

HALBJAHRESBERICHT  
PCI - DIVERSIFIED MULTI ASSET SELECT STRATEGY  
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄß § 2 ABS. 1 UND 2 INVFG 2011  
FÜR DAS HALBJAHR VOM  
1. MAI 2023 BIS  
31. OKTOBER 2023

# HALBJAHRESBERICHT

## des PCI - Diversified Multi Asset Select Strategy Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 1 und 2 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. Mai 2023 bis 31. Oktober 2023

Sehr geehrter Anteilinhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des PCI - Diversified Multi Asset Select Strategy über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2023 / 2024 vor.

### 1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 35.828  
zu Halbjahresende 36.596

### 2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandswert pro thesaurierendem Anteil ( AT0000A287K4 ) betrug EUR 81,99  
der Nettobestandswert pro thesaurierendem Anteil ( AT0000A2MMG3 ) betrug EUR 93,67

### 3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND 31.10.2023 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN	
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>									
<b>Aktien</b>									
Nestle Namensaktien (CHF)	CH0038863350	CHF	386	0	0	97,7000	39.431,41	1,23	
							<b>39.431,41</b>	<b>1,23</b>	
Novo-Nordisk AS	DK0062498333	DKK	96	96	0	677,7000	8.716,52	0,27	
							<b>8.716,52</b>	<b>0,27</b>	
Aixtron AG Namensaktien	DE000A0WMPJ6	EUR	1.625	1.625	0	26,6900	43.371,25	1,35	
Energias de Portugal SA	PTEDP0AM0009	EUR	12.000	12.000	0	3,8660	46.392,00	1,44	
Infineon Technologies AG	DE0006231004	EUR	1.200	1.200	0	27,2800	32.736,00	1,02	
Ryanair Holdings Plc	IE00BYTBXV33	EUR	3.030	3.030	0	14,3950	43.616,85	1,36	
							<b>166.116,10</b>	<b>5,17</b>	
American Water Works Co.	US0304201033	USD	280	0	0	116,7100	30.814,52	0,96	
Coca-Cola Corporation Shares (USD)	US1912161007	USD	410	0	0	56,1500	21.708,16	0,68	
Microsoft Corporation Shares (USD)	US5949181045	USD	144	0	0	337,3100	45.801,64	1,42	
Waste Management Incorporation	US94106L1098	USD	200	0	0	162,7500	30.693,07	0,95	
							<b>129.017,39</b>	<b>4,01</b>	
<b>Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>							<b>EUR</b>	<b>343.281,42</b>	<b>10,68</b>
<b>Investmentfonds</b>									
Ansa - Global Q Equity Market Neutral S	DE000A3DEBZ3	EUR	940	0	0	108,2600	101.764,40	3,16	
Assenagon Alpha Volatility I	LU0575255335	EUR	85	0	0	01.133,9200	96.383,20	3,00	
DNB Fund TMT Absolute Return	LU1706375778	EUR	11.957	0	2.243	9,9997	119.566,41	3,72	
Flossbach von Storch-Multiple Opportunities II	LU1038809395	EUR	1.616	0	0	154,4000	249.510,40	7,76	
H2O Adagio I-C Sidepocket	FR0013534914	EUR	2	0	0	945,3300	2.126,99	0,07	
Jupiter Global Fund - Dynamic Bond Fund I	LU0853555893	EUR	26.066	0	0	11,8900	309.924,74	9,64	
Jupiter Strategic Absolute Return Bond Fund	IE00BLP58Q81	EUR	12.650	0	0	11,1400	140.921,00	4,38	
Lyxor Epsilon Global Trend Fund	IE00B643RZ01	EUR	626	0	0	153,2098	95.909,33	2,98	
LO Funds - TerreNeuve	LU1858042242	EUR	16.500	4.500	0	8,8074	145.322,10	4,52	
Man Funds VI-Man GLG Alpha Select Alternative	IE00BJQ2XG97	EUR	2.300	0	0	125,3400	288.282,00	8,97	
Man Funds VI-Man GLG Global Investment Grade Opp.	IE000VA5W9H0	EUR	2.210	0	0	98,0200	216.624,20	6,74	
Man Umbrella SICAV - Man AHL Trend Alt.IN H EUR	LU0428380124	EUR	650	0	0	162,2800	105.482,00	3,28	
Nordea 1 SICAV - Alpha 15 MA Fund BP	LU0607983896	EUR	1.873	375	640	86,5296	162.096,85	5,04	
Protea UCITS II - ECO Advisors ESG Absolute Return	LU2002382492	EUR	950	0	0	103,4700	98.296,50	3,06	
PCI-Diversified Equity Income Fund	AT0000ARCUS3	EUR	28.750	0	0	9,7300	279.737,50	8,70	
Uninstitutional Euro Reserve Plus	DE000A1C81J5	EUR	1.995	1.995	0	100,0300	199.559,85	6,21	
Xtrackers II Global Inflation Linked Bond U.ETF 1C	LU0290357929	EUR	680	0	0	204,5605	139.101,14	4,33	
							<b>2.750.608,61</b>	<b>85,54</b>	
<b>Summe Investmentfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>2.750.608,61</b>	<b>85,54</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>3.093.890,03</b>	<b>96,22</b>
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR-Guthaben Kontokorrent</b>									
		EUR	126.327,90				126.327,90	3,93	

<b>Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen</b>					
	USD	128,38		121,06	0,00
<b>Summe der Bankguthaben</b>			<b>EUR</b>	<b>126.448,96</b>	<b>3,93</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>					
<b>Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben</b>					
	EUR	246,94		246,94	0,01
	USD	0,48		0,45	0,00
<b>Verwaltungsgebühren</b>					
	EUR	-4.861,73		-4.861,73	-0,15
<b>Depotgebühren</b>					
	EUR	-85,29		-85,29	0,00
<b>Depotbankgebühren</b>					
	EUR	-53,72		-53,72	0,00
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>			<b>EUR</b>	<b>-4.753,35</b>	<b>-0,15</b>
<b>FONDSVERMÖGEN</b>			<b>EUR</b>	<b>3.215.585,64</b>	<b>100,00</b>
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A287K4		EUR	81,99	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A287K4		STK	18.187,00000	
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A2MMG3		EUR	93,67	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A2MMG3		STK	18.409,58947	

#### Umrechnungskurse/Devisenkurse

Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Umrechnungskursen/Devisenkursen per 30.10.2023 in EUR umgerechnet:

Währung	Einheiten	Kurs	
US-Dollar	1 EUR =	1,06050	USD
Pfund Sterling	1 EUR =	0,87345	GBP
Schweizer Franken	1 EUR =	0,95640	CHF
Dänische Krone	1 EUR =	7,46390	DKK
Norwegische Krone	1 EUR =	11,79050	NOK

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-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.

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

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	KÄUFE ZUGÄNGE	VERKÄUFE ABGÄNGE
<b>Amtlicher Handel und organisierte Märkte</b>				
<b>Aktien</b>				
ASML Holding N.V. (EUR)	NL0010273215	EUR	68	68
KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N. (EUR)	DE000KGX8881	EUR	1.050	1.050
Prismian S.p.A.	IT0004176001	EUR	1.225	1.225
Tenaris S.A.	LU0156801721	EUR	3.550	3.550
Glencore PLC (GBP)	JE00B4T3BW64	GBP	0	5.062
Novo Nordisk B (DKK)	DK0060534915	DKK	48	48
Subsea 7 SA (NOK)	LU0075646355	NOK	4.610	4.610
Pfizer Incorporation Shares	US7170811035	USD	0	486
<b>Investmentfonds</b>				
Bantleon Diversified Markets IA	LU1808872029	EUR	0	1.130
OFI Precious Metals I	FR0011170786	EUR	0	1
SEB Fund 5 - Danish Mortgage Bond Fund B-ID	LU0337316045	EUR	0	2.284
BlackRock GLFds. - World Gold Fund A2-Thes.	LU0055631609	USD	0	796
<b>GESCHLOSSENE FINANZTERMINKONTRAKTE IM BERICHTSJAHR</b>				
EUROSTOXX 50 Future September 2023	DE000C1TL5V9	EUR	4,00	4,00

Wien, am 10. November 2023

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung