

**LB≡BW Asset Management**

**LBBW Geldmarktfonds**

**Halbjahresbericht zum 31.07.2024**



# Inhalt

Vermögensübersicht zum 31.07.2024	8
Vermögensaufstellung zum 31.07.2024	9
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	17
Übersicht Anteilklassen	19
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	20



**Liebe Anlegerin, lieber Anleger,**

der vorliegende Halbjahresbericht gibt Ihnen einen Einblick in die Situation Ihres Fonds innerhalb des Berichtszeitraums. Sollten Sie ausführlichere Erläuterungen oder weiter gehende Auskünfte wünschen, wenden Sie sich bitte an Ihren Berater.

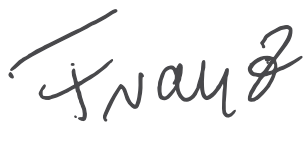

Auf unserer Internetseite informieren wir Sie darüber hinaus regelmäßig über die Entwicklung des Fonds. Auf [www.LBBW-AM.de](http://www.LBBW-AM.de) finden Sie die aktuellen Fondspreise, umfangreiche Angaben zur Wertentwicklung, die Portfolio-Struktur sowie viele weitere Fakten.

Außerdem stehen Ihnen hier die jeweils aktuellen Basisinformationsblätter, Verkaufsprospekte sowie die Jahres- und Halbjahresberichte als PDF-Dateien zum Download zur Verfügung.

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

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH  
Geschäftsführung



Uwe Adamla  
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz  
(Stellv. Vorsitzender)



Michael Hünseler



# LBBW Geldmarktfonds

## Halbjahresbericht zum 31.07.2024

## Vermögensübersicht zum 31.07.2024

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>461.260.896,13</b>	<b>100,03</b>
<b>1. Anleihen</b>	<b>416.304.527,96</b>	<b>90,28</b>
Bundesrep. Deutschland	92.913.851,21	20,15
Frankreich	53.307.927,50	11,56
Niederlande	52.680.584,00	11,42
USA	46.641.914,10	10,11
Canada	42.955.392,00	9,31
Großbritannien	26.690.326,00	5,79
Australien	16.010.145,00	3,47
Irland	13.820.580,00	3,00
andere Instit. der EU	9.826.677,00	2,13
Belgien	9.731.985,00	2,11
Schweden	7.430.780,00	1,61
Österreich	7.137.860,00	1,55
Schweiz	5.006.450,00	1,09
Europ. Investitionsbank	4.916.800,00	1,07
Dänemark	4.409.685,00	0,96
Neuseeland	3.959.456,15	0,86
Norwegen	3.935.600,00	0,85
Spanien	3.919.660,00	0,85
Italien	3.078.965,00	0,67
Finnland	2.975.070,00	0,65
EFSF	1.987.680,00	0,43
Luxemburg	1.980.100,00	0,43
Polen	987.040,00	0,21
<b>2. Bankguthaben</b>	<b>42.935.017,28</b>	<b>9,31</b>
<b>3. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>2.021.350,89</b>	<b>0,44</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-116.983,91</b>	<b>-0,03</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>461.143.912,22</b>	<b>100,00</b>



# Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bestandspositionen</b>							<b>EUR</b>	<b>416.304.527,96</b>	<b>90,28</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>372.163.442,96</b>	<b>80,70</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
4,0490 % ABN AMRO Bank N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LCKY		EUR	9.000			% 100,123	9.011.070,00	1,95
0,0000 % adidas AG Anleihe v.2020(2020/2024)	A3H2X0		EUR	4.700	4.700		% 99,530	4.677.910,00	1,01
1,0000 % Air Liquide Finance EO-Med.-Term Nts 2020(20/25)	A28VK0		EUR	3.000	3.000		% 98,289	2.948.670,00	0,64
0,6250 % ASB Bank Ltd. EO-Med.T. Mtg Cov. Nts 17(24)	A19QN3		EUR	3.985	200		% 99,359	3.959.456,15	0,86
3,2050 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(24)	A3LA60		EUR	4.600	2.000		% 99,870	4.594.020,00	1,00
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 2022(25)	A3K3DG		EUR	4.000	4.000		% 98,080	3.923.200,00	0,85
0,5000 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2018(25)	A19ZB1		EUR	2.000	2.000		% 97,960	1.959.200,00	0,42
0,1250 % AXA Bank Europe SCF EO-Med.-Term Obl.Fonc.2020(24)	A28UWD		EUR	700	700		% 99,420	695.940,00	0,15
4,2220 % Bank of Montreal EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LJHW		EUR	5.000			% 100,180	5.009.000,00	1,09
4,2000 % Bank of Nova Scotia, The EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LNLJ		EUR	2.000			% 100,352	2.007.040,00	0,44
4,2650 % Bank of Nova Scotia, The EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LG8E		EUR	3.000			% 100,210	3.006.300,00	0,65
0,5000 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 18(25)	A19U1C		EUR	2.000	2.000		% 98,635	1.972.700,00	0,43
0,0100 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 20(25)	A28U40		EUR	1.100	1.100		% 97,890	1.076.790,00	0,23
3,0500 % Bank of Nova Scotia, The EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 22(24)	A3LAWQ		EUR	1.500	500	4.000	% 99,842	1.497.630,00	0,32
4,2060 % Bayerische Landesbank FLR-MTN-Inh.Schv. v.24(26)	BLB9V0		EUR	2.000			% 100,081	2.001.620,00	0,43
1,2500 % Berlin Hyp AG Inh.-Schv.Ser.109 v.15(25)	BHY0A5		EUR	2.000	2.000		% 98,760	1.975.200,00	0,43
4,1860 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2026)A.516	A2NB9X		EUR	1.500	1.500		% 101,000	1.515.000,00	0,33
0,0000 % Berlin, Land Landessch.v.2016(2024)Ausg.489	A16803		EUR	3.000	3.000		% 98,750	2.962.500,00	0,64
3,9080 % BMW Finance N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LK2T		EUR	5.000			% 100,050	5.002.500,00	1,08
0,5000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(25)	A3K2JU		EUR	1.000	1.000		% 98,230	982.300,00	0,21
3,5000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(24)	A3LGRW		EUR	3.400			% 99,894	3.396.396,00	0,74
0,5000 % BNP Paribas Fortis S.A. EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 17(24)	A19E2Z		EUR	2.100			% 99,685	2.093.385,00	0,45
0,3750 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2015(25)	BP459C		EUR	100	100		% 97,750	97.750,00	0,02
2,3750 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2014(14/24)	A1ZP1W		EUR	3.000	3.000		% 99,790	2.993.700,00	0,65
1,9530 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2016(25)	A18YPQ		EUR	4.000	4.000		% 99,390	3.975.600,00	0,86

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,0000 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(25)	A1ZSQE		EUR	1.000	1.000		% 98,650	986.500,00	0,21
0,1250 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2020(25)	A28U94		EUR	200	200		% 97,880	195.760,00	0,04
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24)	114180		EUR	2.000	2.000		% 99,285	1.985.700,00	0,43
0,3750 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2016(25)	A183D5		EUR	800	800		% 97,456	779.648,00	0,17
4,2550 % Canadian Imperial Bk of Comm. EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LJNY		EUR	6.000			% 100,243	6.014.580,00	1,30
1,0000 % Capgemini SE EO-Notes 2018(18/24)	A19YYV		EUR	2.100	2.100		% 99,390	2.087.179,50	0,45
0,3750 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2017(24)	A19NVF		EUR	300	300		% 98,880	296.640,00	0,06
0,7500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Fonc.2015(25)	A1ZUZD		EUR	200	200		% 98,787	197.574,00	0,04
1,1250 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Foncières 15(25)	A1Z28H		EUR	1.000	1.000		% 98,182	981.820,00	0,21
1,7500 % Citigroup Inc. EO-Notes 2015(25)	A1ZVDS		EUR	2.000			% 99,060	1.981.200,00	0,43
1,8750 % Coca Cola HBC Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(24)	A18YV1		EUR	1.000	1.000		% 99,460	994.600,00	0,22
1,0000 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2017(25)	A19EF4		EUR	1.000	1.000		% 98,428	984.280,00	0,21
0,5000 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(25)	A19CL7		EUR	1.000	1.000		% 98,110	981.100,00	0,21
0,1250 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2020(24)	A28VN5		EUR	4.000	2.000		% 98,740	3.949.600,00	0,86
0,2500 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2016(24)	A187HN		EUR	1.600	1.600		% 99,430	1.590.880,00	0,34
1,1250 % Credit Agricole Italia S.p.A. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(25)	A19EUZ		EUR	500	500		% 98,423	492.115,00	0,11
4,0720 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Pref Med.-T. Nts 23(25)	A3LE13		EUR	5.000			% 100,230	5.011.500,00	1,09
0,1250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2020(25)	A28VTL		EUR	5.000	5.000		% 97,887	4.894.350,00	1,06
0,7090 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/24)	A188JH		EUR	2.800	2.800		% 99,236	2.778.608,00	0,60
1,0000 % Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/25)	A19YD7		EUR	2.000	2.000		% 98,338	1.966.760,00	0,43
0,0100 % De Volksbank N.V. EO-Preferred MTN 2019(24)	A2R7SB		EUR	7.000			% 99,510	6.965.700,00	1,51
4,2080 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.23(25)	A351VE		EUR	8.000			% 100,252	8.020.160,00	1,74
4,3350 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.24(26)	A3826Q		EUR	2.200			% 100,350	2.207.700,00	0,48
0,8750 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2019(25)	A2RWDY		EUR	1.000	1.000		% 98,720	987.200,00	0,21
0,7500 % Deutsche Kreditbank AG Inh.-Schv. v.2017(2024)	GRN001		EUR	8.000	8.000		% 99,360	7.948.800,00	1,72
4,0170 % Diageo Finance PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2024(24/26)	A3LOBL		EUR	2.000	2.000		% 99,960	1.999.200,00	0,43

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
1,0000 % Diageo Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2018(25/25)	A2RS8W		EUR	3.800	3.800		% 98,180	3.730.840,00	0,81
0,3750 % DNB Boligkreditt A.S. EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(24)	A19SAM		EUR	2.000			% 99,050	1.981.000,00	0,43
0,6250 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 2018(25)	A19192		EUR	2.000	2.000		% 97,730	1.954.600,00	0,42
4,0250 % DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. FLR-MTN-IHS A.2578 v.24(26)	DJ9AJP		EUR	500	500		% 99,916	499.580,00	0,11
1,1250 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.356 14(24) [WL]	A12UGG		EUR	3.600	3.600		% 99,670	3.588.120,00	0,78
0,3750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.377 16(25) [WL]	A2AASB		EUR	500	500		% 97,447	487.235,00	0,11
0,6250 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2016(24)	A186GR		EUR	1.000	1.000		% 99,597	995.970,00	0,22
0,7500 % Erste Group Bank AG EO-Med.-T. Hyp.Pfandb.2015(25)	EBOJE5		EUR	3.000	3.000		% 98,570	2.957.100,00	0,64
0,3750 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) EO-Medium-Term Notes 2017(24)	A1G0DQ		EUR	2.000	2.000		% 99,384	1.987.680,00	0,43
Europäische Union EO-Bills Tr. 10.1.2025	A3LOVR		EUR	5.000	5.000		% 98,479	4.923.957,00	1,07
Europäische Union EO-Bills Tr. 6.12.2024	A3K4EZ		EUR	1.000	1.000		% 98,776	987.760,00	0,21
0,8000 % Europäische Union EO-Med.-Term Nts 2022(25)	A3K4DJ		EUR	4.000	4.000		% 97,874	3.914.960,00	0,85
0,0000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A28TN8		EUR	5.000	5.000		% 98,336	4.916.800,00	1,07
2,1250 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Med.-Term Nts 2014(24)	A1ZQNR		EUR	3.500	500		% 99,722	3.490.270,00	0,76
1,2500 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2016(24/25)	A18791		EUR	500	500		% 98,335	491.675,00	0,11
3,3750 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2020(25)	A28VAL		EUR	5.000	5.000		% 99,846	4.992.300,00	1,08
3,8750 % Heineken N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(24)	A3LFK7		EUR	6.300	6.300		% 99,770	6.285.510,00	1,36
0,5000 % Hessen, Land Schatzanw. S.1509 v.2015(2025)	A1RQCL		EUR	2.000	2.000		% 98,430	1.968.600,00	0,43
4,1550 % HSBC Bank PLC EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LE4U		EUR	5.000			% 100,170	5.008.500,00	1,09
0,8750 % HSBC Holdings PLC EO-Medium-Term Notes 2016(24)	A185SK		EUR	2.600	2.600		% 99,711	2.592.486,00	0,56
0,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	A28VN1		EUR	1.000	1.000		% 97,760	977.600,00	0,21
0,6250 % ING Belgium SA/NV EO-Med.-T.Mortg.Cov.Bds 18(25)	A191ER		EUR	1.800	1.800		% 97,810	1.760.580,00	0,38
1,1250 % ING Groep N.V. EO-Med.-Term Nts 2018(25)	A19WCF		EUR	1.000	1.000		% 98,640	986.400,00	0,21
0,9500 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2017(17/25)	A19HWW		EUR	2.500	2.500		% 97,955	2.448.875,00	0,53
0,8750 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2019(19/25)	A2RW4Q		EUR	6.000	6.000		% 98,660	5.919.600,00	1,28
0,0100 % Investitionsbank Berlin Inh.-Schw.Ser.206 v.20(25)	A2YN03		EUR	4.000	4.000		% 97,390	3.895.600,00	0,84

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,5000 % JPMorgan Chase & Co. EO-Medium-Term Notes 2015(25)	JPM4DR		EUR	2.200	2.200		% 98,989	2.177.759,10	0,47
0,3750 % Jyske Realkredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2019(25)	A2RY29		EUR	4.500	4.500		% 97,993	4.409.685,00	0,96
0,6250 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(25)	A2R0KC		EUR	6.000	6.000		% 97,967	5.878.020,00	1,27
0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl.v.2017 (2024)	A2DAJ5		EUR	3.400	2.000		% 99,398	3.379.532,00	0,73
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.20(25)	A254PM		EUR	4.000	4.000		% 98,191	3.927.640,00	0,85
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.21(24)	A3E5XK		EUR	2.000	2.000		% 99,007	1.980.140,00	0,43
1,6130 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.22(24)	A30VM4		EUR	2.000	2.000		% 99,708	1.994.160,00	0,43
3,1250 % L'Oréal S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/25)	A3LHYB		EUR	2.700	2.700		% 99,640	2.690.280,00	0,58
4,3480 % Lb.Hessen-Thüringen GZ FLR-MTN IHS S. H370 v.23(26)	HLB2QZ		EUR	1.000			% 100,057	1.000.570,00	0,22
0,0100 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H342 v.20(25)	HLB2P5		EUR	4.000	4.000		% 98,411	3.936.440,00	0,85
0,6250 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	A19X75		EUR	7.000	7.000		% 98,210	6.874.700,00	1,49
3,9220 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LNY1		EUR	1.000			% 100,023	1.000.230,00	0,22
4,1080 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LRS6		EUR	1.600			% 100,280	1.604.480,00	0,35
2,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2020(25)	A289RN		EUR	5.000	5.000		% 99,380	4.969.000,00	1,08
1,7500 % Morgan Stanley EO-Medium-Term Notes 2015(25)	MSOKP6		EUR	5.000	5.000		% 99,096	4.954.800,00	1,07
3,7110 % Münchener Hypothekenbank FLR-MTN HPF R.2035 v.23(25)	MHB487		EUR	900	900		% 99,904	899.136,00	0,19
4,2890 % National Bank of Canada EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LJT3		EUR	7.400			% 100,078	7.405.772,00	1,61
0,7500 % National Bank of Canada EO-Med.-Term Cov. Bds 2018(25)	A19XNT		EUR	1.000	1.000		% 98,390	983.900,00	0,21
4,3120 % NatWest Markets PLC EO-FLR Med.-Term Nts 2024(26)	A3LS0V		EUR	2.500			% 100,360	2.509.000,00	0,54
0,0000 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2020(24/24)	A28W7B		EUR	2.000	2.000		% 99,005	1.980.100,00	0,43
0,2500 % Niederlande EO-Anl. 2015(25)	A1ZY9A		EUR	2.000	2.000		% 97,490	1.949.800,00	0,42
3,9360 % Niedersachsen, Land FLR-Landessch.v.15(25) Aus.584	A161HQ		EUR	1.200			% 100,365	1.204.380,00	0,26
4,0500 % Nordrhein-Westfalen, Land FLR-Landessch.v.14(24) R.1324	NRW0FT		EUR	600			% 100,011	600.066,00	0,13
3,7950 % Nordrhein-Westfalen, Land FLR-Landessch.v.14(24) R.1330	NRW0FZ		EUR	2.200			% 99,990	2.199.780,00	0,48
1,0000 % Nordrhein-Westfalen, Land Landessch.v.14(25) R.1337	NRW0F6		EUR	2.500	2.500		% 98,870	2.471.750,00	0,54
0,0000 % NRW.BANK Inh.-Schv.A.18T v.21(24)	NWB18T		EUR	5.000	5.000		% 98,450	4.922.500,00	1,07

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
0,0000 % OMV AG EO-Medium-Term Notes 2019(25)	A2R4J4		EUR	3.300	3.300		% 97,030	3.201.990,00	0,69
1,0000 % OP-Asuntoluottopankki Oyj EO-Cov. Med.-Term Nts 2014(24)	A1ZSVZ		EUR	3.000			% 99,169	2.975.070,00	0,65
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2021(25)	A3KPSJ		EUR	1.000	1.000		% 97,877	978.770,00	0,21
2,7500 % Philip Morris Internat. Inc. EO-Notes 2013(25)	A1HHM6		EUR	2.470	2.470		% 99,400	2.455.180,00	0,53
2,1250 % PKO Bank Hipoteczny S.A. EO-Mortg. Covered MTN 2022(25)	A3K66R		EUR	1.000	1.000		% 98,704	987.040,00	0,21
0,5000 % Procter & Gamble Co., The EO-Bonds 2017(17/24)	A19RCW		EUR	500	500		% 99,245	496.225,00	0,11
3,6850 % Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2024(2026)	RLP147		EUR	2.000	2.000		% 99,978	1.999.560,00	0,43
4,0920 % Royal Bank of Canada EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LC3W		EUR	3.000			% 100,152	3.004.560,00	0,65
0,1250 % Royal Bank of Canada EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2020(25)	A28U7S		EUR	3.000	3.000		% 98,026	2.940.780,00	0,64
0,7500 % SAP SE Inh.-Schuld.v.2018(2024/2024)	A2TSTE		EUR	5.200	5.200		% 99,038	5.149.976,00	1,12
1,0000 % SAP SE Med.Term Nts. v.2015(25/25)	A14KJF		EUR	409	409		% 98,350	402.251,50	0,09
0,0500 % Schleswig-Holstein, Land Landesschatzanw.v.16(24) A.1	SHFM55		EUR	1.000			% 99,090	990.900,00	0,21
0,3750 % Shell International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2016(25)	A1844R		EUR	2.000	2.000		% 98,300	1.966.000,00	0,43
3,9450 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-FLR Med.-Term Nts 2023(25)	A3LSDY		EUR	2.600			% 100,273	2.607.098,00	0,57
2,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Nts 2022(25/25)	A3K8X0		EUR	5.000	5.000		% 99,190	4.959.500,00	1,08
4,1350 % Société Générale S.A. EO-FLR Pref. MTN 2023(25)	A3LCUW		EUR	7.000			% 100,096	7.006.720,00	1,52
0,7500 % Thermo Fisher Scientific Inc. EO-Notes 2016(16/24)	A18543		EUR	3.000			% 99,651	2.989.530,00	0,65
0,6250 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2018(25)	A191QT		EUR	6.200	6.200		% 97,820	6.064.840,00	1,32
1,7070 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2022(25)	A3K7YF		EUR	2.000	2.000		% 98,575	1.971.500,00	0,43
1,3750 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Notes 2014(25)	A1ZSKG		EUR	4.900	4.900		% 98,852	4.843.748,00	1,05
4,0540 % UBS AG EO-FLR Med.-T. Nts 2024(26)	UK1K6U		EUR	5.000	5.000		% 100,129	5.006.450,00	1,09
0,6250 % Volvo Treasury AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/25)	A3K17E		EUR	4.000	4.000		% 98,392	3.935.680,00	0,85
2,1250 % Volvo Treasury AB EO-Medium-Term Notes 2022(24)	A3K8VU		EUR	3.500	3.500		% 99,860	3.495.100,00	0,76
1,2500 % Vonovia SE EO-Medium-Term Nts 2016(16/24)	A189ZX		EUR	2.000	2.000		% 99,040	1.980.799,71	0,43
0,6250 % Westpac Banking Corp. EO-Medium-Term Nts 2017(24)	A19SM6		EUR	1.000	1.000		% 99,078	990.780,00	0,21
3,4570 % Westpac Banking Corp. EO-Mortg. Cov. MTN 2023(25)	A3LF5D		EUR	6.500	6.500		% 100,033	6.502.145,00	1,41

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>44.141.085,00</b>	<b>9,57</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2021(21/25)	A3KM1G		EUR	6.500	6.500		% 97,940	6.366.100,00	1,38
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/09 f.21.08.24	BU0E08		EUR	2.000	2.000		% 99,820	1.996.400,00	0,43
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/10 f.18.09.24	BU0E09		EUR	1.700	2.000	300	% 99,560	1.692.520,00	0,37
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/12 f.20.11.24	BU0E11		EUR	5.000	8.000	3.000	% 98,998	4.949.900,00	1,07
4,1420 % Deutsche Bahn Finance GmbH FLR-Medium-Term Notes 2017(24)	A2G868		EUR	1.500			% 100,115	1.501.725,00	0,33
0,6970 % Eaton Capital Unlimited Co. EO-Notes 2019(19/25)	A2R2A3		EUR	8.000	8.000		% 97,767	7.821.360,00	1,70
Frankreich EO-Treasury Bills 2023(24)	A4SE7R		EUR	2.000	2.000		% 99,120	1.982.400,00	0,43
Frankreich EO-Treasury Bills 2023(24)	A4SEF7		EUR	2.000	2.000		% 99,670	1.993.400,00	0,43
Frankreich EO-Treasury Bills 2023(24)	A4SEAZ		EUR	3.000	3.000		% 99,950	2.998.500,00	0,65
3,6250 % Linde plc EO-Notes 2023(23/25)	A3LJS5		EUR	6.000	6.000		% 99,987	5.999.220,00	1,30
0,8750 % Nestlé Holdings Inc. EO-Medium-Term Notes 17(17/25)	A19LJV		EUR	5.000	5.000		% 97,694	4.884.700,00	1,06
Spanien EO-Letras d.Tesoro 2024(25)	A4SGB9		EUR	2.000	2.000		% 97,743	1.954.860,00	0,42
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>416.304.527,96</b>	<b>90,28</b>

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>42.935.017,28</b>	<b>9,31</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>42.935.017,28</b>	<b>9,31</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)			EUR	6.935.017,28	%	100,000	6.935.017,28	1,50	
Bayerische Landesbank (München)			EUR	18.000.000,00	%	100,000	18.000.000,00	3,90	
DekaBank Deutsche Girozentrale (Frankfurt)			EUR	18.000.000,00	%	100,000	18.000.000,00	3,90	
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>2.021.350,89</b>	<b>0,44</b>
Zinsansprüche			EUR	2.021.350,89			2.021.350,89	0,44	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten *)</b>							<b>EUR</b>	<b>-116.983,91</b>	<b>-0,03</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>461.143.912,22</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>
<b>LBBW Geldmarktfonds I</b>									
Fondsvermögen					EUR		237.587.314,70	51,52	
Anteilwert					EUR		95,36		
Umlaufende Anteile					STK		2.491.461		
<b>LBBW Geldmarktfonds R</b>									
Fondsvermögen					EUR		223.556.597,52	48,48	
Anteilwert					EUR		48,01		
Umlaufende Anteile					STK		4.656.724		

\*) Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

### Fußnoten:

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

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2024

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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



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

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
2,3750 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	BA0AET	EUR	1.000	6.000	
0,3750 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 2017(24)	A19G8R	EUR		2.500	
5,3750 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-Med.-T.Obl.Foncières 09(24)	A1AJNR	EUR	2.000	2.000	
2,0000 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T.Obl.Foncières 14(24)	A1ZHTB	EUR	1.700	1.700	
1,3750 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2017(23/24)	A19HNC	EUR		5.000	
2,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2014(24)	A1ZNOX	EUR	6.000	6.000	
0,3750 % KNAB N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	A19SHK	EUR	1.500	1.500	
0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN HPF S.H318 v.18(24)	HLB2PD	EUR		900	
4,3420 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. FLR-Med.Term Nts. v.17(24)	A2GSCY	EUR		1.500	
0,2500 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Pref. Med.-T. Nts 2020(25)	A28SDV	EUR		1.000	
4,1780 % Société Générale S.A. EO-FLR Pref. MTN 2024(26)	A3LTFD	EUR		1.500	
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,8750 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(24)	A194DD	EUR		4.000	
5,3750 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 2004(24)	A0BA7Q	EUR	1.000	1.000	
3,2500 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 22(24)	A3LAE3	EUR		6.000	
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,3750 % Aareal Bank AG MTN-HPF.S.219 v.2018(2024)	AAR020	EUR		3.920	
1,3750 % AbbVie Inc. EO-Notes 2016(16/24)	A189FK	EUR		6.000	
0,7500 % ASB Bank Ltd. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2RY52	EUR		3.100	
1,7500 % Belfius Bank S.A. EO-Cov.Med.-Term Nts 2014(24)	A1ZK06	EUR		2.600	
4,6760 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-Term Nts 17(24)	PB1KUK	EUR		2.000	
2,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	BP7TTW	EUR	1.000	1.000	
1,0000 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	A2RWA2	EUR		7.000	
0,3750 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2017(24)	A19DE9	EUR		1.000	
2,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZD0Z	EUR		3.800	
0,0500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 2020(24)	A28V0J	EUR		2.100	
0,0500 % Commerzbank AG MTH S.P15 v.16(24)	CZ40LM	EUR	2.000	2.900	
0,2500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2016(24)	A189DR	EUR		1.800	
2,3750 % Crédit Agricole S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(24)	A1ZJL	EUR		2.000	
1,7500 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2014(24)	A1ZKVP	EUR		2.000	
0,2500 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.2019(24)	A2RW0G	EUR	1.000	1.000	
0,1250 % DekaBank Dt.Girozentrale MTN-OPF.A146 v.19(24)	DK0JTD	EUR		2.600	
0,5000 % Deutsche Bank S.A.E. EO-Cédulas Hipotec. 2018(24)	A195FY	EUR		1.000	
0,5000 % Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15280 v.18(24)	A2GSL	EUR		700	
0,2500 % DNB Bank ASA EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	A2R0GA	EUR		1.000	
0,6250 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1180 15(24) [DG]	A13SWZ	EUR		1.950	
0,2500 % Erste Group Bank AG EO-Med.-T. Hyp.Pfandb.2018(24)	EB0JHL	EUR	1.500	1.500	
Frankreich EO-Treasury Bills 2024(24)	A4SGBL	EUR	1.000	1.000	
0,3750 % Hamburger Sparkasse AG Pfandbr.Ausg.33 v.2017(2024)	A2DAFL	EUR		3.000	
0,0000 % Honeywell International Inc. EO-Notes 2020(20/24)	A28URB	EUR		2.000	
0,2500 % HSBC Continental Europe S.A. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2R2BF	EUR		2.500	

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

Gattungsbezeichnung	WKN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
1,8500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2017(24)	A1V3HR	EUR		5.000	
1,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 2019(24)	A2R0AN	EUR		2.000	
0,6500 % Johnson & Johnson EO-Notes 2016(16/24)	A181MF	EUR	4.000	4.000	
0,3750 % Jyske Realkredit A/S EO-Mortg. Covered MTN 2017(24)	A19NHJ	EUR		3.000	
4,6230 % KBC Groep N.V. EO-FLR Nts 2022(24/25) Reg.S	A3K2JC	EUR		6.000	
0,2500 % Lloyds Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 2019(24)	A2RZQD	EUR		4.850	
1,5000 % Mondi Finance PLC EO-Med.-Term Notes 2016(24/24)	A18Z22	EUR	2.400	2.400	
0,2500 % National Australia Bank Ltd. EO-Medium-Term Nts 2019(24)	A2R2B6	EUR		2.000	
4,7180 % National Bank of Canada EO-FLR Med.-Term Nts 2022(24)	A3K1TG	EUR		2.000	
0,5000 % National Westminster Bank PLC EO-Medium-Term Notes 2017(24)	A19HJY	EUR		6.300	
0,5000 % Nationwide Building Society EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2017(24)	A19DPP	EUR		600	
0,0500 % Nationwide Building Society EO-M.-T.Mortg.Cov.Bds 2019(24)	A2R2XY	EUR		2.100	
0,2500 % Niedersachsen, Land Landessch.v.17(24) Ausg.869	A2DAJD	EUR		1.000	
0,1250 % OP Yrityspankki Oyj EO-Preferred Med.-T.Nts 20(24)	A28Y5W	EUR		7.050	
1,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24)	A2RWEV	EUR	2.000	7.000	
0,2500 % Royal Bank of Canada EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2R1KJ	EUR		4.000	
0,8750 % THALES S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/24)	A19ZHH	EUR		3.500	
0,5000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2017(24)	A19FF9	EUR	1.000	4.500	
0,0000 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Med.-Term Cov.Bds 2019(24)	A2R0KB	EUR		1.500	
0,2500 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 2019(24)	A2ROC8	EUR		3.000	
0,0000 % Volvo Treasury AB EO-Med.-Term Notes 2021(21/24)	A3KYQF	EUR	2.000	2.000	

## Übersicht Anteilklassen

Anteilklasse	Ertrags- verwendung	Ausgabeaufschlag in %		Verwaltungsvergütung in % p. a.		Mindest- anlage- summe EUR	Fonds- währung
		Bis-zu- Satz	tatsächl. Satz	Bis-zu- Satz	tatsächl. Satz		
Anteilklasse I	ausschüttend	0,00	0,00	0,90	0,18	75.000	EUR
Anteilklasse R	ausschüttend	0,00	0,00	0,90	0,45	---	EUR

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

#### LBBW Geldmarktfonds I

Anteilwert	EUR	95,36
Umlaufende Anteile	STK	2.491.461

#### LBBW Geldmarktfonds R

Anteilwert	EUR	48,01
Umlaufende Anteile	STK	4.656.724

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Verantwortung für die Anteilwertermittlung obliegt der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH (im Folgenden: Gesellschaft) unter Kontrolle der Verwahrstelle auf Grundlage der gesetzlichen Regelungen im Kapitalanlagegesetzbuch und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände wird von der Gesellschaft selbst durchgeführt. Unter Vermögensgegenständen versteht die Gesellschaft im Folgenden Wertpapiere, Optionen, Finanzterminkontrakte, Devisentermingeschäfte und Swaps.

Die Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, erfolgt grundsätzlich zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Vermögensgegenstände, für welche die Kursstellung auf der Grundlage von Geld- und Briefkursen erfolgt, werden grundsätzlich zum Geldkurs („Bid“) bewertet.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden die Verkehrswerte zugrunde gelegt. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte. Die Gesellschaft nutzt zur Ermittlung der Verkehrswerte grundsätzlich externe Bewertungsmodelle. Die Verkehrswerte können auch von einem Emittenten, Kontrahenten oder sonstigen Dritten ermittelt und mitgeteilt werden.

Die Gesellschaft bewertet Investmentanteile mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis oder mit einem aktuellen Kurs. Die Bankguthaben und übrigen Forderungen werden mit ihrem Nominalbetrag, die Verbindlichkeiten mit dem Rückzahlungsbetrag angesetzt. Vermögensgegenstände in ausländischer Währung werden zu den von WM-Company (17.00 Uhr) bereitgestellten Devisenkursen des Tages der Preisberechnung in Euro umgerechnet.

Stuttgart

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH







# LB≡BW Asset Management

30005 [15] 09/2024 55 25% Altpapier

**LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH**

Postfach 100351  
70003 Stuttgart  
Pariser Platz 1, Haus 5  
70173 Stuttgart  
Telefon 0711 22910-3000  
Telefax 0711 22910-9098  
[www.LBBW-AM.de](http://www.LBBW-AM.de)  
[info@LBBW-AM.de](mailto:info@LBBW-AM.de)