500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(33)	A3LJG5		EUR	200			% 102,410	204.820,00	0,28
3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2024(33)	A3LTBQ		EUR	400	400		% 103,430	413.720,00	0,56
3,2500 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(33)	A3LJXW		EUR	400	100		% 102,610	410.440,00	0,55
1,5000 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2020(28/Und.)	A285PH		EUR	400			% 90,750	363.000,00	0,49
4,0000 % Estland, Republik EO-Bonds 2022(32)	A3K98Z		EUR	2.000	1.000		% 105,810	2.116.200,00	2,84
3,1240 % Korea Housing Fin.Corp. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2024(29)	A3LV5C		EUR	400	400		% 100,980	403.920,00	0,54
2,5000 % OMV AG EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	A281UC		EUR	400			% 96,630	386.520,00	0,52
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LCQ4		EUR	2.000			% 101,140	2.022.800,00	2,72
0,0100 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2021(31)	A2877Y		EUR	400	200		% 83,560	334.240,00	0,45
4,0000 % Slowakei EO-Anl. 2022(32)	A3LAH2		EUR	1.000			% 104,970	1.049.700,00	1,41
1,7500 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 2022(34)	A3K416		EUR	400	100		% 89,850	359.400,00	0,48
3,9000 % Spanien EO-Bonos 2023(39)	A3LESW		EUR	2.000	2.000		% 105,200	2.104.000,00	2,83
3,2470 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2024(34)	A3LV5J		EUR	400	400		% 102,732	410.929,20	0,55
2,6250 % Vodafone Group PLC EO-FLR Cap.Sec. 2020(26/80)	A281WT		EUR	400			% 97,288	389.152,00	0,52
1,3750 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2017(32)	A19HM5		EUR	200			% 89,367	178.734,00	0,24

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	
Zertifikate									
Invesco Physical Markets PLC ETC 31.12.2100 Platin/Unze	A1KX36		STK	34.000	36.000	USD	88,930	2.731.610,80	3,67
WisdomTree Metal Securiti.Ltd. Physical Platinum ETC 07(unl.)	A0N6XG		STK	16.000		USD	85,555	1.236.679,01	1,66
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	5.112.997,83	6,87	
Verzinsliche Wertpapiere									
1,4500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	A3KLJU		EUR	400		%	94,150	376.600,00	0,51
3,8750 % United States of America DL-Notes 2023(33)	A3LLWD		USD	4.000	2.000	%	99,797	3.606.355,59	4,84
3,3750 % United States of America DL-Notes 2023(33) Ser.C-2033	A3LHJ8		USD	1.300		%	96,219	1.130.042,24	1,52
Investmentanteile						EUR	36.197.431,03	48,63	
Gruppenfremde Investmentanteile									
ATHENA UI Inhaber-Anteile Anteilklasse S	A40DBV		ANT	25.000	25.000	EUR	101,340	2.533.500,00	3,40
FT ICAV-FTSE China U.ETF Reg. Shares USD Acc. o.N.	A2PB5V		ANT	191.000		EUR	19,228	3.672.548,00	4,93
iShs EO H.Yield Corp Bd U.ETF Registered Shares o.N.	A1C3NE		ANT	15.000		EUR	94,460	1.416.900,00	1,90
iShs VII-MSCI EM Asia U.ETF Reg. Shares USD (Acc) o.N.	A1C1H5		ANT	16.000		EUR	162,820	2.605.120,00	3,50
iShsII-J.P.M.\$ EM Bond U.ETF Reg. Shares EUR Hgd (Acc) o.N.	A2PGVX		ANT	410.000		EUR	4,773	1.956.848,00	2,63
iShsIV-Automation&Robot.U.ETF Registered Shares o.N.	A2ANH0		ANT	390.000	130.000	EUR	11,992	4.676.880,00	6,28
iShsIV-MSCI China UCITS ETF Registered Shares USD (Acc)o.N	A2PGQN		ANT	710.000		EUR	3,678	2.611.025,00	3,51
L&G-L&G India INR G.Bd F.U.ETF Reg. Shs USD Dis. oN	A3CRPV		ANT	125.000	125.000	EUR	7,977	997.125,00	1,34
Laz.Nordic H.Yield Bd Reg.Shs EA EUR Acc. oN	A3DTD4		ANT	13.500		EUR	120,754	1.630.172,25	2,19
SPDR MSCI World Heal.Care UETF Registered Shares o.N.	A2AE58		ANT	40.000		EUR	61,540	2.461.600,00	3,31
SPDR Russell2000US.S.Cap U.ETF Registered Shares o.N.	A1XFN1		ANT	30.000	30.000	EUR	57,110	1.713.300,00	2,30
Xtrackers MSCI Emerg.Mkts Swap Inhaber-Anteile 1C o.N.	DBX1EM		ANT	19.000		EUR	47,267	898.073,00	1,21
Zantke Euro High Yield AMI Inhaber-Anteile I(a)	A0YAX4		ANT	7.000		EUR	119,580	837.060,00	1,12
AB SICAV I-Short Dur.H.Yld Ptf Actions Nom. I2 USD o.N.	A1JDQM		ANT	95.000		USD	26,040	2.234.890,23	3,00
InvescoM3-US HY Fall Ang UETF Registered Shares Dis o.N.	A2AN8T		ANT	50.000		USD	21,803	984.845,06	1,32
InvescoMI S&P 500 ETF Registered Shares Acc o.N.	A1CYW7		ANT	5.000		USD	1.099,715	4.967.544,49	6,67
Summe Wertpapiervermögen						EUR	64.908.054,54	87,20	

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	612.165,50	0,82
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
Aktienindex-Derivate						EUR	194.676,58	0,26
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Aktienindex-Terminkontrakte								
S&P 500 E-Mini Index Future 20.09.24		359	USD	Anzahl 58			194.676,58	0,26
Devisen-Derivate						EUR	417.488,92	0,56
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								
Offene Positionen								
CAD/EUR 2,4 Mio.		OTC					-26.929,91	-0,04
NZD/EUR 3,0 Mio.		OTC					-15.957,99	-0,02
USD/EUR 41,3 Mio.		OTC					483.834,04	0,65
Devisenterminkontrakte (Kauf)								
Offene Positionen								
CAD/EUR 6,9 Mio.		OTC					696,10	0,00
NZD/EUR 3,0 Mio.		OTC					45.503,15	0,06
USD/EUR 13,8 Mio.		OTC					-69.656,47	-0,09
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	7.966.942,28	10,70
Bankguthaben						EUR	7.966.942,28	10,70
EUR-Guthaben bei:								
HSBC Continental Europe S.A.,Germany (Düsseldorf)			EUR	3.402.086,27		% 100,000	3.402.086,27	4,57
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
			USD	5.052.839,11		% 100,000	4.564.856,01	6,13
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	1.018.325,27	1,37
Zinsansprüche			EUR	218.387,26			218.387,26	0,29
Dividendenansprüche			EUR	4.527,40			4.527,40	0,01
Einschüsse (Initial Margins)			USD	880.440,00			795.410,61	1,07
Sonstige Verbindlichkeiten *)						EUR	-70.187,16	-0,09
Fondsvermögen						EUR	74.435.300,43	100,00 ¹⁾
Anteilwert						EUR	57,18	
Umlaufende Anteile						STK	1.301.792	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.08.2024		
Schweizer Franken	(CHF)	0,9391500	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4590000	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8422500	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,3355000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,1069000	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

359 Chicago Merc. Ex.

c) OTC

Over-the-Counter

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

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000	861837	STK	45	88	
AAK AB Namn-Aktier SK 1,67	A2JNX7	STK	3.761	3.761	
ABN AMRO Bank N.V. Cert.v.Aand.op Naam EO 1	A143G0	STK		5.387	
Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01	A2JNF4	STK	52	52	
Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10	A12D3A	STK	436	436	
Alfa Laval AB Namn-Aktier SK 2,5	577335	STK	1.939	1.939	
Allfunds Group Ltd. Registered Shares EO-,0025	A3CNAB	STK	13.310	13.310	
ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04	868730	STK		138	
Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568	920876	STK		2.705	
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	A3DLE9	STK	4.753	4.753	
Bakkafrost P/F Navne-Aktier DK 1,-	A1CVJD	STK	1.299	1.299	
Banco BPM S.p.A. Azioni o.N.	A2DJF1	STK	12.587	12.587	
Banco Com. Português SA (BCP) Acç. Nom. + Port. Reg. o.N.	A2ATK9	STK		270.066	
Banco de Sabadell S.A. Acciones Nom. Serie A EO -,125	A0MRD4	STK		60.555	
Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50	858872	STK	17.167	17.167	
Bankinter S.A. Acciones Nom. EO -,30	A0MW33	STK		12.601	
Bca Pop. di Sondrio S.p.A. Azioni nom. EO 3	918561	STK	10.505	10.505	
Bellway PLC Registered Shares LS -,125	869646	STK	2.362	2.362	
Best Buy Co. Inc. Registered Shares DL -,10	873629	STK		411	
Bio-Techne Corp. Registered Shares DL -,01	A12ENG	STK		425	
Bk of New York MellonCorp.,The Registered Shares DL -,01	A0MVKA	STK		705	
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	887771	STK	1.201	1.201	
Bolloré SE Actions Port. EO 0,16	875558	STK	12.367	12.367	
BPER Banca S.p.A. Azioni nom. EO 3	897832	STK	19.737	19.737	
BT Group PLC Registered Shares LS 0,05	794796	STK	64.601	64.601	
Camden Property Trust Reg. Shs of Benef. Int.DL-,01	985335	STK		445	
Catalent Inc. Registered Shares DL -,01	A112H2	STK		506	
Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien SF 6,70	A1T7B9	STK	2.528	2.528	
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	CBK100	STK	5.066	5.066	
Cranswick PLC Registered Shares LS -,10	882401	STK		1.507	
Danske Bank AS Navne-Aktier DK 10	850857	STK	2.885	2.885	
DCC PLC Registered Shares EO -,25	903840	STK		1.065	
Demant AS Navne Aktier A DK 0,2	A2AKB9	STK	1.608	1.608	
Dentsply Sirona Inc. Registered Shares DL -,01	A2AFOE	STK		828	
Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien o.N.	909943	STK		1.791	
Everest Group Ltd. Registered Shares DL -,01	580891	STK		109	
F5 Inc. Registered Shares o.N.	922977	STK		258	
Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -,01	A2ACKK	STK		209	
First Solar Inc. Registered Shares DL -,001	A0LEKM	STK		206	
Frontline PLC Namens-Aktien DL 1	A3D38W	STK		3.525	
Galp Energia SGPS S.A. Acções Nominativas EO 1	A0LB24	STK	4.026	4.026	
Generac Holdings Inc. Registered Shares o.N.	A0YGR4	STK		297	
GSK PLC Registered Shares LS-,3125	A3DMB5	STK	3.732	7.477	
Hera S.p.A. Azioni nom. EO 1	471473	STK		22.785	
HOCHTIEF AG Inhaber-Aktien o.N.	607000	STK		702	
HP Inc. Registered Shares DL -,01	A142VP	STK		934	
Humana Inc. Registered Shares DL -,166	856584	STK		110	
IMI PLC Registered Shares LS -,2857	A1XCMM	STK		3.610	
Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03	A11873	STK	1.525	1.525	
Intermediate Capital Grp PLC Registered Shares LS -,2625	A2AMU0	STK	2.675	6.096	

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
International Paper Co. Registered Shares DL 1	851413	STK		1.506	
ISS AS Indehaver Aktier DK 1	A1XE8F	STK		4.140	
Jyske Bank A/S Navne-Aktier DK 10	A0DKMP	STK		1.011	
Kellanova Co. Registered Shares DL -,25	853265	STK		763	
Lotus Bakeries S.A. Actions Nom. o.N.	877480	STK		8	
Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001	A0F602	STK		94	
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.	843002	STK	190	190	
News Corp. Registered Shares A DL -,01	A1W03Z	STK		1.954	
NEXT PLC Registered Shares LS 0,10	779551	STK	742	742	
Northern Trust Corp. Registered Shares DL 1,666	854009	STK		449	
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	A3EU6F	STK		672	
NXP Semiconductors NV Aandelen aan toonder EO -,20	A1C5WJ	STK		112	
ON Semiconductor Corp. Registered Shares DL -,01	930124	STK		322	
Pandora A/S Navne-Aktier DK 1	A1C6JV	STK	505	1.034	
Prysmian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10	A0MP84	STK	1.622	1.622	
RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N.	701080	STK	109	109	
Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom. EO -,125	A0EABR	STK	1.462	1.462	
Renault S.A. Actions Port. EO 3,81	893113	STK	1.959	1.959	
Ringkjøbing Landbobank AS Navne-Aktier DK 1	A2DSNH	STK		471	
Sage Group PLC, The Registered Shares LS-,01051948	A1WYYZ	STK		5.263	
Salmar ASA Navne-Aksjer NK -,25	A0MR2G	STK	1.244	1.244	
Seagate Technolog.Holdings PLC Registered Shares DL -,00001	A3CQU7	STK		389	
Storebrand ASA Navne-Aksjer NK 5	867218	STK	8.795	8.795	
Sydbank AS Navne-Aktier DK 10	A0D9FT	STK		1.688	
Sysco Corp. Registered Shares DL 1	859121	STK		573	
Targa Resources Corp. Registered Shares DL -,001	A1C9E3	STK		535	
Teradyne Inc. Registered Shares DL -,125	859892	STK		236	
Tesco PLC Registered Shs LS-,0633333	A2QQMK	STK		20.980	
Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria) SK 25	873098	STK	2.334	2.334	
V.F. Corp. Registered Shares o.N.	857621	STK		2.566	
Valero Energy Corp. Registered Shares DL -,01	908683	STK		338	
Valmet Oyj Registered Shares o.N.	A1XA9J	STK	2.629	2.629	
Verisign Inc. Registered Shares DL -,001	911090	STK		208	
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	A0NC7B	STK		144	
Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N.	855689	STK	3.274	3.274	
Walgreens Boots Alliance Inc. Reg. Shares DL -,01	A12HJF	STK		1.500	
Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N.	881050	STK	3.682	3.682	
WH Smith PLC Registered Shares LS-,220895	A0NCXL	STK	6.096	6.096	
Wise PLC Registered Shares LS -,01	A3CTVY	STK	1.161	8.602	
Verzinsliche Wertpapiere					
1,8750 % Slowakei EO-Medium-Term Notes 2017(37)	A19D6Y	EUR		1.000	
1,7500 % Slowenien, Republik EO-Bonds 2016(40)	A188LC	EUR		1.000	
Zertifikate					
XTrackers ETC PLC ETC Z23.04.80 Gold	A2TOVU	STK		86.958	
Sonstige Beteiligungswertpapiere					
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	855167	STK	271	561	

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
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,1250 % United States of America DL-Notes 2023(53)	A3LLWE	USD		3.500	
Nicht notierte Wertpapiere					
Aktien					
WRKCo Inc. Registered Shares DL -,01	A14V41	STK		961	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
Invesco Fds-Inv.India Bond Fd Act. Nom. C Acc. USD o.N.	A1XETN	ANT		65.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): S+P 500)		EUR			16.787,21
Verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)		EUR			13.712,62
Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, BRITISCH LO.GILT SYN.AN., EURO-BUND)		EUR			36.193,56
Verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert(e): 10Y.JAPAN GOV.BD.SYN.AN, 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-BUND)		EUR			41.443,28
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
AUD/EUR		EUR			13.094
CAD/EUR		EUR			6.215
CHF/EUR		EUR			4.062
JPY/EUR		EUR			2.325
JPY/USD		EUR			2.419
NZD/EUR		EUR			3.376
USD/EUR		EUR			148.808
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
Kauf von Devisen auf Termin:					
AUD/EUR		EUR			13.108
CAD/EUR		EUR			4.608
CHF/EUR		EUR			4.084
JPY/EUR		EUR			2.346
JPY/USD		EUR			2.376
NZD/EUR		EUR			3.380
USD/EUR		EUR			185.711

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	57,18
Umlaufende Anteile	STK	1.301.792

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

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