

LB  **BW** Asset Management

LBBW Renten Short Term
Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 30.09.2022

Inhalt

Vermögensübersicht zum 30.09.2022	8
Vermögensaufstellung zum 30.09.2022	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	19
Übersicht Anteilklassen	23
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	24

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.

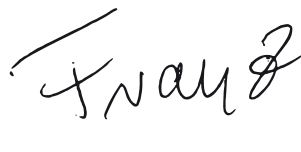
Auf unserer Internetseite informieren wir Sie darüber hinaus regelmäßig über die Entwicklung des Fonds. Auf **www.LBBW-AM.de** finden Sie die aktuellen Fondspreise, umfangreiche Angaben zur Wertentwicklung, die Portfolio-Struktur sowie viele weitere Fakten.

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 Renten Short Term Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 30.09.2022

Vermögensübersicht zum 30.09.2022

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	689.660.110,60	110,09
1. Anleihen	666.038.912,76	106,32
Bundesrep. Deutschland	173.490.870,40	27,69
Frankreich	107.211.454,40	17,11
Italien	67.379.314,36	10,76
Dänemark	35.187.295,31	5,62
Portugal	30.002.700,00	4,79
USA	28.156.455,60	4,49
Großbritannien	26.567.572,70	4,24
Luxemburg	25.427.158,44	4,06
Spanien	24.434.189,00	3,90
Niederlande	18.386.537,34	2,93
Jersey	14.925.000,00	2,38
Finnland	14.059.824,50	2,24
Intern. Investitionsbk	13.827.198,00	2,21
Slowakei	11.927.056,49	1,90
Norwegen	9.842.882,40	1,57
Europ. Investitionsbank	8.187.710,00	1,31
Österreich	6.542.185,00	1,04
Schweden	6.467.315,11	1,03
Tschechische Republik	6.458.964,00	1,03
Guernsey	5.661.314,05	0,90
Neuseeland	4.300.920,00	0,69
Canada	3.835.204,81	0,61
Irland	3.791.060,00	0,61
Belgien	3.728.130,00	0,60
Polen	2.949.048,00	0,47
Andere Länder	13.291.552,85	2,13
2. Derivate	1.241.047,51	0,20
3. Schuldscheindarlehen	16.433.715,61	2,62
Spanien	11.465.867,46	1,83
Portugal	4.967.848,15	0,79
4. Bankguthaben	2.449.143,72	0,39
5. Sonstige Vermögensgegenstände	3.497.291,00	0,56
II. Verbindlichkeiten	-63.189.602,66	-10,09
III. Fondsvermögen	626.470.507,94	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen							EUR	666.038.912,76	106,32
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	577.649.953,14	92,21
Verzinsliche Wertpapiere									
0,3750 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 278 v.19(24)	A2E4CQ		EUR	6.000			% 94,098	5.645.890,51	0,90
4,5000 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 317 v.22(25)	AAR035		EUR	6.000	6.000		% 98,490	5.909.400,00	0,94
0,2500 % Aegon Bank N.V. EO-Med.-Term Cov.Bds 2016(23)2	A18110		EUR	7.000			% 98,853	6.919.710,00	1,10
0,2500 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 17(23/23)	A19S4U		EUR	1.000			% 98,538	985.380,00	0,16
2,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2013(23)	A1HM2E		EUR	10.000	10.000		% 100,145	10.014.500,00	1,60
0,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(24)	A2RTMS		EUR	3.400			% 96,872	3.293.648,00	0,53
0,3750 % Aroundtown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27)	A3K0AH		EUR	1.000			% 75,874	758.735,89	0,12
0,6250 % ASB Finance Ltd. (Ldn Branch) EO-Med.T. Mtg Cov. Nts 17(24)	A19QN3		EUR	4.500			% 95,576	4.300.920,00	0,69
2,4000 % AT & T Inc. EO-Notes 2014(14/24)	A1ZKLS		EUR	2.000		6.000	% 98,840	1.976.800,00	0,32
0,6250 % Banco BPM S.p.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	A182LU		EUR	16.000			% 98,888	15.822.080,00	2,53
0,6250 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2016(24)	A182QC		EUR	6.000			% 96,385	5.783.100,00	0,92
0,6250 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25)	A2R912		EUR	1.500	500		% 92,170	1.382.550,00	0,22
1,7500 % Banco de Sabadell S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R1SN		EUR	9.000			% 95,082	8.557.380,00	1,37
0,9180 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(26)	A288JJ		EUR	1.000	500		% 99,226	992.260,00	0,16
1,3750 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26)	A28WYB		EUR	2.000			% 91,559	1.831.170,00	0,29
0,8750 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.-T.Obr.Hipotecárias17(24)	A19GL2		EUR	10.000			% 97,067	9.706.700,00	1,55
3,0000 % Bank Gospodarstwa Krajowego EO-Medium-Term Nts 2022(29)	A3K55N		EUR	1.000	1.000		% 89,330	893.300,00	0,14
1,9490 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/26)	A3K4WK		EUR	3.200	3.200		% 94,027	3.008.864,00	0,48
0,7500 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(17/23)	BA0AG8		EUR	3.000			% 98,506	2.955.180,00	0,47
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	A2RTCL		EUR	3.150			% 97,860	3.082.590,00	0,49
0,8750 % Bco di Desio e della Brianza EO-Mortg.Cov. MTN 2017(24)	A19NVU		EUR	2.750			% 96,093	2.642.557,50	0,42
0,0000 % Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2021(21/23)	A3KU40		EUR	5.500			% 97,600	5.368.000,00	0,86
1,2500 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.109 v.15(25)	BHY0A5		EUR	5.000			% 94,940	4.747.000,00	0,76
0,6250 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(23)	A2RXDQ		EUR	1.000			% 97,800	978.000,00	0,16
0,5000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	A3K2JU		EUR	2.000	2.000	7.000	% 94,240	1.884.800,00	0,30
2,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(25)	BP457Q		EUR	4.600			% 96,166	4.423.613,00	0,71

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,5000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(25)	PB1KT9		EUR	3.000			% 93,185	2.795.550,00	0,45
1,0000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	PB1K0D		EUR	3.000			% 96,699	2.900.970,00	0,46
0,2500 % BPCE S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(26)	A28R2M		EUR	1.000			% 90,235	902.350,00	0,14
2,8750 % BPCE S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	A180FE		EUR	2.000			% 94,670	1.893.400,00	0,30
0,8750 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	A19VDX		EUR	3.500			% 97,151	3.400.271,00	0,54
1,0000 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	A2RZ4Y		EUR	5.000			% 93,672	4.683.600,00	0,75
3,8500 % BPCE S.A. EO-Obl. 2014(26)	A1ZM39		EUR	3.000			% 98,670	2.960.100,00	0,47
0,3750 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(26)	A3K1KB		EUR	2.500			% 90,085	2.252.125,00	0,36
0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2021(25)	A3KZMU		EUR	5.000	5.000		% 91,995	4.599.725,00	0,73
0,8750 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2018(18/23)	A2RSCK		EUR	1.500			% 97,593	1.463.895,00	0,23
0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.12(23) ****)	103054		EUR	5.000	5.000		% 101,984	6.156.417,14	0,98
0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.15(26) ****)	103056		EUR	5.000	50.000	50.000	% 102,248	6.007.478,99	0,96
0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.21(33) ****)	103058		EUR	5.000	5.000	10.000	% 100,729	5.631.842,35	0,90
3,9000 % Caisse Refinancement l'Habitat EO-Covered Bonds 2011(23)	A1GWA3		EUR	5.441			% 101,485	5.521.798,85	0,88
0,1250 % Caixa Económica Montepio Geral EO-Med.-Term Obr. Hip.2019(24)	A2SAAT		EUR	21.500			% 94,400	20.296.000,00	3,24
1,7500 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	A2RTBL		EUR	3.000			% 98,392	2.951.760,00	0,47
0,3750 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25)	A28R49		EUR	2.000			% 92,998	1.859.960,00	0,30
2,5000 % Capgemini SE EO-Notes 2015(15/23)	A1Z3RG		EUR	4.000			% 99,857	3.994.280,00	0,64
0,6250 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/25)	A28YX9		EUR	1.600			% 93,439	1.495.024,00	0,24
1,8750 % Ceske Drahys AS EO-Notes 2016(23)	A1811Z		EUR	4.200	4.200		% 98,490	4.136.580,00	0,66
2,3750 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZJKF		EUR	5.000			% 98,715	4.935.750,00	0,79
0,7500 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)	A18782		EUR	5.000			% 97,730	4.886.500,00	0,78
0,5000 % Commerzbank AG MTN-Anl. v.16(23) S.871	CZ40LR		EUR	12.132	10.000		% 97,230	11.795.943,60	1,88
0,6250 % Commerzbank AG MTN-IHS S.928 v.19(24)	CZ40N0		EUR	10.000			% 94,970	9.497.000,00	1,52
0,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.939 v.19(24)	CZ45VB		EUR	1.000			% 92,798	927.980,00	0,15
0,3750 % Commerzbank AG MTN-IHS S.961 v.20(27)	CZ45V8		EUR	2.500			% 85,030	2.125.750,00	0,34
0,1000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.973 v.21(25)	CBOHRY		EUR	4.000	1.000		% 90,490	3.619.600,00	0,58
1,7500 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 20(20/23)	A28VK6		EUR	5.000			% 99,697	4.984.850,00	0,80

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,0000 % Continental AG MTN v.19(23/23)Reg.S	A2YPE5		EUR	1.000			% 96,825	968.250,00	0,15
0,3750 % Continental AG MTN v.19(25/25)	A2YPAE		EUR	700			% 92,300	646.100,00	0,10
0,7500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	A19471		EUR	3.100			% 98,128	3.041.968,00	0,49
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KLA2		EUR	3.000			% 88,970	2.669.100,00	0,43
1,8750 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Prefer.FLM 2022(26/27)	A3K4NX		EUR	1.500	1.500		% 92,914	1.393.710,00	0,22
1,0020 % Credit Suisse Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	A287LY		EUR	1.500			% 96,025	1.440.375,00	0,23
1,1250 % Credito Emiliano S.p.A. EO-Mortg.Covered Bds 2019(24)	A2RWHX		EUR	1.000			% 97,918	979.180,00	0,16
2,5930 % CS Group Funding (GG) Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 2015(22)	A1Z953		EUR	5.645	645		% 100,289	5.661.314,05	0,90
0,0000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25)	A3KRXH		EUR	1.000			% 90,735	907.350,00	0,14
0,0100 % Danske Bank AS EO-FLR MTN 2021(23/24)	A3KYQM		EUR	8.400			% 96,168	8.078.112,00	1,29
0,5000 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref.MTN 19(24/25)	A2R6X4		EUR	3.000			% 93,035	2.791.050,00	0,45
0,8750 % Danske Bank AS EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	A1904D		EUR	9.000			% 98,647	8.878.239,00	1,42
2,1250 % Danske Mortgage Bank PLC EO-Mortg.Covered MTN 2022(25)	A3K88D		EUR	5.000	5.000		% 97,936	4.896.800,00	0,78
1,5510 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.15(25)	DB7XKH		EUR	4.000			% 97,278	3.891.129,15	0,62
0,0500 % Deutsche Bank AG Struct.Cov.Bond v.2019(2024)	DL19U1		EUR	1.200			% 94,100	1.129.200,00	0,18
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	GRN001		EUR	15.000			% 94,472	14.170.800,00	2,26
2,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2024/2024)	A3E5X5		EUR	2.000			% 93,528	1.870.560,00	0,30
2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2025/2025)	A3H240		EUR	3.000			% 89,310	2.679.300,00	0,43
0,7500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35304 v.19(23)	A2LQNQ		EUR	300		10.000	% 99,387	298.161,45	0,05
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35408 v.21(25)	A3T0X2		EUR	10.000	10.000		% 86,136	8.613.600,00	1,37
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35413 v.22(25)	A3T0X9		EUR	14.000	3.000		% 90,358	12.650.050,00	2,02
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	A30WV9		EUR	2.700	2.700		% 97,250	2.625.750,00	0,42
1,0000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15317 v.22(26)	A3T0YH		EUR	4.700	9.700	5.000	% 93,699	4.403.853,00	0,70
0,0500 % DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23)	A2SAAP		EUR	7.220			% 96,567	6.972.137,40	1,11
0,7500 % E.ON Intl Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2018(22/22)	A191D1		EUR	200	200		% 99,871	199.742,00	0,03
0,8750 % Elering A.S. EO-Bonds 2018(18/23)	A190AW		EUR	2.000			% 98,730	1.974.600,00	0,32
0,8750 % Elisa Oyj EO-Med.-Term Notes 2017(23/24)	A19EPA		EUR	1.150			% 97,195	1.117.742,50	0,18
0,6250 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2020(25/25)	A28V1E		EUR	500			% 94,000	470.000,00	0,08

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,7500 % Erste Group Bank AG EO-Med.-T. Hyp.Pfandb.2015(25)	EBOJE5		EUR	1.000			% 95,320	953.200,00	0,15
0,3750 % Erste Group Bank AG EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24)	EBOJJN		EUR	1.500			% 95,390	1.430.850,00	0,23
0,5000 % Euroclear Bank S.A./N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	A193AG		EUR	3.000			% 98,461	2.953.830,00	0,47
2,2500 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2022(30)	A3K9EZ		EUR	8.500	8.500		% 96,326	8.187.710,00	1,31
1,7500 % Goldman Sachs Internatl EO-Medium-Term Nts 2015(24)	A162WX		EUR	347	347		% 96,880	336.173,72	0,05
0,3500 % Hamburg Commercial Bank AG IHS v. 2020(2024) S.2727	HCB0AX		EUR	12.200			% 96,305	11.749.268,68	1,88
3,0000 % HSBC Holdings PLC EO-Medium-Term Notes 2015(25)	A1Z3RC		EUR	2.000			% 97,038	1.940.760,00	0,31
0,8750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Med.-Term Notes 2018(23)	A19Y85		EUR	2.300			% 97,870	2.251.010,00	0,36
0,3750 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr.2017(24)	A19HK3		EUR	500			% 96,425	482.125,00	0,08
0,7500 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/23)	A3E44U		EUR	1.000			% 98,540	985.400,00	0,16
1,1250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/26)	A3E44V		EUR	500	500		% 91,989	459.945,00	0,07
0,4180 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 2007(27)	A0V0TR		EUR	1.600	1.600		% 93,177	1.490.832,00	0,24
2,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-M.T.Preferred Nts 2018(23)	A195AW		EUR	5.500	3.000		% 98,999	5.444.945,00	0,87
0,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdr.19(24)	A2RYP8		EUR	6.500			% 96,970	6.303.050,00	1,01
0,0000 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(23)	A3KXKH		EUR	6.000			% 93,785	5.627.118,00	0,90
0,1190 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(24)	A288KE		EUR	9.000			% 91,112	8.200.080,00	1,31
0,5000 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2017(22)	A19T2C		EUR	900	900		% 99,807	898.263,00	0,14
0,6250 % Island, Republik EO-Medium-Term Nts 2020(26)	A28X37		EUR	1.000			% 91,175	911.750,00	0,15
2,1250 % ISS Global A/S EO-Med.-Term Notes 2014(14/24)	A1ZS18		EUR	2.339			% 97,909	2.290.091,51	0,37
1,3750 % John Deere Cash Mgmt S.a.r.L. EO-Medium-Term Notes 2020(24)	A28VJ7		EUR	6.000			% 97,348	5.840.880,00	0,93
1,3750 % Johnson Controls Internat. PLC EO-Notes 2016(17/25)	A19BCD		EUR	4.000			% 94,777	3.791.060,00	0,61
0,2500 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/23)	A28W3W		EUR	1.200			% 98,903	1.186.836,00	0,19
2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H357 v.22(26)	HLB2QL		EUR	4.000	4.000		% 98,457	3.938.280,00	0,63
0,1250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24)	HLB2P2		EUR	1.800			% 94,196	1.695.528,00	0,27
2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27)	HLB2QJ		EUR	1.000	1.000		% 93,360	933.600,00	0,15
0,2500 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28WWK		EUR	250			% 91,060	227.650,00	0,04
0,5000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/25)	A2R99B		EUR	2.000			% 92,902	1.858.040,00	0,30
1,0730 % mBank Hipoteczny S.A. EO-Med.-T.Hyp.-Pf.-Br.2018(25)	A19ZWS		EUR	1.000			% 95,140	951.400,00	0,15

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,2420 % mBank Hipoteczny S.A. EO-Med.-T.Hyp.-Pf.-Br.2019(25)	A2R902		EUR	1.200			% 92,029	1.104.348,00	0,18
1,1250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-Non-Preferred MTN 2020(25)	A28SHV		EUR	500	500		% 92,610	463.050,00	0,07
0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/23)	A2RY13		EUR	5.000			% 99,402	4.970.100,00	0,79
0,8750 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1794 v.18(25)	MHB60L		EUR	1.000			% 93,570	935.700,00	0,15
0,4100 % National Grid North Amer. Inc. EO-Med.-Term Nts 2022(22/26)	A3K1DM		EUR	1.000			% 89,820	898.200,00	0,14
0,5000 % Nationwide Building Society EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(24)	A19DPP		EUR	2.730			% 97,130	2.651.649,00	0,42
4,0670 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/28)	A3K81M		EUR	4.100	4.100		% 95,238	3.904.737,50	0,62
1,1250 % NatWest Markets PLC EO-Med.-T.Nts 2018(23)	A19145		EUR	2.000			% 99,088	1.981.760,00	0,32
0,1250 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KSMY		EUR	2.000			% 86,282	1.725.640,00	0,28
0,0500 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 20(25)	A28SJM		EUR	1.500			% 93,517	1.402.755,00	0,22
1,8480 % Norddeutsche Landesbank -GZ- FLR-MTN-Inh.Schv.v.18(23)	NLB2UU		EUR	5.000			% 99,964	4.998.200,00	0,80
1,5000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Inh.-Schv. v.2015(2026)	NLB854		EUR	6.000			% 91,522	5.491.328,89	0,88
0,2500 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	A189FH		EUR	1.400			% 97,563	1.365.882,00	0,22
2,1200 % Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(23)	A3KSYJ		EUR	7.000			% 100,261	7.018.270,00	1,12
0,2500 % Nykredit Realkredit A/S EO-Medium-Term Notes 2019(23)	A2SA04		EUR	2.000			% 99,484	1.989.680,00	0,32
0,1250 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R68P		EUR	3.890			% 94,102	3.660.567,80	0,58
1,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24)	A2RWEV		EUR	1.100			% 96,736	1.064.096,00	0,17
3,2500 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2022(22/31)	A3K88F		EUR	500	500		% 96,257	481.285,00	0,08
0,6250 % PSA Banque France S.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/24)	A2R3WH		EUR	5.000			% 95,295	4.764.750,00	0,76
0,2500 % RaiffeisenL.Niederöst.-Wien AG EO-Preferred MTN 2019(24)	A2R88P		EUR	1.500			% 95,000	1.425.000,00	0,23
1,7500 % Rumänien EO-Med.-Term Nts 2021(30)Reg.S	A3KTZA		EUR	3.000			% 64,570	1.937.100,00	0,31
1,1250 % Santander Consumer Finance SA EO-Medium-Term Nts 2018(23)	A2RSGN		EUR	1.100			% 97,819	1.076.009,00	0,17
2,0030 % Santander UK Group Hldgs PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2018(23/24)	A19YE9		EUR	2.000			% 99,874	1.997.480,00	0,32
1,2500 % Santander UK PLC EO-Med.-T.Cov. Bds 2014(24)	A1ZPYK		EUR	2.000			% 97,072	1.941.440,00	0,31
0,1250 % SID Banka d.d. EO-Bonds 2020(25)	A28ZG3		EUR	700	700		% 92,331	646.319,36	0,10
4,0000 % Société Générale S.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23)	A1HLVP		EUR	5.000			% 100,400	5.020.000,00	0,80
1,1250 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	A19U5Y		EUR	1.000			% 94,446	944.460,00	0,15
4,2500 % Société Générale SCF EO-Med.-T.Pub.Ob.Fonc.2011(23)	A1GLWR		EUR	8.000	8.000		% 100,940	8.075.200,00	1,29

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,0000 % Sp Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	A3K4VR		EUR	7.000	7.000		% 95,420	6.679.400,00	1,07
0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	A2RZQK		EUR	1.000			% 96,351	963.505,00	0,15
1,1250 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2017(17/25)	A19EWG		EUR	2.000			% 95,362	1.907.240,00	0,30
3,6250 % Swedbank AB EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/32)	A3K8N4		EUR	2.700	2.700		% 93,008	2.511.216,00	0,40
0,2500 % Swedbank AB EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R83B		EUR	4.210			% 93,969	3.956.099,11	0,63
0,9000 % Tatra Banka AS EO-Cov. Bonds 2017(24)	A19DD5		EUR	7.000			% 97,918	6.854.260,00	1,09
2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-FLR Nts 2022(22/Und.)	A3K11Y		EUR	2.000			% 76,787	1.535.740,36	0,25
0,1250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2019(25)	A2R5K9		EUR	7.000			% 91,410	6.398.700,00	1,02
4,9000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Notes 2004(24)	A0DEEL		EUR	4.100			% 104,020	4.264.820,00	0,68
0,8500 % U.S. Bancorp EO-Med.-Term Nts 2017(24)	A19JLL		EUR	3.100			% 96,070	2.978.170,00	0,48
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(23/Und.)	A19ZL9		EUR	1.000			% 87,100	871.001,89	0,14
1,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/25)	A190KM		EUR	3.000			% 90,391	2.711.730,00	0,43
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	A28VTN		EUR	500			% 94,230	471.150,00	0,08
6,9500 % UniCredit S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2012(22)	A1HBVX		EUR	7.400			% 100,380	7.428.120,00	1,19
3,0000 % UniCredit S.p.A. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 14(24)	A1ZCET		EUR	3.100			% 100,345	3.110.695,00	0,50
0,5000 % Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 2016(24)	A18635		EUR	2.000			% 97,053	1.941.060,00	0,31
0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/24)	A3E5MF		EUR	6.200			% 92,959	5.763.458,00	0,92
0,5000 % Vseobecná úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2018(23)	A1917U		EUR	2.700			% 98,655	2.663.671,49	0,43
0,2500 % Vseobecná úverová Banka AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 19(24)	A2RZRG		EUR	2.500			% 96,365	2.409.125,00	0,38
1,2500 % ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23)	A2R9EL		EUR	3.000			% 96,460	2.893.800,00	0,46
Commerzbank AG 0-Kp-Li-Anl.T.46v.96(20.11.26)	181578		ITL	7.000.000			% 82,278	2.974.512,85	0,47
4,7941 % Citigroup Glob.Mkts Hldgs Inc. DL-FLR Med.-Term Nts 2016(26)	A1V2CV		USD	1.200			% 93,801	1.148.991,60	0,18
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	67.672.614,74	10,80
Verzinsliche Wertpapiere									
0,1000 % Allianz Banque S.A. EO-Bons Moy.T.Nég. 2021(25)	A1V76J		EUR	5.000			% 89,859	4.492.950,00	0,72
2,1500 % ASIF III (Jersey) Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 2004(24)	A0D3W6		EUR	15.000			% 99,500	14.925.000,00	2,38
0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	A255C2		EUR	2.000			% 88,800	1.776.000,00	0,28
0,2000 % Deutsche Bank AG, London Br. Festzinsanl. v.2020(2026)	DL8Y3N		EUR	5.000			% 88,810	4.440.500,00	0,71

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,5000 % Deutsche Bank AG, London Br. FLR-Notes v.2016(2026)	DB1ZDT		EUR	2.000			% 90,770	1.815.400,00	0,29
1,0000 % Evonik Industries AG Medium Term Notes v.15(22/23)	A14J1H		EUR	500			% 99,854	499.270,00	0,08
0,0000 % Highland Holdings S.A.r.L. EO-Notes 2021(21/23)	A3KYWL		EUR	5.200			% 96,335	5.009.420,00	0,80
3,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Obbl. 2017(24)	A19QHA		EUR	2.300			% 99,010	2.277.230,00	0,36
1,1250 % Knorr-Bremse AG Medium Term Notes v.18(25/25)	A2LQP5		EUR	700			% 94,699	662.893,00	0,11
3,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr.Anleihe v.15(25)	HLB2DM		EUR	500			% 99,777	498.885,00	0,08
0,5000 % Ontario Teachers Finance Trust EO-Notes 2020(25) Reg.S	A28WUY		EUR	800			% 94,077	752.614,81	0,12
1,3750 % Tyco International Fin. S.A. EO-Notes 2015(15/25)	A1ZXLQ		EUR	7.805	900		% 95,391	7.445.267,55	1,19
0,6000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(25/26)	A3KL4S		EUR	2.500			% 86,980	2.174.500,00	0,35
0,4890 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Obbl. 2016(23)	A182NM		EUR	5.000			% 99,960	4.998.000,00	0,80
1,6930 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Obbl. 2016(23)	A1V1W8		EUR	2.053			% 99,650	2.045.814,50	0,33
2,1250 % Wüstenrot& Württembergische AG FLR-Nachr.-Anl. v.21(31/41)	A3E5VS		EUR	700			% 67,190	470.330,77	0,08
UBS Finance (Curaçao) N.V. LI-Zero-Bonds 1997(27)	135414		ITL	6.000.000	6.000.000		% 83,466	2.586.395,49	0,41
1,1620 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2021(21/24)	A3KZCD		USD	5.000			% 94,535	4.824.937,48	0,77
3,8750 % Société Générale S.A. DL-Non-Pref. MTN 2019(24) 144A	A2RZ0K		USD	5.000			% 97,261	4.964.068,80	0,79
5,0000 % Vonovia Finance B.V. DL-Notes 2013(13/23)Reg.S	A1HRRS		USD	1.000			% 99,252	1.013.137,34	0,16
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	20.716.344,88	3,31
Verzinsliche Wertpapiere									
2,8750 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2014(24)	A1ZRT1		EUR	2.400	2.400		% 96,766	2.322.384,00	0,37
3,8500 % Communauté française Belgique EO-Medium-Term Notes 2012(24)	A1UB2S		EUR	750			% 103,240	774.300,00	0,12
4,4290 % VPV Lebensversicherungs-AG FLR-Nachr.-Anl. v.06(16/26)	A0KAHT		EUR	700			% 93,150	652.050,00	0,10
4,6517 % Crédit Agricole S.A. DL-FLR Non-Pref. MTN 19(24)	A285VV		USD	10.000			% 100,202	10.228.346,86	1,63
4,8271 % Deutsche Bank AG FLR-DL- MTN 18(25)	A2LQFZ		USD	6.800			% 97,090	6.739.264,02	1,08
Summe Wertpapiervermögen							EUR	666.038.912,76	106,32
Schuldscheindarlehen							EUR	16.433.715,61	2,62
5,6550 % Generalitat de Catalunya SSD EUR 09/24	ODE00109		EUR	11.000			% 104,235	11.465.867,46	1,83
0,0000 % Metropolitano de Lisboa SSD EUR 04/24	ODE00074		EUR	5.000			% 99,357	4.967.848,15	0,79

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	1.241.047,51	0,20
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Zins-Derivate							EUR	1.484.019,00	0,24
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
Buxl Future 08.12.22		185	EUR	-10.000				1.267.660,00	0,20
Euro Bund Future 08.12.22		185	EUR	7.500				-445.606,50	-0,07
Euro Schatz Future 08.12.22		185	EUR	-75.000				661.965,50	0,11
Swaps							EUR	-1.005.835,49	-0,16
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsswaps									
PAYER SWAP 1,125% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 07.10.2022/07.10.2052 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	9.900				2.592.980,86	0,41
RECEIVER SWAP 1,38% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 07.10.2022/07.10.2032 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	26.400				-3.865.381,04	-0,62
Credit Default Swaps									
Protection Seller									
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	1.700				-19.506,38	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	2.000				-22.948,69	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	2.100				-24.096,12	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	500				-5.737,17	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.600				-18.358,95	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.000				-11.474,34	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	2.200				-25.243,56	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	2.300				-26.390,99	0,00
Protection Buyer									
Deutsche Bank AG Sub EUR 22/24 CDS Referenz 1% 20.06.2022/20.06.2023 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	25.000				179.485,66	0,03
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	3.300				37.865,34	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	400				4.589,74	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.900				21.801,25	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.100				12.621,78	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	2.600				29.833,29	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.500				17.211,52	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	1.000				11.474,34	0,00

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027									
Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	1.500				17.211,52	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027									
J.P. Morgan SE		OTC	EUR	100				1.147,43	0,00
SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) 1% 14.08.2021/20.06.2023									
BNP Paribas S.A.		OTC	JPY	1.300.000				87.079,02	0,01
Optionsrechte auf Swaps							EUR	762.864,00	0,12
Swaption.Pay. 1,5 % EUR /gg.3mth EURIBOR. 13.07.23		OTC	STK	100.000.000				1.670.909,00	0,27
Swaption.Pay. 2,5 % EUR /gg.3mth EURIBOR. 13.07.23		OTC	STK	-100.000.000				-908.045,00	-0,14
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.449.143,72	0,39
Bankguthaben							EUR	2.449.143,72	0,39
EUR-Guthaben bei:									
J.P. Morgan AG (Frankfurt)			EUR	420.000,00			% 100,000	420.000,00	0,07
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	1.950.000,00			% 100,000	1.950.000,00	0,31
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			GBP	67.570,89			% 100,000	76.995,09	0,01
			JPY	304.675,00			% 100,000	2.148,63	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	3.497.291,00	0,56
Zinsansprüche			EUR	3.497.291,00				3.497.291,00	0,56
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-63.021.554,54	-10,06
EUR-Kredite			EUR	-33.659.148,43			% 100,000	-33.659.148,43	-5,37
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	-28.764.881,15			% 100,000	-29.362.406,11	-4,69
Sonstige Verbindlichkeiten *)							EUR	-168.048,12	-0,03
Fondsvermögen							EUR	626.470.507,94	100,00 ¹⁾
LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I									
Fondsvermögen							EUR	395.902.248,27	63,20
Anteilwert							EUR	95,97	
Umlaufende Anteile							STK	4.125.185	
LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R									
Fondsvermögen							EUR	230.568.259,67	36,80
Anteilwert							EUR	38,36	
Umlaufende Anteile							STK	6.010.352	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwarentgelte, Kostenpauschale

*****) Bei diesen Wertpapieren wurde der Kurswert durch einen Inflationskoeffizienten beeinflusst.

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.09.2022		
Britische Pfund	(GBP)	0,8776000	=	1 Euro (EUR)
Italienische Lire	(ITL)	1936,2700000	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	141,7994000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	0,9796500	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

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

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					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,2500 % ACEA S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/30)	A288DX	EUR	10.000	10.000	
0,3750 % Achmea Bank N.V. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(24)	A19SM8	EUR		24.600	
1,2890 % Alpha Bank Romania S.A. EO-FLR M-T.Hyp.-Pfandbr.19(24)	A2R2E1	EUR		5.000	
1,9500 % American Honda Finance Corp. EO-Med.-T.Nts 2020(20/24)Ser.A	A28V99	EUR		7.000	
0,8750 % Apple Inc. EO-Notes 2017(17/25)	A19HY4	EUR		3.000	
2,5000 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2014(24)	A1ZB57	EUR		15.200	
1,2520 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 2022(24)	A3K421	EUR	10.000	10.000	
1,4530 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2021(24/25)	A3KRJM	EUR		2.000	
0,0100 % Belfius Bank S.A. EO-Preferred MTN 2020(25)	A283SF	EUR		15.000	
0,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(26/27)	BP45SW	EUR		1.000	
0,6250 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R301	EUR		15.000	
1,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2015(25)	A1ZUS6	EUR		5.000	
1,1250 % Bremen, Freie Hansestadt LandSchatz. A.196 v.14(24)	A11QJZ	EUR	10.000	10.000	
1,0000 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24)	A19KH4	EUR		6.000	
0,8750 % Caixabank S.A. EO-Preferred Bonos 2019(24)	A2RZQE	EUR		7.600	
0,8750 % Cajamar Caja Rural, S.C.Créd. EO-Cédulas Hipotec. 2018(23)	A19141	EUR		9.600	
2,5000 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2014(24/24)	A1ZJZQ	EUR		1.000	
0,1070 % Carrefour Banque EO-Med.-T. Nts 2021(25/25)	A3KSG1	EUR		11.300	
3,1080 % Cassa Depositi e Prestiti SpA EO-FLR Med.-Term Nts 2019(26)	A2R3L1	EUR		4.000	
1,8750 % Comun. Autónoma del País Vasco EO-Obligaciones 2022(33)	A3K4WM	EUR	6.000	6.000	
0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2RYJC	EUR		5.000	
2,3750 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K7DS	EUR	3.500	3.500	
1,2500 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Non-Preferred Nts 2017(24)	A19H8T	EUR		4.000	
0,0100 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1220 20(24)	A2TSD5	EUR		25.000	
0,8750 % E.ON SE Medium Term Notes v.22(24/25)	A3MQY8	EUR		8.200	
0,0100 % Equitable Bank EO-Med.-Term Cov. Bds 2021(24)	A3KV73	EUR		13.245	
1,3750 % Equitable Bank EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	A3K5YQ	EUR	10.000	10.000	
1,2500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(43)	A3K4DG	EUR	21.000	21.000	
2,5000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(52)	A3K4DT	EUR	25.000	25.000	
0,5000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Nts 2019(24/24)	A2R7MQ	EUR		1.000	
1,2690 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 2022(24/25)	A3K11V	EUR		4.700	
1,7500 % Intl Development Association EO-Med.-Term Nts 2022(37)	A3K41V	EUR	10.000	10.000	
0,6250 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(25)	A2R0KC	EUR		5.000	
2,3750 % KommuneKredit EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K81N	EUR	4.500	4.500	
1,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(32)	A3E5J6	EUR	14.000	14.000	
0,5000 % Länsförsäkringar Bank AB EO-Medium-Term Notes 2017(22)	A19N7Y	EUR	1.000	1.000	
0,1000 % LHV Pank AS EO-Mortg.Covered MTN 2020(25)	A28X73	EUR		5.000	
2,1250 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2022(32)	A3K557	EUR	7.000	7.000	
0,2500 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/25)	A2R4FH	EUR		1.500	
0,2500 % Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	A2RYF6	EUR	10.000	12.800	
2,1200 % Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(24)	A3KNS1	EUR		9.000	
1,6500 % Portugal, Republik EO-Obr. 2022(32)	A3K4CV	EUR	9.500	9.500	
0,0000 % PSA Banque France S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(21/25)	A287TD	EUR		4.200	
0,0000 % Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2021(21/25)	A3KPS1	EUR		3.000	
2,5000 % RWE AG Medium Term Notes v.22(25/25)	A30VMU	EUR	8.000	8.000	
2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25)	A3K8X0	EUR	4.900	4.900	
2,7500 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(30/30)	A3K8XZ	EUR	2.400	2.400	
0,7500 % Swedbank AB EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28WSZ	EUR		5.000	
2,1000 % Swedbank AB EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27)	A3K5X5	EUR	3.800	3.800	
3,8750 % Telia Company AB EO-Medium-Term Notes 2010(25)	A1A1TH	EUR		5.625	

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
0,3750 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2R08A	EUR		12.000	
0,2500 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2R0C8	EUR		3.000	
0,0640 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	A3K0SY	EUR		8.700	
0,1250 % Volvo Treasury AB EO-Med.-T.Notes 2020(20/24)	A282HN	EUR		3.000	
1,3750 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/26)	A3MQS5	EUR		6.700	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,8500 % Ontario Teachers Finance Trust EO-Notes 2022(32) Reg.S	A3K411	EUR	8.000	8.000	
---	--------	-----	-------	-------	--

Nicht notierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

0,2500 % Danmarks Skibskredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2019(22)	A2RZUT	EUR		1.000	
0,5830 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. FLR-MTN-IHS A.1463 v.20(22)	DFK0C3	EUR		2.000	
1,0580 % mBank S.A. EO-Medium-Term Nts 2018(22)	A195HB	EUR		1.900	
0,5500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-IHS S.470 v.2016(2022)	DHY470	EUR	700	700	
2,8000 % UniCredit S.p.A. DL-Obbl. 2016(22)	A183SF	USD		9.840	
0,3750 % Vseobecna úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2017(22)	A19PB2	EUR		1.000	

Schuldscheindarlehen

0,8990 % Kaufland Stiftung & Co. KG SSD 0,899% EUR 03.08.2022	ODE00108	EUR		25.000	
---	----------	-----	--	--------	--

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): EURIBOR (EUR) 3 MONATE, EURO-BUND)	EUR	137.643,36
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 10Y.JAPAN GOV.BD.SYN.AN, 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ)	EUR	858.383,11

Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin: USD/EUR	EUR	27.352,20
--	-----	-----------

Optionsrechte

Optionsrechte auf Zins-Derivate

Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): 3 Month Euribor Future 19.12.22, Euro Bund Future 08.12.22)	EUR	2.282,82
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): 3 Month Euribor Future 19.12.22, Euro Bund Future 08.09.22, Euro Bund Future 08.12.22, Euro Schatz Future 08.09.22, Euro Schatz Future 08.12.22)	EUR	2.847,37
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): Euro Bund Future 08.09.22, Euro Bund Future 08.12.22, Euro Schatz Future 08.09.22, Euro Schatz Future 08.12.22)	EUR	789,16

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Optionsrechte auf Devisen-Derivate					
Optionsrechte auf Devisen					
Gekaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswährungen: EUR/USD)		EUR			250,25
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswährungen: EUR/USD)		EUR			92,25
SWAPS (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)					
Zinsswaps Payer					
(Basiswert(e): PAYER SWAP 1,476% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 07.10.2022/07.10.2052 BNP Paribas S.A.)		EUR			9.900,00
Zinsswaps Receiver					
(Basiswert(e): RECEIVER SWAP 0,775% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 17.05.2022/17.05.2024 Landesbank Baden-Württemberg, RECEIVER SWAP 1,758% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 07.10.2022/07.10.2032 BNP Paribas S.A.)		EUR			76.400,00
Credit Default Swaps					
Protection Seller					
(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 20.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A., iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 20.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE, iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A., iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE, iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A., iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG, iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE)		EUR			76.200,00
Protection Buyer					
(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 20.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE, iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A., iTraxx Europe Crossover Ser.37 Index (5 Year) 5% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE, iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A., iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG, iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE)		EUR			99.400,00

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
Optionsrechte auf Swaps					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ITRAXX EUROPE S.37 5 YRS)		EUR			12,65
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswert(e): ITRAXX EUROPE S.37 5 YRS)		EUR			50,00
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswert(e): ITRAXX EUROPE S.37 5 YRS)		EUR			55,00

Übersicht Anteilklassen

Anteil- klasse	Ertrags- verwendung	Zielgruppe	Ausgabeaufschlag		Verwaltungsvergütung		Mindest- anlage- summe EUR	Fonds währung
			Bis-zu- Satz in %	tatsächl. Satz in %	Bis-zu- Satz in % p. a.	tatsächl. Satz in % p. a.		
I	ausschüttend	Institutionelle Anleger	3,00	---	1,20	0,05	50.000	EUR
R	ausschüttend	Privatanleger und Institutionelle Anleger	3,00	0,50	1,20	0,10	---	EUR

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I

Anteilwert	EUR	95,97
Umlaufende Anteile	STK	4.125.185

LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R

Anteilwert	EUR	38,36
Umlaufende Anteile	STK	6.010.352

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 4. Oktober 2022

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

30060 [4] 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