LB≡BW Asset Management

# W&W Dachfonds GlobalPlus

## Halbjahresbericht zum 31.08.2023

# Inhalt


| | |
|---|---|
| Vermögensübersicht zum 31.08.2023 | 8 |
| Vermögensaufstellung zum 31.08.2023 | 9 |
| Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen | 12 |
| Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 13 |

**Liebe Anlegerin, lieber Anleger,**

wir danken Ihnen für das Vertrauen, das Sie uns entgegenbringen.

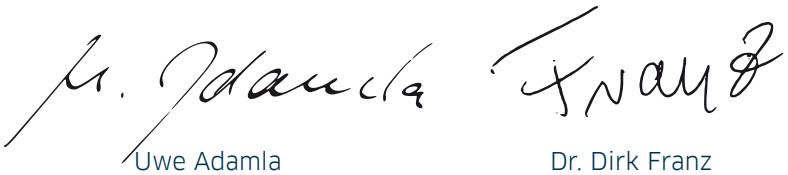
Seit unserer Gründung legen wir Fonds für private und institutionelle Anleger auf. Dadurch bieten wir Ihnen die Möglichkeit, an den Entwicklungen der Märkte teilzunehmen. Detailinformationen erhalten Sie von Ihrem Berater.

In diesem Halbjahresbericht können Sie sich ein Bild von der Situation Ihres Fonds verschaffen. Sollten Sie weitergehende Auskünfte zu Ihrem Fonds benötigen, sprechen Sie bitte Ihren Berater an.

Tagesaktuelle Informationen zu Fondspreisen finden Sie im Internet unter **www.LBBW-AM.de** und in der überregionalen Tagespresse.

Mit freundlichen Grüßen

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH
Geschäftsführung



Uwe Adamla
(Vorsitzender)

Dr. Dirk Franz
(Stellv. Vorsitzender)

# W&W Dachfonds GlobalPlus

## Halbjahresbericht zum 31.08.2023

# Vermögensübersicht zum 31.08.2023

| Anlageschwerpunkte | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens |
|---|---|---|
| **I. Vermögensgegenstände** | **385.185.481,03** | **100,15** |
| **1. Investmentanteile** | **378.475.970,30** | **98,40** |
| Aktienfonds | 378.475.970,30 | 98,40 |
| **2. Bankguthaben** | **6.709.510,73** | **1,74** |
| **II. Verbindlichkeiten** | **-561.897,70** | **-0,15** |
| **III. Fondsvermögen** | **384.623.583,33** | **100,00** |

# Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

| Gattungsbezeichnung | WKN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Bestandspositionen** | | | | | | | **EUR** | | **378.475.970,30** | **98,40** |
| **Investmentanteile** | | | | | | | **EUR** | | **378.475.970,30** | **98,40** |
| **Gruppenfremde Investmentanteile** | | | | | | | | | | |
| AB SICAV I-Gl.Core Equity Ptf. Actions Nom. IX EUR o.N. | A1JJJ4 | ANT | | 33.000 | | | EUR | 404,070 | 13.334.310,00 | 3,47 |
| AIS-Amundi MSCI EM LAT.AMERICA Namens-Anteile C Cap.EUR o.N. | A2H58P | ANT | | 640.000 | 120.000 | | EUR | 15,136 | 9.687.040,00 | 2,52 |
| AIS-Amundi S&P Global Luxury Namens-Anteile C Cap.EUR o.N. | A2H564 | ANT | | 54.000 | 36.000 | | EUR | 206,400 | 11.145.600,00 | 2,90 |
| BNP P.Easy-ECPI Circ.Econ.Ldrs Namens-Ant.UCITS ETF CAP o.N. | A2PHCA | ANT | | 750.000 | | | EUR | 16,604 | 12.453.000,00 | 3,24 |
| Candriam Equities L-Australia Namens-Anteile I EUR o.N. | A0NADB | ANT | | 23.000 | | | EUR | 295,390 | 6.793.970,00 | 1,77 |
| Deka MSCI USA Cl.Ch.ESG UC.ETF Inhaber-Anteile | ETFL57 | ANT | | 350.000 | | | EUR | 38,410 | 13.443.500,00 | 3,50 |
| Deka MSCI World C.Ch.ESG U.ETF Inhaber-Anteile | ETFL58 | ANT | | 300.000 | | 140.000 | EUR | 26,730 | 8.019.000,00 | 2,08 |
| DPAM B-Equties Europe Sustain. Actions Nom. F Inst. Cap. o.N. | A0RM1L | ANT | | 17.500 | | | EUR | 436,860 | 7.645.050,00 | 1,99 |
| FIDELITY-SRE Jap.Eq.ETF Reg. Shs ACC JPY Acc. oN | A2QD43 | ANT | | 2.500.000 | 2.500.000 | | EUR | 4,651 | 11.626.250,00 | 3,02 |
| GuardCap UCITS Funds-Gl.Equity Registered Acc.Shs I EUR o.N. | A140FA | ANT | | 500.000 | | | EUR | 22,988 | 11.494.000,00 | 2,99 |
| InvescoMI MSCI USA ETF Registered Shares Acc o.N. | A0RGCQ | ANT | | 225.000 | | | EUR | 118,150 | 26.583.750,00 | 6,91 |
| iShsIV-Automation&Robot.U.ETF Registered Shares o.N. | A2ANH0 | ANT | | 900.000 | 500.000 | | EUR | 10,682 | 9.613.800,00 | 2,50 |
| JPM ICAV-EU Res.Enh.Idx Eq.ETF Reg.Sh.JPM E.R.E.I.E.EO Acc.oN | A2DWM4 | ANT | | 415.000 | 115.000 | | EUR | 37,363 | 15.505.437,50 | 4,03 |
| JPMorgan Inv.-Gbl Dividend Reg. Shs I (acc) EUR o.N. | A0M60G | ANT | | 100.000 | 14.000 | | EUR | 152,420 | 15.242.000,00 | 3,96 |
| Jupiter Gl.Fd.-Japan Select Namens-Anteile D EUR Acc. o.N. | A1W1DV | ANT | | 750.000 | 100.000 | | EUR | 15,590 | 11.692.500,00 | 3,04 |
| Nordea 1-Nordic Equ. Sm.Cap Fd Actions Nom. BI-EUR o.N. | A0NJEJ | ANT | | 230.000 | | | EUR | 40,889 | 9.404.539,00 | 2,45 |
| OSS.Shill.Barc.C.US Sec.Val.TR Inh.-Ant. UCITS ETF 1C EUR o.N | A116QV | ANT | | 25.500 | | | EUR | 1.117,010 | 28.483.755,00 | 7,41 |
| SPDR MSCI World Heal.Care UETF Registered Shares o.N. | A2AE58 | ANT | | 250.000 | 250.000 | | EUR | 52,780 | 13.195.000,00 | 3,43 |
| SPDR S+P US Tech.Sel.Sec.UETF Registered Shares o.N. | A14QB5 | ANT | | 117.000 | 247.000 | 130.000 | EUR | 84,360 | 9.870.120,00 | 2,57 |
| UI I-Montrusco Bol.Glbl Eq.Fd Act. Nom. IX EUR Acc. oN | A3CTNT | ANT | | 135.000 | 45.000 | | EUR | 113,750 | 15.356.250,00 | 3,99 |
| Xtr.MSCI Europe Small Cap Inhaber-Anteile 1C o.N. | DBX1AU | ANT | | 110.000 | 110.000 | | EUR | 51,930 | 5.712.300,00 | 1,49 |
| Brown Advisory Fds-US Flex.Eq. Registered Shares B USD Acc oN | A1XFLA | ANT | | 480.000 | 130.000 | | USD | 27,150 | 12.007.186,62 | 3,12 |
| CIM Dividend Income Fund Reg. Ord. Shares I USD o.N. | A2JJ6X | ANT | | 920.000 | | | USD | 13,619 | 11.544.301,73 | 3,00 |
| Fisher Inv.Ins.US Sm.Core Eq. Registered Shares USD o.N. | A2ADKA | ANT | | 63.000 | 12.000 | | USD | 231,020 | 13.409.738,79 | 3,49 |

# Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

| Gattungsbezeichnung | WKN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.08.2023 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum | | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM ICAV-US Res.Enh.Idx Eq.ETF Reg.S. (ESG) UCITS DL Acc.oN | A2DWM7 | | ANT | 510.000 | 510.000 | | USD | 44,400 | 20.863.315,98 | 5,42 |
| Lumen Vietnam Fund Inh.-Ant. I2 USD Acc. oN | A2PVW6 | | ANT | 115.000 | 15.000 | | USD | 116,580 | 12.352.420,88 | 3,21 |
| SPDR MSCI World UCITS ETF Reg.Shares USD Unhgd Acc. o.N. | A2N6CW | | ANT | 600.000 | 250.000 | 60.000 | USD | 31,100 | 17.192.610,68 | 4,47 |
| Xtrackers S&P 500 Swap Inhaber-Anteile 1C USD o.N. | DBX0F2 | | ANT | 305.000 | 80.000 | | USD | 88,270 | 24.805.224,12 | 6,45 |
| **Summe Wertpapiervermögen** | | | | | | | **EUR** | | **378.475.970,30** | **98,40** |
| **Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds** | | | | | | | **EUR** | | **6.709.510,73** | **1,74** |
| **Bankguthaben** | | | | | | | **EUR** | | **6.709.510,73** | **1,74** |
| **EUR-Guthaben bei:** | | | | | | | | | | |
| HSBC Continental Europe S.A.,Germany (Düsseldorf) | | | EUR | 3.432.272,07 | | | % | 100,000 | 3.432.272,07 | 0,89 |
| **Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen** | | | | | | | | | | |
| | | | USD | 3.556.950,98 | | | % | 100,000 | 3.277.238,66 | 0,85 |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** *) | | | **EUR** | **-561.897,70** | | | | | **-561.897,70** | **-0,15** |
| **Fondsvermögen** | | | | | | | **EUR** | | **384.623.583,33** | **100,00** [1)] |
| **Anteilwert** | | | | | | | **EUR** | | **108,53** | |
| **Umlaufende Anteile** | | | | | | | **STK** | | **3.544.100** | |

*) Beratungsvergütung, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten

**Fußnoten:**

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

# Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

**Devisenkurse (in Mengennotiz)**

| | | per 31.08.2023 | | |
|---|---|---|---|---|
| US-Dollar | (USD) | 1,0853500 | = | 1 Euro (EUR) |

# 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| **Investmentanteile** | | | | | |
| **Gruppenfremde Investmentanteile** | | | | | |
| Algebris UCITS Fd.-Al.Fin.Equ. Regist. Shs. B EUR Acc. o.N. | A2DVGQ | ANT | | 40.000 | |
| Bellevue(L)-B.As.Pac.Healthc. Namens-Anteile I2 EUR o.N. | A2DPA8 | ANT | | 36.000 | |
| EuroEquityFlex Act. au Port. I EUR Dis. oN | A2QD6N | ANT | | 10.300 | |
| FT ICAV-FTSE China U.ETF Reg. Shares USD Acc. o.N. | A2PB5V | ANT | 160.000 | 160.000 | |
| L&G-L&G Cyber Security U.ETF Registered Shares o.N. | A14WU5 | ANT | 50.000 | 510.000 | |
| Matt.Asia-Asia ex Jpn TR Eq.Fd Actions Nom. S Acc.EUR o.N. | A2P87D | ANT | | 875.000 | |
| Partners Grp L.I.-List.Pr.Equ. Nam.-An. EUR (I-Acc.) o.N. | A0B61A | ANT | | 24.000 | |
| US EquityFlex Inhaber-Anteile I o.N. | A12E0R | ANT | | 11.500 | |
| Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Anteile 1D o.N. | DBX1EU | ANT | 160.000 | 160.000 | |
| Xtrackers MSCI Canada Inhaber-Anteile 1C o.N. | DBX0ET | ANT | | 140.000 | |

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Sonstige Angaben

| | | |
|---|---|---|
| **Anteilwert** | **EUR** | **108,53** |
| **Umlaufende Anteile** | **STK** | **3.544.100** |

## 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 1. September 2023

LBBW Asset Management
Investmentgesellschaft mbH

LB≡BW Asset Management

70420 [14] 10/2023 55 25% Altpapier

**LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH**

Postfach 100351
70003 Stuttgart
Pariser Platz 1, Haus 5
70173 Stuttgart
Telefon 0711 22910-3000
Telefax 0711 22910-9098
www.LBBW-AM.de
info@LBBW-AM.de