



Das Wasser. Aufgrund seiner molekularen Struktur gehört es zu den wenigen Stoffen, die Licht nahezu ungehindert durchdringen kann.

# Besondere Transparenz. LBBW FondsPortfolio Rendite Halbjahresbericht zum 31.07.2017



## Inhalt

- 8 Vermögensübersicht zum 31.07.2017
- 9 Vermögensaufstellung zum 31.07.2017
- 11 Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,  
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen
- 12 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 wesentlichen Anlegerinformationen, 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



Andrea Daniela Bauer



Nicolas Themistocli



Jürgen Zirner



# **LBBW FondsPortfolio Rendite**

## Halbjahresbericht zum 31.07.2017

## Vermögensübersicht zum 31.07.2017

Anlageschwerpunkte	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>9.706.365,56</b>	<b>100,20</b>
<b>1. Investmentanteile</b>	<b>9.232.195,00</b>	<b>95,30</b>
Rentenfonds	4.913.418,00	50,72
Aktienfonds	4.318.777,00	44,58
<b>2. Bankguthaben</b>	<b>463.358,66</b>	<b>4,78</b>
<b>3. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>10.811,90</b>	<b>0,11</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-18.989,36</b>	<b>-0,20</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>9.687.376,20</b>	<b>100,00</b>



## Vermögensaufstellung zum 31.07.2017

Gattungsbezeichnung	WKN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2017	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bestandspositionen</b>							EUR	9.232.195,00	95,30
<b>Investmentanteile</b>							EUR	9.232.195,00	95,30
<b>KVG-eigene Investmentanteile</b>									
LBBW Global Equity Inhaber-Anteile	A2DHTM		ANT	32.000	32.000		EUR 49,100	1.571.200,00	16,22
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
db x-tr.iBoxx EUR Co.Y.Pl.(DR) Registered Shares 1D o.N.	A2ACJ8		ANT	30.000	30.000		EUR 16,050	481.500,00	4,97
db x-tr.II-EUROZONE GOV.BD(DR) Inhaber-Anteile 1C o.N.	DBX0AC		ANT	4.000		2.490	EUR 227,500	910.000,00	9,39
db x-tr.MSCI World Index ETF Inhaber-Anteile 4C EUR o.N.	DBX0KQ		ANT	10.000			EUR 20,710	207.100,00	2,14
dbxt.II-E.G.B.Y.P.1-3U.ETF(DR) Inhaber-Anteile 1C o.N.	DBX0K7		ANT	3.000	3.000		EUR 142,260	426.780,00	4,41
dbxtr.II-Eu.Go.B.3-5 U.ETF(DR) Inhaber-Anteile 1C o.N.	DBX0AE		ANT	3.900	3.900		EUR 202,320	789.048,00	8,15
iShares Core DAX UCITS ETF DE Inhaber-Anteile	593393		ANT	9.000		2.000	EUR 105,450	949.050,00	9,80
iShsIII-Core EO Corp.Bd U.ETF Registered Shares o.N.	A0RGEP		ANT	11.000	9.000		EUR 129,740	1.427.140,00	14,73
iShsIII-Core MSCI World U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	A0RPWH		ANT	20.000			EUR 42,540	850.800,00	8,78
Lyx.EUROMTS A.-M.I.G.(DR)U.ETF Actions au Porteur EUR o.N.	A0B9ED		ANT	5.000		3.490	EUR 175,790	878.950,00	9,07
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF Actions au Porteur D-EUR o.N.	A0JDGC		ANT	5.900	5.900		EUR 125,530	740.627,00	7,65
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							EUR	9.232.195,00	95,30
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							EUR	463.358,66	4,78
<b>Bankguthaben</b>							EUR	463.358,66	4,78
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Landesbank Baden-Württemberg (Stuttgart)				EUR 463.358,66			% 100,000	463.358,66	4,78
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							EUR	10.811,90	0,11
Ansprüche auf Ausschüttung				EUR 10.811,90				10.811,90	0,11
<b>Sonstige Verbindlichkeiten <sup>*)</sup></b>				EUR -18.989,36				-18.989,36	-0,20
<b>Fondsvermögen</b>							EUR	9.687.376,20	100,00 <sup>1)</sup>
<b>Anteilwert</b>							EUR	58,28	
<b>Umlaufende Anteile</b>							STK	166.226	

<sup>\*)</sup> Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten

### Fußnoten:

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

## Vermögensaufstellung zum 31.07.2017

### 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>Investmentanteile</b>					
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>					
db x-tr.II-iBoxx S.E.Y.P.ETF Inhaber-Anteile 1C o.N.	DBX0HM	ANT		8.790	
iShs VI-E.MSCI Eur.Min.Vol.U.E Reg. Shares EUR (Acc) o.N.	A1J783	ANT		20.500	
iShs VI-E.MSCI Wld Min.Vo.U.E. Reg. Shares USD (Acc) o.N.	A1J781	ANT		18.200	
Lyxor MSCI World UCITS ETF Actions au Port.D-EUR o.N.	LYX0AG	ANT		5.400	
SI UCITS-UC TR Bal.Eu.C.B.U.E. Namens-Anteile o.N.	A14PYG	ANT		5.100	

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	58,28
Umlaufende Anteile	STK	166.226

### 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 Kurse der Vermögensgegenstände im Zusammenhang mit der Anteilwertermittlung werden von einem externen Bewerter geliefert. 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 Reuters bereitgestellten Devisenkursen des Tages der Preisberechnung in Euro umgerechnet.

### Zusätzliche steuerliche Informationen

Der Aktiengewinn kann bei der Gesellschaft erfragt werden.

Die von der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH für den Zeitraum 01.03.2013 bis 30.06.2013 ermittelten Aktiengewinne der Publikumsfonds für in Deutschland körperschaftsteuerpflichtige Anleger können auf der Homepage des elektronischen Bundesanzeigers unter der Adresse <https://www.bundesanzeiger.de> und auf der Homepage der LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH unter der Adresse <https://www.LBBW-AM.de> abgerufen werden.

Stuttgart, den 1. August 2017

LBBW Asset Management  
Investmentgesellschaft mbH







LBBW Asset Management Investmentgesellschaft mbH

Postfach 1003 51  
70003 Stuttgart  
Fritz-Elsas-Straße 31  
70174 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)

30024 [8] 09/2017 55 25% Altpapier

Fonds in Feinarbeit.

**LB≡BW Asset Management**