

HALBJAHRESBERICHT
SWISS LIFE GSF - GLOBAL FIXED INCOME FUND
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄSS §2 ABS. 1 UND 2 INVFG 2011
FÜR DAS HALBJAHR VOM
1. JANUAR 2024 BIS
30. JUNI 2024

HALBJAHRESBERICHT

des Swiss Life GSF - Global Fixed Income Fund Miteigentumsfonds gemäß §2 Abs. 1 und 2 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. Januar 2024 bis 30. Juni 2024

Sehr geehrte Anteilhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des Swiss Life GSF - Global Fixed Income Fund über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2024 vor.

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn	41.791
zu Halbjahresende	41.164

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro vollthesaurierendem Anteil (AT0000A28DT0) betrug	EUR	87,45
--	-----	-------

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	BESTAND 30.06.2024 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FV
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
1.75% Obligation Borealis 2018-10.12.25	AT0000A24UY3	EUR	80.000			97,0720	77.657,60	2,16
0.5% Anleihe Oesterreich 2019-20.02.29 Unitary 144A/Reg S	AT0000A269M8	EUR	115.000		15.000	89,9320	103.421,80	2,87
1.25% Obligations Lineaires Belgium 2018-22.04.33 OLO 86 Unitary	BE0000346552	EUR	115.000		15.000	86,6770	99.678,54	2,77
1.5% EMTN AB InBev 2015-18.4.30 Reg S	BE6276040431	EUR	80.000			90,9960	72.796,80	2,02
1.75% SAP 2014-22.2.27 Serie 5	DE000A13SL34	EUR	80.000			97,4890	77.991,20	2,17
0.75% EMTN Evonik Industr 2016-07.09.28 Reg S	DE000A185QB3	EUR	80.000			91,3240	73.059,20	2,03
0.01% Landesschatzanweisung Bundeslaender BRD 2020-26.08.30	DE000A289QK1	EUR	115.000		15.000	83,9800	96.577,00	2,68
0.75% EMTN Mercedes-BenzGr 2020-10.09.30 Series 92 Tranche 1	DE000A289QR9	EUR	80.000			85,8870	68.709,60	1,91
2.3% Bundesanleihe DE 2023-15.02.33 Reg S	DE000BU3Z005	EUR	110.000	110.000		99,2220	109.144,20	3,03
0.1% Treasury Nts Spain 2021-30.04.31	ES0000012H41	EUR	115.000		15.000	81,8240	94.097,60	2,61
0.5% Obligation Assimilable du Tresor Republiq Francaise 2018-25.05.29	FR0013407236	EUR	115.000		15.000	88,7530	102.065,95	2,84
4.75% EMTN RCI Banque 2022-06.07.27 Sr 331 Tr 1 Reg S	FR001400B1L7	EUR	80.000			102,7860	82.228,80	2,28
4% Buoni del Tesoro Poliennali Green Italia 2023-30.10.31 Reg S	IT0005542359	EUR	115.000		15.000	101,9740	117.270,10	3,26
1.125% EMTN Deutsche Tel Intl F 2017-22.05.26 Guarant.Reg S	XS1617898363	EUR	80.000			96,1430	76.914,40	2,14
1% Bonds Suedzucker Int Fin 2017-28.11.25 Guarant.	XS1724873275	EUR	80.000			96,3550	77.084,00	2,14
1.5% Nts BASF 2018-22.05.30 Reg S	XS1823502577	EUR	75.000			91,1410	68.355,75	1,90
1% Nts Siemens Fin Nv 2018-06.09.27 Guarant.	XS1874128033	EUR	80.000			94,5680	75.654,40	2,10
1.125% Bonds Heid Mat Lux 2019-01.12.27 Guarant.	XS2018637327	EUR	80.000			92,9120	74.329,60	2,06
0.5% Bonds HELLA 2019-26.01.27	XS2047479469	EUR	80.000			92,7380	74.190,40	2,06
1.25% EMTN Fresenius Med 2019-29.11.29	XS2084488209	EUR	80.000			88,1600	70.528,00	1,96
0.875% EMTN Gldm Sachs Grp 2020-21.01.30 Series F Tranche F-784 Reg S	XS2107332640	EUR	80.000			86,1560	68.924,80	1,91
0.375% Nts Nestle Fin 2020-12.05.32 Reg S	XS2170362912	EUR	75.000	75.000		81,5380	61.153,50	1,70
0.75% Bonds Deutsche Post 2020-20.05.29	XS2177122624	EUR	80.000			91,4960	73.196,80	2,03
0.75% EMTN OMV 2020-16.06.30	XS2189613982	EUR	80.000			86,3400	69.072,00	1,92
0.35% EMTN DeutschBahnFin 2021-29.09.31 Guarant.	XS2391406530	EUR	75.000			82,2730	61.704,75	1,71
1.625% Bonds E.ON 2022-29.03.31 Series 80 Tranche 1	XS2463518998	EUR	75.000			89,1080	66.831,00	1,86
1.5% Nts BEI 2022-15.06.32 Tranche 1 Reg S	XS2484093393	EUR	115.000		15.000	89,9940	103.493,10	2,88
							2.196.130,89	61,01
2.25% Treasury Nts United States 2017-15.08.27 Series E-2027	US9128282R06	USD	130.000			93,5078	113.650,11	3,16
3.5% Treasury Nts United States 2023-15.02.33	US91282CGM73	USD	130.000			94,2422	114.542,68	3,18
							228.192,79	6,34
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte							2.424.323,68	67,35
Investmentfonds								
Ant LLB Anleihen Strategie CEEMENA (EUR) Klasse I (T)	AT0000A17Z45	EUR	500			139,1100	69.555,00	1,93
Ant LLB Anleihen Schwellenlaender Accumulating ESG -IT-	AT0000A23K10	EUR	2.500			97,1300	242.825,00	6,75
Ant LLB Obligationen Inflation Linked ESG Klasse -H EUR-	LI0290911580	EUR	800			94,4100	75.528,00	2,10
Ant Macquarie Fund Solutions SICAV - Macquarie Global CV Fund Cap -I EUR-	LU1274833612	EUR	25.000			12,5505	313.762,50	8,72
Uts Xtrackers II SICAV US Treasuries UCITS ETF Distr -2D - EUR Hedged-	LU1399300455	EUR	2.600			92,7078	241.040,28	6,70
							942.710,78	26,19
Summe Investmentfonds							942.710,78	26,19
Summe Wertpapiervermögen							3.367.034,46	93,54
Bankguthaben								
EUR-Guthaben Kontokorrent								
Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen		EUR	144.455,73				144.455,73	4,01
		CHF	66.290,95				69.024,31	1,92
		USD	7.475,00				6.988,59	0,19
Summe Bankguthaben							220.468,63	6,12
Sonstige Vermögensgegenstände								
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben								
		EUR	1.289,80				1.289,80	0,04
		USD	68,24				63,80	0,00
Zinsansprüche aus Wertpapieren								
		EUR	11.950,45				11.950,45	0,33
		USD	2.751,79				2.572,73	0,07
Verwaltungsgebühren								
Depotbankgebühren		EUR	-1.200,00				-1.200,00	-0,03
Rückstellungen für Prüfungskosten und sonstige Gebühren		EUR	-330,00				-330,00	-0,01
Summe sonstige Vermögensgegenstände		EUR	-2.249,99				-2.249,99	-0,06
FONDSVERMÖGEN							3.599.599,88	100,00

Anteilwert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A28DT0	EUR	87,45
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A28DT0	STK	41.164,00000
Anteilwert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A28DS2	EUR	77,06
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A28DS2	STK	1,00000

Umrechnungskurse/Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Wahrung zu den Devisen/Umrechnungskursen per 27.06.2024 in EUR umgerechnet

Wahrung		Einheit in EUR	Kurs
US Dollar	CHF	1 = EUR	1,069600
Schweizer Franken	CHF	1 = EUR	0,960400

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

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	KAUFE ZUGANGE	VERKAUFE ABGANGE
Obligationen				
Nts Lenzing 2020-no fix mat Fixed/Variable Rate	XS2250987356	EUR		100.000
0% EMTN Nestle Fin 2021-14.06.26	XS2350621863	EUR		80.000
0% Gruene Bundesanleihe DE 2020-15.08.30 Reg S	DE0001030708	EUR		130.000

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.

[*]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 17. Juli 2024

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung