

# Mit gutem Gewissen anlegen

## Pfalz Invest Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht zum 31.03.2023



LB≡BW Asset Management

 Sparkasse  
Rhein-Haardt



## Inhalt

- 8 Vermögensübersicht zum 31.03.2023
- 9 Vermögensaufstellung zum 31.03.2023
- 17 Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,  
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen
- 19 Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV



**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 Portfoliostruktur 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



Dr. Bernhard Scherer



# **Pfalz Invest Nachhaltigkeit**

Halbjahresbericht zum 31.03.2023

## Vermögensübersicht zum 31.03.2023

| Anlageschwerpunkte                         | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens |
|--|----------------------|----------------------|
| <b>I. Vermögensgegenstände</b>             | <b>55.770.570,35</b> | <b>100,10</b>        |
| <b>1. Aktien</b>                           | <b>24.877.961,00</b> | <b>44,65</b>         |
| USA  | 10.905.544,06        | 19,57                |
| Bundesrep. Deutschland                     | 3.886.780,00         | 6,98                 |
| Frankreich                                 | 3.701.935,48         | 6,64                 |
| Großbritannien                             | 1.857.167,25         | 3,33                 |
| Niederlande                                | 1.008.366,00         | 1,81                 |
| Schweiz                                    | 862.319,80           | 1,55                 |
| Dänemark                                   | 841.121,99           | 1,51                 |
| Irland                                     | 510.295,50           | 0,92                 |
| Österreich                                 | 336.000,00           | 0,60                 |
| Canada                                     | 287.712,45           | 0,52                 |
| Japan                                      | 281.920,75           | 0,51                 |
| Andere Länder                              | 398.797,72           | 0,71                 |
| <b>2. Anleihen</b>                         | <b>30.127.049,53</b> | <b>54,07</b>         |
| Frankreich                                 | 4.992.626,38         | 8,96                 |
| Bundesrep. Deutschland                     | 4.003.449,35         | 7,19                 |
| Niederlande                                | 3.886.935,76         | 6,98                 |
| Spanien                                    | 2.170.792,98         | 3,90                 |
| Großbritannien                             | 1.877.979,00         | 3,37                 |
| Belgien                                    | 1.741.100,00         | 3,13                 |
| Österreich                                 | 1.658.842,56         | 2,98                 |
| Australien                                 | 1.616.497,60         | 2,90                 |
| Island                                     | 1.250.550,00         | 2,24                 |
| Irland                                     | 1.195.934,00         | 2,15                 |
| Finnland                                   | 1.038.407,65         | 1,86                 |
| Italien                                    | 986.629,00           | 1,77                 |
| Portugal                                   | 901.355,00           | 1,62                 |
| Canada                                     | 772.235,00           | 1,39                 |
| Andere Länder                              | 2.033.715,25         | 3,65                 |
| <b>3. Sonstige Beteiligungswertpapiere</b> | <b>578.428,21</b>    | <b>1,04</b>          |
| <b>4. Derivate</b>                         | <b>-261.658,54</b>   | <b>-0,47</b>         |
| <b>5. Bankguthaben</b>                     | <b>205.030,64</b>    | <b>0,37</b>          |
| <b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>    | <b>243.759,51</b>    | <b>0,44</b>          |
| <b>II. Verbindlichkeiten</b>               | <b>-55.743,91</b>    | <b>-0,10</b>         |
| <b>III. Fondsvermögen</b>                  | <b>55.714.826,44</b> | <b>100,00</b>        |



## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung                                   | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge |     | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens |
|---|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|-----|------------|----------------------|----------------------|
| <b>Bestandspositionen</b>                             |        |       |                                       |                    |                                     |                    |     | <b>EUR</b> | <b>55.583.438,74</b> | <b>99,76</b>         |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>                   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |     | <b>EUR</b> | <b>52.604.493,50</b> | <b>94,42</b>         |
| <b>Aktien</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |     |            |                      |                      |
| Sun Life Financial Inc. Registered Shares o.N.        | 936039 |       | STK                                   | 6.700              | 7.300                               | 600                | CAD | 63,140     | 287.712,45           | 0,52                 |
| Meyer Burger Technology AG Nam.-Aktien SF -,05        | A0YJZX |       | STK                                   | 1.207.800          | 343.000                             | 115.200            | CHF | 0,643      | 782.484,03           | 1,40                 |
| Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05               | 893484 |       | STK                                   | 295                |                                     |                    | CHF | 268,600    | 79.835,77            | 0,14                 |
| Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1                      | A1KAGC |       | STK                                   | 4.000              | 2.100                               | 200                | DKK | 901,800    | 484.233,42           | 0,87                 |
| Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -,20                | A1XA8R |       | STK                                   | 1.750              |                                     | 3.550              | DKK | 1.085,800  | 255.077,66           | 0,46                 |
| Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10                     | A0NBLH |       | STK                                   | 1.300              |                                     | 1.600              | DKK | 583,400    | 101.810,91           | 0,18                 |
| Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50  | 850133 |       | STK                                   | 1.110              |                                     | 100                | EUR | 154,200    | 171.162,00           | 0,31                 |
| Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.                    | 840400 |       | STK                                   | 2.200              |                                     | 400                | EUR | 212,800    | 468.160,00           | 0,84                 |
| ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09            | A1J4U4 |       | STK                                   | 200                |                                     | 1.080              | EUR | 625,200    | 125.040,00           | 0,22                 |
| ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16           | A2AKBT |       | STK                                   | 10.300             |                                     | 1.000              | EUR | 36,740     | 378.422,00           | 0,68                 |
| AXA S.A. Actions Port. EO 2,29                        | 855705 |       | STK                                   | 17.200             |                                     | 1.600              | EUR | 28,165     | 484.438,00           | 0,87                 |
| BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2                   | 887771 |       | STK                                   | 9.000              | 13.300                              | 4.300              | EUR | 55,210     | 496.890,00           | 0,89                 |
| Bouygues S.A. Actions Port. EO 1                      | 858821 |       | STK                                   | 10.480             | 680                                 | 1.000              | EUR | 31,090     | 325.823,20           | 0,58                 |
| Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N.             | 531370 |       | STK                                   | 1.900              |                                     | 200                | EUR | 128,000    | 243.200,00           | 0,44                 |
| CRH PLC Registered Shares EO -,32                     | 864684 |       | STK                                   | 10.980             | 5.780                               | 1.000              | EUR | 46,475     | 510.295,50           | 0,92                 |
| Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10            | A3CRC5 |       | STK                                   | 4.800              |                                     | 500                | EUR | 37,875     | 181.800,00           | 0,33                 |
| Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.                  | 581005 |       | STK                                   | 3.700              |                                     | 1.000              | EUR | 179,450    | 663.965,00           | 1,19                 |
| Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien o.N.     | 577330 |       | STK                                   | 1.000              | 1.100                               | 100                | EUR | 46,310     | 46.310,00            | 0,08                 |
| Hannover Rück SE Namens-Aktien o.N.                   | 840221 |       | STK                                   | 2.300              |                                     | 1.200              | EUR | 180,350    | 414.805,00           | 0,74                 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N.               | 850605 |       | STK                                   | 100.000            | 200.000                             | 100.000            | EUR | 2,368      | 236.750,00           | 0,42                 |
| KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N.                     | KGX888 |       | STK                                   | 7.000              | 10.000                              | 10.700             | EUR | 35,610     | 249.270,00           | 0,45                 |
| Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0,20 | 940602 |       | STK                                   | 9.400              | 23.700                              | 14.300             | EUR | 16,836     | 158.258,40           | 0,28                 |
| Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.   | 843002 |       | STK                                   | 2.900              |                                     | 600                | EUR | 322,500    | 935.250,00           | 1,68                 |
| NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -,12            | A115DY |       | STK                                   | 10.360             | 3.660                               | 1.000              | EUR | 33,460     | 346.645,60           | 0,62                 |
| Orange S.A. Actions Port. EO 4                        | 906849 |       | STK                                   | 37.390             | 1.290                               | 3.600              | EUR | 10,952     | 409.495,28           | 0,73                 |
| Oréal S.A., L' Actions Port. EO 0,2                   | 853888 |       | STK                                   | 1.500              |                                     | 100                | EUR | 411,250    | 616.875,00           | 1,11                 |
| SAP SE Inhaber-Aktien o.N.                            | 716460 |       | STK                                   | 2.800              | 30.000                              | 30.300             | EUR | 116,060    | 324.968,00           | 0,58                 |
| Schneider Electric SE Actions Port. EO 4              | 860180 |       | STK                                   | 600                |                                     | 100                | EUR | 153,680    | 92.208,00            | 0,17                 |

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung  | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs          | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|--|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|---------------|-----------------|----------------------|
| Scout24 SE Namens-Aktien o.N.                              | A12DM8 |       | STK                                   | 4.200              | 4.600                               | 400                | EUR 54,700    | 229.740,00      | 0,41                 |
| Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N.                 | SHL100 |       | STK                                   | 3.600              |                                     | 300                | EUR 53,020    | 190.872,00      | 0,34                 |
| Symrise AG Inhaber-Aktien o.N.                             | SYM999 |       | STK                                   | 1.200              |                                     | 1.600              | EUR 100,200   | 120.240,00      | 0,22                 |
| Téléperformance SE Actions Port. EO 2,5                    | 889287 |       | STK                                   | 2.400              | 1.400                               | 200                | EUR 221,700   | 532.080,00      | 0,96                 |
| Unilever PLC Registered Shares LS -,031111                 | A0JNE2 |       | STK                                   | 6.700              | 300                                 | 600                | EUR 47,690    | 319.523,00      | 0,57                 |
| Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N.                           | 877738 |       | STK                                   | 4.200              |                                     | 400                | EUR 80,000    | 336.000,00      | 0,60                 |
| VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50                           | 867475 |       | STK                                   | 3.700              |                                     | 400                | EUR 105,720   | 391.164,00      | 0,70                 |
| HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -,50                | 923893 |       | STK                                   | 36.000             | 3.200                               | 43.200             | GBP 5,497     | 225.209,97      | 0,40                 |
| London Stock Exchange Group PLC Reg. Shares LS 0,069186047 | A0JEJF |       | STK                                   | 9.400              | 3.000                               | 600                | GBP 78,680    | 841.688,86      | 1,51                 |
| Relx PLC Registered Shares LS -,144397                     | A0M95J |       | STK                                   | 15.800             |                                     | 1.500              | GBP 26,180    | 470.745,42      | 0,84                 |
| Nomura Research Institute Ltd. Registered Shares o.N.      | 630026 |       | STK                                   | 13.300             |                                     | 1.300              | JPY 3.065,000 | 281.920,75      | 0,51                 |
| Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098                      | 851908 |       | STK                                   | 23.700             | 26.000                              | 2.300              | NOK 77,800    | 162.047,72      | 0,29                 |
| 3M Co. Registered Shares DL -,01                           | 851745 |       | STK                                   | 2.800              | 1.100                               | 300                | USD 105,110   | 270.889,59      | 0,49                 |
| Adobe Inc. Registered Shares o.N.                          | 871981 |       | STK                                   | 1.800              |                                     | 200                | USD 385,250   | 638.271,43      | 1,15                 |
| Air Products & Chemicals Inc. Registered Shares DL 1       | 854912 |       | STK                                   | 1.700              |                                     | 200                | USD 287,210   | 449.405,86      | 0,81                 |
| Amgen Inc. Registered Shares DL -,0001                     | 867900 |       | STK                                   | 500                | 600                                 | 100                | USD 241,765   | 111.263,75      | 0,20                 |
| Blackrock Inc. Reg. Shares Class A DL -,01                 | 928193 |       | STK                                   | 830                |                                     | 100                | USD 669,120   | 511.178,24      | 0,92                 |
| Boston Scientific Corp. Registered Shares DL -,01          | 884113 |       | STK                                   | 6.400              |                                     | 4.600              | USD 50,030    | 294.713,98      | 0,53                 |
| Citigroup Inc. Registered Shares DL -,01                   | A1H92V |       | STK                                   | 8.800              | 3.500                               | 800                | USD 46,890    | 379.798,43      | 0,68                 |
| CSX Corp. Registered Shares DL 1                           | 865857 |       | STK                                   | 5.200              | 5.700                               | 500                | USD 29,930    | 143.251,88      | 0,26                 |
| CVS Health Corp. Registered Shares DL-,01                  | 859034 |       | STK                                   | 3.400              | 3.400                               |                    | USD 74,310    | 232.550,05      | 0,42                 |
| Elevance Health Inc. Registered Shares DL -,01             | A12FMV |       | STK                                   | 1.150              |                                     | 100                | USD 459,810   | 486.705,78      | 0,87                 |
| GATX Corp. Registered Shares DL -,625                      | 851137 |       | STK                                   | 1.400              | 1.500                               | 100                | USD 110,020   | 141.771,83      | 0,25                 |
| Johnson & Johnson Registered Shares DL 1                   | 853260 |       | STK                                   | 3.200              | 1.600                               | 200                | USD 155,000   | 456.532,74      | 0,82                 |
| Keysight Technologies Inc. Registered Shares DL -,01       | A1286J |       | STK                                   | 1.200              |                                     | 100                | USD 161,480   | 178.357,03      | 0,32                 |
| Merck & Co. Inc. Registered Shares DL-,01                  | A0YD8Q |       | STK                                   | 2.540              | 140                                 | 2.300              | USD 106,390   | 248.728,06      | 0,45                 |
| Microsoft Corp. Registered Shares DL-,00000625             | 870747 |       | STK                                   | 3.700              | 1.000                               | 300                | USD 288,400   | 982.171,29      | 1,76                 |
| Moody's Corp. Registered Shares DL-,01                     | 915246 |       | STK                                   | 900                |                                     | 100                | USD 306,020   | 253.502,69      | 0,46                 |
| Newmont Corp. Registered Shares DL 1,60                    | 853823 |       | STK                                   | 7.890              | 2.090                               | 800                | USD 49,020    | 355.992,27      | 0,64                 |
| NIKE Inc. Registered Shares Class B o.N.                   | 866993 |       | STK                                   | 2.700              | 3.000                               | 300                | USD 122,640   | 304.779,79      | 0,55                 |

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs        | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|-------------|-----------------|----------------------|
| Norfolk Southern Corp.<br>Registered Shares DL 1                          | 867028 |       | STK                                   | 3.000              |                                     | 300                | USD 212,000 | 585.392,79      | 1,05                 |
| Oracle Corp.<br>Registered Shares DL -,01                                 | 871460 |       | STK                                   | 8.200              |                                     | 800                | USD 92,920  | 701.315,29      | 1,26                 |
| Pfizer Inc.<br>Registered Shares DL -,05                                  | 852009 |       | STK                                   | 9.300              | 9.300                               |                    | USD 40,800  | 349.247,55      | 0,63                 |
| Procter & Gamble Co., The<br>Registered Shares o.N.                       | 852062 |       | STK                                   | 4.044              | 44                                  | 400                | USD 148,690 | 553.456,08      | 0,99                 |
| S&P Global Inc.<br>Registered Shares DL 1                                 | A2AHZ7 |       | STK                                   | 1.700              |                                     | 200                | USD 344,770 | 539.471,67      | 0,97                 |
| ServiceNow Inc.<br>Registered Shares DL-,001                              | A1JX4P |       | STK                                   | 600                |                                     | 100                | USD 464,720 | 256.645,04      | 0,46                 |
| SolarEdge Technologies Inc.<br>Registered Shares DL -,0001                | A14QVM |       | STK                                   | 2.300              |                                     | 200                | USD 304,170 | 643.923,79      | 1,16                 |
| Sunnova Energy International I<br>Registered Shares DL -,0001             | A2PNYK |       | STK                                   | 19.400             |                                     | 1.800              | USD 15,620  | 278.915,73      | 0,50                 |
| VISA Inc.<br>Reg. Shares Class A DL -,0001                                | A0NC7B |       | STK                                   | 1.600              |                                     | 200                | USD 225,460 | 332.031,85      | 0,60                 |
| Waste Management Inc.<br>Registered Shares DL -,01                        | 893579 |       | STK                                   | 1.500              |                                     | 100                | USD 163,170 | 225.279,58      | 0,40                 |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |             |                 |                      |
| 4,5000 % A2A S.p.A.<br>EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)                     | A3K9HY |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 100,920   | 302.760,00      | 0,54                 |
| 0,9500 % Adif - Alta Velocidad<br>EO-Medium-Term Notes 2019(27)           | A2R03E |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 91,450    | 457.250,00      | 0,82                 |
| 0,2500 % Agence Française Développement<br>EO-Medium-Term Notes 2016(26)  | A184BH |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 90,810    | 454.050,00      | 0,81                 |
| 1,6250 % Akzo Nobel N.V.<br>EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)                | A28V25 |       | EUR                                   | 350                |                                     |                    | % 85,982    | 300.935,81      | 0,54                 |
| 1,5000 % Akzo Nobel N.V.<br>EO-Med.-Term Notes 2022(22/28)                | A3K3L0 |       | EUR                                   | 200                |                                     |                    | % 90,154    | 180.308,00      | 0,32                 |
| 1,5000 % Amadeus IT Group S.A.<br>EO-Med.-T. Nts 2018(18/26)              | A195RS |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 93,040    | 279.120,00      | 0,50                 |
| 0,1250 % Auckland, Council<br>EO-Medium-Term Notes 2019(29)               | A2R8AW |       | EUR                                   | 500                |                                     | 200                | % 82,163    | 410.813,75      | 0,74                 |
| 3,0000 % AXA Bank Europe SCF<br>EO-Med.-Term Obl.Fonc.2022(26)            | A3LAW1 |       | EUR                                   | 500                | 500                                 |                    | % 98,820    | 494.100,00      | 0,89                 |
| 0,0100 % Baden-Württemberg, Land<br>Landessch.v.2021(2031)                | A14JZS |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 79,370    | 238.110,00      | 0,43                 |
| 0,8750 % Banco Santander Totta S.A.<br>EO-M.-T.Obr.Hipotecárias17(24)     | A19GL2 |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 97,101    | 485.505,00      | 0,87                 |
| 3,2500 % Bank of Nova Scotia, The<br>EO-Med.-T. Cov. Bonds 2023(28)       | A3LC1J |       | EUR                                   | 500                | 500                                 |                    | % 99,160    | 495.800,00      | 0,89                 |
| 1,2080 % Becton Dickinson<br>Euro Fin.Sarl EO-Notes 2019(19/26)           | A2R2UQ |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 92,598    | 277.794,00      | 0,50                 |
| 0,1000 % Belgien, Königreich<br>EO-Bons d'Etat 2020(30)                   | A28SFQ |       | EUR                                   | 1.000              |                                     |                    | % 82,795    | 827.950,00      | 1,49                 |
| 0,8000 % Belgien, Königreich<br>EO-Obl. Lin. 2018(28) Ser. 85             | A19U5T |       | EUR                                   | 500                |                                     | 500                | % 91,140    | 455.700,00      | 0,82                 |
| 0,3750 % BMW Finance N.V.<br>EO-Medium-Term Notes 2019(27)                | A2R76R |       | EUR                                   | 350                |                                     |                    | % 88,950    | 311.325,00      | 0,56                 |
| 3,0000 % BNP Paribas Home Loan SFH<br>EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2023(30)      | BP45YQ |       | EUR                                   | 500                | 500                                 |                    | % 98,888    | 494.440,00      | 0,89                 |
| 4,2500 % Brambles Finance PLC<br>EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)           | A3LFL5 |       | EUR                                   | 300                | 300                                 |                    | % 100,320   | 300.960,00      | 0,54                 |
| 1,1250 % British Telecommunications PLC<br>EO-Med.-Term Notes 2019(19/29) | A2R7MH |       | EUR                                   | 350                |                                     |                    | % 84,778    | 296.723,00      | 0,53                 |
| 0,0000 % Bundesrep.Deutschland<br>Anl.v.2019 (2029)                       | 110247 |       | EUR                                   | 1.000              |                                     | 500                | % 86,673    | 866.730,00      | 1,56                 |

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.03.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs      | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|--------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 2,7500 % Commerzbank AG<br>MTH S.P58 v.22(25)                             | CZ43ZJ |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 98,995  | 296.985,00         | 0,53                         |
| 0,3750 % Commonwealth Bank of Australia<br>EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24) | A19FWG |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 96,716  | 483.580,00         | 0,87                         |
| 0,7500 % Commonwealth Bank of Australia<br>EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(28) | A3K2LY |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 88,240  | 441.200,00         | 0,79                         |
| 0,2500 % Comun. Autónoma del País Vasco<br>EO-Obligaciones 2020(31)       | A28447 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 78,442  | 392.209,55         | 0,70                         |
| 0,3750 % Continental AG<br>MTN v.19(25/25)                                | A2YPAE |       | EUR   | 300                   |   | 100                   | % 93,880  | 281.640,00         | 0,51                         |
| 0,3750 % Dassault Systemes SE<br>EO-Notes 2019(19/29)                     | A2R7Q1 |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 82,997  | 248.991,00         | 0,45                         |
| 0,5000 % De Volksbank N.V.<br>EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 19(26)               | A2RWY9 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 92,270  | 461.350,00         | 0,83                         |
| 1,0000 % Deutsche Post AG<br>Medium Term Notes v.17(27/27)                | A2G8S7 |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 91,460  | 274.380,00         | 0,49                         |
| 0,6250 % DNB Boligkredit A.S.<br>EO-Mortg. Covered MTN 2019(26)           | A2RWAB |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 92,774  | 463.870,00         | 0,83                         |
| 0,2500 % Elisa Oyj<br>EO-Medium-Term Nts 2020(27/27)                      | A282EB |       | EUR   | 200                   |   |                       | % 85,708  | 171.416,00         | 0,31                         |
| 4,0000 % Estland, Republik<br>EO-Bonds 2022(32)                           | A3K98Z |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 102,380 | 307.140,00         | 0,55                         |
| 3,2500 % Hypo Vorarlberg Bank AG<br>EO-M.-T.Hyp.-Pfandbr. 2022(27)        | A3LAH1 |       | EUR   | 200                   | 200                                       |                       | % 99,534  | 199.068,00         | 0,36                         |
| 1,1250 % Infineon Technologies AG<br>Medium Term Notes v.20(20/26)        | A3E44V |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 92,488  | 277.464,00         | 0,50                         |
| 0,0100 % ING-DiBa AG<br>Hyp.-Pfandbrief v.2021(2028)                      | A1KRJV |       | EUR   | 500                   |   | 200                   | % 84,595  | 422.975,35         | 0,76                         |
| 0,2000 % Irland<br>EO-Treasury Bonds 2020(27)                             | A28V33 |       | EUR   | 1.000                 |   | 500                   | % 90,628  | 906.275,00         | 1,63                         |
| 0,0000 % Island, Republik<br>EO-Medium-Term Nts 2021(28)                  | A3KLAX |       | EUR   | 1.500                 |   |                       | % 83,370  | 1.250.550,00       | 2,24                         |
| 0,0000 % Italgas S.P.A.<br>EO-Medium-Term Notes 2021(28)                  | A3KLRN |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 83,740  | 251.220,00         | 0,45                         |
| 0,7500 % Kering S.A.<br>EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)                    | A28W3X |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 88,339  | 265.015,59         | 0,48                         |
| 1,6250 % KION GROUP AG<br>Med.Term.Notes v.20(20/25)                      | A289QY |       | EUR   | 200                   |   |                       | % 91,600  | 183.200,00         | 0,33                         |
| 0,7500 % Koninklijke DSM N.V.<br>EO-Medium-Term Nts 2016(16/26)           | A186SF |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 91,560  | 274.680,00         | 0,49                         |
| 0,0000 % La Poste<br>EO-Medium-Term Notes 2021(29)                        | A287PR |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 79,484  | 238.451,57         | 0,43                         |
| 2,7500 % Landesbank Baden-Württemberg<br>MTN Öff.Pfandbr. 22(24)R.832     | LB381U |       | EUR   | 400                   | 400                                       |                       | % 99,190  | 396.760,00         | 0,71                         |
| 2,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ<br>MTN HPF S.H357 v.22(26)                | HLB2QL |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 97,360  | 292.080,00         | 0,52                         |
| 2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH<br>EO-Medium-Term Nts 2020(28/28)      | A28VAZ |       | EUR   | 450                   |   |                       | % 91,769  | 412.960,50         | 0,74                         |
| 0,5530 % National Grid PLC<br>EO-Medium Term Nts 2020(20/29)              | A282LR |       | EUR   | 350                   |   |                       | % 80,634  | 282.219,00         | 0,51                         |
| 3,8750 % Neste Oyj<br>EO-Medium-Term Nts 2023(23/29)                      | A3LFLA |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 101,070 | 303.210,00         | 0,54                         |
| 2,0000 % Nokia Oyj<br>EO-Medium-Term Notes 19(19/26)                      | A2RYXN |       | EUR   | 283                   |   | 217                   | % 94,355  | 267.024,65         | 0,48                         |
| 4,3750 % Nokia Oyj<br>EO-Medium-Term Notes 23(23/31)                      | A3LEFB |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 98,919  | 296.757,00         | 0,53                         |
| 0,7500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V.<br>EO-Med.-Term Notes 2022(22/25) | A3K3U0 |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 95,006  | 285.016,50         | 0,51                         |
| 1,2500 % Orange S.A.<br>EO-Medium-Term Nts 2020(20/27)                    | A28VQT |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 91,150  | 273.450,00         | 0,49                         |

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>31.03.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs      | Kurswert<br>in EUR | %<br>des Fonds-<br>vermögens |
|---|--------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 2,3750 % Orange S.A.<br>EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)                    | A3K5N4 |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 90,572  | 271.717,44         | 0,49                         |
| 1,5000 % Orsted A/S<br>EO-Med.-Term Notes 2017(17/29)                     | A19SNH |       | EUR   | 100                   |   |                       | % 88,180  | 88.179,50          | 0,16                         |
| 3,2500 % Orsted A/S<br>EO-Medium-Term Nts 2022(22/31)                     | A3K88F |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 96,860  | 290.580,00         | 0,52                         |
| 0,4750 % Portugal, Republik<br>EO-Obr. 2020(30)                           | A28R4W |       | EUR   | 500                   |   | 500                   | % 83,170  | 415.850,00         | 0,75                         |
| 0,3750 % Red Eléctrica Financ. S.A.U.<br>EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)   | A28R5E |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 87,324  | 261.973,43         | 0,47                         |
| 0,5000 % REN Finance B.V.<br>EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)               | A3KPNA |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 84,093  | 252.278,59         | 0,45                         |
| 0,6250 % Royal Bank of Canada<br>EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2022(26)           | A3K3MC |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 92,145  | 276.435,00         | 0,50                         |
| 0,0500 % Santander UK PLC<br>EO-Med.-Term Cov. Bds 2020(27)               | A28R4R |       | EUR   | 300                   |   | 200                   | % 88,295  | 264.885,00         | 0,48                         |
| 1,1250 % Santander UK PLC<br>EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(27)               | A3K374 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 91,685  | 458.425,00         | 0,82                         |
| 1,5000 % Schneider Electric SE<br>EO-Med.-Term Notes 2019(19/28)          | A2RWFV |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 92,836  | 278.508,00         | 0,50                         |
| 3,2500 % Schneider Electric SE<br>EO-Med.-Term Notes 2022(22/27)          | A3LA5M |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 99,855  | 299.565,00         | 0,54                         |
| 3,1250 % Schneider Electric SE<br>EO-Med.-Term Notes 2023(23/29)          | A3LC3G |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 99,351  | 298.053,00         | 0,53                         |
| 3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV<br>EO-Med.-Term Nts 2023(31/31)    | A3LEFR |       | EUR   | 500                   | 500                                       |                       | % 100,295 | 501.475,00         | 0,90                         |
| 0,0100 % Société Générale SFH S.A.<br>EO-M.-T.Obl.Fin.Hab. 2020(30)       | A28S36 |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 80,270  | 401.350,00         | 0,72                         |
| 1,6000 % Spanien<br>EO-Bonos 2015(25)                                     | A1ZVCP |       | EUR   | 800                   |   | 700                   | % 97,530  | 780.240,00         | 1,40                         |
| 2,8750 % Statkraft AS<br>EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)                   | A3K880 |       | EUR   | 200                   | 100                                       |                       | % 97,669  | 195.338,00         | 0,35                         |
| 2,5000 % Telecom Italia S.p.A.<br>EO-Medium-Term Notes 2017(23)           | A19BX5 |       | EUR   | 200                   |   | 300                   | % 99,500  | 199.000,00         | 0,36                         |
| 2,1250 % TenneT Holding B.V.<br>EO-Med.-Term Notes 2022(22/29)            | A3K48Y |       | EUR   | 200                   |   | 300                   | % 93,890  | 187.780,00         | 0,34                         |
| 0,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA<br>EO-Medium-Term Nts 2020(30/30) | A282XN |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 77,883  | 233.649,00         | 0,42                         |
| 1,5000 % UniCredit Bank Austria AG<br>EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2022(28)      | A3K5WE |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 91,865  | 459.325,00         | 0,82                         |
| 3,0000 % UniCredit Bank Austria AG<br>EO-Med.-T.Hyp.Pf.-Br. 2023(26)      | A3LC5A |       | EUR   | 300                   | 300                                       |                       | % 98,870  | 296.610,00         | 0,53                         |
| 1,6250 % Valéo S.E.<br>EO-Med.-Term Nts 2016(16/26)                       | A18Y75 |       | EUR   | 200                   |   |                       | % 92,110  | 184.220,00         | 0,33                         |
| 5,3750 % Valéo S.E.<br>EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)                     | A3LBTB |       | EUR   | 200                   | 200                                       |                       | % 99,850  | 199.700,00         | 0,36                         |
| 0,2500 % Wallonne, Région<br>EO-Medium-Term Notes 2019(26)                | A2R1LF |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 91,490  | 457.450,00         | 0,82                         |
| 2,7500 % Wienerberger AG<br>EO-Schuldv. 2020(20/25)                       | A28XZ9 |       | EUR   | 300                   |   |                       | % 96,960  | 290.879,06         | 0,52                         |
| 3,0000 % ZF Finance GmbH<br>MTN v.2020(2020/2025)                         | A289EU |       | EUR   | 500                   |   |                       | % 94,625  | 473.125,00         | 0,85                         |

### Sonstige Beteiligungswertpapiere

|   |        |  |     |       |       |       |             |            |      |
|---|--------|--|-----|-------|-------|-------|-------------|------------|------|
| Roche Holding AG<br>Inhaber-Genußscheine o.N. | 855167 |  | STK | 2.200 | 5.000 | 5.200 | CHF 260,950 | 578.428,21 | 1,04 |
|---|--------|--|-----|-------|-------|-------|-------------|------------|------|

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs       | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens |
|---|--------|-------|---------------------------------------|--------------------|-------------------------------------|--------------------|------------|----------------------|----------------------|
| <b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>       |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>2.678.657,24</b>  | <b>4,81</b>          |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| 0,6250 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2020(20/29)   | A28WUX |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 85,503   | 256.509,00           | 0,46                 |
| 2,2500 % ASML Holding N.V. EO-Notes 2022(22/32)   | A3K5LQ |       | EUR                                   | 400                |                                     |                    | % 92,419   | 369.677,86           | 0,66                 |
| 3,4370 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2023(25)                  | A3LF4D |       | EUR                                   | 400                | 400                                 |                    | % 99,768   | 399.072,00           | 0,72                 |
| 3,5000 % Getlink SE EO-Notes 2020(20/25) Reg.S  | A284GU |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 96,909   | 290.726,78           | 0,52                 |
| 4,3750 % Rentokil Initial Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)                   | A3K6U4 |       | EUR                                   | 500                |                                     |                    | % 101,120  | 505.600,00           | 0,91                 |
| 0,8750 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/26)                            | A2R2KE |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 91,589   | 274.767,00           | 0,49                 |
| 2,8750 % Smurfit Kappa Acquis. Unl. Co. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S                      | A192ZF |       | EUR                                   | 300                |                                     |                    | % 96,553   | 289.659,00           | 0,52                 |
| 1,0000 % Telstra Corp. Ltd. EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)                              | A28WEQ |       | EUR                                   | 350                |                                     |                    | % 83,613   | 292.645,60           | 0,53                 |
| <b>Nicht notierte Wertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>300.288,00</b>    | <b>0,54</b>          |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| 3,3750 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2023(23/25)                           | A3LF6Q |       | EUR                                   | 300                | 300                                 |                    | % 100,096  | 300.288,00           | 0,54                 |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>55.583.438,74</b> | <b>99,76</b>         |
| <b>Derivate</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>-261.658,54</b>   | <b>-0,47</b>         |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| <b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>-96.433,54</b>    | <b>-0,17</b>         |
| <b>Wertpapier-Optionsrechte</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| Forderungen/Verbindlichkeiten   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| <b>Optionsrechte auf Aktien</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| Call Muenchener Rueckversicher 300 21.04.23 K100  | 185    |       | STK                                   | -2.900             |                                     |                    | EUR 24,420 | -70.818,00           | -0,13                |
| Call SolarEdge Technologies Inc 310 21.04.23  | 361    |       | STK                                   | -2.300             |                                     |                    | USD 12,100 | -25.615,54           | -0,05                |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>   |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>-171.825,00</b>   | <b>-0,31</b>         |
| Forderungen/Verbindlichkeiten   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| DAX Index Future 16.06.23   | 185    |       | EUR                                   | Anzahl -13         |                                     |                    |            | -171.825,00          | -0,31                |
| <b>Zins-Derivate</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    | <b>EUR</b> | <b>6.600,00</b>      | <b>0,01</b>          |
| Forderungen/Verbindlichkeiten   |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>  |        |       |                                       |                    |                                     |                    |            |                      |                      |
| Bobl Future 08.06.23  | 185    |       | EUR                                   | -1.000             |                                     |                    |            | 6.600,00             | 0,01                 |

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

| Gattungsbezeichnung   | WKN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2023 | Käufe / Zugänge / Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs      | Kurswert in EUR      | % des Fondsvermögens        |
|---|-----|-------|---------------------------------------|--------------------|--|-----------|----------------------|-----------------------------|
| <b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b> |     |       |                                       |                    |  | EUR       | 205.030,64           | 0,37                        |
| <b>Bankguthaben</b>   |     |       |                                       |                    |  | EUR       | 205.030,64           | 0,37                        |
| <b>EUR-Guthaben bei:</b>  |     |       |                                       |                    |  |           |                      |                             |
| Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)                                      |     |       | EUR                                   | 165.603,54         |  | % 100,000 | 165.603,54           | 0,30                        |
| <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>                                 |     |       |                                       |                    |  |           |                      |                             |
|   |     |       | DKK                                   | 73.748,88          |  | % 100,000 | 9.900,11             | 0,02                        |
|   |     |       | NOK                                   | 2.949,28           |  | % 100,000 | 259,20               | 0,00                        |
|   |     |       | SEK                                   | 92.541,05          |  | % 100,000 | 8.214,19             | 0,01                        |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                                     |     |       |                                       |                    |  |           |                      |                             |
|   |     |       | CHF                                   | 54,54              |  | % 100,000 | 54,95                | 0,00                        |
|   |     |       | GBP                                   | 10.022,07          |  | % 100,000 | 11.405,57            | 0,02                        |
|   |     |       | JPY                                   | 20.356,00          |  | % 100,000 | 140,78               | 0,00                        |
|   |     |       | USD                                   | 10.269,45          |  | % 100,000 | 9.452,30             | 0,02                        |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>  |     |       |                                       |                    |  | EUR       | 243.759,51           | 0,44                        |
| Zinsansprüche   |     |       | EUR                                   | 211.867,27         |  |           | 211.867,27           | 0,38                        |
| Dividendenansprüche   |     |       | EUR                                   | 31.892,24          |  |           | 31.892,24            | 0,06                        |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten <sup>*)</sup></b>                               |     |       | EUR                                   | -55.743,91         |  |           | -55.743,91           | -0,10                       |
| <b>Fondsvermögen</b>  |     |       |                                       |                    |  | EUR       | <u>55.714.826,44</u> | <u>100,00 <sup>1)</sup></u> |
| <b>Anteilwert</b>   |     |       |                                       |                    |  | EUR       | 47,58                |                             |
| <b>Umlaufende Anteile</b>   |     |       |                                       |                    |  | STK       | 1.171.007            |                             |

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

### Fußnoten:

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

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz)

|                    |       | per 31.03.2023 |   |              |
|--------------------|-------|----------------|---|--------------|
| Canadische Dollar  | (CAD) | 1,4703500      | = | 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken  | (CHF) | 0,9925000      | = | 1 Euro (EUR) |
| Dänische Kronen    | (DKK) | 7,4493000      | = | 1 Euro (EUR) |
| Britische Pfund    | (GBP) | 0,8787000      | = | 1 Euro (EUR) |
| Japanische Yen     | (JPY) | 144,5956000    | = | 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Kronen | (NOK) | 11,3785000     | = | 1 Euro (EUR) |
| Schwedische Kronen | (SEK) | 11,2660000     | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar          | (USD) | 1,0864500      | = | 1 Euro (EUR) |

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

|     |                         |
|-----|-------------------------|
| 185 | Eurex Deutschland       |
| 361 | Chicago - CBOE Opt. Ex. |



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

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

| Gattungsbezeichnung   | WKN    | Stück bzw. Anteile<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|---|--------|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>                                   |        |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Aktien</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)EO-,12                             | A0JL2Y | STK                                 | 5.300                    | 77.400                      |                     |
| Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33                                   | A14TVM | STK                                 |                          | 400                         |                     |
| Capgemini SE Actions Port. EO 8                                       | 869858 | STK                                 |                          | 2.100                       |                     |
| Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.                                    | CBK100 | STK                                 |                          | 81.200                      |                     |
| Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.                                       | 606214 | STK                                 | 7.400                    | 7.400                       |                     |
| Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.                                   | 555200 | STK                                 |                          | 2.200                       |                     |
| EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5                               | A0Q249 | STK                                 |                          | 11.800                      |                     |
| ENCAVIS AG Inhaber-Aktien o.N.  | 609500 | STK                                 | 100.000                  | 110.300                     |                     |
| Goodyear Tire & Rubber Co.,The Registered Shares o.N.                 | 851204 | STK                                 |                          | 14.600                      |                     |
| GSK PLC Registered Shares LS-,3125                                    | A3DMB5 | STK                                 | 450                      | 21.150                      |                     |
| Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.                           | 623100 | STK                                 |                          | 13.900                      |                     |
| ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -,01                               | A2ANV3 | STK                                 | 23.000                   | 23.000                      |                     |
| Intel Corp. Registered Shares DL -,001                                | 855681 | STK                                 |                          | 15.000                      |                     |
| KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N.                              | 854943 | STK                                 | 50                       | 3.150                       |                     |
| Koninklijke DSM N.V. Aandelen op naam EO 1,50                         | A0JLZ7 | STK                                 |                          | 800                         |                     |
| LANXESS AG Inhaber-Aktien o.N.  | 547040 | STK                                 |                          | 2.000                       |                     |
| ON Semiconductor Corp. Registered Shares DL -,01                      | 930124 | STK                                 |                          | 6.000                       |                     |
| Sanofi S.A. Actions Port. EO 2  | 920657 | STK                                 | 50.000                   | 50.000                      |                     |
| SIG Group AG Namens-Aktien SF-,01                                     | A2N5NU | STK                                 |                          | 6.200                       |                     |
| Sunrun Inc. Registered Shares DL -,0001                               | A14V1T | STK                                 |                          | 6.200                       |                     |
| V.F. Corp. Registered Shares o.N.                                     | 857621 | STK                                 | 3.000                    | 3.000                       |                     |
| Vonovia SE Namens-Aktien o.N.   | A1ML7J | STK                                 |                          | 16.500                      |                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                       |        |                                     |                          |                             |                     |
| 0,5000 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2018(25)           | A19ZB1 | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| 0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 21(27)       | A3KZ6V | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| 0,0000 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. EO-Medium-Term Notes 2021(29) | A3KNEU | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| 0,0100 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 2021(26)        | A3KZKN | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| 0,1250 % Telia Company AB EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)              | A285RF | EUR                                 |                          | 350                         |                     |
| 0,6640 % Veolia Environnement S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/31)       | A28R4L | EUR                                 |                          | 300                         |                     |
| 1,0000 % Veolia Environnement S.A. EO-Medium-T. Notes 2017(17/25)     | A19FLC | EUR                                 |                          | 300                         |                     |
| 0,0000 % VINCI S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)                    | A285JA | EUR                                 |                          | 400                         |                     |
| <b>Nicht notierte Wertpapiere</b>                                     |        |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Aktien</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| Linde PLC Registered Shares EO 0,001                                  | A2DSYC | STK                                 |                          | 850                         |                     |
| <b>Verzinsliche Wertpapiere</b>                                       |        |                                     |                          |                             |                     |
| 1,0000 % Caixabank S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2016(23)                  | A18XK5 | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| 1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Mortg.Cov.MTN 2015(23)             | A1Z9GA | EUR                                 |                          | 500                         |                     |
| <b>Andere Wertpapiere</b>   |        |                                     |                          |                             |                     |
| Meyer Burger Technology AG Anrechte                                   | A3DXTP | STK                                 | 980.000                  | 980.000                     |                     |

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

| Gattungsbezeichnung   | WKN | Stück bzw. Anteile<br>Whg. in 1.000 | Käufe<br>bzw.<br>Zugänge | Verkäufe<br>bzw.<br>Abgänge | Volumen<br>in 1.000 |
|---|-----|-------------------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------------|
| <b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte,<br/>bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>          |     |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Terminkontrakte</b>  |     |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>  |     |                                     |                          |                             |                     |
| Verkaufte Kontrakte:  |     |                                     |                          |                             |                     |
| (Basiswert(e): DAX PERFORMANCE-INDEX)   |     |                                     |                          |                             | EUR 17.799,19       |
| <b>Zinsterminkontrakte</b>  |     |                                     |                          |                             |                     |
| Verkaufte Kontrakte:  |     |                                     |                          |                             |                     |
| (Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUND)  |     |                                     |                          |                             | EUR 16.462,29       |
| <b>Optionsrechte</b>  |     |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Wertpapier-Optionsrechte</b>   |     |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktien</b>   |     |                                     |                          |                             |                     |
| Verkaufte Kaufoptionen (Call):  |     |                                     |                          |                             |                     |
| (Basiswert(e): INTEL CORP. DL-,001, KONINKL. PHILIPS EO -,20, MUENCH.RUECKVERS.VNA O.N.,<br>ON SEMICOND. DL-,01, SOLAREEDGE TECHN. DL-,0001, SUNNOVA ENERGY INT.-,0001) |     |                                     |                          |                             | EUR 682,65          |
| Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):   |     |                                     |                          |                             |                     |
| (Basiswert(e): KION GROUP AG, KONINKL. PHILIPS EO -,20, STANLEY BL. + DECK.DL2,50)  |     |                                     |                          |                             | EUR 217,09          |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>   |     |                                     |                          |                             |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>  |     |                                     |                          |                             |                     |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):  |     |                                     |                          |                             |                     |
| (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR)  |     |                                     |                          |                             | EUR 93,17           |

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

|                    |     |           |
|--------------------|-----|-----------|
| Anteilwert         | EUR | 47,58     |
| Umlaufende Anteile | STK | 1.171.007 |

### 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 3. April 2023

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH









**LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH**

Postfach 1003 51  
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)