

LB≡BW Asset Management

LBBW Rohstoffe 1

Halbjahresbericht zum 30.06.2024

Inhalt

Vermögensübersicht zum 30.06.2024	8
Vermögensaufstellung zum 30.06.2024	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	14
Übersicht Anteilklassen	15
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	16

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 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)




Michael Hünseler

Ulrike Modersohn

LBBW Rohstoffe 1

Halbjahresbericht zum 30.06.2024

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	299.957.991,55	100,10
1. Anleihen	248.804.781,20	83,03
Bundesrep. Deutschland	57.904.675,00	19,32
Frankreich	37.239.663,00	12,43
Norwegen	20.802.815,00	6,94
Belgien	20.543.580,00	6,86
Canada	20.459.540,00	6,83
Großbritannien	19.162.454,00	6,39
Niederlande	17.681.860,00	5,90
Spanien	10.902.000,00	3,64
Österreich	8.692.054,00	2,90
Dänemark	7.996.800,00	2,67
Schweden	7.553.960,00	2,52
Australien	6.447.525,20	2,15
USA	5.436.255,00	1,81
Neuseeland	4.939.120,00	1,65
Finnland	2.460.900,00	0,82
Italien	581.580,00	0,19
2. Derivate	-2.062.378,14	-0,69
3. Bankguthaben	51.193.898,34	17,08
4. Sonstige Vermögensgegenstände	2.021.690,15	0,67
8 II. Verbindlichkeiten	-296.508,38	-0,10
III. Fondsvermögen	299.661.483,17	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bestandspositionen							EUR	248.804.781,20	83,03
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	245.827.321,20	82,04
Verzinsliche Wertpapiere									
0,3750 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.220 v.2018(2025)	AAR021		EUR	1.000			% 96,670	966.700,00	0,32
0,0100 % Achmea Bank N.V. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2020(25)	A28YP6		EUR	4.100			% 96,670	3.963.470,00	1,32
3,9510 % ANZ New Zealand (Int'l) Ltd. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2023(26)	A3LKWP		EUR	2.000	2.000		% 101,210	2.024.200,00	0,68
3,0000 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg.Cov.MTN 2023(27)	A3LDP8		EUR	2.800	2.800		% 99,272	2.779.616,00	0,93
1,0000 % Banco Santander S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(25)	A1ZZFA		EUR	5.000			% 98,020	4.901.000,00	1,64
3,8750 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2023(28)	A3LCXR		EUR	2.000	2.000		% 101,330	2.026.600,00	0,68
1,0000 % Bank of Montreal EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(26)	A3K32X		EUR	3.000	3.000		% 96,070	2.882.100,00	0,96
2,7500 % Bank of Montreal EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K6H7		EUR	2.000			% 97,751	1.955.020,00	0,65
0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 20(25)	A28U40		EUR	5.000			% 97,500	4.875.000,00	1,63
3,0000 % BAWAG P.S.K. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(27)	A3LBEB		EUR	2.900	2.900		% 99,006	2.871.174,00	0,96
0,2500 % Bayerische Landesbank HPF-MTN v.18(24)	BLB6JF		EUR	1.500			% 99,383	1.490.745,00	0,50
3,5000 % Bayerische Landesbank HPF-MTN v.23(27)	BLB6JO		EUR	4.000	4.000		% 100,710	4.028.400,00	1,34
0,7500 % Bayerische Landesbank OPF-MTN v.18(28)	BLB6JC		EUR	1.000	1.000		% 91,960	919.600,00	0,31
0,7500 % Belfius Bank S.A. EO-Cov.Med.-Term Nts 2015(25)	A1ZVYK		EUR	5.000			% 98,214	4.910.700,00	1,64
4,5000 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2011(26) Ser. 64	A1GSKN		EUR	4.000	4.000		% 102,330	4.093.200,00	1,37
2,7500 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.24(27)	BHYOGY		EUR	2.200	2.200		% 98,850	2.174.700,00	0,73
0,3750 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv. v.22(27)	BHYOGN		EUR	3.600			% 91,900	3.308.400,00	1,10
0,8750 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 18(28)	A19X8R		EUR	4.000	4.000		% 91,760	3.670.400,00	1,22
0,6250 % BNZ International Funding Ltd. EO-Med.-T.Mtg.Cov.Bds 2018(25)	A192Z1		EUR	3.000			% 97,164	2.914.920,00	0,97
0,6250 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25)	A28WKH		EUR	1.500			% 97,540	1.463.100,00	0,49
1,7500 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27)	A3K4Q8		EUR	200	200		% 95,290	190.580,00	0,06
0,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2018(26)	A2RUS5		EUR	1.500	1.500		% 94,281	1.414.215,00	0,47
3,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 2022(27)	A3K88W		EUR	5.000	5.000		% 98,479	4.923.950,00	1,64
2,7500 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2024(27)	A3LUMD		EUR	4.000	4.000		% 98,695	3.947.800,00	1,32
0,7500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Fonc.2015(25)	A1ZUZD		EUR	3.000			% 98,460	2.953.800,00	0,99
1,7500 % Citigroup Inc. EO-Notes 2015(25)	A1ZVDS		EUR	5.500			% 98,841	5.436.255,00	1,81
0,6250 % Commerzbank AG MTN-IHS S.928 v.19(24)	CZ40N0		EUR	6.000			% 99,463	5.967.780,00	1,99

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,3750 % Commerzbank AG MTN-IHS S.961 v.20(27)	CZ45V8		EUR	2.000			% 91,575	1.831.500,00	0,61
0,7500 % Commonwealth Bank of Australia EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(28)	A3K2LY		EUR	4.000	4.000		% 91,420	3.656.800,00	1,22
3,3750 % Crédit Agricole S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 22(27)	A3LBN7		EUR	5.000	5.000		% 99,279	4.963.950,00	1,66
1,3750 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Preferred Med.-T.Nts 19(25)	A2RWHO		EUR	2.000			% 98,651	1.973.020,00	0,66
3,1250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(27)	A3LEFW		EUR	4.000	4.000		% 99,840	3.993.600,00	1,33
1,0000 % De Volksbank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(28)	A19XCY		EUR	4.000	4.000		% 92,520	3.700.800,00	1,23
0,0100 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2019(24)	A2R7SB		EUR	2.000			% 99,140	1.982.800,00	0,66
0,0500 % Deutsche Bank AG Struct.Cov.Bond v.2019(2024)	DL19U1		EUR	5.000			% 98,639	4.931.950,00	1,65
0,5000 % Deutsche Kreditbank AG Hyp.Pfandbrief 2015(2027)	DKB043		EUR	1.500	1.500		% 93,068	1.396.020,00	0,47
0,3750 % Dt.Apotheker- u. Ärztebank MTN-HPF Nts.v.19(27)A.1477	A2G809		EUR	2.000	2.000		% 92,711	1.854.220,00	0,62
0,0100 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1239 21(26)	A3E5UY		EUR	4.000	4.000		% 92,790	3.711.600,00	1,24
0,5000 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. MTN 2018(25)	A1942V		EUR	200	200		% 96,698	193.395,00	0,06
0,3750 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Nts 2017(25)	A19SJ5		EUR	3.000			% 97,930	2.937.900,00	0,98
0,5000 % HYPO NOE LB f. Nied.u.Wien AG EO-Publ.Covered MTN 2018(25)	A195BW		EUR	4.000	2.500		% 96,480	3.859.200,00	1,29
0,7500 % Hypo Vorarlberg Bank AG EO-MT. Hyp.Pf. 2015(25)	A1ZVUP		EUR	2.000			% 98,084	1.961.680,00	0,65
3,0000 % ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 23(26)	A3LD5E		EUR	1.300	1.300		% 99,510	1.293.630,00	0,43
2,6250 % ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 24(28)	A3LS0H		EUR	4.000	4.000		% 98,194	3.927.760,00	1,31
0,6250 % ING Belgium SA/NV EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 18(25)	A191ER		EUR	4.000			% 97,441	3.897.640,00	1,30
1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Mortg.Cov. MTN 2019(25)	A2RYDE		EUR	600	600		% 96,930	581.580,00	0,19
0,3750 % Jyske Realkredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2017(24)	A19NHJ		EUR	8.000			% 99,960	7.996.800,00	2,67
3,7500 % KBC Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(26)	A3LNY5		EUR	2.000	2.000		% 100,912	2.018.240,00	0,67
0,6250 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(25)	A2R0KC		EUR	2.000			% 97,670	1.953.400,00	0,65
3,5000 % Landesbank Baden-Württemberg MTN Öff.Pfandbr. 23(27)R.843	LB389C		EUR	5.000	5.000		% 100,870	5.043.500,00	1,68
0,8750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S.H320 v.2018(28)	HLB2PF		EUR	4.000	4.000		% 91,975	3.679.000,00	1,23
0,5000 % Leeds Building Society EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	A19KUJ		EUR	2.900			% 99,981	2.899.449,00	0,97
3,5000 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.2033 v.23(26)	MHB36J		EUR	4.000	4.000		% 100,490	4.019.600,00	1,34
3,2627 % National Australia Bank Ltd. EO-Mortg.Cov.Med.-T.Bds 23(26)	A3LDG5		EUR	2.798	2.798		% 99,740	2.790.725,20	0,93
2,0000 % Nationwide Building Society EO-Med.-Term Nts 2022(27)	A3K4W6		EUR	1.000			% 95,903	959.030,00	0,32
1,2500 % Nationwide Building Society EO-Medium-Term Notes 2015(25)	A1ZXQR		EUR	4.000			% 98,361	3.934.440,00	1,31

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,3750 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.486 v.17(25)	DHY486		EUR	3.000			% 97,039	2.911.170,00	0,97
0,6250 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	A191AC		EUR	700	700		% 97,500	682.500,00	0,23
0,0500 % OP-Asuntoluottopankki Oyj EO-Cov. Med.-Term Nts 2020(28)	A28SAX		EUR	2.000	2.000		% 88,920	1.778.400,00	0,59
0,6250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(25)	A195GW		EUR	3.000			% 96,870	2.906.100,00	0,97
0,0500 % Royal Bank of Canada EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(26)	A2R3T2		EUR	1.600	1.600		% 93,850	1.501.600,00	0,50
1,2500 % Santander UK PLC EO-Med.-T.Cov. Bds 2014(24)	A1ZPYK		EUR	5.000			% 99,498	4.974.900,00	1,66
0,5000 % Santander UK PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	A19UNT		EUR	6.500			% 98,379	6.394.635,00	2,13
4,1250 % Société Générale S.A. EO-Pref.Med.-T.Nts 2023(27)	A3LJHS		EUR	3.000			% 101,270	3.038.100,00	1,01
0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2017(25)	A19H9E		EUR	200	200		% 97,311	194.622,00	0,06
0,5000 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2018(25)	A2RUVH		EUR	5.500			% 98,242	5.403.310,00	1,80
2,8000 % Spanien EO-Bonos 2023(26)	A3LC67		EUR	4.000	4.000		% 99,360	3.974.400,00	1,33
0,1250 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(26)	A2R1X9		EUR	1.000	1.000		% 94,360	943.600,00	0,31
3,7500 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Medium-Term Notes 2023(27)	A3LDC1		EUR	3.500	3.500		% 100,740	3.525.900,00	1,18
0,7500 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2018(25)	A19W00		EUR	4.900			% 98,180	4.810.820,00	1,61
0,3750 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2017(24)	A19P20		EUR	3.000			% 99,200	2.976.000,00	0,99
0,7500 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2018(25)	A2RS2T		EUR	5.600	100		% 96,700	5.415.200,00	1,81
3,2500 % Svensk Exportkredit, AB EO-Medium-Term Notes 2023(26)	A3LGGJ		EUR	1.700	1.700		% 99,880	1.697.960,00	0,57
0,7500 % Swedbank AB EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28WSZ		EUR	6.000			% 97,600	5.856.000,00	1,95
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	A3K7YF		EUR	2.000			% 98,220	1.964.400,00	0,66
3,7650 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2023(26)	A3LMVR		EUR	2.000	2.000		% 100,946	2.018.920,00	0,67
3,8790 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2023(26)	A3LFCF		EUR	500	500		% 100,880	504.400,00	0,17
0,5000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(27)	A3K01J		EUR	2.000	2.000		% 92,600	1.852.000,00	0,62
0,0100 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2064 v.19(27)	HV2ASU		EUR	3.000	3.000		% 89,947	2.698.410,00	0,90
3,1250 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2168 v.24(28)	HV2AOA		EUR	4.000	4.000		% 99,848	3.993.920,00	1,33
0,8750 % Van Lanschot Kempen N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(27)	A19DC1		EUR	3.000	3.000		% 93,780	2.813.400,00	0,94
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	2.977.460,00	0,99
Verzinsliche Wertpapiere									
3,3750 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-IHS S.A-167 v.24(27)	DKOYUZ		EUR	2.000	2.000		% 99,737	1.994.740,00	0,67
0,7000 % Landesbank Berlin AG Pfandbr.Ser.531 v.2015(2025)	A13SNL		EUR	1.000			% 98,272	982.720,00	0,33
Summe Wertpapiervermögen							EUR	248.804.781,20	83,03

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Derivate							EUR	-2.062.378,14	-0,69
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Devisen-Derivate							EUR	43.123,45	0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR	11,5 Mio.	OTC						43.123,45	0,01
Derivate auf Rohstoffe und Waren							EUR	-2.105.501,59	-0,70
Swaps auf Rohstoffe und Waren									
Commodity Index Swap - long LBBW Top 10 Rohstoff Index (Excess Return)									
11.04.2024/11.07.2024		OTC	USD	150.000				-928.402,41	-0,31
Commodity Index Swap - long LBBW Top 10 Rohstoff Index (Excess Return)									
11.04.2024/11.07.2024		OTC	USD	150.000				-928.402,41	-0,31
Commodity Index Swap - long LBBW Top 10 Rohstoff Index (Excess Return)									
16.04.2024/11.07.2024		OTC	USD	15.000				-127.427,07	-0,04
Commodity Index Swap - long LBBW Top 10 Rohstoff Index (Excess Return)									
26.04.2024/11.07.2024		OTC	USD	15.000				-121.269,70	-0,04
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	51.193.898,34	17,08
Bankguthaben							EUR	51.193.898,34	17,08
EUR-Guthaben bei:									
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	36.227.212,54			% 100,000	36.227.212,54	12,09
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
			USD	16.040.545,51			% 100,000	14.966.685,80	4,99
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	2.021.690,15	0,67
Zinsansprüche			EUR	2.021.690,15				2.021.690,15	0,67
Sonstige Verbindlichkeiten *)							EUR	-296.508,38	-0,10
Fondsvermögen							EUR	299.661.483,17	100,00 ¹⁾
LBBW Rohstoffe 1 I									
Fondsvermögen							EUR	186.361.488,22	62,19
Anteilwert							EUR	79,96	
Umlaufende Anteile							STK	2.330.597	
LBBW Rohstoffe 1 I USD									
Fondsvermögen							USD	11.667.260,00	3,63
Anteilwert							USD	102,58	
Umlaufende Anteile							STK	113.742	
LBBW Rohstoffe 1 R									
Fondsvermögen							EUR	102.413.818,14	34,18
Anteilwert							EUR	37,93	
Umlaufende Anteile							STK	2.699.940	

*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Kostenpauschale

Fußnoten:

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 28.06.2024		
US-Dollar	(USD)	1,0717500	=	1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

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					
0,3750 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg. Cov. MTN 2018(24)	A2RTMS	EUR		6.500	
0,6250 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2022(28)	A3K2AZ	EUR	4.000	4.000	
2,0000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Foncières 14(24)	A1ZH7B	EUR		2.000	
0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt AS EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	A19KF4	EUR		7.000	
0,3750 % Sparebanken Vest Boligkred. AS EO-Med.-Term Hyp.Pf. 2017(24)	A19C8S	EUR		4.000	
Nicht notierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,3750 % Areal Bank AG MTN-IHS Serie 278 v.19(24)	A2E4CQ	EUR		4.400	
0,8750 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	A2RWEP	EUR		5.500	
0,3500 % Bayerische Landesbank Inh.-Schv. v.20(24)	BLB808	EUR		2.000	
1,7500 % Belfius Bank S.A. EO-Cov.Med.-Term Nts 2014(24)	A1ZK06	EUR		5.000	
0,3750 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.16(24) Ser.198	BHY0BE	EUR		1.000	
0,1250 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.17(24) Ser.203	BHY0MT	EUR		3.000	
2,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	BP7TTW	EUR		2.500	
1,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(24)	A1ZK05	EUR		3.600	
0,3750 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(24)	A19DE9	EUR		3.100	
2,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZD0Z	EUR		5.000	
0,5000 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2018(24)	A195FY	EUR		2.000	
0,2500 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15286 v.19(24)	A2LQNP	EUR		5.000	
0,0100 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1220 20(24)	A2TSD5	EUR		1.000	
0,3500 % Federat.caisses Desjard Quebec EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(24)	A2RW3C	EUR		5.000	
1,1250 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2RWX2	EUR		5.000	
0,5000 % National Westminster Bank PLC EO-Medium-Term Notes 2017(24)	A19HJY	EUR		5.000	
0,2500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- MTN-HPF S.464 v.16(24)	DHY464	EUR		9.500	
1,0000 % Santander Consumer Finance SA EO-Medium-Term Nts 2019(24)	A2RYDX	EUR		2.000	
0,2500 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2017(24)	A19BUM	EUR		2.900	
0,1250 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 2019(24)	A2R3N3	EUR		7.000	
0,0000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2019(24)	A2R0KB	EUR		1.900	
0,2500 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2020(24)	A28UWC	EUR		6.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
USD/EUR		USD			20.700
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
Kauf von Devisen auf Termin:					
USD/EUR		USD			10.200
SWAPS (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)					
Swaps auf Rohstoffe und Waren					
(Basiswert(e): Commodity Index Swap - long LBBW Top 10 Rohstoff Index (Excess Return) 11.01.2024/11.04.2024,		EUR			277.245
Commodity Index Swap - short LBBW Top 10 Rohstoff Index (Excess Return) 05.04.2024/11.04.2024)					

Übersicht Anteilklassen

Anteilklasse	Ertrags- verwendung	Ausgabeaufschlag		Verwaltungsvergütung		Mindest- anlagesumme in Fonds- währung	Fonds- währung
		Bis-zu- Satz in %	tatsächl. Satz in %	Bis-zu- Satz in % p. a.	tatsächl. Satz in % p. a.		
LBBW Rohstoffe 1 I	ausschüttend	5,00	---	1,50	0,80	75.000	EUR
LBBW Rohstoffe 1 I USD	ausschüttend	5,00	---	1,50	0,80	100.000	USD
LBBW Rohstoffe 1 R	ausschüttend	5,00	5,00	1,50	1,50	---	EUR

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

LBBW Rohstoffe 1 I

Anteilwert	EUR	79,96
Umlaufende Anteile	STK	2.330.597

LBBW Rohstoffe 1 I USD

Anteilwert	USD	102,58
Umlaufende Anteile	STK	113.742

LBBW Rohstoffe 1 R

Anteilwert	EUR	37,93
Umlaufende Anteile	STK	2.699.940

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

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

30021 [14] 08/2024 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
info@LBBW-AM.de