

HALBJAHRESBERICHT
PCI - DIVERSIFIED MULTI ASSET SELECT STRATEGY
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄß § 2 ABS. 1 UND 2 INVFG 2011
FÜR DAS HALBJAHR VOM
1. MAI 2022 BIS
31. OKTOBER 2022

HALBJAHRESBERICHT

des PCI - Diversified Multi Asset Select Strategy Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 1 und 2 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. Mai 2022 bis 31. Oktober 2022

Sehr geehrter Anteilsinhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des PCI - Diversified Multi Asset Select Strategy über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2022 / 2023 vor.

Aktuelles Statement zur Corona-Situation (Stand 1. Jänner 2022):

Für das Jahr 2022 rechnen wir durch die weitere Verbreitung von COVID-19-Impfstoffen global mit einer stetigen Normalisierung der Wirtschaftstätigkeit. Ein Risiko für dieses positive Szenario geht von der Möglichkeit aus, dass die bisher entwickelten Impfstoffe gegen zukünftige Virusmutationen keinen oder geringeren Schutz bieten und sich somit die Aufhebung der Lockdowns verzögert. Da die Finanzmärkte im letzten Jahr rasch dazu übergegangen sind, Ihren Fokus auf die Zeit nach der Corona-Pandemie zu richten, könnten negative Nachrichten zum Impfschutz zwischenzeitliche Korrekturen auslösen. Wir schätzen aber aus heutiger Sicht die Wahrscheinlichkeit einer neuerlichen harten Rezession mit entsprechenden Verwerfungen an den Finanzmärkten als gering ein.

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 49.302
zu Halbjahresende 42.295

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A287K4) betrug EUR 82,56
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A2MMG3) betrug EUR 94,65

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND 31.10.2022 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN	
Amtlicher Handel und organisierte Märkte									
Aktien									
Nestle Namensaktien (CHF)	CH0038863350	CHF	386	0	0	107,7600	41.930,81	1,10	
							41.930,81	1,10	
Glencore PLC (GBP)	JE00B4T3BW64	GBP	5.062	3.700	5.400	4,9675	29.198,20	0,77	
							29.198,20	0,77	
American Water Works Co.	US0304201033	USD	280	0	0	145,9400	41.064,42	1,08	
Coca-Cola Corporation Shares (USD)	US1912161007	USD	410	0	0	60,7600	25.034,27	0,66	
Microsoft Corporation Shares (USD)	US5949181045	USD	179	45	37	235,8700	42.428,63	1,12	
Pfizer Incorporation Shares	US7170811035	USD	486	0	0	47,4300	23.164,49	0,61	
Waste Management Incorporation	US94106L1098	USD	200	0	140	157,9100	31.737,51	0,84	
							163.429,32	4,31	
Obligationen									
3,85 BHP Billiton Finance Ltd. 30.9.13-30.9.2023	US055451AU28	USD	55.000	0	0	99,2000	54.828,66	1,44	
							54.828,66	1,44	
Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte							EUR	289.386,99	7,62
Investmentfonds									
Assenagon Alpha Volatility I	LU0575255335	EUR	155	45	28	1.119,9900	173.598,45	4,57	
Bantleon Diversified Markets IA	LU1808872029	EUR	1.130	1.130	0	108,4700	122.571,10	3,23	
DNB Fund TMT Absolute Return	LU1706375778	EUR	16.330	0	3.050	9,6593	157.736,37	4,16	
Flossbach von Storch-Multiple Opportunities II	LU1038809395	EUR	2.191	375	540	150,2400	329.175,84	8,67	
H2O Adagio I-C Sidepocket	FR0013534914	EUR	2	0	0	3.604,5100	8.110,15	0,21	
Jupiter Global Fund - Dynamic Bond Fund I	LU0853555893	EUR	29.286	2.500	3.980	11,9500	349.967,70	9,22	
Jupiter Strategic Absolute Return Bond Fund	IE00BLP58Q81	EUR	17.550	0	0	11,3075	198.446,63	5,23	
Lyxor Epsilon Global Trend Fund	IE00B643RZ01	EUR	626	0	332	164,9293	103.245,74	2,72	
Man Funds VI-Man GLG Alpha Select Alternative	IE00BJQ2XG97	EUR	2.700	0	0	118,5800	320.166,00	8,43	
Man Funds VI-Man GLG Global Investment Grade Opp.	IE000VA5W9H0	EUR	2.210	2.210	0	83,8800	185.374,80	4,88	
Nordea 1 SICAV - Alpha 15 MA Fund BP	LU0607983896	EUR	2.138	0	1.420	87,6360	187.393,02	4,94	
OFI Precious Metals I	FR0011170786	EUR	3	0	0	039.079,0400	117.237,12	3,09	
Protea UCITS II - ECO Advisors ESG Absolute Return	LU2002382492	EUR	1.647	0	1.200	105,6700	174.038,49	4,58	
PCI-Diversified Equity Income Fund	AT0000ARCUS3	EUR	33.775	4.000	2.920	9,6800	326.942,00	8,61	

SEB Fund 5 - Danish Mortgage Bond Fund B-ID	LU0337316045	EUR	3.244	0	580	83,0160	269.303,90	7,09
TRYCON Basic Invest HAIG	LU0451958309	EUR	1.605	0	0	124,8800	200.432,40	5,28
Xtrackers II Global Inflation Linked Bond U.ETF 1C	LU0290357929	EUR	680	0	0	216,4825	147.208,10	3,88
							3.370.947,81	88,80
BlackRock Gl.Fds. - World Gold Fund A2-Thes.	LU0055631609	USD	1.607	0	0	27,1100	43.780,29	1,15
							43.780,29	1,15
Summe Investmentfonds							EUR 3.414.728,10	89,96
Summe Wertpapiervermögen							EUR 3.704.115,09	97,58
Bankguthaben								
EUR-Guthaben Kontokorrent		EUR	97.066,73				97.066,73	2,56
Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen		USD	128,38				129,01	0,00
Summe der Bankguthaben							EUR 97.195,74	2,56
Sonstige Vermögensgegenstände								
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben		EUR	79,94				79,94	0,00
		USD	0,23				0,23	0,00
Zinsansprüche aus Wertpapieren		USD	176,46				177,33	0,00
Verwaltungsgebühren		EUR	-5.488,46				-5.488,46	-0,14
Depotgebühren		EUR	-128,90				-128,90	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR -5.359,86	-0,14
FONDSVERMÖGEN							EUR 3.795.950,97	100,00
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A287K4	EUR					82,56	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A287K4	STK					17.149,00000	
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A2MMG3	EUR					94,65	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A2MMG3	STK					25.146,29518	
Umrechnungskurse/Devisenkurse								
Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Umrechnungskursen/Devisenkursen per 28.10.2022 in EUR umgerechnet:								
Währung	Einheiten	Kurs						
US-Dollar	1 EUR =	0,99510	USD					
Pfund Sterling	1 EUR =	0,86120	GBP					
Schweizer Franken	1 EUR =	0,99200	CHF					

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:

- 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.
- 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.

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung aufscheinen:

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
Amtlicher Handel und organisierte Märkte				
Aktien				
Aurubis AG	DE0006766504	EUR	918	1.353
Bechtle AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0005158703	EUR	0	600
ENEL S.p.A.	IT0003128367	EUR	21.200	21.200
Infineon Technologies AG	DE0006231004	EUR	0	2.480
Obligationen				
2 S IMMO AG 15.10.2019-15.10.2029	AT0000A2AEA8	EUR	0	80.000
3,25 UBM Development AG 11.10.2017-11.10.2022	AT0000A1XBUE	EUR	0	80.000
Investmentfonds				
iShares IV-Digital Security UCITS ETF	IE00BG0J4C88	EUR	0	8.500
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF	IE00BMYDM794	EUR	0	9.580
GESCHLOSSENE FINANZTERMINKONTRAKTE IM BERICHTSJAHR				
EURO STOXX 50 Future Dezember 2022	DE000C52VJW3	EUR	8,00	8,00

Wien, am 11. November 2022

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung