

**LB**  **BW Asset Management**

**LBBW Aktien Deutschland**

**Halbjahresbericht zum 31.07.2022**



# Inhalt

|                                                                                                                          |    |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| Vermögensübersicht zum 31.07.2022                                                                                        | 8  |
| Vermögensaufstellung zum 31.07.2022                                                                                      | 9  |
| Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,<br>soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen | 14 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV                                                                                              | 15 |



Liebe Anlegerin, lieber Anleger,

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.

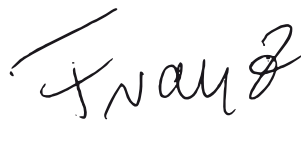
Auf unserer Internetseite informieren wir Sie darüber hinaus regelmäßig über die Entwicklung des Fonds. Auf [www.LBBW-AM.de](http://www.LBBW-AM.de) finden Sie die aktuellen Fondspreise, umfangreiche Angaben zur Wertentwicklung, die Portfolio-Struktur sowie viele weitere Fakten.

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 Aktien Deutschland

## Halbjahresbericht zum 31.07.2022

# Vermögensübersicht zum 31.07.2022

| Anlageschwerpunkte             | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens |
|--------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b> | <b>85.547.049,50</b> | <b>100,14</b>        |
| <b>1. Aktien</b>               | <b>85.265.451,99</b> | <b>99,81</b>         |
| Industrieprodukte und Services | 16.106.227,50        | 18,85                |
| Chemie                         | 13.228.235,00        | 15,48                |
| Technologie                    | 10.062.370,00        | 11,78                |
| Gesundheit                     | 9.239.060,00         | 10,82                |
| Fahrzeugbau                    | 7.990.500,00         | 9,35                 |
| Versicherungen                 | 7.595.430,00         | 8,89                 |
| Telekommunikation              | 4.937.460,00         | 5,78                 |
| Versorger                      | 3.939.020,00         | 4,61                 |
| Konsumgüter private Haushalte  | 3.289.205,00         | 3,85                 |
| Finanzdienstleistungen         | 2.557.850,00         | 2,99                 |
| Immobilien                     | 2.349.220,00         | 2,75                 |
| Kreditinstitute                | 2.004.870,00         | 2,35                 |
| Einzelhandel                   | 920.600,00           | 1,08                 |
| Baugewerbe                     | 544.500,00           | 0,64                 |
| Tourismus                      | 362.250,00           | 0,42                 |
| Medien                         | 138.654,49           | 0,16                 |
| <b>2. Derivate</b>             | <b>-109.770,00</b>   | <b>-0,13</b>         |
| <b>3. Bankguthaben</b>         | <b>391.367,51</b>    | <b>0,46</b>          |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>   | <b>-120.641,38</b>   | <b>-0,14</b>         |
| <b>III. Fondsvermögen</b>      | <b>85.426.408,12</b> | <b>100,00</b>        |

# Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

| Gattungsbezeichnung                                     | WKN    | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.07.2022 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs        | Kurswert<br>in EUR   | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---------------------------------------------------------|--------|-------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|-------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Bestandspositionen</b>                               |        |       |                                             |                       |                                           |                       | <b>EUR</b>  | <b>85.265.451,99</b> | <b>99,81</b>                 |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>                     |        |       |                                             |                       |                                           |                       | <b>EUR</b>  | <b>84.993.451,99</b> | <b>99,49</b>                 |
| <b>Aktien</b>                                           |        |       |                                             |                       |                                           |                       |             |                      |                              |
| adidas AG<br>Namens-Aktien o.N.                         | A1EWWW |       | STK                                         | 13.600                |                                           | 900                   | EUR 167,800 | 2.282.080,00         | 2,67                         |
| Airbus SE<br>Aandelen op naam EO 1                      | 938914 |       | STK                                         | 18.000                | 1.500                                     |                       | EUR 104,880 | 1.887.840,00         | 2,21                         |
| Allianz SE<br>vink.Namens-Aktien o.N.                   | 840400 |       | STK                                         | 23.250                |                                           | 2.000                 | EUR 177,320 | 4.122.690,00         | 4,83                         |
| BASF SE<br>Namens-Aktien o.N.                           | BASF11 |       | STK                                         | 56.000                |                                           |                       | EUR 43,415  | 2.431.240,00         | 2,85                         |
| Bayer AG<br>Namens-Aktien o.N.                          | BAY001 |       | STK                                         | 65.000                |                                           | 1.500                 | EUR 57,000  | 3.705.000,00         | 4,34                         |
| Bayerische Motoren Werke AG<br>Vorzugsaktien o.St. EO 1 | 519003 |       | STK                                         | 12.000                |                                           |                       | EUR 73,900  | 886.800,00           | 1,04                         |
| Bechtle AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                       | 515870 |       | STK                                         | 16.000                | 4.000                                     |                       | EUR 45,010  | 720.160,00           | 0,84                         |
| Brenntag SE<br>Namens-Aktien o.N.                       | A1DAHH |       | STK                                         | 7.500                 |                                           |                       | EUR 68,360  | 512.700,00           | 0,60                         |
| CEWE Stiftung & Co. KGaA<br>Inhaber-Aktien o.N.         | 540390 |       | STK                                         | 5.800                 | 1.250                                     | 450                   | EUR 83,800  | 486.040,00           | 0,57                         |
| Commerzbank AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                   | CBK100 |       | STK                                         | 230.000               | 40.000                                    |                       | EUR 6,678   | 1.535.940,00         | 1,80                         |
| Compleo Charging Solutions AG<br>Inhaber-Aktien o.N.    | A2QDNX |       | STK                                         | 14.000                | 7.500                                     | 1.500                 | EUR 18,680  | 261.520,00           | 0,31                         |
| CompuGroup Medical SE & Co. KGaA<br>Namens-Aktien o.N.  | A28890 |       | STK                                         | 8.000                 | 1.000                                     | 1.000                 | EUR 42,240  | 337.920,00           | 0,40                         |
| Continental AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                   | 543900 |       | STK                                         | 7.500                 | 500                                       |                       | EUR 69,220  | 519.150,00           | 0,61                         |
| Covestro AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                      | 606214 |       | STK                                         | 10.000                |                                           | 500                   | EUR 33,230  | 332.300,00           | 0,39                         |
| CTS Eventim AG & Co. KGaA<br>Inhaber-Aktien o.N.        | 547030 |       | STK                                         | 5.500                 | 5.500                                     |                       | EUR 53,600  | 294.800,00           | 0,35                         |
| Daimler Truck Holding AG<br>Namens-Aktien o.N.          | DTR0CK |       | STK                                         | 24.000                | 1.000                                     | 2.000                 | EUR 26,590  | 638.160,00           | 0,75                         |
| Delivery Hero SE<br>Namens-Aktien o.N.                  | A2E4K4 |       | STK                                         | 13.000                | 6.000                                     | 1.000                 | EUR 46,910  | 609.830,00           | 0,71                         |
| Deutsche Bank AG<br>Namens-Aktien o.N.                  | 514000 |       | STK                                         | 55.000                | 2.500                                     | 2.500                 | EUR 8,526   | 468.930,00           | 0,55                         |
| Deutsche Börse AG<br>Namens-Aktien o.N.                 | 581005 |       | STK                                         | 12.500                | 250                                       | 750                   | EUR 170,500 | 2.131.250,00         | 2,49                         |
| Deutsche Post AG<br>Namens-Aktien o.N.                  | 555200 |       | STK                                         | 70.000                |                                           | 2.500                 | EUR 38,900  | 2.723.000,00         | 3,19                         |
| Deutsche Telekom AG<br>Namens-Aktien o.N.               | 555750 |       | STK                                         | 220.000               |                                           | 10.000                | EUR 18,506  | 4.071.320,00         | 4,77                         |
| Deutsche Wohnen SE<br>Inhaber-Aktien o.N.               | A0HN5C |       | STK                                         | 21.000                | 7.000                                     |                       | EUR 24,130  | 506.730,00           | 0,59                         |
| DFV Dt.Familienvers.AG<br>Inhaber-Aktien o.N.           | A2NBVD |       | STK                                         | 36.000                | 2.000                                     | 1.000                 | EUR 11,160  | 401.760,00           | 0,47                         |
| Dürr AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                          | 556520 |       | STK                                         | 19.000                | 5.500                                     |                       | EUR 24,220  | 460.180,00           | 0,54                         |
| DWS Group GmbH & Co. KGaA<br>Inhaber-Aktien o.N.        | DWS100 |       | STK                                         | 15.000                | 2.000                                     |                       | EUR 28,440  | 426.600,00           | 0,50                         |
| E.ON SE<br>Namens-Aktien o.N.                           | ENAG99 |       | STK                                         | 130.000               |                                           | 5.000                 | EUR 8,770   | 1.140.100,00         | 1,33                         |

# Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

| Gattungsbezeichnung                                            | WKN    | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.07.2022 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs        | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|--------|-------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|-------------|--------------------|------------------------------|
| Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG<br>Inhaber-Aktien o.N.          | 565970 |       | STK                                         | 8.000                 | 4.000                                     | 2.000                 | EUR 43,100  | 344.800,00         | 0,40                         |
| Evonik Industries AG<br>Namens-Aktien o.N.                     | EVNK01 |       | STK                                         | 21.000                | 1.000                                     |                       | EUR 20,780  | 436.380,00         | 0,51                         |
| Evotec SE<br>Inhaber-Aktien o.N.                               | 566480 |       | STK                                         | 23.000                | 10.000                                    |                       | EUR 25,300  | 581.900,00         | 0,68                         |
| freenet AG<br>Namens-Aktien o.N.                               | A0Z2ZZ |       | STK                                         | 21.000                | 23.000                                    | 2.000                 | EUR 22,990  | 482.790,00         | 0,57                         |
| Fresenius Medical Care KGaA<br>Inhaber-Aktien o.N.             | 578580 |       | STK                                         | 11.000                |                                           | 1.000                 | EUR 36,160  | 397.760,00         | 0,47                         |
| Fresenius SE & Co. KGaA<br>Inhaber-Aktien o.N.                 | 578560 |       | STK                                         | 23.000                |                                           | 2.000                 | EUR 24,950  | 573.850,00         | 0,67                         |
| GEA Group AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                            | 660200 |       | STK                                         | 18.000                | 2.000                                     |                       | EUR 36,370  | 654.660,00         | 0,77                         |
| Gerresheimer AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                         | A0LD6E |       | STK                                         | 9.500                 | 1.500                                     |                       | EUR 58,550  | 556.225,00         | 0,65                         |
| Hannover Rück SE<br>Namens-Aktien o.N.                         | 840221 |       | STK                                         | 4.500                 | 800                                       |                       | EUR 138,300 | 622.350,00         | 0,73                         |
| HeidelbergCement AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                     | 604700 |       | STK                                         | 11.000                |                                           | 500                   | EUR 49,500  | 544.500,00         | 0,64                         |
| HelloFresh SE<br>Inhaber-Aktien o.N.                           | A16140 |       | STK                                         | 13.000                | 2.500                                     | 500                   | EUR 26,850  | 349.050,00         | 0,41                         |
| Henkel AG & Co. KGaA<br>Inhaber-Stammaktien o.N.               | 604840 |       | STK                                         | 7.500                 | 500                                       |                       | EUR 61,450  | 460.875,00         | 0,54                         |
| HUGO BOSS AG<br>Namens-Aktien o.N.                             | A1PHFF |       | STK                                         | 9.500                 | 2.000                                     |                       | EUR 57,500  | 546.250,00         | 0,64                         |
| INDUS Holding AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                        | 620010 |       | STK                                         | 15.000                |                                           |                       | EUR 23,400  | 351.000,00         | 0,41                         |
| Infineon Technologies AG<br>Namens-Aktien o.N.                 | 623100 |       | STK                                         | 97.000                |                                           |                       | EUR 26,550  | 2.575.350,00       | 3,01                         |
| init innov.in traffic syst.SE<br>Inhaber-Aktien o.N.           | 575980 |       | STK                                         | 17.000                | 7.000                                     | 2.000                 | EUR 22,550  | 383.350,00         | 0,45                         |
| K+S Aktiengesellschaft<br>Namens-Aktien o.N.                   | KSAG88 |       | STK                                         | 22.000                | 22.000                                    |                       | EUR 20,610  | 453.420,00         | 0,53                         |
| KION GROUP AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                           | KGX888 |       | STK                                         | 15.000                | 5.000                                     |                       | EUR 44,350  | 665.250,00         | 0,78                         |
| LANXESS AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                              | 547040 |       | STK                                         | 16.500                | 500                                       |                       | EUR 35,830  | 591.195,00         | 0,69                         |
| LEG Immobilien SE<br>Namens-Aktien o.N.                        | LEG111 |       | STK                                         | 6.500                 | 1.000                                     |                       | EUR 88,640  | 576.160,00         | 0,67                         |
| Linde PLC<br>Registered Shares EO 0,001                        | A2DSYC |       | STK                                         | 24.000                |                                           | 4.000                 | EUR 295,400 | 7.089.600,00       | 8,30                         |
| Mercedes-Benz Group AG<br>Namens-Aktien o.N.                   | 710000 |       | STK                                         | 54.000                |                                           | 2.000                 | EUR 57,220  | 3.089.880,00       | 3,62                         |
| Merck KGaA<br>Inhaber-Aktien o.N.                              | 659990 |       | STK                                         | 10.000                |                                           |                       | EUR 185,700 | 1.857.000,00       | 2,17                         |
| Mister Spex SE<br>Inhaber-Aktien o.N.                          | A3CSAE |       | STK                                         | 45.000                | 30.068                                    | 11.068                | EUR 4,800   | 216.000,00         | 0,25                         |
| MTU Aero Engines AG<br>Namens-Aktien o.N.                      | A0D9PT |       | STK                                         | 5.000                 |                                           |                       | EUR 188,100 | 940.500,00         | 1,10                         |
| Münchener Rückvers.-Ges. AG<br>vink.Namens-Aktien o.N.         | 843002 |       | STK                                         | 8.500                 |                                           |                       | EUR 221,100 | 1.879.350,00       | 2,20                         |
| Porsche Automobil Holding SE<br>Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | PAH003 |       | STK                                         | 24.000                | 1.000                                     | 1.000                 | EUR 70,400  | 1.689.600,00       | 1,98                         |
| Qiagen N.V.<br>Aandelen op naam EO -,01                        | A2DKCH |       | STK                                         | 9.000                 | 1.000                                     |                       | EUR 48,860  | 439.740,00         | 0,51                         |

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

| Gattungsbezeichnung                                                                     | WKN    | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.07.2022 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs        | Kurswert<br>in EUR   | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------|-------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|-------------|----------------------|------------------------------|
| Rheinmetall AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                   | 703000 |       | STK                                         | 6.250                 |                                           | 1.750                 | EUR 178,850 | 1.117.812,50         | 1,31                         |
| RWE AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                           | 703712 |       | STK                                         | 50.000                |                                           |                       | EUR 40,180  | 2.009.000,00         | 2,35                         |
| SAP SE<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                           | 716460 |       | STK                                         | 57.000                |                                           | 4.250                 | EUR 90,680  | 5.168.760,00         | 6,05                         |
| Sartorius AG<br>Vorzugsaktien o.St. o.N.                                                | 716563 |       | STK                                         | 1.200                 | 300                                       |                       | EUR 435,500 | 522.600,00           | 0,61                         |
| Siemens AG<br>Namens-Aktien o.N.                                                        | 723610 |       | STK                                         | 46.000                |                                           | 2.000                 | EUR 108,540 | 4.992.840,00         | 5,84                         |
| Siemens Energy AG<br>Namens-Aktien o.N.                                                 | ENER6Y |       | STK                                         | 32.000                | 3.000                                     |                       | EUR 16,185  | 517.920,00           | 0,61                         |
| Siemens Healthineers AG<br>Namens-Aktien o.N.                                           | SHL100 |       | STK                                         | 8.000                 | 500                                       |                       | EUR 50,020  | 400.160,00           | 0,47                         |
| Software AG<br>Namens-Aktien o.N.                                                       | A2GS40 |       | STK                                         | 21.000                | 3.000                                     | 1.000                 | EUR 26,280  | 551.880,00           | 0,65                         |
| SPORTTOTAL AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                    | A1EMG5 |       | STK                                         | 206.947               | 1.652                                     | 174.705               | EUR 0,670   | 138.654,49           | 0,16                         |
| Symrise AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                       | SYM999 |       | STK                                         | 7.000                 |                                           | 500                   | EUR 113,600 | 795.200,00           | 0,93                         |
| SYNLAB AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                        | A2TSL7 |       | STK                                         | 22.500                | 4.000                                     | 2.500                 | EUR 18,500  | 416.250,00           | 0,49                         |
| Talanx AG<br>Namens-Aktien o.N.                                                         | TLX100 |       | STK                                         | 16.000                |                                           |                       | EUR 35,580  | 569.280,00           | 0,67                         |
| TUI AG<br>Namens-Aktien o.N.                                                            | TUAG00 |       | STK                                         | 230.000               | 230.000                                   |                       | EUR 1,575   | 362.250,00           | 0,42                         |
| United Internet AG<br>Namens-Aktien o.N.                                                | 508903 |       | STK                                         | 17.000                | 4.000                                     |                       | EUR 25,670  | 436.390,00           | 0,51                         |
| Vitesco Technologies Group AG<br>Namens-Aktien o.N.                                     | VTSC01 |       | STK                                         | 11.000                | 3.000                                     | 3.000                 | EUR 52,950  | 582.450,00           | 0,68                         |
| Volkswagen AG<br>Vorzugsaktien o.St. o.N.                                               | 766403 |       | STK                                         | 7.000                 |                                           |                       | EUR 137,300 | 961.100,00           | 1,13                         |
| Vonovia SE<br>Namens-Aktien o.N.                                                        | A1ML7J |       | STK                                         | 39.000                |                                           |                       | EUR 32,470  | 1.266.330,00         | 1,48                         |
| Wacker Chemie AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                 | WCH888 |       | STK                                         | 4.000                 |                                           | 500                   | EUR 146,550 | 586.200,00           | 0,69                         |
| Zalando SE<br>Inhaber-Aktien o.N.                                                       | ZAL111 |       | STK                                         | 13.000                | 2.000                                     |                       | EUR 27,350  | 355.550,00           | 0,42                         |
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>       |        |       |                                             |                       |                                           |                       | <b>EUR</b>  | <b>272.000,00</b>    | <b>0,32</b>                  |
| <b>Aktien</b>                                                                           |        |       |                                             |                       |                                           |                       |             |                      |                              |
| Pacifico Renewables Yield AG<br>Inhaber-Aktien o.N.                                     | A2YN37 |       | STK                                         | 10.000                | 1.500                                     | 5.500                 | EUR 27,200  | 272.000,00           | 0,32                         |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>                                                         |        |       |                                             |                       |                                           |                       | <b>EUR</b>  | <b>85.265.451,99</b> | <b>99,81</b>                 |
| <b>Derivate</b>                                                                         |        |       |                                             |                       |                                           |                       | <b>EUR</b>  | <b>-109.770,00</b>   | <b>-0,13</b>                 |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |        |       |                                             |                       |                                           |                       |             |                      |                              |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>                                                             |        |       |                                             |                       |                                           |                       | <b>EUR</b>  | <b>-109.770,00</b>   | <b>-0,13</b>                 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten                                                           |        |       |                                             |                       |                                           |                       |             |                      |                              |
| <b>Optionsrechte</b>                                                                    |        |       |                                             |                       |                                           |                       |             |                      |                              |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>                                                  |        |       |                                             |                       |                                           |                       |             |                      |                              |
| Call DAX 13000 16.09.22                                                                 |        | 185   |                                             | Anzahl -150           |                                           |                       | EUR 731,800 | -109.770,00          | -0,13                        |

Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

| Gattungsbezeichnung                                                    | WKN | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.07.2022 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs      | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------------------------|-----|-------|---------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds |     |       |                                             |                       |                                           |                       | EUR       | 391.367,51         | 0,46                         |
| Bankguthaben                                                           |     |       |                                             |                       |                                           |                       | EUR       | 391.367,51         | 0,46                         |
| EUR-Guthaben bei:                                                      |     |       |                                             |                       |                                           |                       |           |                    |                              |
| Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)                               |     |       | EUR                                         | 391.367,51            |                                           |                       | % 100,000 | 391.367,51         | 0,46                         |
| Sonstige Verbindlichkeiten *)                                          |     |       | EUR                                         | -120.641,38           |                                           |                       |           | -120.641,38        | -0,14                        |
| Fondsvermögen                                                          |     |       |                                             |                       |                                           |                       | EUR       | 85.426.408,12      | 100,00 <sup>1)</sup>         |
| Anteilwert                                                             |     |       |                                             |                       |                                           |                       | EUR       | 164,48             |                              |
| Umlaufende Anteile                                                     |     |       |                                             |                       |                                           |                       | STK       | 519.358            |                              |

\*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwahrensentgelte, Kostenpauschale

Fußnoten:

<sup>1)</sup> 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.

## 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<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|---------------------|-----|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
|---------------------|-----|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

|                                                    |        |     |        |        |  |
|----------------------------------------------------|--------|-----|--------|--------|--|
| AUTO1 Group SE Inhaber-Aktien o.N.                 | A2LQ88 | STK |        | 20.000 |  |
| Borussia Dortmund GmbH&Co.KGaA Inhaber-Aktien o.N. | 549309 | STK | 20.000 | 75.000 |  |
| HENSOLDT AG Inhaber-Aktien o.N.                    | HAG000 | STK | 40.880 | 40.880 |  |

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

Optionsrechte

Wertpapier-Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktien

|                                                                    |     |      |
|--------------------------------------------------------------------|-----|------|
| Verkaufte Kaufoptionen (Call):<br>(Basiswert(e): COVESTRO AG O.N.) | EUR | 6,82 |
|--------------------------------------------------------------------|-----|------|

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Sonstige Angaben

|                    |     |         |
|--------------------|-----|---------|
| Anteilwert         | EUR | 164,48  |
| Umlaufende Anteile | STK | 519.358 |

## 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

30027 [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](http://www.LBBW-AM.de)  
[info@LBBW-AM.de](mailto:info@LBBW-AM.de)