

LB≡**BW** Asset Management

LBBW Welt im Wandel

Halbjahresbericht zum 31.07.2022

Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.07.2022	8
Vermögensaufstellung zum 31.07.2022	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	16
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.

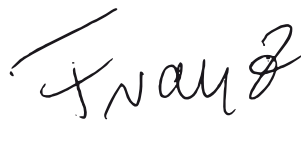
Auf unserer Internetseite informieren wir Sie darüber hinaus regelmäßig über die Entwicklung des Fonds. Auf **www.LBBW-AM.de** finden Sie die aktuellen Fondspreise, umfangreiche Angaben zur Wertentwicklung, die Portfolio-Struktur sowie viele weitere Fakten.

Außerdem stehen Ihnen hier die jeweils aktuellen wesentlichen Anlegerinformationen, 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 Adamlä
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz



Dr. Bernhard Scherer

LBBW Welt im Wandel

Halbjahresbericht zum 31.07.2022

Vermögensübersicht zum 31.07.2022

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	30.827.921,84	100,12
1. Aktien	18.635.440,25	60,52
USA	10.208.516,80	33,15
Schweiz	1.410.694,10	4,58
Canada	1.303.610,69	4,23
Japan	1.125.327,45	3,65
Irland	761.173,50	2,47
Frankreich	722.054,17	2,34
Bundesrep. Deutschland	546.158,27	1,77
Großbritannien	424.820,62	1,38
Hongkong	402.535,04	1,31
Kaimaninseln	295.641,95	0,96
Taiwan	294.687,47	0,96
China	212.150,92	0,69
Niederlande	204.686,99	0,66
Dänemark	186.655,43	0,61
Australien	180.400,30	0,59
Norwegen	137.512,25	0,45
Spanien	128.067,42	0,42
Italien	90.746,88	0,29
2. Anleihen	11.469.609,71	37,25
USA	6.635.239,21	21,55
Frankreich	1.599.548,00	5,19
Großbritannien	1.215.544,69	3,95
Bundesrep. Deutschland	1.043.443,81	3,39
Italien	474.840,00	1,54
Dänemark	315.726,00	1,03
Niederlande	185.268,00	0,60
3. Derivate	-219.396,42	-0,71
4. Bankguthaben	862.073,94	2,80
5. Sonstige Vermögensgegenstände	80.194,36	0,26
II. Verbindlichkeiten	-36.670,65	-0,12
III. Fondsvermögen	30.791.251,19	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	30.105.049,96	97,77
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	23.905.916,99	77,64
Aktien									
Allkem Ltd. Registered Shares o.N.	A3C8Z7		STK	11.807	11.807		AUD 11,280	91.143,17	0,30
Mineral Resources Ltd. Registered Shares o.N.	A0J36A		STK	2.427	2.427		AUD 53,740	89.257,13	0,29
Bank of Montreal Registered Shares CD 2	850386		STK	6.239	6.239		CAD 127,660	609.598,36	1,98
Nutrien Ltd Registered Shares o.N.	A2DWB8		STK	1.595	1.595		CAD 109,620	133.821,06	0,43
Stantec Inc. Registered Shares o.N.	813102		STK	4.648	4.648		CAD 63,190	224.795,93	0,73
Waste Connections Inc. Registered Shares o.N.	A2AKQ7		STK	1.484	1.484		CAD 170,670	193.849,67	0,63
WSP Global Inc. Registered Shares o.N.	A1XBPS		STK	1.197	1.197		CAD 154,500	141.545,67	0,46
Barry Callebaut AG Namensaktien SF 0,02	914661		STK	153	153		CHF 2.104,000	331.475,06	1,08
UBS Group AG Namens-Aktien SF -,10	A12DFH		STK	14.542	14.542		CHF 15,485	231.872,39	0,75
Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10	579919		STK	770	770		CHF 414,900	328.963,60	1,07
DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1	A0MRDY		STK	613	613		DKK 1.220,000	100.446,59	0,33
GN Store Nord AS Navne-Aktier DK 1	854734		STK	2.542	2.542		DKK 252,500	86.208,84	0,28
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1	519000		STK	2.138	2.138		EUR 79,480	169.928,24	0,55
BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2	887771		STK	4.401	4.401		EUR 46,000	202.446,00	0,66
Capgemini SE Actions Port. EO 8	869858		STK	939	939		EUR 185,350	174.043,65	0,57
Cellnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -,25	A14RZD		STK	2.938	2.938		EUR 43,590	128.067,42	0,42
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.	555750		STK	15.788	15.788		EUR 18,506	292.172,73	0,95
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.	623100		STK	3.166	3.166		EUR 26,550	84.057,30	0,27
Infrastrutt. Wireless Italiane Azioni nom. o.N.	A14UAV		STK	8.862	8.862		EUR 10,240	90.746,88	0,29
Just Eat Takeaway.com N.V. Registered Shares EO -,04	A2ASAC		STK	4.439	4.439		EUR 17,800	79.014,20	0,26
Linde PLC Registered Shares EO 0,001	A2DSYC		STK	1.592	1.592	1.500	EUR 295,400	470.276,80	1,53
Sanofi S.A. Actions Port. EO 2	920657		STK	1.852	1.852		EUR 97,210	180.032,92	0,58
Spie S.A. Actions Nom. EO 0,47	A14UTB		STK	7.074	7.074		EUR 23,400	165.531,60	0,54
STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1,04	893438		STK	3.403	3.403		EUR 36,930	125.672,79	0,41
AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25	886455		STK	2.240	2.240		GBP 108,440	289.898,08	0,94
Unite Group PLC Registered Shares LS -,25	634811		STK	9.704	9.704		GBP 11,650	134.922,54	0,44

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
China Everbright Envi.Grp.Ltd. Registered Shares o.N.	885610		STK	332.371	332.371		HKD 4,180	173.573,81	0,56
China Railway Sig.&Com.Co.Ltd. Registered Shares H YC 1	A14XHK		STK	676.529	676.529		HKD 2,510	212.150,92	0,69
Kuaishou Technology Registered Shares Cl.B o.N.	A2QNAP		STK	10.033	10.033		HKD 79,000	99.024,51	0,32
MTR Corporation Ltd. Registered Shares o.N.	579779		STK	44.160	44.160		HKD 41,500	228.961,23	0,74
WH Group Ltd Registered Shares DL -,0001	A1116F		STK	264.942	264.942		HKD 5,940	196.617,44	0,64
Denso Corp. Registered Shares o.N.	858734		STK	2.084	2.084		JPY 7.234,000	110.625,70	0,36
Ebara Corp. Registered Shares o.N.	858656		STK	4.502	4.502		JPY 5.190,000	171.455,99	0,56
NEC Corp. Registered Shares o.N.	853675		STK	5.331	5.331		JPY 4.895,000	191.487,84	0,62
Nexon Co. Ltd Registered Shares o.N.	A1JPFB		STK	3.968	3.968		JPY 3.015,000	87.788,74	0,29
Nintendo Co. Ltd. Registered Shares o.N.	864009		STK	539	539		JPY 59.710,000	236.165,07	0,77
TIS Inc. Registered Shares o.N.	A0NFRJ		STK	4.290	4.290		JPY 3.755,000	118.208,05	0,38
Toyota Motor Corp. Registered Shares o.N.	853510		STK	5.823	5.823		JPY 2.137,000	91.312,69	0,30
Z Holdings Corp. Registered Shares o.N.	916008		STK	34.362	34.362		JPY 469,100	118.283,37	0,38
Leroy Seafood Group ASA Navne-Aksjer NK 0,10	570796		STK	17.954	17.954		NOK 75,500	137.512,25	0,45
Abbott Laboratories Registered Shares o.N.	850103		STK	1.797	1.797		USD 108,840	191.816,29	0,62
AbbVie Inc. Registered Shares DL -,01	A1J84E		STK	2.035	2.035		USD 143,510	286.414,80	0,93
Adobe Inc. Registered Shares o.N.	871981		STK	640	640		USD 410,120	257.418,46	0,84
Advanced Micro Devices Inc. Registered Shares DL -,01	863186		STK	969	969		USD 94,461	89.768,75	0,29
Agilent Technologies Inc. Registered Shares DL -,01	929138		STK	1.500	1.500		USD 134,100	197.273,57	0,64
American Tower Corp. Registered Shares DL -,01	A1JRLA		STK	516	516		USD 270,830	137.055,15	0,45
Ameriprise Financial Inc. Registered Shares DL -,01	A0F555		STK	357	357		USD 269,920	94.504,43	0,31
AMETEK Inc. Registered Shares DL -,01	908668		STK	1.023	1.023		USD 123,500	123.905,75	0,40
Amphenol Corp. Registered Shares Cl.A DL-,001	882749		STK	3.954	3.954		USD 77,130	299.094,81	0,97
Apple Inc. Registered Shares o.N.	865985		STK	6.615	6.615		USD 162,469	1.054.020,92	3,42
Bank of America Corp. Registered Shares DL 0,01	858388		STK	19.307	19.307		USD 33,810	640.189,94	2,08
Blackrock Inc. Reg. Shares Class A DL -,01	928193		STK	301	301		USD 669,180	197.541,49	0,64
Bristol-Myers Squibb Co. Registered Shares DL -,10	850501		STK	3.374	3.374		USD 73,780	244.136,44	0,79
Camden Property Trust Reg. Shs of Benef. Int.DL-,01	985335		STK	1.513	1.513		USD 141,100	209.370,18	0,68

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Charles River Labs Intl Inc. Registered Shares DL-,01	939391		STK	472	472		USD 250,540	115.975,95	0,38
Cheniere Energy Inc. Registered Shares DL -,003	580884		STK	3.578	3.578		USD 149,580	524.883,28	1,70
Chubb Ltd. Registered Shares SF 24,15	A0Q636		STK	2.802	2.802		USD 188,640	518.383,05	1,68
Ciena Corp. Registered Shares New DL -,01	A0LDA7		STK	1.941	1.941		USD 51,600	98.225,47	0,32
Cloudflare Inc. Registered Shs Cl.A DL -,001	A2PQMN		STK	1.762	1.762		USD 50,320	86.955,17	0,28
Coinbase Global Inc. Reg. Shares Cl.A DL -,00001	A2QP7J		STK	1.263	1.263		USD 62,950	77.973,67	0,25
Corteva Inc. Registered Shares DL -,01	A2PKRR		STK	2.143	2.143		USD 57,550	120.952,93	0,39
CSX Corp. Registered Shares DL 1	865857		STK	8.938	8.938		USD 32,320	283.309,14	0,92
Danaher Corp. Registered Shares DL -,01	866197		STK	374	374		USD 291,470	106.909,02	0,35
Darling Ingredients Inc. Registered Shares DL -,01	895117		STK	1.725	1.725		USD 69,280	117.204,92	0,38
Deckers Outdoor Corp. Registered Shares DL -,01	894298		STK	367	367		USD 313,210	112.732,87	0,37
Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01	A12FMV		STK	298	298		USD 477,100	139.435,88	0,45
Equity Lifestyle Propert. Inc. Registered Shares DL -,01	A0DNDJ		STK	2.867	2.867		USD 73,520	206.719,80	0,67
Estée Lauder Compan. Inc., The Reg. Shares Class A DL -,01	897933		STK	1.433	1.433		USD 273,100	383.810,43	1,25
Intuitive Surgical Inc. Registered Shares DL -,001	888024		STK	650	650		USD 230,200	146.746,43	0,48
Invitation Homes Inc. Registered Shares DL -,01	A2DK5V		STK	2.982	2.982		USD 39,030	114.144,52	0,37
IQVIA Holdings Inc. Registered Shares DL -,01	A2JSPM		STK	458	458		USD 240,270	107.922,97	0,35
Johnson Controls Internat. PLC Registered Shares DL -,01	A2AQCA		STK	5.502	5.502		USD 53,910	290.896,70	0,94
Lam Research Corp. Registered Shares DL -,001	869686		STK	228	228		USD 500,665	111.951,77	0,36
Mastercard Inc. Registered Shares A DL -,0001	A0F602		STK	469	469		USD 353,790	162.729,87	0,53
Match Group Inc. Registered Shares New DL-,001	A2P75D		STK	1.302	1.302		USD 73,350	93.661,26	0,30
Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01	A0YD8Q		STK	3.259	3.259		USD 89,340	285.548,04	0,93
Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625	870747		STK	3.469	3.469		USD 280,560	954.506,59	3,10
NVIDIA Corp. Registered Shares DL-,001	918422		STK	1.258	1.258		USD 181,596	224.044,78	0,73
PayPal Holdings Inc. Reg. Shares DL -,0001	A14R7U		STK	1.343	1.343		USD 86,500	113.930,76	0,37
QUALCOMM Inc. Registered Shares DL -,0001	883121		STK	951	951		USD 145,130	135.358,83	0,44
Rithm Capital Corp. Registered Shares DL -,01	A12DW2		STK	17.287	17.287		USD 10,910	184.966,58	0,60
Roku Inc. Reg. Shares Cl. A DL-,0001	A2DW4X		STK	1.164	1.164		USD 65,520	74.795,55	0,24

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
SBA Communications Corp. Reg. Shares Class A DL -,01	A2DKP8		STK	346	346		USD 335,500	113.845,93	0,37
Synopsys Inc. Registered Shares DL -,01	883703		STK	309	309		USD 367,440	111.350,91	0,36
Taiwan Semiconduct.Manufact.Co Reg.Shs (Spons.ADRs)/5 TA 10	909800		STK	3.396	3.396		USD 88,480	294.687,47	0,96
Tractor Supply Co. Registered Shares DL -,008	889826		STK	569	569		USD 191,500	106.863,63	0,35
United Rentals Inc. Registered Shares DL -,01	911443		STK	390	390		USD 322,670	123.416,17	0,40
UnitedHealth Group Inc. Registered Shares DL -,01	869561		STK	620	620		USD 542,340	329.770,80	1,07
VISA Inc. Reg. Shares Class A DL -,0001	A0NC7B		STK	1.516	1.516		USD 212,110	315.361,90	1,02
Verzinsliche Wertpapiere									
4,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2003(2034)	113522		EUR	300	300		% 144,100	432.300,00	1,40
4,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2007(2039) I.Ausgabe	113532		EUR	200	300	100	% 149,248	298.496,00	0,97
4,7500 % Frankreich EO-OAT 2004(35)	A0AXNP		EUR	300	300		% 137,166	411.498,00	1,34
2,5000 % Frankreich EO-OAT 2014(30)	A1ZHSU		EUR	400	600	200	% 111,060	444.240,00	1,44
1,0000 % Frankreich EO-OAT 2017(27)	A19FUW		EUR	300	500	200	% 101,220	303.660,00	0,99
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2022(32)	A3K0NZ		EUR	500	500		% 88,030	440.150,00	1,43
5,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2003(34)	907835		EUR	400	400		% 118,710	474.840,00	1,54
2,3750 % Merck Financial Services GmbH Med.-Term Nts.v.2022(22/30)	A30VKF		EUR	300	300		% 104,216	312.647,81	1,02
2,8750 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/33)	A3K6A1		EUR	300	300		% 105,242	315.726,00	1,03
3,5000 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2014(45)	A1ZLDD		GBP	300	300		% 117,255	419.817,40	1,36
0,7500 % Großbritannien LS-Treasury Stock 2017(23)	A19LWB		GBP	500	900	400	% 99,010	590.822,29	1,92
5,3750 % United States of America DL-Bonds 2001(31)	610743		USD	700	700		% 120,359	826.279,24	2,68
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	6.199.132,97	20,13
Verzinsliche Wertpapiere									
0,6250 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2020(20/29)	A28WUX		EUR	200	200		% 92,634	185.268,00	0,60
1,5000 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2017(17/29)	A19HWX		EUR	200	200		% 97,765	195.530,00	0,64
2,8750 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)	A3K72B		EUR	200	200		% 102,453	204.905,00	0,67
3,2500 % Ecolab Inc. DL-Notes 2018(18/27)	A19YHX		USD	200	200		% 100,040	196.224,19	0,64
2,9000 % Texas Instruments Inc. DL-Notes 2017(17/27)	A19RNE		USD	200	200		% 98,243	192.699,37	0,63

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
3,1250 % United States of America DL-Bonds 2018(48)	A190V2		USD	500	500	%	98,688	483.928,31	1,57	
2,7500 % United States of America DL-Notes 2018(23)	A195B0		USD	1.000	1.400	400	%	99,758	978.353,48	3,18
0,1250 % United States of America DL-Notes 2020(23)	A281D6		USD	700	1.400	700	%	97,098	666.585,19	2,16
0,5000 % United States of America DL-Notes 2020(27)	A28WTY		USD	700	700	%	90,148	618.878,11	2,01	
0,6250 % United States of America DL-Notes 2020(30)	A281D2		USD	600	600	%	85,359	502.286,32	1,63	
1,2500 % United States of America DL-Notes 2021(26)	A3K0N8		USD	1.100	1.100	%	93,852	1.012.472,11	3,29	
1,2500 % United States of America DL-Notes 2021(28)	A3KQG0		USD	200	500	300	%	92,063	180.576,67	0,59
1,1250 % United States of America DL-Notes 2021(31) Ser.B-2031	A3KLWE		USD	900	900	%	88,531	781.426,22	2,54	
Summe Wertpapiervermögen							EUR	30.105.049,96	97,77	
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							EUR	-219.396,42	-0,71	
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-53.648,05	-0,17	
Aktienindex-Terminkontrakte										
MSCI World NTR Daily Index Future 16.09.22		185	EUR	Anzahl -10				-38.600,00	-0,13	
STXE 600 Future 16.09.22		185	EUR	Anzahl -90				-127.020,00	-0,41	
S&P 500 E-Mini Index Future 16.09.22		359	USD	Anzahl 5				96.491,44	0,31	
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
Put Euro Stoxx 3300 16.09.22		185		Anzahl 500			EUR	22,900	11.450,00	0,04
Put EURO STOXX 50 Price EUR 2800 16.09.22		185		Anzahl -500			EUR	4,100	-2.050,00	-0,01
Put S&P 3600 16.09.22		361		Anzahl 500			USD	15,600	7.649,68	0,02
Put S&P 500 INDEX 3100 16.09.22		361		Anzahl -500			USD	3,200	-1.569,17	-0,01
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-165.748,37	-0,54	
Devisenterminkontrakte (Verkauf)										
Offene Positionen										
GBP/EUR 0,9 Mio.		OTC						-36.396,08	-0,12	
USD/EUR 7,0 Mio.		OTC						-125.900,42	-0,41	
Devisenterminkontrakte (Kauf)										
Offene Positionen										
USD/EUR 0,4 Mio.		OTC						-3.451,87	-0,01	

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	862.073,94	2,80
Bankguthaben							EUR	862.073,94	2,80
EUR-Guthaben bei:									
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	724.001,17			% 100,000	724.001,17	2,35
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
			DKK	26.465,09			% 100,000	3.554,58	0,01
			NOK	84.636,98			% 100,000	8.586,05	0,03
			SEK	34.912,80			% 100,000	3.358,45	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			CAD	7.284,41			% 100,000	5.575,30	0,02
			CHF	9.767,06			% 100,000	10.057,21	0,03
			GBP	15.740,99			% 100,000	18.786,24	0,06
			USD	89.887,18			% 100,000	88.154,94	0,29
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	80.194,36	0,26
Zinsansprüche			EUR	65.061,89				65.061,89	0,21
Dividendenansprüche			EUR	15.132,47				15.132,47	0,05
Sonstige Verbindlichkeiten *)				EUR	-36.670,65			-36.670,65	-0,12
Fondsvermögen							EUR	30.791.251,19	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	37,36	
Umlaufende Anteile							STK	824.251	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwahrensentgelte, Kostenpauschale

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.07.2022		
Australische Dollar	(AUD)	1,4612500	=	1 Euro (EUR)
Canadische Dollar	(CAD)	1,3065500	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,9711500	=	1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,4453500	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,8379000	=	1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,0041500	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	136,2762500	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	9,8575000	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,3955000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0196500	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
359	Chicago Merc. Ex.
361	Chicago - CBOE Opt. 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					
BP PLC Registered Shares DL -,25	850517	STK		50.000	
CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01	859034	STK	1.081	1.081	
ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1	928624	STK		28.000	
Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N.	EVNK01	STK		4.000	
OMV AG Inhaber-Aktien o.N.	874341	STK		3.000	
Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10	A0NBLH	STK		2.000	
RWE AG Inhaber-Aktien o.N.	703712	STK		5.000	
Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.	SYM999	STK		1.000	
Wilmar International Ltd. Registered Shares SD -,50	A0KEWL	STK	71.002	71.002	
Verzinsliche Wertpapiere					
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2020 (2030)	103070	EUR	500	500	
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2022 (2032)	110258	EUR	500	500	
1,5000 % Frankreich EO-OAT 2015(31)	A127JJ	EUR	500	500	
0,0000 % Frankreich EO-OAT 2020(30)	A28X7U	EUR	500	500	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
2,5000 % United States of America DL-Notes 2013(23)	A1HPL7	USD	1.000	1.000	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
I.M.-I.STOXX 600 Opt.Res.ETF Registered Shares Acc o.N.	A0RPR2	ANT		2.000	
iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE Inhaber-Anlageaktien	A0F5UK	ANT		95.000	
iSh.ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE Inhaber-Anlageaktien	A0H08M	ANT		150.000	
iSh.ST.Eur.600 Chemic.U.ETF DE Inhaber-Anlageaktien	A0H08E	ANT		30.000	
iSh.ST.Eur.600 Utilit.U.ETF DE Inhaber-Anlageaktien	A0Q4R0	ANT		100.000	
Lyxor IF-L.ST.Eu.600 Bas.Res. Act. Nom. EUR Acc. oN	LYX01X	ANT		70.000	
Lyxor IF-L.ST.Eu.600 Oil & G. Act. Nom. EUR Acc. oN	LYX02P	ANT		110.000	
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			6.621,83
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, STXE 600 PR.EUR)		EUR			3.908,13
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin: GBP/EUR		EUR			1.522
USD/EUR		EUR			8.136
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
Kauf von Devisen auf Termin: GBP/EUR		EUR			1.505
USD/EUR		EUR			8.354

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	37,36
Umlaufende Anteile	STK	824.251

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, den 1. August 2022

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

30025 [13] 09/2022 55 25% Altpapier

LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 100351
70003 Stuttgart
Fritz-Elsas-Straße 31
70174 Stuttgart
Telefon 0711 22910-3000
Telefax 0711 22910-9098
www.LBBW-AM.de
info@LBBW-AM.de