

HALBJAHRESBERICHT
ALPHAMA ASSET ALLOCATION (AAA)
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄSS §2 ABS. 1 UND 2 INVFG 2011
FÜR DAS HALBJAHR VOM
1. NOVEMBER 2023 BIS
30. APRIL 2024

HALBJAHRESBERICHT

des ALPHAMA ASSET ALLOCATION (AAA) Miteigentumsfonds gemäß §2 Abs. 1 und 2 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. November 2023 bis 30. April 2024

Sehr geehrte Anteilhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des ALPHAMA ASSET ALLOCATION (AAA) über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2023 / 2024 vor.

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn	17.155
zu Halbjahresende	17.822

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro vollthesaurierendem Anteil (AT0000A0XZ56) betrug	EUR	113,08
--	-----	--------

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND 30.04.2024	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FV
			STK./NOM.	IM BERICHTSZEITRAUM				
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
0% Obligation Oesterreich 2019-15.07.24	AT0000A28KX7	EUR	320.000			99,2540	317.612,80	15,76
DE 2015-15.4.26 var.	DE0001030567	EUR	170.000			122,3473	207.948,76	10,32
0.5% Bundesobl DE 2015-15.2.25	DE0001102374	EUR	260.000	260.000		97,7450	254.137,00	12,61
Republiq Francaise 2020-01.03.26 Idxee sur l'Inflation HICP								
All Items Ex T -S	FR0013519253	EUR	170.000			116,2845	197.643,41	9,81
2% Netherlands 2014-15.7.24	NL0010733424	EUR	338.000			99,6720	336.891,36	16,72
(0% Min) Bonds BEI 2014-15.07.24 Reg S FR	XS1133551405	EUR	150.000			100,0460	150.069,00	7,45
							1.464.302,33	72,65
United States 2020-15.04.25 Series X-2025 Inflation Lkd to CPI Idx	US912828ZJ22	USD	85.000			117,1399	92.862,10	4,61
							92.862,10	4,61
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte							1.557.164,43	77,26
Investmentfonds								
Uts iShares V PLC MSCI World EUR Hedged UCITS ETF Accum EUR	IE00B441G979	EUR	3.250	850	1.650	82,7660	268.989,50	13,35
							268.989,50	13,35
Summe Investmentfonds							268.989,50	13,35
Summe Wertpapiervermögen							1.826.153,93	90,61
Finanzterminkontrakte								
Put CBOE VIX Idx JUN24 USD 35 (18.06.2024)	BBG01JK1J092	USD	69	69		19,4500	125.191,23	6,21
Call CBOE VIX Idx SEP24 USD 35 (18.09.2024)	BBG01KSDYYJ3	USD	60	60		0,7100	3.973,88	0,20
Summe Finanzterminkontrakte							129.165,11	6,41
Währungskurssicherungsgeschäfte								
Absicherung von Beständen								
Verkauf von Devisen auf Termin								
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Offene Position								
DH USD/EUR 28.06.2024		USD	-210.000			1,0746	-7.830,45	-0,39
Summe Währungskurssicherungsgeschäfte							-7.830,45	-0,39
Bankguthaben								
EUR-Guthaben Kontokorrent								
		EUR	50.388,45				50.388,45	2,50
Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen								
		USD	14.184,03				13.231,37	0,66
Summe Bankguthaben							63.619,82	3,16
Sonstige Vermögensgegenstände								
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben								
		EUR	254,02				254,02	0,01
		USD	89,61				83,59	0,00
Zinsansprüche aus Wertpapieren								
		EUR	5.909,04				5.909,04	0,29
		USD	5,23				4,88	0,00
Depotgebühren								
		EUR	-61,07				-61,07	0,00
Verwaltungsgebühren								
		EUR	-1.897,82				-1.897,82	-0,09
Depotbankgebühren								
		EUR	-83,97				-83,97	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände							4.208,67	0,21
FONDSVERMÖGEN							2.015.317,08	100,00
Anteilwert Vollthesaurierungsanteile								
Anteilwert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0XZ56					EUR	113,08	
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0XZ56					STK	17.821,61000	

Umrechnungskurse/Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Wahrung zu den Devisen/Umrechnungskursen per 29.04.2024 in EUR umgerechnet

Wahrung		Einheit in EUR	Kurs
US Dollar	USD	1 = EUR	1,072000

WAHREND DES BERICHTSZEITRAUMES ABGESCHLOSSENE GESCHAFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMOGENSAUFSTELLUNG AUFSCHNEIDEN:

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	KAUFE ZUGANGE	VERKAUFE ABGANGE
Investmentfonds				
Ant Multi Units France Sicav Amundi MSCI World II UCITS ETF Monthly Hedg. to EUR	FR0011660927	EUR		770
Finanzterminkontrakte				
Put CBOE VIX Idx APR24 USD 35 (17.04.2024)	BBG01HN4Q632	USD	54	54
Put CBOE VIX Idx FEB24 USD 35 (14.02.2024)	BBG01GSRVCY5	USD	27	27
Put CBOE VIX Idx JAN24 USD 45 (17.01.2024)	BBG01GG41F48	USD		40
Put CBOE VIX Idx MAR24 USD 35 (20.03.2024)	BBG01H7WL1L4	USD	27	27
Put CBOE VIX Idx MAY24 USD 35 (22.05.2024)	BBG01J2126D2	USD	54	54

Informationen zur allfälligen Verrechnung einer variablen Vergütung (Performancegebühr, erfolgsabhängige Vergütung) sind im Rechenschaftsbericht des Fonds, unter 2.3, ersichtlich.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps (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 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.

Wien, am 3. Mai 2024

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung