

HALBJAHRESBERICHT
DIVERSIFIED SYSTEMATIC RATES FUND
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄSS §2 ABS. 1 UND 2 INVFG 2011
FÜR DAS RUMPFHALBJAHR VOM
17. JULI 2024 BIS
31. OKTOBER 2024

HALBJAHRESBERICHT
des Diversified Systematic Rates Fund Miteigentumsfonds gemäß §2 Abs. 1 und 2 InvFG
2011 für das Rumpfhalfjahr vom 17. Juli 2024 bis 31. Oktober 2024

Sehr geehrte Anteilsinhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des Diversified Systematic Rates Fund über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2024 / 2025 vor.

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rumpfhalfjahresende	200.119
------------------------	---------

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A3DC13) betrug	EUR	99,56
der Nettobestandpreis pro vollthesaurierendem Anteil (AT0000A3DC21) betrug	EUR	99,57

Am Freitag, den 19.7.2024, wurde durch die LLB Invest KAG ein technischer Fehler in der Berechnung des Nettoinventarwerts (NAV-Berechnung) der Fonds aufgrund falscher Abgrenzungen/Berechnungen von Zinsansprüchen (in Bezug auf Anleihen/Geldmarktinstrumenten) seitens des externen Dienstleisters festgestellt. Die diesbezüglichen Korrekturmaßnahmen konnten an diesem Tag nicht rechtzeitig abgeschlossen werden, weshalb eine Aussetzung der Ausgabe-/Rücknahme und NAV-Berechnung aller Fonds vorgenommen werden musste. Die Aufhebung dieser Aussetzung erfolgte am nachfolgenden Montag, den 22.7.2024.

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND 31.10.2024 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FV
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
0.5% Bundesobl DE 2015-15.2.25	DE0001102374	EUR	2.500.000	2.500.000		99,3710	2.484.275,00	12,47
0.5% Bundesobl DE 2016-15.2.26	DE0001102390	EUR	3.500.000	3.500.000		97,7310	3.420.585,00	17,17
4% Finland 2009-4.7.25	FI4000006176	EUR	2.500.000	2.500.000		100,8530	2.521.325,00	12,65
0.875% Finland 2015-15.9.25	FI4000167317	EUR	3.500.000	3.500.000		98,5970	3.450.895,00	17,32
0.25% Netherlands 2015-15.07.25 Unitary 144A/Reg S	NL0011220108	EUR	2.500.000	2.500.000		98,4070	2.460.175,00	12,35
0% Dutch State Loan Netherlands 2022-15.01.26 Unitary	NL0015000QL2	EUR	3.500.000	3.500.000		97,2480	3.403.680,00	17,08
							17.740.935,00	89,04
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte							17.740.935,00	89,04
Summe Wertpapiervermögen							17.740.935,00	89,04
Total Return Swap								
TRS USD/USD 16.07.2025		USD	-597.192				-552.188,40	-2,77
Summe Total Return Swap							-552.188,40	-2,77
Bankguthaben								
EUR-Guthaben Kontokorrent								
		EUR	2.665.597,85				2.665.597,85	13,38
Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen								
		USD	9.250,00				8.552,94	0,04
Summe Bankguthaben							2.674.150,79	13,42
Sonstige Vermögensgegenstände								
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben								
		EUR	7.268,72				7.268,72	0,04
		USD	32,51				30,06	0,00
Zinsansprüche aus Wertpapieren								
		EUR	59.541,16				59.541,16	0,30
Depotgebühren								
		EUR	-445,01				-445,01	0,00
Verwaltungsgebühren								
		EUR	-4.317,07				-4.317,07	-0,02
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							62.077,86	0,31
FONDSVERMÖGEN							19.924.975,25	100,00
Anteilwert Thesaurierungsanteile								
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A3DC13					EUR	99,56	
	AT0000A3DC13					STK	44.275,00000	
Anteilwert Vollthesaurierungsanteile								
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A3DC21					EUR	99,57	
	AT0000A3DC21					STK	155.844,00000	

Umrechnungskurse/Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung zu den Devisen/Umrechnungskursen per 30.10.2024 in EUR umgerechnet

Währung		Einheit in EUR	Kurs
US Dollar	USD	1 = EUR	1,095080

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (im Sinne der Verordnung des Europäischen Parlaments und des Rates über die Meldung und Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften, Verordnung (EU) 2015/2365) wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Der Einsatz von Gesamtrendite-Swaps (im Sinne der Verordnung des Europäischen Parlaments und des Rates über die Meldung und Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften, Verordnung (EU) 2015/2365) ist laut Fondsbestimmungen zulässig. Während des Berichtszeitraumes wurden Gesamtrenditeswaps eingesetzt.

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.

b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

[*]Anleihen mit (0% Min) in der Wertpapierbezeichnung sind floating rates notes. Der für die Zinsperiode gültige Zinssatz, wird angepasst, aber in der Wertpapierbezeichnung nicht ausgewiesen.

Wien, am 12. November 2024

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung