

**LB≡BW Asset Management**

**LBBW Renten Short Term  
Nachhaltigkeit**

**Halbjahresbericht zum 30.09.2023**



# Inhalt

Vermögensübersicht zum 30.09.2023	8
Vermögensaufstellung zum 30.09.2023	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	19
Übersicht Anteilklassen	21
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	22



**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 Basisinformationsblätter, Verkaufsprospekte sowie die Jahres- und Halbjahresberichte als PDF-Dateien zum Download zur Verfügung.

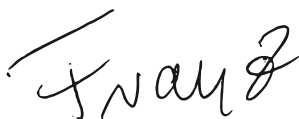
Profitieren Sie auch von unserem kostenlosen E-Mail-Fondspreis- und Factsheetabo: Das Factsheet gibt Ihnen einfach und bequem einen monatlichen Überblick über Ihren Fonds. Diesen E-Mail-Service können Sie auf unserer Internetseite abonnieren.

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH  
Geschäftsführung



Uwe Adamla  
(Vorsitzender)



Dr. Dirk Franz  
(Stellv. Vorsitzender)



Ulrike Modersohn



# LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit

## Halbjahresbericht zum 30.09.2023

## Vermögensübersicht zum 30.09.2023

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>542.729.311,08</b>	<b>100,89</b>
<b>1. Anleihen</b>	<b>521.826.709,52</b>	<b>97,01</b>
Bundesrep. Deutschland	165.422.992,62	30,75
Frankreich	64.561.004,20	12,00
Italien	32.835.095,77	6,10
USA	29.094.797,53	5,41
Spanien	26.008.328,00	4,83
Dänemark	22.236.556,75	4,13
Portugal	17.720.780,00	3,29
Slowakei	15.092.358,36	2,81
Norwegen	15.063.993,52	2,80
Jersey	14.693.850,00	2,73
Niederlande	12.692.595,04	2,36
Australien	12.361.225,00	2,30
Schweden	12.052.120,00	2,24
Intern. Investitionsbk	11.850.000,00	2,20
Luxemburg	8.974.588,10	1,67
Großbritannien	8.751.568,71	1,63
Finnland	8.161.018,50	1,52
Schweiz	7.411.650,00	1,38
Tschechische Republik	6.978.806,00	1,30
Österreich	6.506.048,00	1,21
Neuseeland	4.337.550,00	0,81
Irland	4.278.006,00	0,80
Belgien	2.851.460,00	0,53
Andean Development Corp.	2.717.400,00	0,51
Curaçao	2.603.810,42	0,48
Rumänien	2.269.800,00	0,42
Andere Länder	4.299.307,00	0,79
<b>2. Derivate</b>	<b>-2.686.060,78</b>	<b>-0,50</b>
<b>3. Schuldscheindarlehen</b>	<b>16.080.006,81</b>	<b>2,99</b>
Spanien	11.067.867,42	2,06
Portugal	5.012.139,39	0,93
<b>4. Bankguthaben</b>	<b>3.325.551,27</b>	<b>0,62</b>
<b>5. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>4.183.104,26</b>	<b>0,78</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-4.807.643,83</b>	<b>-0,89</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>537.921.667,25</b>	<b>100,00</b>



# Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>521.826.709,52</b>	<b>97,01</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>441.917.809,61</b>	<b>82,15</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,3750 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 278 v.19(24)	A2E4CQ		EUR	6.000			% 97,550	5.853.024,44	1,09
4,5000 % Aareal Bank AG MTN-IHS Serie 317 v.22(25)	AAR035		EUR	6.000			% 99,076	5.944.560,00	1,11
3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 2023(26)	A3LCKZ		EUR	5.000			% 99,056	4.952.800,00	0,92
0,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(24)	A2RTMS		EUR	3.400			% 98,510	3.349.340,00	0,62
0,6250 % ASB Bank Ltd. EO-Med.T. Mtg Cov. Nts 17(24)	A19QN3		EUR	4.500			% 96,390	4.337.550,00	0,81
2,4000 % AT & T Inc. EO-Notes 2014(14/24)	A1ZKLS		EUR	2.000			% 99,163	1.983.260,00	0,37
3,4370 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LF4D		EUR	8.000			% 99,140	7.931.200,00	1,47
3,6250 % Banco BPI S.A. EO-Covered MTN 2023(28) Tr.2	A3LMEP		EUR	10.000	10.000		% 98,675	9.867.500,00	1,83
0,6250 % Banco de Sabadell S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2016(24)	A182QC		EUR	6.000			% 97,586	5.855.160,00	1,09
0,6250 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 19(24/25)	A2R912		EUR	1.500			% 95,654	1.434.810,00	0,27
1,7500 % Banco de Sabadell S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R1SN		EUR	9.000			% 98,529	8.867.610,00	1,65
4,3940 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(26)	A288JJ		EUR	1.000			% 99,420	994.200,00	0,18
1,3750 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26)	A28WYB		EUR	2.000			% 93,881	1.877.620,00	0,35
0,8750 % Banco Santander Totta S.A. EO-M.-T.Obr.Hipotecárias17(24)	A19GL2		EUR	8.000			% 98,166	7.853.280,00	1,46
1,3790 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2017(17/25)	BA0AHZ		EUR	7.422	7.422		% 98,989	7.346.963,58	1,37
0,2500 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	A2RV6W		EUR	600	600		% 99,025	594.150,00	0,11
0,8750 % Bco di Desio e della Brianza EO-Mortg.Cov. MTN 2017(24)	A19NVU		EUR	2.750			% 96,811	2.662.302,50	0,49
1,2500 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.109 v.15(25)	BHY0A5		EUR	5.000			% 95,584	4.779.200,00	0,89
3,5000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(24)	A3LGRW		EUR	500	500		% 99,441	497.205,00	0,09
2,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2015(25)	BP457Q		EUR	4.600			% 97,195	4.470.970,00	0,83
1,0000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	PB1K0D		EUR	3.000			% 98,356	2.950.680,00	0,55
1,2500 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	PB1KZX		EUR	3.000	3.000		% 95,950	2.878.500,00	0,54
2,3750 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2014(14/24)	A1ZP1W		EUR	3.000			% 98,349	2.950.470,00	0,55
0,2500 % BPCE S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(26)	A28R2M		EUR	1.000			% 91,581	915.810,00	0,17
2,8750 % BPCE S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26)	A180FE		EUR	2.000			% 96,620	1.932.400,00	0,36
0,8750 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(24)	A19VDX		EUR	3.500			% 98,964	3.463.740,00	0,64

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,3750 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(26)	A3K1KB		EUR	2.500			% 91,659	2.291.475,00	0,43
3,6250 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(26)	A3LGHR		EUR	6.200	6.200		% 98,520	6.108.240,00	1,14
5,5550 % CA Auto Bank S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 2022(24)	A3LAQB		EUR	5.000			% 100,360	5.018.000,00	0,93
2,1200 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-FLR Med.-T.Obl.Fonc.05(25)	A0D3XJ		EUR	10.000			% 97,783	9.778.290,00	1,82
1,7500 % Caixabank S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	A2RTBL		EUR	3.000			% 99,860	2.995.800,00	0,56
0,3750 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25)	A28R49		EUR	2.000			% 94,810	1.896.200,00	0,35
0,6250 % Capgemini SE EO-Notes 2020(20/25)	A28YX9		EUR	1.600			% 94,681	1.514.896,00	0,28
2,3750 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZJKF		EUR	5.000			% 98,889	4.944.450,00	0,92
0,6250 % Commerzbank AG MTN-IHS S.928 v.19(24)	CZ40N0		EUR	10.000			% 96,987	9.698.700,00	1,80
0,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.939 v.19(24)	CZ45VB		EUR	1.000			% 96,407	964.070,00	0,18
0,1000 % Commerzbank AG MTN-IHS S.973 v.21(25)	CBOHRY		EUR	4.000			% 92,718	3.708.720,00	0,69
0,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2RY5V		EUR	500			% 98,472	492.360,00	0,09
4,0000 % Continental AG MTN v.23(27/27)	A35138		EUR	4.200	4.200		% 99,640	4.184.880,00	0,78
0,2500 % Corporación Andina de Fomento EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KLA2		EUR	3.000			% 90,580	2.717.400,00	0,51
1,8750 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Preferred.FLM 2022(26/27)	A3K4NX		EUR	500	500		% 93,500	467.500,00	0,09
1,1250 % Credito Emiliano S.p.A. EO-Mortg.Covered Bds 2019(24)	A2RWHX		EUR	1.000			% 99,108	991.080,00	0,18
0,0100 % Danske Bank AS EO-FLR MTN 2021(23/24)	A3KYQM		EUR	8.400			% 99,545	8.361.780,00	1,55
0,5000 % Danske Bank AS EO-FLR Non-Pref.MTN 19(24/25)	A2R6X4		EUR	3.000			% 96,450	2.893.500,00	0,54
4,8920 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.15(25)	DB7XKH		EUR	4.000			% 98,503	3.940.120,00	0,73
0,0500 % Deutsche Bank AG Struct.Cov.Bond v.2019(2024)	DL19U1		EUR	1.200			% 95,530	1.146.360,00	0,21
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	GRN001		EUR	15.000			% 96,759	14.513.850,00	2,70
2,0000 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2024/2024)	A3E5X5		EUR	2.000			% 97,485	1.949.700,00	0,36
2,8750 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2025/2025)	A3H240		EUR	3.000			% 96,456	2.893.680,00	0,54
4,6630 % Deutsche Pfandbriefbank AG FLR-MTN R.35411 v.22(24)	A3TOX7		EUR	5.000			% 99,640	4.982.000,00	0,93
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35408 v.21(25)	A3TOX2		EUR	12.000	2.000		% 90,150	10.818.000,00	2,01
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35413 v.22(25)	A3TOX9		EUR	14.000			% 93,994	13.159.160,00	2,45
4,3750 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35416 v.22(26)	A30WFV		EUR	3.200	500		% 97,938	3.134.016,00	0,58
0,0500 % DNB Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2019(23)	A2SAAP		EUR	7.770			% 99,549	7.734.957,30	1,44

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,2240 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. FLR-MTN-IHS A.2004 v.23(25)	DW6C2F		EUR	10.000			% 99,974	9.997.400,00	1,86
0,0100 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1220 20(24)	A2TSD5		EUR	1.000			% 98,755	987.550,00	0,18
0,8750 % Elisa Oyj EO-Med.-Term Notes 2017(23/24)	A19EPA		EUR	2.150	1.000		% 98,495	2.117.642,50	0,39
0,3750 % Erste Group Bank AG EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24)	EBOJJN		EUR	1.500			% 97,952	1.469.280,00	0,27
3,0000 % Focniere de Paris SIIC S.A. EO-Obl. 2015(23)	A1Z91Y		EUR	2.000			% 99,894	1.997.880,00	0,37
1,7500 % Goldman Sachs Internatl EO-Medium-Term Nts 2015(24)	A162WX		EUR	347			% 98,023	340.139,81	0,06
0,3500 % Hamburg Commercial Bank AG IHS v. 2020(2024) S.2727	HCB0AX		EUR	12.200			% 98,623	12.032.006,00	2,24
4,8750 % Hamburg Commercial Bank AG IHS v. 2023(2025) S.2755	HCB0BS		EUR	6.500			% 99,447	6.464.055,00	1,20
0,8750 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Med.-Term Notes 2018(23)	A19Y85		EUR	2.300			% 99,876	2.297.148,00	0,43
3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-M.-T.Hyp.-Pfbr. 2023(28)	A3LHPR		EUR	1.300	1.300		% 97,970	1.273.610,00	0,24
4,1030 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 2007(27)	A0V0TR		EUR	1.600			% 94,128	1.506.048,00	0,28
0,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdr.19(24)	A2RYP8		EUR	6.500			% 98,440	6.398.600,00	1,19
1,1250 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2016(16/24)	A18YPL		EUR	1.000			% 97,324	973.240,00	0,18
0,0000 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(23)	A3KXKH		EUR	6.000			% 79,000	4.740.000,00	0,88
0,1190 % Intl Investment Bank -IIB- EO-Medium-Term Notes 2021(24)	A288KE		EUR	9.000			% 79,000	7.110.000,00	1,32
2,1250 % ISS Global A/S EO-Med.-Term Notes 2014(14/24)	A1ZS18		EUR	2.339			% 97,235	2.274.326,65	0,42
0,2500 % Italgas S.P.A. EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28Y1D		EUR	500			% 93,524	467.620,00	0,09
0,3750 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. EO-Notes 2020(20/27)	A282G6		EUR	500	500		% 86,278	431.390,00	0,08
1,3750 % Johnson Controls Internat. PLC EO-Notes 2016(17/25)	A19BCD		EUR	4.000			% 96,165	3.846.616,00	0,72
0,1250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H339 v.19(24)	HLB2P2		EUR	1.800			% 95,675	1.722.150,00	0,32
2,6250 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H355 v.22(27)	HLB2QJ		EUR	1.000			% 94,755	947.550,00	0,18
0,2500 % Litauen, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28WWK		EUR	250			% 93,700	234.250,00	0,04
1,0730 % mBank Hipoteczny S.A. EO-Med.-T.Hyp.-Pf.-Br.2018(25)	A19ZWS		EUR	1.000			% 95,590	955.900,00	0,18
0,2420 % mBank Hipoteczny S.A. EO-Med.-T.Hyp.-Pf.-Br.2019(25)	A2R902		EUR	1.200			% 92,864	1.114.368,00	0,21
1,1250 % Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA EO-Non-Preferred MTN 2020(25)	A28SHV		EUR	500			% 94,790	473.950,00	0,09
0,8750 % Münchener Hypothekenbank MTN-IHS Serie 1794 v.18(25)	MHB60L		EUR	1.000			% 92,903	929.030,00	0,17
3,2627 % National Australia Bank Ltd. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Bds 23(26)	A3LDG5		EUR	4.500			% 98,445	4.430.025,00	0,82
0,4100 % National Grid North Amer. Inc. EO-Med.-Term Nts 2022(22/26)	A3K1DM		EUR	1.000			% 91,701	917.010,00	0,17

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,1250 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2021(26)	A3KSMY		EUR	2.000			% 89,302	1.786.040,00	0,33
0,0500 % Nord/LB Lux.S.A. Cov.Bond Bk. EO-M.-T.Lett.d.Ga.Publ. 20(25)	A28SJM		EUR	1.500			% 94,729	1.420.935,00	0,26
1,5000 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Inh.-Schv. v.2015(2026)	NLB854		EUR	6.000			% 90,541	5.432.460,00	1,01
3,6250 % Nordea Bank Abp EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	A3LDX3		EUR	3.500			% 98,778	3.457.230,00	0,64
0,2500 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	A189FH		EUR	1.400			% 99,499	1.392.986,00	0,26
3,5000 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(26)	A3LMEO		EUR	1.200	1.200		% 99,430	1.193.160,00	0,22
0,1250 % Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	A2R68P		EUR	3.890			% 97,009	3.773.650,10	0,70
3,6250 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	A3LEU1		EUR	5.000			% 98,666	4.933.300,00	0,92
0,2500 % RaiffeisenNiederöst.-Wien AG EO-Preferred MTN 2019(24)	A2R88P		EUR	1.500			% 97,734	1.466.010,00	0,27
1,7500 % Rumänien EO-Med.-Term Nts 2021(30)Reg.S	A3KTZA		EUR	3.000			% 75,660	2.269.800,00	0,42
1,1250 % Santander Consumer Finance SA EO-Medium-Term Nts 2018(23)	A2RSGN		EUR	1.100			% 99,948	1.099.428,00	0,20
1,0000 % Santander Consumer Finance SA EO-Medium-Term Nts 2019(24)	A2RYDX		EUR	1.000			% 98,750	987.500,00	0,18
1,2500 % Santander UK PLC EO-Med.-T.Cov. Bds 2014(24)	A1ZPYK		EUR	2.000			% 97,260	1.945.200,00	0,36
0,1250 % SID Banka d.d. EO-Bonds 2020(25)	A28ZG3		EUR	700			% 91,913	643.391,00	0,12
3,7500 % Sika Capital B.V. EO-Notes 2023(23/26)	A3LG7V		EUR	2.400	2.400		% 99,360	2.384.640,00	0,44
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)	A3LHVU		EUR	10.000	10.000		% 98,849	9.884.900,00	1,84
3,2500 % Slovenská Sporitelna AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 23(26)	A3LDG4		EUR	3.000			% 97,750	2.932.500,00	0,55
4,0000 % Slowakei EO-Anl. 2023(43)	A3LEHS		EUR	3.000		2.000	% 93,368	2.801.048,36	0,52
1,1250 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(25)	A19U5Y		EUR	1.000			% 96,020	960.200,00	0,18
0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	A2RZQK		EUR	1.000			% 98,278	982.780,00	0,18
1,1250 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 2017(17/25)	A19EWG		EUR	2.000			% 95,771	1.915.420,00	0,36
3,3750 % Svensk Exportkredit, AB EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30)	A3LME6		EUR	2.200	2.200		% 98,510	2.167.220,00	0,40
0,9000 % Tatra Banka AS EO-Cov. Bonds 2017(24)	A19DDS		EUR	7.000			% 98,683	6.907.810,00	1,28
2,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-FLR Nts 2022(22/Und.)	A3K11Y		EUR	2.000			% 86,305	1.726.090,24	0,32
4,9000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Notes 2004(24)	A0DEEL		EUR	4.100			% 100,766	4.131.422,53	0,77
0,8500 % U.S. Bancorp EO-Med.-Term Nts 2017(24)	A19JLL		EUR	3.100			% 97,545	3.023.895,00	0,56
4,6630 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	A287LY		EUR	2.500			% 99,866	2.496.650,00	0,46
1,0000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.2022(24/25)	A3K3JQ		EUR	5.000			% 98,300	4.915.000,00	0,91

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
7,2500 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2023(23/Und.)	A3LKNM		EUR	900	900		% 89,760	807.840,00	0,15
1,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/25)	A190KM		EUR	3.000			% 94,580	2.837.400,00	0,53
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	A28VTN		EUR	500			% 96,845	484.225,00	0,09
3,6250 % UniCredit Bk Czech R.+Slov.as EO-Mortgage Cov.Bonds 2023(26)	A3LD5L		EUR	4.700			% 98,650	4.636.550,00	0,86
3,0000 % UniCredit S.p.A. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Nts 14(24)	A1ZCET		EUR	3.100			% 99,588	3.087.228,00	0,57
0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/24)	A3E5MF		EUR	6.200			% 95,757	5.936.957,41	1,10
0,2500 % Vseobecná úverová Banka AS EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 19(24)	A2RZRG		EUR	2.500			% 98,040	2.451.000,00	0,46
0,2500 % Wallonne, Région EO-Medium-Term Notes 2019(26)	A2R1LF		EUR	2.300	2.300		% 91,570	2.106.110,00	0,39
0,5000 % Wells Fargo & Co. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2R1B9		EUR	6.000	6.000		% 97,959	5.877.540,00	1,09
1,2500 % ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23)	A2R9EL		EUR	3.000			% 99,785	2.993.550,00	0,56
Commerzbank AG 0-Kp-LI-Anl.T.46v.96(20.11.26)	181578		ITL	7.000.000			% 84,601	3.058.493,91	0,57
3,6500 % Oslo, Stadt NK-Anleihe 2013(23)	A1HS46		NOK	50.000			% 99,836	4.430.836,22	0,82
4,7941 % Citigroup Glob.Mkts Hldgs Inc. DL-FLR Med.-Term Nts 2016(26)	A1V2CV		USD	1.200			% 95,108	1.077.968,95	0,20
6,2500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- Nachr.DL-IHS.S.1748 v.14(24)	NLB8B3		USD	5.200	2.000		% 97,917	4.809.169,11	0,89
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>60.387.791,92</b>	<b>11,23</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,1000 % Allianz Banque S.A. EO-Bons Moy.T.Nég. 2021(25)	A1V76J		EUR	5.000			% 91,782	4.589.100,00	0,85
2,7970 % ASIF III (Jersey) Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 2004(24)	A0D3W6		EUR	15.000			% 97,959	14.693.850,00	2,73
0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.)	A255C2		EUR	2.000			% 92,340	1.846.800,00	0,34
0,2000 % Deutsche Bank AG Festzinsanl. v.2020(2026)	DL8Y3N		EUR	5.000			% 89,870	4.493.500,00	0,84
0,5000 % Deutsche Bank AG FLR-Notes v.2016(2026)	DB1ZDT		EUR	2.000			% 92,763	1.855.250,00	0,34
0,0000 % Highland Holdings S.A.r.L. EO-Notes 2021(21/23)	A3KYWL		EUR	50	350	5.500	% 99,540	49.770,00	0,01
5,8340 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Obbl. 2017(24)	A19QHA		EUR	2.300			% 100,445	2.310.241,31	0,43
4,5000 % Landesbank Berlin AG IHS S.568 v.23(26)	A162BJ		EUR	5.800	500		% 99,962	5.797.796,00	1,08
3,0000 % Lb.Hessen-Thüringen GZ Nachr.Anleihe v.15(25)	HLB2DM		EUR	500			% 96,317	481.585,00	0,09
0,5000 % Ontario Teachers Finance Trust EO-Notes 2020(25) Reg.S	A28WUY		EUR	800			% 94,656	757.248,00	0,14
0,0000 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-Notes 2021(21/25)	A3KY3D		EUR	1.000			% 91,989	919.890,00	0,17
1,3750 % Tyco International Fin. S.A. EO-Notes 2015(15/25)	A1ZXLQ		EUR	7.805			% 96,142	7.503.883,10	1,39

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
0,6000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(25/26)	A3KL4S		EUR	2.500		% 89,301	2.232.525,00	0,42
UBS Finance (Curaçao) N.V. LI-Zero-Bonds 1997(27)	135414		ITL	6.000.000		% 84,028	2.603.810,42	0,48
1,1620 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2021(21/24)	A3KZCD		USD	5.000		% 99,103	4.680.188,90	0,87
3,2500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(24) Cl.X 144A	A2R744		USD	2.000		% 96,875	1.829.988,19	0,34
3,8750 % Société Générale S.A. DL-Non-Pref. MTN 2019(24) 144A	A2RZ0K		USD	3.000	2.000	% 98,741	2.797.855,96	0,52
5,0000 % Vonovia Finance B.V. DL-Notes 2013(13/23)Reg.S	A1HRRS		USD	1.000		% 100,000	944.510,04	0,18
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>19.521.107,99</b>	<b>3,63</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
2,8750 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2014(24)	A1ZRT1		EUR	2.400		% 97,594	2.342.256,00	0,44
3,8500 % Communauté française Belgique EO-Medium-Term Notes 2012(24)	A1UB2S		EUR	750		% 99,380	745.350,00	0,14
7,8770 % VPV Lebensversicherungs-AG FLR-Nachr.-Anl. v.06(16/26)	A0KAHT		EUR	700		% 93,265	652.855,00	0,12
6,7077 % Crédit Agricole S.A. DL-FLR Non-Pref. MTN 19(24)	A285VV		USD	10.000		% 100,288	9.472.302,24	1,76
6,7774 % Deutsche Bank AG FLR-DL- MTN 18(25)	A2LQFZ		USD	6.800		% 98,220	6.308.344,75	1,17
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>521.826.709,52</b>	<b>97,01</b>
<b>Schuldscheindarlehen</b>						<b>EUR</b>	<b>16.080.006,81</b>	<b>2,99</b>
5,6550 % Generalitat de Catalunya SSD EUR 09/24	ODE00109		EUR	11.000		% 100,617	11.067.867,42	2,06
3,9520 % Metropolitan de Lisboa SSD EUR 04/24	ODE00074		EUR	5.000		% 100,243	5.012.139,39	0,93
<b>Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-2.686.060,78</b>	<b>-0,50</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)								
<b>Zins-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-830.278,49</b>	<b>-0,15</b>
Forderungen/Verbindlichkeiten								
<b>Zinsterminkontrakte</b>								
Euro Bund Future 07.12.23		185	EUR	55.000			-1.295.645,00	-0,24
Euro Schatz Future 07.12.23		185	EUR	50.000			-180.000,00	-0,03
Euro-OAT Future 07.12.23		185	EUR	-15.500			440.200,00	0,08
10 Year Japan Government Bond Future 13.12.23		969	JPY	-3.000.000			162.666,51	0,03
<b>Optionsrechte</b>								
<b>Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte</b>								
Call Euro Bund Future Dez 23 131 27.10.23		185	EUR	Anzahl 250			-332.500,00	-0,06
Call Euro Bund Future Dez 23 133,5 27.10.23		185	EUR	Anzahl -500			375.000,00	0,07

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Devisen-Derivate</b>							EUR	-538.035,70	-0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>									
<b>Offene Positionen</b>									
USD/EUR 28,8 Mio.		OTC						-538.035,70	-0,10
<b>Swaps</b>							EUR	-1.346.590,62	-0,25
Forderungen/Verbindlichkeiten									
<b>Zinsswaps</b>									
PAYER SWAP 1,125% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 07.10.2022/07.10.2052 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	9.900				3.698.599,38	0,69
PAYER SWAP % EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 30.09.2023/30.09.2053 BofA Securities Europe S.A.		OTC	EUR	11.440				1.256.118,13	0,23
RECEIVER SWAP 1,38% EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 07.10.2022/07.10.2032 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	26.400				-4.142.197,94	-0,77
RECEIVER SWAP % EUR / EURIBOR (EUR) 6 Monate 30.09.2023/30.09.2033 BofA Securities Europe S.A.		OTC	EUR	27.130				-948.709,64	-0,18
PAYER SWAP 3,624% USD / Secured Overnight Financing Rate (SOFR) 09.06.2023/09.06.2028 BofA Securities Europe S.A.		OTC	USD	55.320				1.939.179,25	0,36
RECEIVER SWAP 4,405% USD / Secured Overnight Financing Rate (SOFR) 09.06.2023/09.06.2025 BofA Securities Europe S.A.		OTC	USD	131.900				-1.864.143,94	-0,35
<b>Credit Default Swaps</b>									
<b>Protection Seller</b>									
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	2.300				33.483,08	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	2.200				32.027,29	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	2.000				29.115,72	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.000				14.557,86	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	1.600				23.292,58	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	500				7.278,93	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				30.571,51	0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Citigroup Global Markets Europe AG		OTC	EUR	1.700				24.748,36	0,00
<b>Protection Buyer</b>									
iTraxx Europe Crossover Ser.39 Index (5 Year) 5% 20.03.2023/20.06.2028 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	5.000				-257.087,17	-0,05
iTraxx Europe Crossover Ser.39 Index (5 Year) 5% 20.03.2023/20.06.2028 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	5.000				-257.087,17	-0,05
iTraxx Europe Crossover Ser.39 Index (5 Year) 5% 20.03.2023/20.06.2028 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	5.000				-257.087,17	-0,05
iTraxx Europe Crossover Ser.39 Index (5 Year) 5% 20.03.2023/20.06.2028 BNP Paribas S.A.		OTC	EUR	10.000				-514.174,34	-0,10

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	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	400			-5.823,14	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.100			-16.013,65	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 Goldman Sachs Bank Europe SE		OTC	EUR	1.500			-21.836,79	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			-14.557,86	0,00
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.500			-21.836,79	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			-37.850,44	-0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	1.900			-27.659,94	-0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	3.300			-48.040,94	-0,01
iTraxx Europe Series 37 Index (5 Year) 1% 21.03.2022/20.06.2027 J.P. Morgan SE		OTC	EUR	100			-1.455,79	0,00
<b>Optionsrechte auf Swaps</b>						<b>EUR</b>	<b>28.844,03</b>	<b>0,01</b>
Swaption.Rec. 2 % EUR /gg.6mth EURIBOR. 02.04.24		OTC	STK	-100.000.000			-4.593,25	0,00
Swaption.Rec. 3 % EUR /gg.6mth EURIBOR. 02.04.24		OTC	STK	100.000.000			33.437,28	0,01
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>						<b>EUR</b>	<b>3.325.551,27</b>	<b>0,62</b>
<b>Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>3.325.551,27</b>	<b>0,62</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>								
BNP Paribas S.A. (Paris)			EUR	740.000,00		% 100,000	740.000,00	0,14
J.P. Morgan AG (Frankfurt)			EUR	1.040.000,00		% 100,000	1.040.000,00	0,19
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	560.000,00		% 100,000	560.000,00	0,10
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>								
			NOK	1.775.789,51		% 100,000	157.623,78	0,03
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>								
			GBP	63.803,94		% 100,000	73.557,69	0,01
			JPY	37.386.201,00		% 100,000	236.633,58	0,04
			USD	548.153,22		% 100,000	517.736,22	0,10
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>4.183.104,26</b>	<b>0,78</b>
Zinsansprüche			EUR	4.183.104,26			4.183.104,26	0,78
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>						<b>EUR</b>	<b>-4.707.033,40</b>	<b>-0,88</b>
EUR-Kredite			EUR	-4.707.033,40		% 100,000	-4.707.033,40	-0,88
<b>Sonstige Verbindlichkeiten *)</b>			<b>EUR</b>	<b>-100.610,43</b>			<b>-100.610,43</b>	<b>-0,02</b>
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>537.921.667,25</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>



## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit I</b>								
Fondsvermögen						EUR	359.889.799,09	66,90
Anteilwert						EUR	97,84	
Umlaufende Anteile						STK	3.678.517	
<b>LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R</b>								
Fondsvermögen						EUR	178.031.868,16	33,10
Anteilwert						EUR	39,10	
Umlaufende Anteile						STK	4.553.618	

<sup>\*)</sup> Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Verwahrensentgelte, Kostenpauschale

### Fußnoten:

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

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.09.2023		
Britische Pfund	(GBP)	0,8674000	=	1 Euro (EUR)
Italienische Lire	(ITL)	1936,2700000	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	157,9919500	=	1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	11,2660000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,0587500	=	1 Euro (EUR)

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

185	Eurex Deutschland
969	Osaka Exchange F.+O.

#### 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,2500 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 17(23/23)	A19S4U	EUR		1.000	
0,3750 % Aroundtown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27)	A3K0AH	EUR		2.000	
0,3750 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(23)	A2RTCL	EUR		3.150	
3,2500 % BNG Bank N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(33)	A3LMEU	EUR	5.000	5.000	
1,5000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2017(25)	PB1KT9	EUR		3.000	
3,8500 % BPCE S.A. EO-Obl. 2014(26)	A1ZM39	EUR		3.000	
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.2023 (2023) Grüne	BU3Z00	EUR	10.000	10.000	
1,8750 % Ceske Drahy AS EO-Notes 2016(23)	A1811Z	EUR		4.200	
0,7500 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)	A18782	EUR		5.000	
4,0000 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 23(28/29)	A3LFCX	EUR		3.300	
3,7500 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(28/29)	A351VG	EUR	2.750	2.750	
4,0000 % E.ON SE Medium Term Notes v.23(33/33)	A351VH	EUR	3.950	3.950	
3,0000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2023(28)	A2SCAH	EUR	14.500	14.500	
3,3750 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(42)	A3K4DV	EUR	17.450	17.450	
2,5000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(52)	A3K4DT	EUR	16.300	16.300	
3,0000 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2022(53)	A3K4DY	EUR	35.000	35.000	
3,3750 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 2023(38)	A3K4D7	EUR	15.040	15.040	
2,7500 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2023(30)	A3LHZY	EUR	5.500	5.500	
3,0000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LKWV	EUR	14.500	14.500	
3,0000 % Finnland, Republik EO-Bonds 2023(33)	A3LG8A	EUR	10.000	10.000	
4,0000 % Flämische Gemeinschaft EO-Medium-Term Notes 2023(42)	A3LNYL	EUR	6.300	6.300	
0,5500 % Frankreich EO-Infl.Index-Lkd OAT 2023(39)	A3LJOK	EUR	13.500	13.500	
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2023(31)	A3LGGP	EUR	8.750	8.750	
4,0000 % Société Générale S.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23)	A1HLVP	EUR		5.000	
3,6250 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)	A3LGUC	EUR	500	500	
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(23/Und.)	A19ZL9	EUR		1.000	
4,4500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(28/29)	A3LEBR	EUR		8.000	
4,1250 % Zypern, Republik EO-Medium-Term Notes 2023(33)	A3LGGM	EUR	5.544	5.544	

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
1,5000 % América Móvil S.A.B. de C.V. EO-Notes 2016(16/24)	A18YZT	EUR		3.000	
0,5000 % Commerzbank AG MTN-Anl. v.16(23) S.871	CZ40LR	EUR		12.132	
0,0000 % Continental AG MTN v.19(23/23)Reg.S	A2YPE5	EUR		1.000	
0,7500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	A19471	EUR		3.100	

Nicht notierte Wertpapiere

<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
2,7500 % AT & T Inc. EO-Notes 2016(16/23)	A18ZJR	EUR		4.000	
0,7500 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(17/23)	BA0AG8	EUR		3.000	
0,0000 % Becton, Dickinson & Co. EO-Notes 2021(21/23)	A3KU40	EUR		5.500	
0,8750 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2018(18/23)	A2RSCK	EUR		1.500	
2,5000 % Capgemini SE EO-Notes 2015(15/23)	A1Z3RG	EUR		4.000	
0,8750 % Elering A.S. EO-Bonds 2018(18/23)	A190AW	EUR		2.000	
0,5000 % Euroclear Bank S.A./N.V. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	A193AG	EUR		3.000	
2,8750 % Gecina S.A. EO-Medium Term-Notes 2013(23)	A1HLGM	EUR		3.900	
0,7500 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.20(20/23)	A3E44U	EUR		1.000	

## 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
2,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-M.T.Preferred Nts 2018(23)	A195AW	EUR		5.500	
0,2500 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/23)	A28W3W	EUR		1.200	
1,1250 % NatWest Markets PLC EO-Med.-T.Nts 2018(23)	A19145	EUR		2.000	
3,9900 % Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Non-Pref. MTN 2021(23)	A3KSYJ	EUR		7.000	
3,4900 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Obbl. 2016(23)	A1V1W8	EUR		2.053	
3,7150 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Obbl. 2016(23)	A182NM	EUR		5.000	
0,5000 % Vseobecna úverová Banka AS EO-Cov.Bonds 2018(23)	A1917U	EUR		2.700	

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

#### Terminkontrakte

##### Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): EURO-BUND, EURO-SCHATZ)

EUR

165.625,04

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswert(e): 10Y.JAPAN GOV.BD.SYN.AN, 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, EURO-BUND, EURO-BUXL)

EUR

170.283,26

##### Devisenterminkontrakte (Verkauf)

Verkauf von Devisen auf Termin:

USD/EUR

EUR

26.593

##### Devisenterminkontrakte (Kauf)

Kauf von Devisen auf Termin:

USD/EUR

EUR

26.702

#### Optionsrechte

##### Optionsrechte auf Zins-Derivate

##### Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): Euro Bund Future 07.09.23, Euro Bund Future 08.06.23)

EUR

1.515,60

Verkaufte Kaufoptionen (Call):

(Basiswert(e): Euro Bund Future 07.09.23, Euro Bund Future 08.06.23)

EUR

1.143,81

Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):

(Basiswert(e): Euro Bund Future 07.12.23, Euro Schatz Future 07.09.23)

EUR

115,06

### SWAPS (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)

#### Credit Default Swaps

##### Protection Buyer

(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Ser.39 Index (5 Year) 5%  
20.03.2023/20.06.2028 J.P. Morgan SE)

EUR

10.000

## Übersicht Anteilklassen

Anteilklasse	Ertrags- verwendung	Ausgabeaufschlag in %		Verwaltungsvergütung in % p. a.		Mindest- anlage- summe EUR	Fonds- währung
		Bis-zu- Satz	tatsächl. Satz	Bis-zu- Satz	tatsächl. Satz		
Anteilklasse I	ausschüttend	3,00	---	1,20	0,05	50.000	EUR
Anteilklasse R	ausschüttend	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	97,84
Umlaufende Anteile	STK	3.678.517

#### LBBW Renten Short Term Nachhaltigkeit R

Anteilwert	EUR	39,10
Umlaufende Anteile	STK	4.553.618

### 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 2. Oktober 2023

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH



# LB≡BW Asset Management

30060 [5] 10/2023 55 25% Altpapier

## LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 100351  
70003 Stuttgart  
Pariser Platz 1, Haus 5  
70173 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)