

HALBJAHRESBERICHT  
LLB STAATSANLEIHEN EUR ESG  
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄSS §2 ABS.1 UND 2 INVFG 2011  
FÜR DAS HALBJAHR VOM  
1. MÄRZ 2024 BIS  
31. AUGUST 2024

# HALBJAHRESBERICHT

## des LLB Staatsanleihen EUR ESG Miteigentumsfonds gemäß §2 Abs.1 und 2 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. März 2024 bis 31. August 2024

Sehr geehrte Anteilhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des LLB Staatsanleihen EUR ESG über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2024 / 2025 vor.

### 1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn	305 013
zu Halbjahresende	321 083

### 2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000685235 ) betrug	EUR	102,29
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil ( AT0000642343 ) betrug	EUR	156,51
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil ( AT0000A1G8A0 ) betrug	EUR	161,01
der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil ( AT0000A1G890 ) betrug	EUR	104,28

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 31.08.2024	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FV
			STK./NOM.	IM BERICHTSZEITRAUM				
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>								
<b>Obligationen</b>								
0.5% Obligation Oesterreich 2017-20.04.27 Ausgabe 1 Reg S	AT0000A1VGK0	EUR	1 200 000			95,0770	1 140 924,00	2,38
0% Federal Bonds Austria 2020-20.02.30 Series 1	AT0000A2CQD2	EUR	950 000			87,2470	828 846,50	1,73
3% Obligations Lineaires Belgium 2014-22.06.34 OLO 73 Unitary	BE0000333428	EUR	2 300 000	200 000		101,6880	2 338 824,00	4,88
1% Obligations Lineaires Belgium 2016-22.06.26 OLO 77 Unitary	BE0000337460	EUR	100 000			97,3960	97 396,00	0,20
0.8% Obligations Lineaires Belgium 2018-22.06.28 OLO 85 Unitary	BE0000345547	EUR	600 000	100 000		94,2370	565 422,00	1,18
1.25% Bundesanleihe DE 2017-15.08.48	DE0001102432	EUR	1 500 000	200 000		77,1720	1 157 580,00	2,41
0% Bundesanleihe DE 2021-15.05.36	DE0001102549	EUR	1 700 000	200 000		76,0310	1 292 527,00	2,69
1.7% Bundesanleihe DE 2022-15.08.32	DE0001102606	EUR	6 800 000	300 000	150 000	96,6990	6 575 532,00	13,71
1.95% Strippable Government Bond Spain 2015-30.7.30	ES00000127A2	EUR	1 050 000	50 000		96,0050	1 008 052,50	2,10
1.3% Strippable Government Bond Spain 2016-31.10.26	ES00000128H5	EUR	1 800 000	600 000		97,4120	1 753 416,00	3,65
2.35% Government Bonds Spain 2017-30.07.33	ES00000128Q6	EUR	350 000			95,3370	333 679,50	0,70
2.7% Treasury Bills Spain 2018-31.10.48	ES0000012B47	EUR	800 000	120 000		84,9790	679 832,00	1,42
1.4% Treasury Nts Spain 2018-30.07.28	ES0000012B88	EUR	1 800 000	1 100 000		95,7100	1 722 780,00	3,59
1.85% Nts Spain 2019-30.07.35 Unitary 144A/Reg S	ES0000012E69	EUR	1 400 000			88,2990	1 236 186,00	2,58
0.5% Treasury Bonds Finland 2019-15.09.29 Tranche 1 Unitary 144A/Reg S	FI4000369467	EUR	1 050 000			90,6100	951 405,00	1,98
4% Obligation Assimilable du Tresor Republiq Francaise 2006-25.10.38	FR0010371401	EUR	950 000			109,0050	1 035 547,50	2,16
1.5% Obligation Assimilable du Tresor French Republic 2015-25.5.31	FR0012993103	EUR	2 350 000		300 000	92,7080	2 178 638,00	4,54
0.25% French Republic 2015-25.11.26	FR0013200813	EUR	1 800 000	50 000		95,0490	1 710 882,00	3,57
1.5% Obligation Assimilable du Tresor Republiq Francaise 2018-25.05.50	FR0013404969	EUR	2 400 000	250 000		67,2050	1 612 920,00	3,36
0.75% Treasury Nts French Republic 2022-25.02.28	FR001400AIN5	EUR	2 600 000	200 000	100 000	94,0260	2 444 676,00	5,10
2% Treasury Nts French Republic 2021-25.11.32	FR001400BKZ3	EUR	2 400 000	2 400 000		93,9700	2 255 280,00	4,70
1.65% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2015-01.03.32 Reg S	IT0005094088	EUR	2 650 000		100 000	89,0440	2 359 666,00	4,92
2.05% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2017-01.08.27 Reg S	IT0005274805	EUR	750 000			97,9980	734 985,00	1,53
3.35% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2018-01.03.35 Reg S	IT0005358806	EUR	3 150 000			97,3000	3 064 950,00	6,39
1.35% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2019-01.04.30 Reg S	IT0005383309	EUR	1 900 000			91,0530	1 730 007,00	3,61
Italia 2021-27.04.37 Step Up Reg S	IT0005442097	EUR	1 850 000			75,2990	1 393 031,50	2,90
2.15% Buoni del Tesoro Poliennali Italia 2022-01.09.52 Unitary	IT0005480980	EUR	1 200 000	100 000		67,2460	806 952,00	1,68
3.75% Niederlande 2010-15.1.42 -144A	NL0009446418	EUR	1 150 000	250 000		113,7470	1 308 090,50	2,73
2% Bonds Netherlands 2022-15.01.54	NL00150012X2	EUR	1 520 000			85,4850	1 299 372,00	2,71
2.25% Government Nts Portugal 2018-18.04.34	PTOTEW0E0017	EUR	1 000 000			95,3030	953 030,00	1,99
							<b>46 570 430,00</b>	<b>97,08</b>
<b>Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>							<b>46 570 430,00</b>	<b>97,08</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>46 570 430,00</b>	<b>97,08</b>
<b>Finanzterminkontrakte</b>								
Future on debt Euro-BTP-Long Term SEP2024 (06.09.2024)	DE000F0FSQL7	EUR	-7	17	24	118,9200	-17 150,00	-0,04
Future on debt EURO BUNDSEP2024 (06.09.2024)	DE000F0FSQN3	EUR	-9	15	24	133,8800	-33 030,00	-0,07
<b>Summe Finanzterminkontrakte</b>							<b>-50 180,00</b>	<b>-0,11</b>
<b>Bankguthaben</b>								
<b>EUR-Guthaben Kontokorrent</b>								
		EUR	1 132 972,88				1 132 972,88	2,36
<b>Summe Bankguthaben</b>							<b>1 132 972,88</b>	<b>2,36</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								
<b>Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben</b>								
		EUR	7 107,61				7 107,61	0,01
<b>Zinsansprüche aus Wertpapieren</b>								
		EUR	329 279,84				329 279,84	0,69
<b>Depotgebühren</b>								
		EUR	-1 563,32				-1 563,32	0,00
<b>Verwaltungsgebühren</b>								
		EUR	-13 359,57				-13 359,57	-0,03
<b>Depotbankgebühren</b>								
		EUR	-1 366,11				-1 366,11	0,00
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>320 098,45</b>	<b>0,67</b>
<b>FONDSVERMÖGEN</b>							<b>47 973 321,33</b>	<b>100,00</b>

Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000685235	EUR	102,29
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000685235	STK	53 857,48897
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000642343	EUR	156,51
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000642343	STK	17 169,13688
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A1G8A0	EUR	161,01
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1G8A0	STK	241 496,00000
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A1G890	EUR	104,28
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1G890	STK	8 560,00000

**WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG AUFSCHEINEN:**

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WHG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
<b>Obligationen</b>				
0.25% Treasury Nts Spain 2019-30.07.24	ES0000012E85	EUR		1 200 000
0.5% Obligation Assimilable du Tresor Republiq Francaise 2018-25.05.29	FR0013407236	EUR		1 900 000
<b>Finanzterminkontrakte</b>				
Future on debt EURO BUNDJUN2024 (06.06.2024)	DE000C75XMU8	EUR	50	50
Future on debt EURO BUNDMAR2024 (07.03.2024)	DE000C7X7UK8	EUR	30	
Future on debt Euro-BTP-Long Term JUN2024 (06.06.2024)	DE000C75XMS2	EUR	35	35
Future on debt Euro-BTP-Long Term MAR2024 (07.03.2024)	DE000C7X7UH4	EUR	5	

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, 16. September 2024

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung