

LB≡BW Asset Management

W&W Nachhaltige Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2022

Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.08.2022	8
Vermögensaufstellung zum 31.08.2022	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	15
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	16

Liebe Anlegerin, lieber Anleger,

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

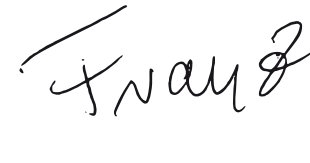
Seit unserer Gründung legen wir Fonds für private und institutionelle Anleger auf. Dadurch bieten wir Ihnen die Möglichkeit, an den Entwicklungen der Märkte teilzunehmen. Detailinformationen erhalten Sie von Ihrem Berater.

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

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

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH
Geschäftsführung



Uwe Adamla
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz



Dr. Bernhard Scherer

W&W Nachhaltige Strategie

Halbjahresbericht zum 31.08.2022

Vermögensübersicht zum 31.08.2022

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	83.182.195,19	100,11
1. Anleihen	26.055.381,31	31,36
Frankreich	4.668.911,04	5,62
Bundesrep. Deutschland	3.591.473,23	4,32
Niederlande	3.361.172,48	4,05
Spanien	1.636.571,00	1,97
USA	1.556.979,30	1,87
Schweden	1.514.555,34	1,82
Weltbank	1.204.085,00	1,45
Australien	1.075.680,00	1,29
Dänemark	732.679,00	0,88
Europ. Investitionsbank	569.419,72	0,69
Andean Development Corp.	545.880,00	0,66
Großbritannien	526.848,00	0,63
Österreich	496.476,00	0,60
IFFIm	452.637,86	0,54
Andorra	438.413,00	0,53
Int. Entwicklungsg.	405.521,00	0,49
Japan	388.883,52	0,47
Irland	382.064,00	0,46
Südkorea	353.852,12	0,43
Polen	298.000,00	0,36
Asiat. Infrastrukturinv.	295.002,73	0,36
Norwegen	269.340,00	0,32
Luxemburg	264.260,00	0,32
Übrige intern. Organis.	193.907,81	0,23
Belgien	185.640,00	0,22
Finnland	174.130,00	0,21
Tschechische Republik	166.436,00	0,20
Lettland	165.060,00	0,20
Asiat. Entwicklungsbank	141.503,16	0,17
2. Investmentanteile	51.264.155,98	61,69
3. Derivate	-74.500,00	-0,09
4. Bankguthaben	5.804.161,13	6,99
5. Sonstige Vermögensgegenstände	132.996,77	0,16
II. Verbindlichkeiten	-88.609,52	-0,11
III. Fondsvermögen	83.093.585,67	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	77.319.537,29	93,05
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	21.543.269,01	25,93
Verzinsliche Wertpapiere									
4,5000 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 317 v.22(25)	AAR035		EUR	300	300		% 100,220	300.660,00	0,36
0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-T. Nts 2021(29)	A3KWNY		EUR	300			% 81,568	244.704,00	0,29
0,5500 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KWYZ		EUR	200			% 82,700	165.400,00	0,20
1,3750 % Agence Française Développement EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZPVK		EUR	300	300		% 99,710	299.130,00	0,36
1,2500 % Andorra EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KQMN		EUR	300			% 84,535	253.605,00	0,31
1,2500 % Andorra EO-Medium-Term Nts 2022(27)	A3K2LX		EUR	200			% 92,404	184.808,00	0,22
1,3750 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2021(31/41)	A3KN91		EUR	500		500	% 77,370	386.850,00	0,47
0,5000 % Bank Gospodarstwa Krajowego EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KTQT		EUR	400			% 74,500	298.000,00	0,36
0,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 19(25/26)	PB1K8K		EUR	300			% 92,724	278.172,00	0,33
0,5000 % Česká Sporitelna AS EO-FLR Non-Pref.MTN 21(27/28)	A3KV1A		EUR	200			% 83,218	166.436,00	0,20
1,6250 % Communauté française Belgique EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K43K		EUR	200	200		% 92,820	185.640,00	0,22
0,2500 % Comun. Autónoma del País Vasco EO-Obligaciones 2020(31)	A28447		EUR	200			% 82,499	164.998,00	0,20
1,8750 % Comun. Autónoma del País Vasco EO-Obligaciones 2022(33)	A3K4WM		EUR	300	300		% 91,400	274.200,00	0,33
0,4200 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2021(31)	A3KNNW		EUR	400			% 83,003	332.012,00	0,40
1,7230 % Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2022(32)	A3K324		EUR	300	300		% 91,054	273.162,00	0,33
0,6250 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2019(26)	A2SANG		EUR	600			% 90,980	545.880,00	0,66
1,3750 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27)	A3K2DH		EUR	500			% 91,697	458.485,00	0,55
2,3750 % De Volksbank N.V. EO-FLR Non-Pref.MTN 22(26/27)	A3K41N		EUR	300	300		% 95,410	286.230,00	0,34
0,3750 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(27/28)	A3K03G		EUR	300			% 89,780	269.340,00	0,32
1,3750 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR-Anleihe v.21(28/81)	A3MP4X		EUR	200		600	% 74,760	149.520,00	0,18
2,2500 % Evonik Industries AG Medium Term Notes v.22(22/27)	A30VJM		EUR	200	200		% 93,986	187.972,00	0,23
1,7500 % Frankreich EO-OAT 2017(39)	A19CGY		EUR	500	500		% 91,680	458.400,00	0,55
1,3750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Med.-Term Nts 2022(25)	A3K4F3		EUR	300	300		% 96,781	290.343,00	0,35
0,4000 % Ile-de-France Mobilités EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KRXY		EUR	400			% 85,971	343.884,00	0,41
0,8750 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 21(27/32)	A3KR71		EUR	500			% 84,122	420.610,00	0,51
4,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.T.Nts 22(28/33)	A3K8PP		EUR	200	200		% 96,606	193.212,00	0,23

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,7000 % International Bank Rec. Dev. EO-Medium-Term Nts 2021(46)	A3KXTN		EUR	300			% 68,509	205.527,00	0,25
0,3500 % Intl Development Association EO-Med.-Term Nts 2021(36)	A3KPV1		EUR	300			% 75,045	225.135,00	0,27
1,7500 % Intl Development Association EO-Med.-Term Nts 2022(37)	A3K41V		EUR	200	200		% 90,193	180.386,00	0,22
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 2018(31)	A2RS2Q		EUR	400	400		% 95,516	382.064,00	0,46
0,5000 % Junta de Andalucía EO-Obl. 2021(31)	A3KPJS		EUR	300			% 82,953	248.859,00	0,30
0,2680 % Junta de Galicia EO-Obl. 2021(28)	A3KZK3		EUR	200			% 88,970	177.940,00	0,21
1,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(32)	A3E5J6		EUR	300	300		% 93,000	279.000,00	0,34
0,8750 % L'Oréal S.A. EO-Notes 2022(22/26)	A3K3UK		EUR	400	400		% 95,349	381.396,00	0,46
1,3750 % La Banque Postale EO-Non-Pref. M.-T.Nts 2019(29)	A2R056		EUR	400			% 86,575	346.300,00	0,42
0,3750 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 822 v.21(31)	LB2CW1		EUR	300			% 75,103	225.309,00	0,27
0,2500 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 825 v.21(28)	LB2V7C		EUR	500			% 82,658	413.290,00	0,50
0,6250 % LANXESS AG Medium-Term Nts 2021(21/29)	A3MQMG		EUR	300			% 78,392	235.176,00	0,28
2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27)	HLB2QJ		EUR	200	200		% 96,456	192.912,00	0,23
0,2500 % Lettland, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(30)	A3KZ18		EUR	200			% 82,530	165.060,00	0,20
1,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.20(30/41)	A289EQ		EUR	300			% 77,454	232.362,00	0,28
1,0000 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.21(31/42)	A3E5WY		EUR	500			% 73,440	367.200,00	0,44
1,8750 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(32)	A3K5D7		EUR	200	200		% 94,660	189.320,00	0,23
0,7500 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/36)	A3KW75		EUR	300			% 70,880	212.640,00	0,26
3,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	A3K66V		EUR	200	200		% 99,614	199.228,00	0,24
0,2500 % NIBC Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KVYN		EUR	300			% 84,801	254.401,50	0,31
0,6250 % OP Yrityspankki Oyj EO-Non-Preferred MTN 2022(27)	A3K1M0		EUR	200			% 87,065	174.130,00	0,21
2,3750 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	A3K5N4		EUR	300	300		% 94,468	283.403,70	0,34
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)	A19SNH		EUR	300			% 91,398	274.194,00	0,33
0,5000 % RWE AG Medium Term Notes v.21(28/28)	A3MP70		EUR	300			% 84,309	252.927,00	0,30
2,1250 % RWE AG Medium Term Notes v.22(26/26)	A30VJE		EUR	300	300		% 96,654	289.962,00	0,35
1,8750 % SBAB Bank AB (publ) EO-Preferred MTN 2022(25)	A3K6HP		EUR	200	200		% 97,694	195.388,00	0,24
0,7500 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 2019(36)	A2R4MT		EUR	500			% 78,482	392.410,00	0,47
0,3000 % Société du Grand Paris EO-Medium-Term Notes 2021(31)	A3KZBQ		EUR	300			% 83,575	250.725,00	0,30

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,6250 % Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(26/27)	A3KZMP		EUR	200			% 87,400	174.800,00	0,21
0,8000 % Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(28/29)	A3KY2U		EUR	400			% 82,088	328.352,00	0,40
0,0000 % Stedin Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/26)	A3KY3H		EUR	300			% 89,103	267.309,00	0,32
1,8750 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	A3K5RQ		EUR	200	200		% 93,819	187.638,00	0,23
2,0000 % Svensk Exportkredit, AB EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K63X		EUR	300	300		% 98,680	296.040,00	0,36
2,3760 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	A3KLMN		EUR	400			% 74,623	298.492,00	0,36
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	A28Z9P		EUR	200		200	% 94,190	188.380,00	0,23
1,6250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/26)	A3K48X		EUR	200	200		% 96,575	193.150,00	0,23
1,7500 % Union Natle Interp.Em.Com.Ind. EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K5NK		EUR	300	300		% 94,732	284.196,00	0,34
0,9000 % Verbund AG EO- Notes 2021(21/41)	A3KNZ9		EUR	300			% 68,711	206.133,00	0,25
4,0500 % American Express Co. DL-Notes 2022(29/29)	A3K47Q		USD	200	200		% 97,067	193.062,50	0,23
3,1250 % Asian Development Bank DL-Medium-Term Notes 2018(28)	A2RR9D		USD	145			% 98,130	141.503,16	0,17
3,3750 % Asian Infrastruct.Invest.Bank DL-Medium-Term Notes 22(25)	A3K612		USD	300	300		% 98,880	295.002,73	0,36
1,3750 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. DL-Med.-T.Nts 2021(31) Reg.S	A287TH		USD	200			% 84,320	167.709,21	0,20
1,2500 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. DL-Med.-Term Nts 2021(26)Reg.S	A3KX3N		USD	200			% 90,850	180.697,13	0,22
2,3750 % European Investment Bank DL-Bonds 2017(27)	A19H0E		USD	600			% 95,430	569.419,72	0,69
1,7500 % Henkel AG & Co. KGaA DL-Med. Term Nts. v.21(21/26)	A3MQMB		USD	200			% 90,978	180.950,72	0,22
1,2500 % Hyundai Capital Services Inc. DL-Med.-Term Nts2021(26) Reg.S	A3KLCQ		USD	400			% 88,954	353.852,12	0,43
2,1250 % International Bank Rec. Dev. DL-Medium-Term Notes 2015(25)	A1ZXG1		USD	400			% 96,790	385.023,12	0,46
1,3750 % International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2021(28)	A3KPR8		USD	500			% 89,428	444.672,07	0,54
1,2500 % International Bank Rec. Dev. DL-Notes 2021(31)	A3KLLS		USD	200			% 84,900	168.862,81	0,20
1,0000 % Intl.Fin.Fac.for Immunisation DL-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KPVS		USD	500			% 91,030	452.637,86	0,54
0,3750 % Kommuninvest i Sverige AB DL-Medium-Term Nts 21(24)Reg.S	A3KM09		USD	500			% 94,310	468.947,34	0,56
2,0000 % Landesbank Baden-Württemberg DL-MTN-Pfandbr.S.828 v.22(25)	LB2ZTL		USD	300			% 95,270	284.232,51	0,34
0,6713 % New Development Bank DL-FLR Med.-Term Nts 2021(24)	A3KZU8		USD	200			% 97,492	193.907,81	0,23
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	4.313.616,30	5,19
Verzinsliche Wertpapiere									
0,3750 % Action Logement Services SAS EO-Medium-Term Nts 2021(31)	A3KW10		EUR	300			% 84,400	253.200,00	0,30

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,6690 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 21(26/31)	A3KK88		EUR	900			% 87,350	786.150,00	0,95
0,3000 % Colgate-Palmolive Co. EO-Bonds 2021(21/29)	A3KYQK		EUR	200			% 85,995	171.990,00	0,21
0,4500 % Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 2021(21/29)	A3KVTY		EUR	400			% 66,065	264.260,00	0,32
2,1250 % Development Bank of Japan EO-Medium-Term Notes 2022(26)	A3K8VT		EUR	200	200		% 98,903	197.806,00	0,24
0,6250 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV EO-Notes 2021(21/32) Reg.S	A3KVZV		EUR	300			% 77,951	233.853,00	0,28
2,1250 % National Australia Bank Ltd. EO-Medium-Term Nts 2022(28)	A3K5XA		EUR	300	300		% 96,510	289.530,00	0,35
2,6250 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2022(29)	A3K8VF		EUR	200	200		% 98,062	196.124,00	0,24
1,3750 % Telia Company AB EO-FLR Securities 2020(26/81)	A28TEC		EUR	400		400	% 89,514	358.056,00	0,43
2,2500 % General Mills Inc. DL-Notes 2021(21/31)	A3KXB7		USD	300			% 82,917	247.378,05	0,30
2,2710 % Honda Motor Co. Ltd. DL-Notes 2022(22/25)	A3K29A		USD	200	200		% 96,069	191.077,52	0,23
1,4000 % ING Groep N.V. DL-FLR Notes 2020(25/26) Reg.S	A28ZD1		USD	200			% 90,320	179.642,98	0,22
2,6250 % Pfizer Inc. DL-Notes 2020(20/30)	A28VAY		USD	200			% 90,492	179.985,08	0,22
1,7500 % Pfizer Inc. DL-Notes 2021(21/31)	A3KU99		USD	300			% 83,113	247.962,81	0,30
2,1500 % Toyota Motor Credit Corp. DL-Med.-Term Nts 2020(20/30)	A28TM5		USD	400			% 86,561	344.332,95	0,41
0,7500 % VISA Inc. DL-Notes 2020(20/27)	A2807T		USD	200			% 86,612	172.267,91	0,21
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	198.496,00	0,24
Verzinsliche Wertpapiere									
4,0670 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28)	A3K81M		EUR	200	200		% 99,248	198.496,00	0,24
Investmentanteile							EUR	51.264.155,98	61,69
Gruppenfremde Investmentanteile									
ASSENAGON Green Economy Act. Nom. I2 EUR Acc. oN	A3C505		ANT	1.000	1.000		EUR 1.011,180	1.011.180,00	1,22
BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.Ldrs Namens-Ant. UCITS ETF CAP o.N.	A2PHCA		ANT	250.000			EUR 14,884	3.721.000,00	4,48
BNP PARIBAS EASY-E.Gl.E.B.Eco. Act. au Port. UE EUR Acc. oN	A2QCJJ		ANT	250.000			EUR 14,458	3.614.500,00	4,35
BNP Paribas Energy Transition Act. Nom. I Cap o.N.	A1T8W4		ANT	100			EUR 1.148,190	114.819,00	0,14
Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ETFL57		ANT	80.000			EUR 34,795	2.783.600,00	3,35
DPAM B-Equities NewGems Sust. Actions Nom. W Cap. o.N.	A2JBEJ		ANT	10.000			EUR 253,360	2.533.600,00	3,05
Guinness A.M.Fds-G.Sust.Energy Reg. Shs Z EUR Acc. oN	A2PS1C		ANT	80.000			EUR 24,555	1.964.400,00	2,36
H.C.F.HC Bos.Com.Gl.Eq.Imp. Reg. Shs Founder EUR Dis. oN	A2QRYB		ANT	17.000			EUR 133,080	2.262.360,00	2,72
iShsIV-MSCI WLD.ESG.Enh.U.ETF Reg. Shares USD Acc. o.N.	A2PCB4		ANT	370.000	370.000		EUR 6,436	2.381.320,00	2,87

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Robeco Cap.Gr.F-Gl.Ge.E.Im.Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	A2QD2H		ANT	10.100			EUR 201,560	2.035.756,00	2,45
Sng.Sel.PI-Clim.Trans.Euro.Eq. Act. Nom. I EUR Acc. oN	A2PHX5		ANT	22.300			EUR 129,427	2.886.222,10	3,47
TBF SMART POWER Inhaber-Anteile EUR I	A2AQZX		ANT	44.000	10.000		EUR 63,370	2.788.280,00	3,36
UBS(L)FS-MSCI World Soc. Resp. Namens-Anteile A Acc. USD o.N.	A1W3CQ		ANT	160.000			EUR 22,465	3.594.400,00	4,33
UI I-Montrusco Bol.Glbl Eq.Fd Act. Nom. IX EUR Acc. oN	A3CTNT		ANT	25.500	25.500		EUR 103,700	2.644.350,00	3,18
Xtr.(IE)-MSCI World ESG Registered Shares 1C o.N.	A2AQST		ANT	70.000		30.000	EUR 28,580	2.000.600,00	2,41
BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Nam.-Ant.UCITS ETF CAP USD o.N	A2AL1U		ANT	200.000			USD 15,926	3.167.619,71	3,81
JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF Reg.S. (ESG) UCITS DL Acc.oN	A2DWM7		ANT	110.000	110.000		USD 38,170	4.175.525,83	5,03
JSS Ifds II-JSS Sus.Bd Gl Mul. Act. Nom. I USD Acc. oN	A2PAXS		ANT	20.000			USD 133,580	2.656.854,46	3,20
Schroder ISF - Healthc.Innov. Act. Nom. C USD Acc. oN	A2PNKQ		ANT	15.000	5.000		USD 143,987	2.147.882,75	2,58
Wellingt.M.Fds Ir.-W.Gl.Impact Regist.Acc.Shs S USD Unh.o.N.	A2DGFF		ANT	165.000			USD 16,941	2.779.886,13	3,35
Summe Wertpapiervermögen							EUR	77.319.537,29	93,05
Derivate							EUR	-74.500,00	-0,09
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate							EUR	-74.500,00	-0,09
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
Euro Bund Future 08.09.22		185	EUR	1.000				-74.500,00	-0,09
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	5.804.161,13	6,99
Bankguthaben							EUR	5.804.161,13	6,99
EUR-Guthaben bei:									
HSBC Trinkaus & Burkhardt GmbH (Düsseldorf)			EUR	4.739.394,27			% 100,000	4.739.394,27	5,70
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			USD	1.070.676,32			% 100,000	1.064.766,86	1,28
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	132.996,77	0,16
Zinsansprüche			EUR	132.996,77				132.996,77	0,16
Sonstige Verbindlichkeiten *)			EUR	-88.609,52				-88.609,52	-0,11
Fondsvermögen							EUR	83.093.585,67	100,00 ¹⁾
Anteilwert							EUR	54,53	
Umlaufende Anteile							STK	1.523.845	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 31.08.2022		
US-Dollar	(USD)	1,0055500	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

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

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

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,4000 % Bank of China Ltd. (Lux Br.) DL-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KP8U	USD		300	
1,0000 % Cassa Depositi e Prestiti SpA EO-Medium-Term Notes 2020(28)	A282LZ	EUR		200	
1,7500 % De Volksbank N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2020(25/30)	A280AJ	EUR		900	
1,6250 % First Abu Dhabi Bank P.J.S.C EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K39P	EUR	400	400	
0,1000 % Frankreich EO-Infl.Index-Lkd OAT 2022(38)	A3K58A	EUR	300	300	
0,1250 % Ind.& Com.Bk of China(Lux.Br.) EO-Medium-Term Notes 2021(24)	A3KX59	EUR		200	
0,7500 % Korea Development Bank, The DL-Notes 2021(25)	A3KX10	USD		300	
0,6250 % New Development Bank DL-Medium-Term Notes 2021(24)	A3KUBC	USD		500	
1,7500 % Orsted A/S EO-FLR Cap.Secs 2019(27/3019)	A2SA9D	EUR		500	
2,8750 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/33)	A3K6A1	EUR	300	300	
2,8750 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	A3K5RS	EUR	200	200	
0,8750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/35)	A3KYH5	EUR		200	
1,8750 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/28)	A3MQS6	EUR	300	300	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere					
1,7500 % Development Bank of Japan DL-Med.-Term Nts 2022(25)Reg.S	A3K1SZ	USD		300	
2,7500 % Telia Company AB EO-FLR Notes 2022(28/83)	A3K3R8	EUR	200	200	

Investmentanteile

Gruppenfremde Investmentanteile					
BNP P.Easy-Low Car.100 Eur.PAB Nam.-Ant.UCITS ETF CAP EUR o.N	A2DPX9	ANT		17.000	
Deka MSCI Europ.C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	ETFL56	ANT	120.000	310.000	
HSBC ETFS-US Sust.Equity Reg. Shs USD Acc. oN	A2PXVQ	ANT		200.000	
iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF Reg. Shs EUR Acc. oN	A2PNZM	ANT		965.000	
L&G-L&G Clean Water UCITS ETF Registered Shares o.N.	A2PM52	ANT		200.000	

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	54,53
Umlaufende Anteile	STK	1.523.845

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. September 2022

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

30070 [2] 10/2022 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