

LB  BW

# LBBW Balance

## Halbjahresbericht

### zum 31. Oktober 2023.

LBBW Balance CR 20

LBBW Balance CR 40

LBBW Balance CR 75

Ein Investmentfonds mit Teilfonds gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (OGAW).

 **Deka**  
Investments

# Bericht der Geschäftsführung.

31. Oktober 2023

## **Sehr geehrte Anlegerinnen, sehr geehrte Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung Ihres Umbrellafonds LBBW Balance bestehend aus den drei Teilfonds LBBW Balance CR 20, LBBW Balance CR 40 und LBBW Balance CR 75 für den Zeitraum vom 1. Mai 2023 bis zum 31. Oktober 2023.

Im Berichtszeitraum entfernten sich die Teuerungsraten sukzessive von ihren Höchstständen und sorgten damit für eine gewisse Entlastung an den Finanzmärkten. Dennoch hat sich in Deutschland und im Euroraum die Konjunktur merklich abgekühlt, was sowohl die BIP-Entwicklung als auch das Geschäftsklima der Unternehmen und die Einkaufsmanagerdaten dokumentierten. Sehr robust präsentierte sich hingegen weiterhin das Wirtschaftswachstum in den USA. Zu einem exogenen Schock kam es am 7. Oktober, als radikale Palästinenser unter Führung der islamistisch-terroristischen Hamas Israel überfielen. Dieser überraschende Angriff und die noch nicht absehbaren Konsequenzen des eskalierenden Konflikts in Nahost sorgten zuletzt für große Verunsicherung.

In der Geld- und Fiskalpolitik stand im Berichtszeitraum unverändert die Inflationsbekämpfung im Fokus, was sowohl die US-Notenbank Federal Reserve als auch die Europäische Zentralbank zu weiteren restriktiven Schritten bewog. Während die Fed zuletzt bei einem Leitzinsintervall von 5,25 Prozent bis 5,50 Prozent angelangt war, erhöhte die EZB die Leitzinsen bis auf 4,50 Prozent. An den Rentenmärkten zogen die Renditen weiter an. Dabei sorgte am Anleihemarkt der zwischenzeitliche Renditesprung 10-jähriger US-Staatstitel über die Marke von 5 Prozent – erstmals seit 16 Jahren – für Aufsehen. Im Betrachtungszeitraum erhöhte sich die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen auf 2,8 Prozent, laufzeitgleiche US-Treasuries rentierten Ende Oktober bei 4,9 Prozent.

Die globalen Aktienbörsen präsentierten auf Halbjahressicht ein uneinheitliches Bild. Insbesondere in den USA wussten die im Nasdaq gelisteten Technologiewerte lange zu überzeugen und auch der Nikkei 225 in Japan verbuchte ein solides Plus. In Europa überwogen hingegen die Minuszeichen und in China sorgten verschiedene Belastungsfaktoren wie u.a. der kriselnde Immobiliensektor für einen kräftigen Rückgang. Der Euro zeigte sich im Verhältnis zum US-Dollar volatil und lag Ende Oktober bei 1,06 US-Dollar. Rohöl verteuerte sich auf Halbjahressicht und beendete die Berichtsperiode bei rund 87 US-Dollar je Barrel (Brent Future).

Auskunft über die Wertentwicklung und die Anlagestrategie Ihres Fonds erhalten Sie im Abschnitt Anlagepolitik. Gerne nehmen wir die Gelegenheit zum Anlass, um Ihnen für das uns entgegengebrachte Vertrauen zu danken.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige Informationen an die Anteilinhaber im Internet unter [www.deka.de](http://www.deka.de) bekannt gemacht werden. Darüber hinaus finden Sie dort ein weitergehendes Informations-Angebot rund um das Thema „Investmentfonds“ sowie monatlich aktuelle Zahlen und Fakten zu Ihren Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Die Geschäftsführung



Dirk Degenhardt (Vorsitzender)



Dirk Heuser



Thomas Ketter



Thomas Schneider

# Inhalt.

Anlagepolitik	
LBBW Balance CR 20	5
LBBW Balance CR 40	7
LBBW Balance CR 75	8
Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2023	
LBBW Balance CR 20	9
LBBW Balance CR 40	13
LBBW Balance CR 75	17
Fondszusammensetzung	20
Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe	21

**Der Erwerb von Anteilen darf nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigelegt sind, erfolgen.**

# LBBW Balance CR 20

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist es, ein langfristiges Kapitalwachstum zu erwirtschaften.

Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds in nach dem Grundsatz der Risikostreuung in Investmentanteile, Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Derivate an, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen je nach Markteinschätzung variieren. Die Investitionen in Aktienfonds können 10%-30%, in Rentenfonds 0%-90%, in sonstige Fonds 0%-30% und in Geldmarktfonds 0%-90%, Bankguthaben 0%-20% des Fondsvermögens betragen.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die 10 volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen.

Die Einstufung welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als "unfrei" ("not free") eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

# LBBW Balance CR 20

## Wichtige Kennzahlen

### LBBW Balance CR 20

Performance*	6 Monate
	-1,2%
ISIN	LU0097711666

\* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Detaillierte Angaben zur Nachhaltigkeitsstrategie und deren Merkmale können Sie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung im Anhang des Verkaufsprospekts, dem entsprechenden Anhang des Jahresberichts sowie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung auf der Webseite des Fonds entnehmen.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Der Fonds wird von der BW Bank beraten. Die Verwaltungsgesellschaft ist die Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main. Zur Verwaltung setzt sie ihre rechtlich unselbständige Zweigniederlassung, die Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg ein.

# LBBW Balance CR 40 Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist es, ein langfristiges Kapitalwachstum zu erwirtschaften.

Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds in nach dem Grundsatz der Risikostreuung in Investmentanteile, Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Derivate an, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen je nach Markteinschätzung variieren. Die Investitionen in Aktienfonds können 30%-50%, in Rentenfonds 0%-70%, in sonstige Fonds 0%-30% und in Geldmarktfonds 0%-70%, Bankguthaben 0%-20% des Fondsvermögens betragen.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die 10 volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen.

Die Einstufung welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als "unfrei" ("not free") eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

## Wichtige Kennzahlen LBBW Balance CR 40

Performance*	6 Monate
	-2,0%
ISIN	LU0097712045

\* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Detaillierte Angaben zur Nachhaltigkeitsstrategie und deren Merkmale können Sie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung im Anhang des Verkaufsprospekts, dem entsprechenden Anhang des Jahresberichts sowie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung auf der Webseite des Fonds entnehmen.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Der Fonds wird von der BW Bank beraten. Die Verwaltungsgesellschaft ist die Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main. Zur Verwaltung setzt sie ihre rechtlich unselbständige Zweigniederlassung, die Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg ein.

# LBBW Balance CR 75

## Anlagepolitik.

Anlageziel des Teilfonds ist es, ein langfristiges Kapitalwachstum zu erwirtschaften.

Dabei wird die Erzielung einer größtmöglichen Rendite bei gleichzeitig angemessenem Risiko für diese Anlageklasse angestrebt.

Um dies zu erreichen, legt der Teilfonds in nach dem Grundsatz der Risikostreuung in Investmentanteile, Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Derivate an, wobei der Anteil der Investmentanteile mindestens 51% betragen muss. Innerhalb festgelegter Anlagegrenzen kann die Gewichtung der Anlageklassen je nach Markteinschätzung variieren. Die Investitionen in Aktienfonds können 50%-100%, in Rentenfonds 0%-50%, in sonstige Fonds 0%-30% und in Geldmarktfonds 0%-50%, Bankguthaben 0%-20% des Fondsvermögens betragen.

Dem Teilfonds liegt ein aktiver Investmentansatz zugrunde. Der Investmentprozess basiert auf einer fundamental orientierten Kapitalmarkteinschätzung. Dabei werden die 10 volkswirtschaftlichen Rahmenbedingungen bewertet. Weitere Auswahlkriterien (z.B. Bewertung, Liquidität, Gewinne, Sentiment) fließen in die Chance-Risiko-Analyse ein. Auch sind die Auswahlkriterien wie bspw. Bonität, Regionen und Sektoren bei der Portfoliokonstruktion maßgebend. Danach werden die erfolgversprechenden Zielfonds und Wertpapiere ausgewählt. Bei der Investition orientiert sich das Fondsmanagement hinsichtlich der Auswahl und Gewichtung an einem Musterportfolio. Dabei wird der Anlagebetrag auf die zulässigen Anlageklassen verteilt. Je nach Einschätzung der Entwicklungschancen einzelner Anlageklassen weicht das Management bei der Verteilung des Anlagebetrages auf die Anlageklassen von der Gewichtung des Musterportfolios ab. Im Rahmen des Investmentansatzes wird auf die Nutzung eines Referenzwertes (Index) verzichtet, da die Teilfondsallokation/Selektion nicht mit einem Index vergleichbar ist.

Bei der Auswahl geeigneter Anlagen werden ökologische, soziale und/oder die Unternehmens- bzw. Staatsführung betreffende Kriterien (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Dazu werden Unternehmen nach Kriterien für Umweltmanagement (z.B. Klimaschutz, Umweltpolitik), soziale Verantwortung (z.B. Sozialstandards in der Lieferkette, Sicherheit und Gesundheit) und Unternehmensführung (z.B. Bestechung, Korruption, Transparenz und Berichterstattung) bewertet und im Ergebnis entweder in das investierbare Universum aufgenommen oder aus diesem ausgeschlossen. Bei staatlichen Emittenten stehen Kriterien wie beispielsweise Ressourcennutzung und Treibhausgasemissionen (E), Einkommensungleichheiten und Arbeitslosigkeit (S) oder politische Rechte und zivile Freiheiten (G) im Fokus. Die Ausschlusskriterien orientieren sich an den Prinzipien des UN Global Compact sowie an den Geschäftspraktiken der Emittenten. Die zehn Prinzipien des UN Global Compact umfassen Leitlinien zum Umgang mit Menschenrechten, Arbeitsrechten, Korruption und Umweltverstößen. Unterzeichner sollen unter anderem den Schutz der Menschenrechte sicherstellen sowie die Entwicklung und Verbreitung umweltfreundlicher Technologien beschleunigen und im Umgang mit Umweltproblemen dem Vorsorgeprinzip folgen.

Die Einstufung welche Unternehmen in diesem Sinne kontroverse Geschäftspraktiken anwenden, erfolgt im Rahmen des Investmentprozesses. Unternehmen, die kontroverse Waffen herstellen, werden grundsätzlich aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. Nicht investiert wird zudem in Staaten, die nach dem Freedom-House Index als "unfrei" ("not free") eingestuft werden und/oder nach dem Corruption-Perceptions-Index einen Score von weniger als 40 aufweisen. Im Rahmen der ESG-Strategie wird auf der Basis interner Recherchen und Analysen sowie unter Verwendung von ESG-Ratings von Research- bzw. Ratingagenturen in Zielfonds investiert, welche eine ESG-Bewertung aus der oberen Hälfte ihrer Vergleichsgruppe sowie ein MSCI-ESG-Rating von mindestens "BBB" oder einer vergleichbaren Bewertung aufweisen.

### Wichtige Kennzahlen

#### LBBW Balance CR 75

Performance*	6 Monate
	-3,7%
ISIN	LU0097712474

\* Berechnung nach BVI-Methode, die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Detaillierte Angaben zur Nachhaltigkeitsstrategie und deren Merkmale können Sie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung im Anhang des Verkaufsprospekts, dem entsprechenden Anhang des Jahresberichts sowie der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegung auf der Webseite des Fonds entnehmen.

Es können Derivate zu Investitions- und/oder Absicherungszwecken eingesetzt werden. Ein Derivat ist ein Finanzinstrument, dessen Wert – nicht notwendig 1:1 – von der Entwicklung eines oder mehrerer Basiswerte wie z. B. Wertpapieren oder Zinssätzen abhängt.

Der Fonds wird von der BW Bank beraten. Die Verwaltungsgesellschaft ist die Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main. Zur Verwaltung setzt sie ihre rechtlich unselbständige Zweigniederlassung, die Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg ein.

# LBBW Balance CR 20

## Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>312.547.815,15</b>	<b>27,88</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>280.547.754,87</b>	<b>25,02</b>
<b>EUR</b>								<b>213.796.447,91</b>	<b>19,07</b>
DE0001102366	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24	EUR		32.900.000	0	0	% 98,048	32.257.792,00	2,88
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25	EUR		29.800.000	0	30.800.000	% 96,443	28.739.865,00	2,57
DE0001102606	1,7000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/32	EUR		61.200.000	11.600.000	0	% 91,878	56.229.336,00	5,01
ES0000012B88	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28	EUR		25.000.000	0	0	% 91,478	22.869.500,00	2,04
IT0005474330	0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/24	EUR		25.050.000	0	0	% 95,881	24.018.190,50	2,14
AT0000A32458	2,9000 % Republik Oesterreich MTN 23/33	EUR		51.881.000	51.881.000	0	% 95,761	49.681.764,41	4,43
<b>USD</b>								<b>66.751.306,96</b>	<b>5,95</b>
US298785JV96	3,7500 % European Investment Bank Notes 23/33	USD		19.500.000	19.500.000	0	% 90,755	16.628.133,51	1,48
US459058JG93	0,7500 % International Bank Rec. Dev. MTN 20/30	USD		23.600.000	23.600.000	0	% 75,461	16.732.983,18	1,49
US459058KQ56	3,8750 % International Bank Rec. Dev. MTN 23/30	USD		19.000.000	19.000.000	0	% 93,775	16.740.815,56	1,49
US500769JY19	4,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 23/33	USD		19.100.000	19.100.000	0	% 92,775	16.649.374,71	1,49
<b>Zertifikate</b>								<b>32.000.060,28</b>	<b>2,86</b>
<b>USD</b>								<b>32.000.060,28</b>	<b>2,86</b>
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK		176.776	0	0	USD 192,660	32.000.060,28	2,86
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>801.644.971,91</b>	<b>71,57</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>34.791.787,09</b>	<b>3,11</b>
<b>EUR</b>								<b>34.791.787,09</b>	<b>3,11</b>
DE000ETF557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT		966.879	396.364	408.894	EUR 13,752	13.296.520,01	1,19
DE000ETF540	Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	ANT		966.306	0	114.400	EUR 11,020	10.648.692,12	0,95
DE000ETF573	Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT		304.508	304.508	0	EUR 35,620	10.846.574,96	0,97
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>766.853.184,82</b>	<b>68,46</b>
<b>EUR</b>								<b>681.936.095,06</b>	<b>60,88</b>
LU1931536749	AGIF-AllPet and Animal Wellb. Act. Nom. W Dis.	ANT		4.795	0	0	EUR 1.378,960	6.612.113,20	0,59
LU1861137484	AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A Acc.	ANT		238.279	0	9.842	EUR 67,981	16.198.444,70	1,45
LU1861136247	AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PAB Act. Nom. DR AH Acc.	ANT		103.666	0	0	EUR 86,834	9.001.733,44	0,80
LU1437018168	AIS-Amundi Index Euro Corp.SRI Act.Nom.UCL ETF DR	ANT		1.079.965	583.638	0	EUR 47,795	51.616.927,18	4,61
DE000A2QDSD0	Aramea Rendite Plus Inhaber-Anteile V	ANT		326.428	0	0	EUR 87,180	28.457.993,04	2,54
LU1859444769	BNP P.E.-EO Corp Bd.SRI PAB Nam.-Ant.UCITS ETF	ANT		3.688.284	0	1.363.700	EUR 9,330	34.411.689,72	3,07
IE0009458997	D-A-CH Portfolio (Ireland) plc Reg.Shares A	ANT		251.442	0	0	EUR 47,390	11.915.836,38	1,06
DE000DWS28A6	DWS ESG Investa Inhaber-Anteile TFC	ANT		71.650	0	32.912	EUR 112,060	8.029.099,00	0,72
FR001400GFA5	EDR SICAV-Euro Sustain.Equity Act. au Port. P Acc.	ANT		116.298	0	0	EUR 97,190	11.303.002,62	1,01
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	ANT		631.385	0	0	EUR 17,380	10.973.471,30	0,98
LU2084129654	Fidelity Fds-Sust.Euroz.Eq.Fd Act. Nom. I Acc.	ANT		934.959	0	0	EUR 11,710	10.948.369,89	0,98
LU2420420007	GS Corp.Green Bd Act. Nom. Q Acc.	ANT		11.203	11.203	0	EUR 4.624,410	51.807.265,23	4,61
IE00BJQRDM08	InvescoMI2 MSCI USA ESG ETF Reg.Shs Acc.	ANT		142.318	0	20.829	EUR 57,890	8.238.789,02	0,74
IE00BKKKWJ26	iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares Acc.	ANT		8.303.462	0	2.775.927	EUR 4,139	34.370.520,26	3,07
IE00BHZPJ015	iShsIV-MSCI EMU.ESG.Enh.U.ETF Reg.Shares Acc.	ANT		1.330.538	0	942.490	EUR 6,208	8.259.979,90	0,74
IE00BF4G7076	JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF R.S. (ESG) UCITS A.	ANT		612.136	453.665	0	EUR 38,480	23.554.993,28	2,10
DE000A2N67X0	LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	ANT		191.223	0	0	EUR 131,540	25.153.473,42	2,25
DE0005326144	LBBW Rentamax Inhaber-Anteile R	ANT		451.622	0	0	EUR 61,130	27.607.652,86	2,46
DE000A2QDRK7	LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	ANT		486.255	0	0	EUR 98,190	47.745.378,45	4,26
DE000A1144F1	LBBW Untern.anleih.Euro Offen. Inhaber-Anteile I	ANT		182.057	0	0	EUR 96,180	17.510.242,26	1,56
LU0832976624	Nordea 1-Danish Covered Bd Fd Actions Nom. HBI	ANT		1.438.179	0	91.852	EUR 31,390	45.144.870,26	4,03
LU0539144625	Nordea 1-Europ.Covered Bond Fd Actions Nom. BI	ANT		3.416.114	0	186.026	EUR 13,244	45.242.672,20	4,04
LU0348927095	Nordea 1-Gbl Climate a.Envir.F Actions Nom. BI	ANT		358.968	0	0	EUR 30,230	10.851.746,23	0,97
LU2133169826	SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. E Acc.	ANT		468.091	0	0	EUR 105,112	49.202.121,62	4,39



# LBBW Balance CR 20

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge Im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU0329573405	Threadneedle L-Pan Eur.ESG Eq. Nam.-Ant. IE		ANT	227.280	0	0	EUR 56,950	12.943.664,18	1,16
LU1484799769	UBS(L)FS-BBG MSCI EO ALCS.UETF Inhaber-Ant. A Dis.		ANT	2.356.288	0	0	EUR 12,346	29.090.731,65	2,60
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.UETF Inh.-Anteile A Dis.		ANT	1.039.174	0	0	EUR 10,960	11.389.347,04	1,02
LU0484968812	Xtrackers II EO Cor.BdSRI PAB Inhaber-Anteile 1D		ANT	255.905	0	88.689	EUR 134,245	34.353.966,73	3,07
<b>USD</b>								<b>84.917.089,76</b>	<b>7,58</b>
LU0260062368	AB SICAV I-Int.Health Care Ptf Act. Nom. S1 Acc.		ANT	89.064	0	0	USD 207,060	17.327.437,60	1,55
LU218277693	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Act.N. Tr.I P. Acc.		ANT	76	38	7	USD 146.517,358	10.462.575,58	0,93
IE00BZ1G7G66	Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr Nam.-Ant. P Dis.(A)		ANT	25.013	0	2.613	USD 227,530	5.347.371,88	0,48
IE00BKY40J65	HSBC ETFs-US Sust.Equity Reg.Shs Acc.		ANT	522.391	251.458	35.940	USD 22,405	10.997.059,44	0,98
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	50.058	3.622	0	USD 145,214	6.829.956,22	0,61
IE00BLF7VX27	SSGA S.ETF.EI-SBSASBUSCE ETF Reg.Shs UNH Acc.		ANT	1.436.813	0	0	USD 25,150	33.952.689,04	3,03
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>1.114.192.787,06</b>	<b>99,45</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	5.494.286,71			% 100,000	5.494.286,71	0,49
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	99.833,36			% 100,000	8.423,19	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	12,24			% 100,000	12,76	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	528,56			% 100,000	604,49	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	522.384,00			% 100,000	3.263,17	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	450,26			% 100,000	423,06	0,00
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>5.507.013,38</b>	<b>0,49</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Zinsansprüche		EUR	2.193.868,77				2.193.868,77	0,20
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	9.167,08				9.167,08	0,00
	Forderungen aus Bestandsprovisionen		EUR	84.621,51				84.621,51	0,01
<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>2.287.657,36</b>	<b>0,21</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verwahrstellenvergütung		EUR	-79.288,63				-79.288,63	-0,01
	Verwaltungsvergütung		EUR	-872.175,04				-872.175,04	-0,08
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-656.379,52				-656.379,52	-0,06
<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-1.607.843,19</b>	<b>-0,15</b>
<b>Fondsvermögen</b>									
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>EUR</b>	<b>1.120.379.614,61</b>	<b>100,00</b>
<b>Anteilwert</b>							<b>STK</b>	<b>27.029.014,000</b>	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>							<b>EUR</b>	<b>41,45</b>	<b>99,45</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>0,00</b>

\*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

In-/ ausländische Renten, Zertifikate und Wertpapier-Investmentanteile per: 30.10.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87439	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,85220	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,95926	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06430	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	160,08500	= 1 Euro (EUR)

## Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt.

Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

# LBBW Balance CR 20

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:  
 - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial Inhaber-Anteile I(A)	ANT	0	32.336
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
FR0013188737	AMUNDI R.I-IMP. GREEN BONDS Act. au Port. I2 Acc.	ANT	0	2.593
LU2244386053	BNPP Easy-EUR HY SRI FsslFree Act. Nom. Acc.	ANT	0	1.924.113
LU1922482994	GS Green Bd Short Duration Actions Nom.I Cap.	ANT	0	64.412
IE00BYZTVV78	iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF Reg.Shares	ANT	0	9.155.023
<b>GBP</b>				
IE00BMP3HN93	UBS(Ir)ETF-MSCI UK IMI Soc.R. Reg.Shs A Dis.	ANT	0	654.099
<b>USD</b>				
LU1458428759	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. I Cap.	ANT	0	34.956
IE00BJSB6Q51	Twelve Cat Bond Fund Reg.Shs S12-JSS Acc.	ANT	0	384.698

# LBBW Balance CR 20

**Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.10.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.**

	<b>Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.10.2023</b>
AB SICAV I-Int.Health Care Ptf Act. Nom. S1 Acc.	0,90
AGIF-All.Pet and Animal Wellb. Act. Nom. W Dis.	0,73
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A Acc.	0,18
AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PAB Act. Nom. DR AH Acc.	0,18
AIS-Amundi Index Euro Corp.SRI Act.Nom.UCI. ETF DR	0,14
Aramea Rendite Plus Inhaber-Anteile V	0,55
BNP P.E.-EO Corp Bd.SRI PAB Nam.-Ant.UCITS ETF	0,20
BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Act.N. Tr.I P. Acc.	0,05
D-A-CH Portfolio (Ireland) plc Reg.Shares A	0,60
DWS ESG Investa Inhaber-Anteile TFC	0,80
Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UCETF Inhaber-Anteile	0,20
Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,20
Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UCETF Inhaber-Anteile	0,25
EDR SICAV-Euro Sustain.Equity Act.au Port. P Acc.	0,65
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	0,80
Fidelity Fds-Sust.Euroz.Eq.Fd Act. Nom. I Acc.	0,80
Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr Nam.-Ant. P Dis.(A)	0,60
GS Corp.Green Bd Act. Nom. Q Acc.	0,07
HSBC ETFS-US Sust.Equity Reg.Shs Acc.	0,12
InvescoMI2 MSCI USA ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,09
JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF R.S. (ESG) UCITS A.	0,20
LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	0,60
LBBW RentaMax Inhaber-Anteile R	0,75
LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	0,05
LBBW Untern.anleih.Euro Offen. Inhaber-Anteile I	0,65
Nordea 1-Danish Covered Bd Fd Actions Nom. HBI	0,30
Nordea 1-Europ.Covered Bond Fd Actions Nom. BI	0,30
Nordea 1-Gbl Climate a.Envir.F Actions Nom. BI	0,75
SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. E Acc.	0,23
SSGA S.ETF.EI-SBSASBUSCE ETF Reg.Shs UNH Acc.	0,15
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
CT (Lux) Pan European ESG Equ. Nam.-Ant. IE	0,65
UBS(L)FS-BBG MSCI EO ALCS.UETF Inhaber-Ant. A Dis.	0,20
UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF Inh.-Anteile A Dis.	0,35
Xtrackers II EO Cor.BdSRI PAB Inhaber-Anteile 1D	0,06
iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares Acc.	0,15
iShIV-MSCI EMU.ESG.Enh.U.ETF Reg.Shares Acc.	0,12

Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeaufschläge für den Erwerb bzw. die Rückgabe von Investmentanteilen an anderen OGA wurden dem Teilfonds im Berichtszeitraum nicht berechnet.

# LBBW Balance CR 40

## Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>211.701.892,79</b>	<b>22,24</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>180.240.911,22</b>	<b>18,94</b>
<b>EUR</b>								<b>138.014.783,72</b>	<b>14,51</b>
DE0001102366	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24	EUR		19.900.000	1.800.000	0	% 98,048	19.511.552,00	2,05
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25	EUR		15.200.000	0	13.600.000	% 96,443	14.659.260,00	1,54
DE0001102606	1,7000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 22/32	EUR		41.050.000	10.650.000	0	% 91,878	37.715.919,00	3,97
ES0000012B88	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28	EUR		16.000.000	1.000.000	0	% 91,478	14.636.480,00	1,54
IT0005474330	0,0000 % Republik Italien B.T.P. 21/24	EUR		15.100.000	0	0	% 95,881	14.478.031,00	1,52
AT0000A32458	2,9000 % Republik Oesterreich MTN 23/33	EUR		38.652.000	38.652.000	0	% 95,761	37.013.541,72	3,89
<b>USD</b>								<b>42.226.127,50</b>	<b>4,43</b>
US298785JV96	3,7500 % European Investment Bank Notes 23/33	USD		11.100.000	11.100.000	0	% 90,755	9.465.245,23	0,99
US459058JG93	0,7500 % International Bank Rec. Dev. MTN 20/30	USD		16.400.000	16.400.000	0	% 75,461	11.628.005,26	1,22
US459058KQ56	3,8750 % International Bank Rec. Dev. MTN 23/30	USD		13.300.000	13.300.000	0	% 93,775	11.718.570,89	1,23
US500769JY19	4,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 23/33	USD		10.800.000	10.800.000	0	% 92,775	9.414.306,12	0,99
<b>Zertifikate</b>								<b>31.460.981,57</b>	<b>3,30</b>
<b>USD</b>								<b>31.460.981,57</b>	<b>3,30</b>
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00	STK		173.798	0	0	USD 192,660	31.460.981,57	3,30
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>735.514.427,60</b>	<b>77,17</b>
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>50.318.818,18</b>	<b>5,28</b>
<b>EUR</b>								<b>50.318.818,18</b>	<b>5,28</b>
DE000ETF557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT		1.263.305	0	329.689	EUR 13,752	17.372.970,36	1,82
DE000ETF540	Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	ANT		1.726.796	0	0	EUR 11,020	19.029.291,92	2,00
DE000ETF573	Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	ANT		390.695	390.695	0	EUR 35,620	13.916.555,90	1,46
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>685.195.609,42</b>	<b>71,89</b>
<b>EUR</b>								<b>580.560.233,01</b>	<b>60,92</b>
LU1931536749	AGIF-AllPet and Animal Wellb. Act. Nom. W Dis.	ANT		7.534	0	0	EUR 1.378,960	10.389.084,64	1,09
LU1861137484	AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A Acc.	ANT		338.039	0	16.739	EUR 67,981	22.980.229,26	2,41
LU1861136247	AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PAB Act. Nom. DR AH Acc.	ANT		156.877	0	11.885	EUR 86,834	13.622.257,42	1,43
LU1437018168	AIS-Amundi Index Euro Corp.SRI Act.Nom.UCL ETF DR	ANT		510.330	262.300	0	EUR 47,795	24.391.222,35	2,56
DE000A2QDSD0	Aramea Rendite Plus Inhaber-Anteile V	ANT		159.401	0	0	EUR 87,180	13.896.579,18	1,46
LU1859444769	BNP P.E.-EO Corp Bd.SRI PAB Nam.-Ant.UCITS ETF	ANT		2.575.242	0	119.967	EUR 9,330	24.027.007,86	2,52
IE0009458997	D-A-CH Portfolio (Ireland) plc Reg.Shares A	ANT		320.082	0	0	EUR 47,390	15.168.685,98	1,59
DE000DWS28A6	DWS ESG Investa Inhaber-Anteile TFC	ANT		138.825	0	28.248	EUR 112,060	15.556.729,50	1,63
FR001400GFA5	EDR SICAV-Euro Sustain.Equity Act. au Port. P Acc.	ANT		119.098	0	0	EUR 97,190	11.575.134,62	1,21
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	ANT		1.097.809	88.137	0	EUR 17,380	19.079.920,42	2,00
LU2084129654	Fidelity Fds-Sust.Euroz.Eq.Fd Act. Nom. I Acc.	ANT		954.255	0	0	EUR 11,710	11.174.326,05	1,17
LU2420420007	GS Corp.Green Bd Act. Nom. Q Acc.	ANT		7.915	7.915	0	EUR 4.624,410	36.602.205,15	3,84
IE00BJQRDM08	InvescoMI2 MSCI USA ESG ETF Reg.Shs Acc.	ANT		242.286	0	23.307	EUR 57,890	14.025.936,54	1,47
IE00BKKKJW26	iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares Acc.	ANT		5.797.661	0	763.676	EUR 4,139	23.998.258,18	2,52
IE00BHZPJ015	iShsIV-MSCI EMU.ESG.Enh.U.ETF Reg.Shares Acc.	ANT		2.946.241	0	763.920	EUR 6,208	18.290.264,13	1,92
IE00BF4G7076	JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF R.S. (ESG) UCITS A.	ANT		889.525	627.955	0	EUR 38,480	34.228.922,00	3,59
DE000A2N67X0	LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	ANT		198.953	0	0	EUR 131,540	26.170.277,62	2,75
DE0005326144	LBBW Rentamax Inhaber-Anteile R	ANT		356.465	20.387	0	EUR 61,130	21.790.705,45	2,29
DE000A2QDRK7	LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	ANT		293.834	0	0	EUR 98,190	28.851.560,46	3,03
DE000A1144F1	LBBW Untern.anleih.Euro Offen. Inhaber-Anteile I	ANT		125.425	0	0	EUR 96,180	12.063.376,50	1,27
LU0832976624	Nordea 1-Danish Covered Bd Fd Actions Nom. HBI	ANT		1.090.604	55.958	0	EUR 31,390	34.234.386,74	3,59
LU0539144625	Nordea 1-Europ.Covered Bond Fd Actions Nom. BI	ANT		2.031.940	91.555	0	EUR 13,244	26.910.810,17	2,82
LU0348927095	Nordea 1-Gbl Climate a.Envir.F Actions Nom. BI	ANT		440.008	0	0	EUR 30,230	13.301.617,84	1,40
LU2133169826	SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. E Acc.	ANT		319.815	0	0	EUR 105,112	33.616.490,22	3,53

# LBBW Balance CR 40

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
LU0329573405	Threadneedle L-Pan Eur.ESG Eq. Nam.-Ant. IE		ANT	316.794	0	37.699	EUR 56,950	18.041.513,34	1,89
LU1484799769	UBS(L)FS-BBG MSCI EO ALCS.UETF Inhaber-Ant. A Dis.		ANT	1.130.409	0	0	EUR 12,346	13.956.029,51	1,46
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.UETF Inh.-Anteile A Dis.		ANT	1.699.812	0	0	EUR 10,960	18.629.939,52	1,96
LU0484968812	Xtrackers II EO Cor.BdSRI PAB Inhaber-Anteile 1D		ANT	178.679	0	64.168	EUR 134,245	23.986.762,36	2,52
<b>USD</b>								<b>104.635.376,41</b>	<b>10,97</b>
LU0260062368	AB SICAV I-Int.Health Care Ptf Act. Nom. S1 Acc.		ANT	130.460	0	0	USD 207,060	25.381.046,32	2,66
LU218277693	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Act.N. Tr.I P. Acc.		ANT	145	88	9	USD 146.517,358	19.961.492,88	2,09
IE00BZ1G7G66	Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr Nam.-Ant. P Dis.(A)		ANT	41.470	0	0	USD 227,530	8.865.610,35	0,93
IE00BKY40J65	HSBC ETFS-US Sust.Equity Reg.Shs Acc.		ANT	927.244	462.224	0	USD 22,405	19.519.779,97	2,05
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	85.220	9.328	0	USD 145,214	11.627.489,50	1,22
IE00BLF7VX27	SSGA S.ETF.EI-SBSASBUSCE ETF Reg.Shs UNH Acc.		ANT	815.891	46.492	0	USD 25,150	19.279.957,39	2,02
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>947.216.320,39</b>	<b>99,41</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>									
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben bei</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	4.738.178,48			% 100,000	4.738.178,48	0,50
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	65.756,82			% 100,000	5.548,07	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	11,45			% 100,000	11,94	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	76.082,22			% 100,000	87.012,27	0,01
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	2.423.163,00			% 100,000	15.136,73	0,00
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	160.792,73			% 100,000	151.078,39	0,02
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>4.996.965,88</b>	<b>0,53</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>4.996.965,88</b>	<b>0,53</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Zinsansprüche		EUR	1.511.777,88				1.511.777,88	0,16
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	174.416,60				174.416,60	0,02
	Forderungen aus Bestandsprovisionen		EUR	92.002,90				92.002,90	0,01
<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>1.778.197,38</b>	<b>0,19</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verwahrstellenvergütung		EUR	-67.633,72				-67.633,72	-0,01
	Verwaltungsvergütung		EUR	-828.513,05				-828.513,05	-0,09
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-266.373,04				-266.373,04	-0,03
	Sonstige Verbindlichkeiten		EUR	-0,01				-0,01	0,00
<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-1.162.519,82</b>	<b>-0,13</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>952.828.963,83</b>	<b>100,00</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>19.989.213,000</b>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>47,67</b>	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>99,41</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>0,00</b>

\*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
In-/ ausländische Renten, Zertifikate und Wertpapier-Investmentanteile per: 30.10.2023  
Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87439	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,85220	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,95926	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06430	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	160,08500	= 1 Euro (EUR)

## Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt.  
Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

# LBBW Balance CR 40

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:  
 - Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial Inhaber-Anteile I(A)	ANT	0	43.350
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
FR0013188737	AMUNDI R.I.-IMP. GREEN BONDS Act. au Port. I2 Acc.	ANT	0	1.358
LU2244386053	BNPP Easy-EUR HY SRI FsslFree Act. Nom. Acc.	ANT	0	1.001.580
LU1922482994	GS Green Bd Short Duration Actions Nom.I Cap.	ANT	0	40.300
IE00BYZTVV78	iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF Reg.Shares	ANT	0	5.925.847
<b>GBP</b>				
IE00BMP3HN93	UBS(Ir)ETF-MSCI UK IMI Soc.R. Reg.Shs A Dis.	ANT	0	944.284
<b>USD</b>				
LU1458428759	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. I Cap.	ANT	0	57.741
IE00BJSB6Q51	Twelve Cat Bond Fund Reg.Shs SI2-JSS Acc.	ANT	0	213.231

# LBBW Balance CR 40

**Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.10.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.**

	<b>Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.10.2023</b>
AB SICAV I-Int.Health Care Ptf Act. Nom. S1 Acc.	0,90
AGIF-All.Pet and Animal Wellb. Act. Nom. W Dis.	0,73
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A Acc.	0,18
AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PAB Act. Nom. DR AH Acc.	0,18
AIS-Amundi Index Euro Corp.SRI Act.Nom.UCI. ETF DR	0,14
Aramea Rendite Plus Inhaber-Anteile V	0,55
BNP P.E.-EO Corp Bd.SRI PAB Nam.-Ant.UCITS ETF	0,20
BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Act.N. Tr.I P. Acc.	0,05
D-A-CH Portfolio (Ireland) plc Reg.Shares A	0,60
DWS ESG Investa Inhaber-Anteile TFC	0,80
Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UCETF Inhaber-Anteile	0,20
Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,20
Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UCETF Inhaber-Anteile	0,25
EDR SICAV-Euro Sustain.Equity Act.au Port. P Acc.	0,65
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	0,80
Fidelity Fds-Sust.Euroz.Eq.Fd Act. Nom. I Acc.	0,80
Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr Nam.-Ant. P Dis.(A)	0,60
GS Corp.Green Bd Act. Nom. Q Acc.	0,07
HSBC ETFS-US Sust.Equity Reg.Shs Acc.	0,12
InvescoMI2 MSCI USA ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,09
JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF R.S. (ESG) UCITS A.	0,20
LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	0,60
LBBW RentaMax Inhaber-Anteile R	0,75
LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	0,05
LBBW Untern.anleih.Euro Offen. Inhaber-Anteile I	0,65
Nordea 1-Danish Covered Bd Fd Actions Nom. HBI	0,30
Nordea 1-Europ.Covered Bond Fd Actions Nom. BI	0,30
Nordea 1-Gbl Climate a.Envir.F Actions Nom. BI	0,75
SISF-Sustainable EO Credit Act. Nom. E Acc.	0,23
SSGA S.ETF.EI-SBSASBUSCE ETF Reg.Shs UNH Acc.	0,15
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
CT (Lux) Pan European ESG Equ. Nam.-Ant. IE	0,65
UBS(L)FS-BBG MSCI EO ALCS.UETF Inhaber-Ant. A Dis.	0,20
UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF Inh.-Anteile A Dis.	0,35
Xtrackers II EO Cor.BdSRI PAB Inhaber-Anteile 1D	0,06
iSh.2 plc-DL Corp Bd ESG U.ETF Reg.Shares Acc.	0,15
iShsIV-MSCI EMU.ESG.Enh.U.ETF Reg.Shares Acc.	0,12

Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeaufschläge für den Erwerb bzw. die Rückgabe von Investmentanteilen an anderen OGA wurden dem Teilfonds im Berichtszeitraum nicht berechnet.

# LBBW Balance CR 75

## Vermögensaufstellung zum 31. Oktober 2023.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>70.302.327,37</b>	<b>13,01</b>	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								<b>39.824.105,50</b>	<b>7,36</b>	
<b>EUR</b>								<b>39.824.105,50</b>	<b>7,36</b>	
DE0001102366	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24		EUR	11.600.000	1.700.000	0	% 98,048	11.373.568,00	2,10	
DE0001102382	1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25		EUR	29.500.000	4.300.000	0	% 96,443	28.450.537,50	5,26	
<b>Zertifikate</b>								<b>30.478.221,87</b>	<b>5,65</b>	
<b>USD</b>								<b>30.478.221,87</b>	<b>5,65</b>	
IE00B579F325	Invesco Physical Markets PLC Rohst.-Zert.XAU 09/00		STK	168.369	15.635	0	USD 192,660	30.478.221,87	5,65	
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>464.156.260,22</b>	<b>85,90</b>	
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>63.980.532,35</b>	<b>11,84</b>	
<b>EUR</b>								<b>63.980.532,35</b>	<b>11,84</b>	
DE000ETF557	Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile		ANT	1.926.599	474.527	367.713	EUR 13,752	26.494.589,45	4,90	
DE000ETF540	Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile		ANT	2.179.901	311.111	0	EUR 11,020	24.022.509,02	4,45	
DE000ETF573	Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile		ANT	377.974	377.974	0	EUR 35,620	13.463.433,88	2,49	
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>								<b>400.175.727,87</b>	<b>74,06</b>	
<b>EUR</b>								<b>307.799.124,25</b>	<b>56,96</b>	
LU1931536749	AGIF-AllPet and Animal Wellb. Act. Nom. W Dis.		ANT	8.031	0	0	EUR 1.378,960	11.074.427,76	2,05	
LU1861137484	AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A Acc.		ANT	389.338	0	0	EUR 67,981	26.467.586,58	4,90	
LU1861136247	AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PAB Act. Nom. DR AH Acc.		ANT	182.361	0	8.364	EUR 86,834	15.835.135,07	2,93	
IE0009458997	D-A-CH Portfolio (Ireland) plc Reg.Shares A		ANT	347.771	0	0	EUR 47,390	16.480.867,69	3,05	
DE000DWS28A6	DWS ESG Investa Inhaber-Anteile TFC		ANT	136.773	0	44.027	EUR 112,060	15.326.782,38	2,84	
FR001400GFA5	EDR SICAV-Euro Sustain.Equity Act.au Port. P Acc.		ANT	162.893	0	0	EUR 97,190	15.831.570,67	2,93	
LU1400167562	Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.		ANT	1.276.154	93.881	0	EUR 17,380	22.179.556,52	4,10	
LU2084129654	Fidelity Fds-Sust.Euroz.Eq.Fd Act. Nom. I Acc.		ANT	1.300.711	0	0	EUR 11,710	15.231.325,81	2,82	
IE00BJQRDM08	InvescoMI2 MSCI USA ESG ETF Reg.Shs Acc.		ANT	281.644	0	18.514	EUR 57,890	16.304.371,16	3,02	
IE00BHZPJ015	iShsIV-MSCI EMU.ESG.Enh.U.ETF Reg.Shares Acc.		ANT	3.386.477	0	1.648.623	EUR 6,208	21.023.249,22	3,89	
IE00BF4G7076	JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF R.S. (ESG) UCITS A.		ANT	730.314	429.989	0	EUR 38,480	28.102.482,72	5,20	
DE000A2N67X0	LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I		ANT	179.282	0	0	EUR 131,540	23.582.754,28	4,36	
DE000A2QDRK7	LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I		ANT	174.298	7.814	0	EUR 98,190	17.114.320,62	3,17	
LU0348927095	Nordea 1-Gbl Climate a.Envir.F Actions Nom. Bl		ANT	655.393	29.037	0	EUR 30,230	19.812.792,55	3,67	
LU0329573405	Threadneedle L-Pan Eur.ESG Eq. Nam.-Ant. IE		ANT	391.272	0	13.563	EUR 56,950	22.283.057,78	4,12	
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF Inh.-Anteile A Dis.		ANT	1.929.639	0	0	EUR 10,960	21.148.843,44	3,91	
<b>USD</b>								<b>92.376.603,62</b>	<b>17,10</b>	
LU0260062368	AB SICAV I-Int.Health Care Ptf Act. Nom. S1 Acc.		ANT	99.027	0	0	USD 207,060	19.265.743,32	3,57	
LU2118277693	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Act.N. Tr.I P. Acc.		ANT	188	121	9	USD 146.517,358	25.881.108,01	4,79	
IE00BZ1G7G66	Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr Nam.-Ant. P Dis.(A)		ANT	47.455	0	0	USD 227,530	10.145.105,84	1,88	
IE00BKY40J65	HSBC ETFs-US Sust.Equity Reg.Shs Acc.		ANT	1.065.796	524.151	0	USD 22,405	22.436.492,89	4,15	
LU2016064037	Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.		ANT	107.359	13.730	0	USD 145,214	14.648.153,56	2,71	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>534.458.587,59</b>	<b>98,91</b>
<b>Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>										
<b>Bankguthaben</b>										
<b>EUR-Guthaben bei</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		EUR	6.006.932,73			% 100,000	6.006.932,73	1,11	
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		NOK	95.085,93			% 100,000	8.022,64	0,00	
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
	DekaBank Deutsche Girozentrale		CHF	9,24			% 100,000	9,63	0,00	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		GBP	95.961,23			% 100,000	109.747,11	0,02	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		JPY	4.424.250,00			% 100,000	27.636,88	0,01	
	DekaBank Deutsche Girozentrale		USD	20.744,92			% 100,000	19.491,61	0,00	
<b>Summe der Bankguthaben</b>								<b>EUR</b>	<b>6.171.840,60</b>	<b>1,14</b>
<b>Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere und Geldmarktfonds</b>								<b>EUR</b>	<b>6.171.840,60</b>	<b>1,14</b>



# LBBW Balance CR 75

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2023	Käufe/ Zugänge Im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens *)
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
	Zinsansprüche		EUR	87.590,16				87.590,16	0,02
	Forderungen aus Anteilsceingeschäften		EUR	213.893,57				213.893,57	0,04
	Forderungen aus Bestandsprovisionen		EUR	58.074,31				58.074,31	0,01
	<b>Summe der sonstigen Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>359.558,04</b>	<b>0,07</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
	Verwahrstellenvergütung		EUR	-38.851,33				-38.851,33	-0,01
	Verwaltungsvergütung		EUR	-524.492,96				-524.492,96	-0,10
	Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften		EUR	-42.153,76				-42.153,76	-0,01
	<b>Summe der sonstigen Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-605.498,05</b>	<b>-0,12</b>
<b>Fondsvermögen</b>									
	<b>Umlaufende Anteile</b>						<b>EUR</b>	<b>540.384.488,18</b>	<b>100,00</b>
	<b>Anteilwert</b>						<b>STK</b>	<b>8.841.670,000</b>	
	<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>						<b>EUR</b>	<b>61,12</b>	<b>98,91</b>
	<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>								<b>0,00</b>

\*) Rundungsbedingte Differenzen bei den Prozent-Anteilen sind möglich.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

In-/ ausländische Renten, Zertifikate und Wertpapier-Investmentanteile per: 30.10.2023

Alle anderen Vermögenswerte per: 31.10.2023

## Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2023

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,87439	= 1 Euro (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,85220	= 1 Euro (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,95926	= 1 Euro (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06430	= 1 Euro (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	160,08500	= 1 Euro (EUR)

## Zusätzliche Angaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Angaben pro Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts/Total Return Swaps)

Das Sondervermögen hat im Berichtszeitraum keine Wertpapier-Darlehen-, Pensions- oder Total Return Swap-Geschäfte getätigt.

Zusätzliche Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sind daher nicht erforderlich.

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Nominal in Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>EUR</b>				
LU0368601893	Deka-Europa Aktien Spezial Inhaber-Anteile I(A)	ANT	0	35.349
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>				
<b>GBP</b>				
IE00BMP3HN93	UBS(Ir)ETF-MSCI UK IMI Soc.R. Reg.Shs A Dis.	ANT	0	926.397
<b>USD</b>				
LU1458428759	BNP Paribas Sust. US MF Equity Act. Nom. I Cap.	ANT	0	65.617

# LBBW Balance CR 75

**Verwaltungsvergütung der in dem Teilfonds gehaltenen Investmentanteile per 31.10.2023, die den Zielfonds in der Berichtsperiode berechnet wurde.**

	<b>Verwaltungsvergütung in % p.a. per 31.10.2023</b>
AB SICAV I-Int.Health Care Ptf Act. Nom. S1 Acc.	0,90
AGIF-All.Pet and Animal Wellb. Act. Nom. W Dis.	0,73
AIS-AM.IDX MSCI EUR.SRI PAB Act. Nom. DR A Acc.	0,18
AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PAB Act. Nom. DR AH Acc.	0,18
BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C. Act.N. Tr.I P. Acc.	0,05
D-A-CH Portfolio (Ireland) plc Reg.Shares A	0,60
DWS ESG Investa Inhaber-Anteile TFC	0,80
Deka MSCI EMU Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	0,20
Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile	0,20
Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile	0,25
EDR SICAV-Euro Sustain.Equity Act.au Port. P Acc.	0,65
Fidelity Fds-Sust.Asia Eq.Fund Reg.Shares I Acc.	0,80
Fidelity Fds-Sust.Euroz.Eq.Fd Act. Nom. I Acc.	0,80
Fr.Tpl.GF-FTGF CB US Eq.Su.Ldr Nam.-Ant. P Dis.(A)	0,60
HSBC ETFs-US Sust.Equity Reg.Shs Acc.	0,12
InvescoMI2 MSCI USA ESG ETF Reg.Shs Acc.	0,09
JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF R.S. (ESG) UCITS A.	0,20
LBBW Global Warming Inhaber-Anteile I	0,60
LBBW Renten Short Term Nachha. Inhaber-Anteile I	0,05
Nordea 1-Gbl Climate a.Envir.F Actions Nom. Bl	0,75
Schroder ISF - Gl.Ener.Trans. Act. Nom. IZ Acc.	0,75
CT (Lux) Pan European ESG Equ. Nam.-Ant. IE	0,65
UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF Inh.-Anteile A Dis.	0,35
iShsIV-MSCI EMU.ESG.Enh.U.ETF Reg.Shares Acc.	0,12

Ausgabeaufschläge bzw. Rücknahmeaufschläge für den Erwerb bzw. die Rückgabe von Investmentanteilen an anderen OGA wurden dem Teilfonds im Berichtszeitraum nicht berechnet.

# Fondszusammensetzung.

	<b>LBBW Balance CR 20 in EUR</b>	<b>LBBW Balance CR 40 in EUR</b>	<b>LBBW Balance CR 75 in EUR</b>	<b>Gesamt in EUR</b>
<b>Vermögensaufstellung</b>				
Wertpapiervermögen	1.114.192.787,06	947.216.320,39	534.458.587,59	2.595.867.695,04
Bankguthaben/Geldmarktfonds	5.507.013,38	4.996.965,88	6.171.840,60	16.675.819,86
Sonstige Vermögensgegenstände	2.287.657,36	1.778.197,38	359.558,04	4.425.412,78
Sonstige Verbindlichkeiten	-1.607.843,19	-1.162.519,82	-605.498,05	-3.375.861,06
<b>Fondsvermögen</b>	<b>1.120.379.614,61</b>	<b>952.828.963,83</b>	<b>540.384.488,18</b>	<b>2.613.593.066,62</b>

---

Luxemburg, den 1. November 2023  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main  
Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg  
Die Geschäftsführung

---

# Ihre Partner in der Sparkassen-Finanzgruppe.

## **Verwaltungsgesellschaft**

Deka Vermögensmanagement GmbH  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main

Zweigniederlassung

Deka Vermögensmanagement GmbH,  
Zweigniederlassung Luxemburg  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel,  
Luxembourg

## **Eigenmittel der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main**

**zum 31. Dezember 2022**

gezeichnet und eingezahlt  
haftend

EUR 10,2 Mio.

EUR 22,4 Mio.

## **Leitung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg**

Jörg Palms

## **Geschäftsführung der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main**

Dirk Degenhardt (Vorsitzender)

Mitglied des Aufsichtsrates der bevestor GmbH, Frankfurt am Main

Dirk Heuser

Thomas Ketter

Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main;

Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der  
IQAM Invest GmbH, Salzburg

Thomas Schneider

Mitglied der Geschäftsführung der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main;

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka International S.A.,  
Luxembourg;

## **Aufsichtsrat der Deka Vermögensmanagement GmbH, Frankfurt am Main**

### **Vorsitzender**

Dr. Matthias Danne

Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der

DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt am Main;

Vorsitzender des Aufsichtsrates der Deka Investment GmbH,  
Frankfurt am Main

und der

Deka Immobilien Investment GmbH, Frankfurt am Main

und der

WestInvest Gesellschaft für Investmentfonds mbH, Düsseldorf

### **Stellvertretende Vorsitzende**

Birgit Dietl-Benzin

Mitglied des Vorstandes der DekaBank Deutsche Girozentrale,  
Frankfurt am Main;

Stellvertretende Vorsitzende des Aufsichtsrates der  
Deka Investment GmbH, Frankfurt am Main

und der

S Broker AG & Co. KG, Wiesbaden;

Mitglied des Aufsichtsrates der S Broker Management AG,  
Wiesbaden

### **Mitglieder**

Wolfgang Dürr, Trier

Rita Geyermann

Direktorin der KfW-Bankengruppe, Frankfurt am Main

Victor Moftakhar, Bad Nauheim

Sabine Schmittroth

Geschäftsführende Gesellschafterin der sajos GmbH,  
Frankfurt am Main

## **Verwahr- und Zahlstelle**

DekaBank Deutsche Girozentrale,

Frankfurt am Main, Niederlassung Luxemburg

6, rue Lou Hemmer

1748 Luxembourg-Findel,

Luxembourg

## **Cabinet de révision agréé für den Fonds**

Deloitte Audit

Société à responsabilité limitée

20 Boulevard de Kockelscheuer

1821 Luxembourg,

Großherzogtum Luxemburg

## **Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland**

DekaBank Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
Deutschland

Stand: 31. Oktober 2023

Die vorstehenden Angaben werden in den Jahres- und ggf.  
Halbjahresberichten jeweils aktualisiert.

**Deka Vermögens-  
management GmbH,**  
Lyoner Straße 13  
60528 Frankfurt am Main  
Postfach 11 05 23  
60040 Frankfurt am Main  
Telefon: (069) 71 47 - 8500  
Telefax: (069) 71 47 - 8650  
www.deka.de

**Deka Vermögens-  
management GmbH,  
Zweigniederlassung Luxemburg**  
6, rue Lou Hemmer  
1748 Luxembourg-Findel  
Postfach 504  
2015 Luxembourg  
Telefon: (+352) 34 09 - 27 39  
Telefax: (+352) 34 09 - 22 90



**Vertrieb durch**  
**Landesbank Baden-Württemberg**  
Hauptsitze

**Stuttgart**  
70144 Stuttgart  
Am Hauptbahnhof 2  
70173 Stuttgart  
Telefon 07 11 1 27 - 0  
Telefax 07 11 1 27 - 4 35 44  
www.LBBW.de  
kontakt@LBBW.de

**Karlsruhe**  
76245 Karlsruhe  
Ludwig-Erhard-Allee 4  
76131 Karlsruhe  
Telefon 07 21 1 42 - 0  
Telefax 07 21 1 42 - 2 30 12  
www.LBBW.de  
kontakt@LBBW.de

**Mannheim**  
Postfach 10 03 52  
68003 Mannheim  
Augustaanlage 33  
68165 Mannheim  
Telefon 06 21 4 28 - 0  
Telefax 06 21 4 28 - 7 25 91  
www.LBBW.de  
kontakt@LBBW.de

**Mainz**  
55098 Mainz  
Große Bleiche 54-56  
55116 Mainz  
Telefon 061 31 64 - 3 78 00  
Telefax 061 31 64 - 3 57 01  
www.LBBW.de  
kontakt@LBBW.de