

Sparkasse Trier Saar-Mosel Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 31.03.2024

LB≡BW Asset Management



Weil's um mehr als Geld geht

Sparkasse
Trier

Inhalt

- 8 Vermögensübersicht zum 31.03.2024
- 9 Vermögensaufstellung zum 31.03.2024
- 17 Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen
- 19 Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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



Ulrike Modersohn

Sparkasse Trier Saar-Mosel Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 31.03.2024

Vermögensübersicht zum 31.03.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	58.859.860,01	100,12
1. Aktien	23.129.040,95	39,34
USA	8.062.027,83	13,71
Bundesrep. Deutschland	3.530.752,50	6,01
Frankreich	2.778.867,60	4,73
Großbritannien	2.654.998,98	4,52
Niederlande	1.336.075,10	2,27
Irland	1.121.366,63	1,91
Canada	781.819,06	1,33
Dänemark	612.634,40	1,04
Schweden	589.053,51	1,00
Italien	479.061,00	0,81
Japan	364.619,47	0,62
Andere Länder	817.764,87	1,39
2. Anleihen	34.491.278,67	58,67
Frankreich	6.172.960,50	10,50
Niederlande	5.095.205,00	8,67
Bundesrep. Deutschland	4.559.384,00	7,76
Österreich	2.380.617,00	4,05
Italien	2.310.978,46	3,93
Großbritannien	2.072.303,00	3,52
Australien	1.719.928,00	2,93
Spanien	1.622.470,00	2,76
Canada	975.085,00	1,66
Norwegen	875.783,00	1,49
Portugal	844.628,00	1,44
Schweden	809.593,00	1,38
Finnland	781.718,57	1,33
Belgien	767.965,00	1,31
Andere Länder	3.502.660,14	5,96
3. Sonstige Beteiligungswertpapiere	141.680,80	0,24
4. Derivate	69.236,12	0,12
5. Bankguthaben	569.185,47	0,97
6. Sonstige Vermögensgegenstände	459.438,00	0,78
II. Verbindlichkeiten	-69.737,36	-0,12
III. Fondsvermögen	58.790.122,65	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	57.762.000,42	98,25
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	54.508.512,28	92,72
Aktien									
Canadian Paci.Kansas City Ltd. Registered Shares o.N.	A3D9ZG		STK	2.600	800		CAD 119,430	212.465,28	0,36
Sun Life Financial Inc. Registered Shares o.N.	936039		STK	7.400	2.200		CAD 73,910	374.227,85	0,64
Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -,10	A0Q4DC		STK	2.700	2.700		CHF 95,750	265.767,15	0,45
Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK 0,1	A3EU6F		STK	4.400	1.600	1.000	DKK 881,300	519.871,30	0,88
Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10	A0NBLH		STK	1.800	500		DKK 384,400	92.763,10	0,16
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50	850133		STK	1.390	400		EUR 192,840	268.047,60	0,46
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.	840400		STK	1.200	500	400	EUR 277,800	333.360,00	0,57
ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09	A1J4U4		STK	750	300	250	EUR 892,200	669.150,00	1,14
ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16	A2AKBT		STK	4.500	1.300		EUR 45,390	204.255,00	0,35
AXA S.A. Actions Port. EO 2,29	855705		STK	18.000	6.000	2.400	EUR 34,815	626.670,00	1,07
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	887771		STK	3.500	1.000		EUR 65,860	230.510,00	0,39
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.	CBK100		STK	16.500	16.500		EUR 12,730	210.045,00	0,36
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.	581005		STK	3.900	1.700	1.800	EUR 189,650	739.635,00	1,26
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.	555200		STK	3.500	1.000		EUR 39,915	139.702,50	0,24
EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5	A0Q249		STK	8.500	8.500		EUR 12,545	106.632,50	0,18
ENCAVIS AG Inhaber-Aktien o.N.	609500		STK	8.600	8.600		EUR 16,855	144.953,00	0,25
Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.	840221		STK	1.650	900	1.450	EUR 253,700	418.605,00	0,71
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	623100		STK	9.300	9.300		EUR 31,515	293.089,50	0,50
KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.	854943		STK	2.425	700		EUR 69,420	168.343,50	0,29
L'Oréal S.A. Actions Port. EO 0,2	853888		STK	1.300	400		EUR 438,650	570.245,00	0,97
LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.	547040		STK	11.200	11.200		EUR 24,810	277.872,00	0,47
NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12	A115DY		STK	10.805	3.200		EUR 42,820	462.670,10	0,79
Prysmian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10	A0MP84		STK	9.900	2.900		EUR 48,390	479.061,00	0,81
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	920657		STK	3.500	3.500		EUR 90,960	318.360,00	0,54
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.	716460		STK	825	500	825	EUR 180,460	148.879,50	0,25
Schneider Electric SE Actions Port. EO 4	860180		STK	1.100	300		EUR 209,650	230.615,00	0,39
Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N.	SHL100		STK	3.300	1.000		EUR 56,720	187.176,00	0,32
Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	SYM999		STK	1.300	400		EUR 110,950	144.235,00	0,25

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Unilever PLC Registered Shares LS -,031111	A0JNE2		STK	11.780	3.900	1.500	EUR 46,520	548.005,60	0,93
VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50	867475		STK	4.500	1.500	600	EUR 118,760	534.420,00	0,91
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.	A1ML7J		STK	18.000	18.000		EUR 27,400	493.200,00	0,84
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	886455		STK	4.000	1.200		GBP 106,780	499.584,77	0,85
CRH PLC Registered Shares EO -,32	864684		STK	9.800	9.800		GBP 68,280	782.670,33	1,33
HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50	923893		STK	37.000	22.400	38.870	GBP 6,190	267.887,01	0,46
London Stock Exchange Group PLC Reg. Shares LS 0,069186047	A0JEJF		STK	6.800	2.000		GBP 94,900	754.804,37	1,28
Relx PLC Registered Shares LS -,144397	A0M95J		STK	14.600	4.300		GBP 34,240	584.717,23	0,99
Nomura Research Institute Ltd. Registered Shares o.N.	630026		STK	14.000	4.100		JPY 4.257,000	364.619,47	0,62
Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098	851908		STK	24.100	7.100		NOK 59,400	122.181,54	0,21
Tomra Systems ASA Navne-Aksjer NK -,50	A3DHA0		STK	10.700	10.700		NOK 169,550	154.840,18	0,26
Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK-,052125	A3DLE9		STK	25.500	25.500		SEK 180,800	399.237,96	0,68
Epiroc AB Namn-Aktier A o.N.	A3CPHU		STK	10.900	3.200		SEK 201,100	189.815,55	0,32
3M Co. Registered Shares DL -,01	851745		STK	2.800	800		USD 106,070	274.996,30	0,47
Abbott Laboratories Registered Shares o.N.	850103		STK	2.100	600		USD 113,660	221.005,56	0,38
Air Products & Chemicals Inc. Registered Shares DL 1	854912		STK	3.300	1.000		USD 242,270	740.269,44	1,26
Blackrock Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	928193		STK	700	300	300	USD 833,700	540.361,11	0,92
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	850501		STK	3.100	900		USD 54,230	155.660,19	0,26
Canadian National Railway Co. Registered Shares o.N.	897879		STK	1.600			USD 131,710	195.125,93	0,33
Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01	A1H92V		STK	9.600	2.800		USD 63,240	562.133,33	0,96
Colgate-Palmolive Co. Registered Shares DL 1	850667		STK	3.500	1.000		USD 90,050	291.828,70	0,50
CSX Corp. Registered Shares DL 1	865857		STK	5.800	1.700		USD 37,031	198.871,80	0,34
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	A12FMV		STK	1.100	300		USD 518,540	528.142,59	0,90
GATX Corp. Registered Shares DL -,625	851137		STK	1.400	400		USD 134,030	173.742,59	0,30
General Mills Inc. Registered Shares DL -,10	853862		STK	5.400	3.500		USD 69,970	349.850,00	0,60
Intel Corp. Registered Shares DL -,001	855681		STK	300			USD 44,135	12.259,72	0,02
Johnson Controls Internat. PLC Registered Shares DL -,01	A2AQCA		STK	5.600	5.600		USD 65,320	338.696,30	0,58
Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	A12B6J		STK	1.300	400		USD 156,380	188.235,19	0,32
Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001	A0F602		STK	800	800		USD 481,570	356.718,52	0,61
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	A0YD8Q		STK	2.600	800		USD 131,950	317.657,41	0,54

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Moody's Corp. Registered Shares DL-,01	915246		STK	1.100	300		USD 393,030	400.308,33	0,68
MSCI Inc. Registered Shares A DL -,01	A0M63R		STK	600	600		USD 560,450	311.361,11	0,53
NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.	866993		STK	3.000	900		USD 93,980	261.055,56	0,44
Pfizer Inc. Registered Shares DL -,05	852009		STK	10.500	3.100		USD 27,750	269.791,67	0,46
Procter & Gamble Co., The Registered Shares o.N.	852062		STK	2.820	800		USD 162,250	423.652,78	0,72
S&P Global Inc. Registered Shares DL 1	A2AHZ7		STK	1.500	600	500	USD 425,450	590.902,78	1,01
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	A0NC7B		STK	1.700	500		USD 279,080	439.292,59	0,75
Waste Management Inc. Registered Shares DL -,01	893579		STK	2.300	700		USD 213,150	453.930,56	0,77
Verzinsliche Wertpapiere									
4,5000 % A2A S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K9HY		EUR	300			% 104,516	313.548,00	0,53
1,6250 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	A28V25		EUR	300			% 90,580	271.740,00	0,46
1,5000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/28)	A3K3L0		EUR	300			% 93,185	279.555,00	0,48
4,0000 % Akzo Nobel N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/33)	A3LH2B		EUR	500			% 103,221	516.105,00	0,88
3,8750 % Assa-Abloy AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LM37		EUR	300			% 103,381	310.143,00	0,53
3,4370 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LF4D		EUR	500			% 99,901	499.505,00	0,85
3,0000 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2022(26)	A3LAW1		EUR	500			% 99,548	497.740,00	0,85
3,2500 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.T.Obr.Hipotecárias 24(31)	A3LUMT		EUR	200	200		% 100,310	200.620,00	0,34
3,2500 % Bank of Nova Scotia, The EO-Med.-T. Cov. Bonds 2023(28)	A3LC1J		EUR	500			% 100,100	500.500,00	0,85
1,2080 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2019(19/26)	A2R2UQ		EUR	300			% 95,339	286.017,00	0,49
0,8000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2018(28) Ser. 85	A19U5T		EUR	500			% 92,831	464.155,00	0,79
3,3750 % BMW US Capital LLC EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LT42		EUR	300	300		% 99,420	298.260,00	0,51
3,0000 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(30)	BP45YQ		EUR	500			% 100,260	501.300,00	0,85
4,2500 % Brambles Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	A3LFL5		EUR	300			% 104,984	314.952,00	0,54
1,1250 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/29)	A2R7MH		EUR	300			% 88,740	266.220,00	0,45
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2019 (2029)	110247		EUR	500			% 88,725	443.625,00	0,75
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033)	BU2Z00		EUR	700			% 100,360	702.520,00	1,19
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2033) Grüne	BU3Z00		EUR	800			% 100,215	801.720,00	1,36
3,1250 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2023(30)	A3LESJ		EUR	700			% 101,750	712.250,00	1,21
3,5000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2023(29)	A3LQ4R		EUR	200	200		% 102,427	204.854,00	0,35
0,7500 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(28)	A3K2LY		EUR	500			% 91,240	456.200,00	0,78

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,8750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 23(23/30)	A3LRD7		EUR	300	300		% 101,933	305.799,00	0,52
0,2500 % Comun. Autónoma del País Vasco EO-Obligaciones 2020(31)	A28447		EUR	500			% 82,203	411.015,00	0,70
3,4620 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2024(34)	A3LU38		EUR	500	500		% 101,297	506.485,00	0,86
4,7500 % Covestro AG EO-MTN v.2022(2022/2028)	A30VQX		EUR	300			% 105,441	316.323,00	0,54
3,5000 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2024(33)	A3LTBQ		EUR	200	200		% 102,620	205.240,00	0,35
3,7060 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	A3LQUX		EUR	300	300		% 102,430	307.290,00	0,52
0,3750 % Dassault Systemes SE EO-Notes 2019(19/29)	A2R7Q1		EUR	300			% 86,765	260.295,00	0,44
0,6250 % DNB Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2019(26)	A2RWAB		EUR	500			% 95,410	477.050,00	0,81
4,3750 % DS Smith PLC EO-Medium-Term Nts 2023(23/27)	A3LLGZ		EUR	200			% 102,079	204.158,00	0,35
3,3750 % E.ON SE Medium Term Notes v.24(30/31)	A3826T		EUR	200	200		% 100,119	200.238,00	0,34
0,2500 % Elisa Oyj EO-Medium-Term Nts 2020(27/27)	A282EB		EUR	300			% 90,145	270.435,00	0,46
3,8500 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2023(30/30)	A3LREE		EUR	300	300		% 102,560	307.680,00	0,52
4,3000 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2023(34/34)	A3LREF		EUR	200	200		% 104,840	209.680,00	0,36
5,1250 % Fresenius SE & Co. KGaA MTN v.2023(2030/2030)	A3515F		EUR	200			% 107,555	215.110,00	0,37
5,1250 % Huhtamäki Oyj EO-Notes 2023(23/28)	A3LRD8		EUR	200	200		% 103,485	206.970,00	0,35
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2022(27)	A3LAH1		EUR	300			% 99,818	299.454,00	0,51
1,1250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/26)	A3E44V		EUR	300			% 95,086	285.258,00	0,49
0,0000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2021(28)	A3KLAX		EUR	400		900	% 88,110	352.440,00	0,60
3,5000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2024(34)	A3LWDK		EUR	300	300		% 101,834	305.502,00	0,52
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	A3LGGP		EUR	1.000	500		% 104,150	1.041.500,00	1,77
1,6250 % KION GROUP AG Med.Term.Notes v.20(20/25)	A289QY		EUR	200			% 96,505	193.010,00	0,33
3,3750 % Kroatien, Republik EO-Notes 2024(34)	A3LVYY		EUR	500	500		% 99,662	498.310,00	0,85
0,0000 % La Poste EO-Medium-Term Notes 2021(29)	A287PR		EUR	300			% 84,270	252.810,00	0,43
3,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN-Pfandbr.Ser.836 v.23(27)	LB387B		EUR	500			% 101,080	505.400,00	0,86
3,5000 % Legrand S.A. EO-Obl. 2023(23/29)	A3LJBG		EUR	300			% 101,420	304.260,00	0,52
2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH EO-Medium-Term Nts 2020(28/28)	A28VAZ		EUR	500			% 96,503	482.515,00	0,82
3,0000 % Münchener Hypothekbank MTN-HPF Ser.2041 v.24(34)	MHB38J		EUR	400	400		% 101,120	404.480,00	0,69
0,5530 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2020(20/29)	A282LR		EUR	300			% 85,482	256.446,00	0,44
4,3750 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 23(23/31)	A3LEFB		EUR	200			% 101,982	203.964,57	0,35
0,7500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/25)	A3K3U0		EUR	500			% 97,189	485.945,00	0,83

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,1250 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/27)	A3K3U1		EUR	500			% 93,946	469.730,00	0,80
1,3750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/30)	A3K3U3		EUR	300		200	% 91,855	275.565,00	0,47
1,2500 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)	A28VQT		EUR	300			% 94,050	282.150,00	0,48
2,3750 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	A3K5N4		EUR	300			% 94,229	282.687,00	0,48
3,8750 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	A3LM16		EUR	300			% 104,652	313.956,00	0,53
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	A19SNH		EUR	300			% 90,451	271.353,00	0,46
3,2500 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/31)	A3K88F		EUR	300			% 98,495	295.485,00	0,50
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(29)	A3LGQG		EUR	500			% 101,340	506.700,00	0,86
2,9000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LTRT		EUR	300	300		% 100,670	302.010,00	0,51
0,4750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2020(30)	A28R4W		EUR	500			% 87,230	436.150,00	0,74
2,8750 % Portugal, Republik EO-Obr. 2024(34)	A3LS33		EUR	210	210		% 98,980	207.858,00	0,35
3,3750 % RELX Finance B.V. EO-Notes 2024(24/33)	A3LWCX		EUR	300	300		% 100,187	300.561,00	0,51
0,5000 % REN Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3KPNA		EUR	300			% 87,520	262.560,00	0,45
0,6250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(26)	A3K3MC		EUR	500			% 94,917	474.585,00	0,81
0,0500 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2020(27)	A28R4R		EUR	300			% 91,525	274.575,00	0,47
1,1250 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(27)	A3K374		EUR	500			% 94,215	471.075,00	0,80
3,2500 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2022(22/27)	A3LA5M		EUR	300			% 100,469	301.407,00	0,51
3,3750 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/25)	A3LF6Q		EUR	300			% 99,825	299.473,50	0,51
3,1250 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)	A3LC3G		EUR	200			% 100,676	201.352,00	0,34
3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2023(31/31)	A3LEFR		EUR	500			% 102,083	510.415,00	0,87
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LHVU		EUR	500			% 99,890	499.450,00	0,85
0,0100 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 2021(26)	A3KZKN		EUR	300			% 92,260	276.780,00	0,47
3,1500 % Spanien EO-Bonos 2023(33)	A3LDPZ		EUR	700			% 100,710	704.970,00	1,20
2,8750 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	A3K880		EUR	300			% 98,240	294.720,00	0,50
4,0000 % Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LJB7		EUR	100			% 100,349	100.349,00	0,17
4,0000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	A3LN80		EUR	100			% 104,013	104.013,00	0,18
0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2020(30/30)	A282XN		EUR	300			% 82,411	247.232,46	0,42
3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LGUC		EUR	300			% 101,018	303.054,00	0,52
3,5000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2024(24/31)	A3LTA8		EUR	200	200		% 100,202	200.404,00	0,34
3,0000 % UniCredit Bank Austria AG EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2023(26)	A3LCSA		EUR	300			% 99,251	297.753,00	0,51

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
3,7500 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(28)	A3LJ6R		EUR	500			% 100,888	504.440,00	0,86
5,3750 % Valéo S.E. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	A3LBTB		EUR	100			% 103,644	103.644,00	0,18
0,0000 % VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A285JA		EUR	300			% 87,089	261.267,00	0,44
3,4570 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(25)	A3LF5D		EUR	500			% 99,918	499.590,00	0,85
2,7500 % Wienerberger AG EO-Schuldv. 2020(20/25)	A28XZ9		EUR	500			% 98,437	492.185,00	0,84
3,0000 % ZF Finance GmbH MTN v.2020(2020/2025)	A289EU		EUR	500			% 98,340	491.700,00	0,84
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N.	855167		STK	600	700	1.800	CHF 229,700	141.680,80	0,24
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	3.253.488,14	5,53
Verzinsliche Wertpapiere									
3,5000 % American Medical Syst.Eu. B.V. EO-Notes 2024(24/32)	A3LU9V		EUR	200	200		% 100,822	201.644,00	0,34
2,2500 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32)	A3K5LQ		EUR	500			% 95,668	478.340,00	0,81
5,0000 % Crown European Holdings S.A. EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	A3LHVJ		EUR	200			% 102,750	205.500,00	0,35
3,7500 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LS5V		EUR	300	300		% 101,270	303.810,00	0,52
3,5000 % Getlink SE EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	A284GU		EUR	300			% 99,382	298.146,00	0,51
3,4000 % Linde PLC EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	A3LUKW		EUR	200	200		% 100,289	200.578,00	0,34
4,3750 % Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	A3K6U4		EUR	500			% 105,137	525.685,00	0,89
0,8750 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)	A2R2KE		EUR	300			% 94,959	284.877,00	0,48
2,1250 % SIG Combibloc PurchaseCo SARL EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	A28YVN		EUR	200			% 97,643	195.285,14	0,33
2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	A192ZF		EUR	300			% 98,330	294.990,00	0,50
1,0000 % Telstra Corp. Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	A28WEQ		EUR	300			% 88,211	264.633,00	0,45
Summe Wertpapiervermögen							EUR	57.762.000,42	98,25
Derivate							EUR	69.236,12	0,12
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-10.750,00	-0,02
Wertpapier-Optionsrechte									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte auf Aktien									
Put Palo Alto Networks Inc 210 20.09.24	361		STK	-2.700			USD 4,300	-10.750,00	-0,02

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Aktienindex-Derivate						EUR	44.486,12	0,08
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Optionsrechte								
Optionsrechte auf Aktienindices								
Call Russell 2000 Index/Old 2230 12.04.24		361	Anzahl	-5500		USD 3,990	-20.319,44	-0,03
Put Russell 2000 Index/Old 1790 12.04.24		361	Anzahl	-5500		USD 0,390	-1.986,11	0,00
Put S&P 500 INDEX 4850 20.12.24		361	Anzahl	700		USD 103,050	66.791,67	0,11
Zins-Derivate						EUR	35.500,00	0,06
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Optionsrechte								
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte								
Put Euro Bund Future Jun 24 132 26.04.24		185	EUR Anzahl	-50			35.500,00	0,06
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	569.185,47	0,97
Bankguthaben						EUR	569.185,47	0,97
EUR-Guthaben bei:								
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	516.718,69		% 100,000	516.718,69	0,88
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen								
			DKK	21.338,93		% 100,000	2.860,83	0,00
			NOK	4.592,27		% 100,000	391,95	0,00
			SEK	76.344,00		% 100,000	6.611,01	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
			CHF	16.332,88		% 100,000	16.790,42	0,03
			GBP	15.871,95		% 100,000	18.564,77	0,03
			JPY	236.371,00		% 100,000	1.446,11	0,00
			USD	6.265,83		% 100,000	5.801,69	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	459.438,00	0,78
Zinsansprüche			EUR	431.015,50			431.015,50	0,73
Dividendenansprüche			EUR	28.422,50			28.422,50	0,05
Sonstige Verbindlichkeiten ^{*)}			EUR	-69.737,36			-69.737,36	-0,12
Fondsvermögen						EUR	58.790.122,65	100,00 ¹⁾
Anteilwert						EUR	49,74	
Umlaufende Anteile						STK	1.182.055	

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

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.03.2024		
Canadische Dollar	(CAD)	1,4615000	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9727500	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4590000	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8549500	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	163,4526000	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	11,7165000	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,5480000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0800000	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
361	Chicago - CBOE Opt. Ex.

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					
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	871981	STK	300	1.000	
Alstom S.A. Actions Port. EO 7	A0F7BK	STK	15.000	15.000	
Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1	A1KAGC	STK	1.300	4.300	
CRH PLC Registered Shares EO -,32	864684	STK	2.900	9.800	
Edenred SE Actions Port. EO 2	A1C0JG	STK	6.200	6.200	
Humana Inc. Registered Shares DL -,166	856584	STK	200	600	
Meyer Burger Technology AG Nam.-Aktien SF -,05	A0YJZX	STK	167.500	567.500	
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	870747	STK	500	1.800	
Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60	853823	STK	2.500	8.430	
Oracle Corp. Registered Shares DL -,01	871460	STK	800	2.600	
PUMA SE Inhaber-Aktien o.N.	696960	STK	4.600	4.600	
Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -,001	A0MLCS	STK	1.700	5.810	
SolarEdge Technologies Inc. Registered Shares DL -,0001	A14QVM	STK	700	2.300	
Valéo S.E. Actions Port. EO 1	A2ALDB	STK	19.000	19.000	
Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N.	877738	STK	1.300	4.400	
Verzinsliche Wertpapiere					
0,9500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2019(27)	A2R03E	EUR		500	
0,3750 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2016(24)	A189S3	EUR		500	
0,2500 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2016(26)	A184BH	EUR		500	
0,1250 % Auckland, Council EO-Medium-Term Notes 2019(29)	A2R8AW	EUR		1.000	
0,8750 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.-T.Obr.Hipotecárias17(24)	A19GL2	EUR		500	
0,1000 % Belgien, Königreich EO-Bons d'Etat 2020(30)	A28SFQ	EUR		1.000	
0,3750 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(27)	A2R76R	EUR		500	
0,3750 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25)	BP459C	EUR		500	
0,0000 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2021(29)	A3KNEU	EUR		300	
0,3750 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	A19FWG	EUR		500	
0,3750 % Continental AG MTN v.19(25/25)	A2YPAE	EUR		300	
0,5000 % De Volksbank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(26)	A2RWY9	EUR		500	
4,0000 % Estland, Republik EO-Bonds 2022(32)	A3K98Z	EUR		500	
3,2500 % Estland, Republik EO-Medium-Term Notes 2024(34)	A3LTA0	EUR	500	500	
3,6250 % HSBC Bank Canada EO-Mortg. Cov. Bonds 2023(28)	A3LE10	EUR		500	
0,2000 % Irland EO-Treasury Bonds 2020(27)	A28V33	EUR		1.000	
2,7500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 22(24)R.832	LB381U	EUR		300	
2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H357 v.22(26)	HLB2QL	EUR		300	
2,0000 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 19(19/26)	A2RYXN	EUR		283	
0,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	A28R5E	EUR		300	
1,5000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2019(19/28)	A2RWFV	EUR		300	
0,0100 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2020(30)	A28S36	EUR		300	
2,1250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	A3K48Y	EUR		300	
1,6250 % Valéo S.E. EO-Med.-Term Nts 2016(16/26)	A18Y75	EUR		300	
0,2500 % Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2019(26)	A2R1LF	EUR		500	
Nicht notierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Mortg.Cov. MTN 2014(24)	A1ZC67	EUR		500	

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
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	4.967,44	
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate									
Optionsrechte auf Aktienindices									
Verkaufte Kaufoptionen (Call):									
(Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)							EUR	73,34	
Optionsrechte auf Zins-Derivate									
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte									
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):									
(Basiswert(e): Euro Bund Future 06.06.24, Euro Bund Future 07.03.24, Euro Bund Future 07.12.23)							EUR	120,71	

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	49,74
Umlaufende Anteile	STK	1.182.055

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

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 1003 51
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