

HALBJAHRESBERICHT
MACQUARIE BONDS EUROPE
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄß § 2 ABS. 1 UND 2 INVFG 2011
FÜR DAS HALBJAHR VOM
1. JUNI 2021 BIS
30. NOVEMBER 2021

HALBJAHRESBERICHT

des Macquarie Bonds Europe Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 1 und 2 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. Juni 2021 bis 30. November 2021

Sehr geehrter Anteilinhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des Macquarie Bonds Europe über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2021 / 2022 vor.

Aktuelles Statement zur Corona-Situation (Stand 23. Februar 2021):

Für das Jahr 2021 rechnen wir durch die allmähliche 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, wie sie zuletzt in Großbritannien oder Südafrika aufgetaucht sind, keinen 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 1.413.688
zu Halbjahresende 1.470.095

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro ausschüttendem Anteil (AT0000A1E2B3) betrug EUR 137,59
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000818059) betrug EUR 144,01

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND 30.11.2021 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN EUR	%-ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Obligationen								
0 Bundesrep. Deutschland Anl.v. 10.01.2020-2030	DE0001102499	EUR	3.500.000	0	400.000	103,7280	3.630.480,00	1,74
0 Bundesrepublik Deutschland 08.01.2021-15.02.2031	DE0001102531	EUR	3.500.000	2.500.000	2.000.000	103,4770	3.621.695,00	1,74
0 Bundesrepublik Deutschland 18.06.2021-15.08.2031	DE0001102564	EUR	2.375.000	4.500.000	2.125.000	103,1530	2.449.883,75	1,17
0 Caisse d'Amort Dette Soc.06.10.2020-25.02.2028	FR00140002P5	EUR	1.000.000	0	0	100,9690	1.009.690,00	0,48
0 European Union 27.10.2020-04.10.2030	EU000A283859	EUR	4.750.000	4.750.000	0	100,6950	4.783.012,50	2,29
0 Europäische Union 22.06.2021-04.07.2031	EU000A3K5XE1	EUR	3.200.000	4.000.000	800.000	100,2610	3.208.352,00	1,54
0 Niederlande 24.09.2020-15.01.2052	NL0015614579	EUR	300.000	0	0	95,4390	286.317,00	0,14
0 PSA Banque France 22.01.2021-22.01.2025	FR0014001JP1	EUR	200.000	0	500.000	99,5290	199.058,00	0,10
0 Region of Ile de France 20.04.2021-20.04.2028	FR0014003067	EUR	300.000	0	0	100,5700	301.710,00	0,14
0 Societe du Grand Paris 15.10.2020-25.11.2030	FR00140005B8	EUR	2.000.000	0	0	98,7410	1.974.820,00	0,95
0 UNEDIC 15.10.2020-25.11.2028	FR0014000667	EUR	1.200.000	0	0	100,8740	1.210.488,00	0,58
0 UNEDIC 19.11.2020-19.11.2030	FR0014000L31	EUR	1.500.000	0	0	99,3570	1.490.355,00	0,71
0,01 Gemeinsame Bundesländer Nr.61 08.10.2021-2027	DE000A3MP5P6	EUR	3.500.000	3.500.000	0	101,0730	3.537.555,00	1,70
0,01 Sachsen-Anhalt 15.10.2020-15.10.2027	DE0001789295	EUR	2.000.000	0	0	100,9910	2.019.820,00	0,97
0,05 Santander Consumer Bank 14.02.2020-2030	XS2114143758	EUR	600.000	0	0	99,9370	599.622,00	0,29
0,1 Erste Group Bank AG FRN 16.11.2020-16.11.2028	AT0000A2KW37	EUR	500.000	0	900.000	98,1600	490.800,00	0,24
0,1 Spanien 20.01.2021-30.04.2031	ES0000012H41	EUR	3.500.000	0	0	97,6940	3.419.290,00	1,64
0,1 Westpac Sec. NZ/London 13.07.2021-2027	XS2362968906	EUR	1.600.000	1.600.000	0	98,1670	1.570.672,00	0,75
0,125 Bpifrance Financem. 06.05.2020-26.02.2027	FR0013510724	EUR	1.800.000	0	0	101,9590	1.835.262,00	0,88
0,125 Freie Hansestadt Bremene 29.04.2020-2030	DE000A289KU6	EUR	1.000.000	0	0	101,0230	1.010.230,00	0,48
0,125 Land Schleswig-Holstein 12.06.2019-2029	DE0005SHFM691	EUR	800.000	0	0	101,4000	811.200,00	0,39
0,15 Freie Hansestadt Bremen 26.10.2021-24.10.2031	DE000A3E5V47	EUR	2.125.000	2.125.000	0	100,8320	2.142.680,00	1,03
0,16 Comun. Autón.de Madrid 26.11.2021-30.07.2028	ES00001010G6	EUR	2.175.000	2.175.000	0	100,4260	2.184.265,50	1,05
0,25 Agence Française Dévelop. 02.07.2019-29.06.29	FR0013431137	EUR	2.300.000	0	0	101,9230	2.344.229,00	1,12
0,25 FCA Bank S.p.A.Ireland 29.01.20-28.02.23	XS2109806369	EUR	700.000	0	100.000	100,4340	703.038,00	0,34
0,25 Land Schleswig-Holstein 18.04.2019-18.04.2028	DE0005SHFM683	EUR	1.550.000	0	0	102,3940	1.587.107,00	0,76
0,25 Niederlande 14.02.2019-15.07.2029	NL0013332430	EUR	1.300.000	0	0	104,4590	1.357.967,00	0,65
0,25 Union Natle Interp.Em.Com.Ind.16.07.2020-2035	FR0013524410	EUR	1.800.000	0	0	98,2510	1.768.518,00	0,85
0,25 UNEDIC 17.06.2020-25.11.2029	FR0013518487	EUR	1.300.000	0	0	102,1270	1.327.651,00	0,64
0,375 BNP Paribas FRN 14.10.2020-14.10.2027	FR00140005J1	EUR	500.000	0	0	99,3740	496.870,00	0,24
0,375 Region Wallonne 07.07.21-22.10.31	BE0002816974	EUR	700.000	700.000	0	100,5740	704.018,00	0,34
0,391 Santander UK FRN 28.02.2020-28.02.2025	XS2126058168	EUR	2.000.000	0	0	100,5610	2.011.220,00	0,96
0,419 Comunidad Madrid 27.02.2020-30.04.2030	ES0000101933	EUR	600.000	0	0	101,0000	606.000,00	0,29
0,5 Agence Francaise Develop 17.04.2020-25.05.2030	FR0013507993	EUR	2.700.000	0	0	103,5930	2.797.011,00	1,34
0,5 Bonos Y Oblig del Estado 21.01.2020-30.04.2030	ES0000012F76	EUR	3.500.000	0	0	102,3530	3.582.355,00	1,72
0,5 Italien 01.09.2020-01.02.2026	IT0005419848	EUR	2.600.000	600.000	0	101,7440	2.645.344,00	1,27
0,5 Republic of Austria 05.02.2019-20.02.2029	AT0000A269M8	EUR	300.000	0	0	105,4430	316.329,00	0,15
0,5 Republik Finnland 12.02.2019-15.09.2029	FI4000369467	EUR	100.000	0	0	105,8950	105.895,00	0,05

0,5 Spanien 29.06.2021-31.10.2031	ES0000012132	EUR	958.000	958.000	0	100,7750	965.424,50	0,46
0,5 UNEDIC 23.06.2021-25.05.2036	FR0014004523	EUR	1.500.000	1.500.000	0	100,8240	1.512.360,00	0,73
0,5 Volkswagen Leasing 12.01.2021-12.01.2029	XS2282095970	EUR	450.000	0	500.000	97,6660	439.497,00	0,21
0,6 Bonos Y Oblig del Estado 19.06.2019-31.10.2029	ES0000012F43	EUR	3.500.000	0	0	103,5980	3.625.930,00	1,74
0,6 Italien 23.02.2021-01.08.2031	IT0005436693	EUR	5.000.000	5.000.000	0	96,9830	4.849.150,00	2,33
0,625 SNCF S.A.17.04.20-30	FR0013507647	EUR	3.000.000	0	0	103,8920	3.116.760,00	1,49
0,7 European Union 06.07.2021-2051	EU000A3KTGW6	EUR	650.000	650.000	0	106,3020	690.963,00	0,33
0,7 EFSF 20.01.2020-20.01.2050	EU000A1G0EG5	EUR	550.000	0	0	107,4530	590.991,50	0,28
0,7 Societe du Grand Paris 15.10.2020-15.10.2060	FR00140005R4	EUR	1.900.000	0	0	89,8570	1.707.283,00	0,82
0,75 Intesa Sanpaolo SPA 04.12.2019-04.12.2024	XS2089368596	EUR	400.000	0	0	101,6880	406.752,00	0,20
0,85 Italien 15.11.2019-15.01.2027	IT0005390874	EUR	1.300.000	150.000	50.000	103,0680	1.339.884,00	0,64
0,875 Banco Santander S.A. 09.05.2019-09.05.2031	ES0413900558	EUR	600.000	0	0	106,8740	641.244,00	0,31
0,875 Mediobanca - Bca Cred.Fin.09.12.2019-2026	XS2090859252	EUR	1.500.000	0	0	101,2990	1.519.485,00	0,73
0,875 SNCF 30.10.2020-28.02.2051	FR0014000C08	EUR	2.400.000	0	0	91,6950	2.200.680,00	1,06
0,9 Irland EO-Treasury Bonds 10.01.18-15.05.28	IE00BDHDP444	EUR	750.000	0	0	107,0330	802.747,50	0,38
0,9 Italien, Republik 01.08.2017-01.08.2022	IT0005277444	EUR	500.000	0	1.000.000	100,9470	504.735,00	0,24
0,95 Buoni Poliennali Del Tes 15.6.2021-01.12.2031	IT0005449969	EUR	5.200.000	5.200.000	0	99,7730	5.188.196,00	2,49
1 Agence Francaise Developpement 31.01.2018-2028	FR0013312774	EUR	1.000.000	0	0	107,1810	1.071.810,00	0,51
1 Cr�dit Agricole Assurances FRN 22.04.2020-2026	FR0013508512	EUR	900.000	0	0	102,3040	920.736,00	0,44
1 Credit Agricole ITALIA 25.03.2019-25.03.2027	IT0005366288	EUR	700.000	0	0	105,7050	739.935,00	0,35
1 Danone SA FRN 16.09.2021-OE	FR00140005E6	EUR	900.000	900.000	0	99,3190	893.871,00	0,43
1 Dexia Cr�dit Local S.A. 18.10.17-18.10.27	XS1700578724	EUR	1.000.000	0	0	106,1220	1.061.220,00	0,51
1 Intesa Sanpaolo SPA 04.07.2019-04.07.2024	XS2022425297	EUR	800.000	0	0	102,1760	817.408,00	0,39
1 SNCF S.A.16.06.2020-25.05.2040	FR0013518099	EUR	1.700.000	0	0	101,3490	1.722.933,00	0,83
1,125 Fresenius SE & Co.KGAA 28.09.2020-28.01.2033	XS2237447961	EUR	650.000	0	0	99,7860	648.609,00	0,31
1,125 Kreditanst.f.Wiederaufbau 24.01.17-15.06.37	DE000A2DAR40	EUR	300.000	0	0	113,4460	340.338,00	0,16
1,25 M�nchner R�ckvers.FRN 23.09.2020-26.05.2041	XS2211845683	EUR	800.000	0	0	99,0100	792.080,00	0,38
1,25 Spanien 30.04.2020-31.10.2030	ES0000012G34	EUR	4.000.000	0	0	108,5490	4.341.960,00	2,08
1,25 Union Natle Interp.Em.Com.Ind. 21.10.15-2027	FR0013020450	EUR	1.200.000	0	0	108,8680	1.306.416,00	0,63
1,25 UniCredit S.p.A.FRN 25.06.19-25.06.2025	XS2017471553	EUR	1.000.000	0	0	102,4610	1.024.610,00	0,49
1,375 AXA S.A. FRN 07.04.2021-07.10.2041	XS2314312179	EUR	1.000.000	500.000	0	97,9320	979.320,00	0,47
1,375 Euroclear Investment FRN 16.6.2021-16.6.2051	BE6328904428	EUR	3.000.000	3.000.000	0	97,5190	2.925.570,00	1,40
1,375 Finnland, Republik 15.02.17-15.04.47	FI4000242870	EUR	275.000	0	75.000	126,6040	348.161,00	0,17
1,375 Hannover R�ck FRN 22.03.2021-30.06.2042	XS2320745156	EUR	1.800.000	0	0	98,9670	1.781.406,00	0,85
1,375 Orange S.A. FRN 11.05.2021-OE	FR0014003B55	EUR	1.400.000	500.000	0	97,2220	1.361.108,00	0,65
1,4 Bonos y Oblig del Estado 30.01.2018-2028	ES0000012B39	EUR	1.100.000	0	1.000.000	109,0810	1.199.891,00	0,58
1,45 Bonos Y Oblig del Estado 29.01.19-30.04.29	ES0000012E51	EUR	1.000.000	0	0	110,0350	1.100.350,00	0,53
1,45 Nordrhein-Westfalen, Land 12.12.17-16.02.43	DE000NRW0K75	EUR	300.000	0	0	120,8060	362.418,00	0,17
1,5 Republic of Austria 02.11.2016-02.11.2086	AT0000A1PEF7	EUR	400.000	0	0	135,5790	542.316,00	0,26
1,5 Republic of Austria 23.02.2016-20.02.2047	AT0000A1K9F1	EUR	200.000	0	0	126,0390	252.078,00	0,12
1,6 Deutsche Bahn FIN GmbH FRN 18.10.19-Open End	XS2010039548	EUR	2.000.000	0	0	99,7060	1.994.120,00	0,96
1,625 Nordrhein-Westfalen, Land 24.10.2014-2030	DE000NRW0F26	EUR	100.000	0	0	114,1820	114.182,00	0,05
1,7 Europ.Fin.Stab.Fac.(EFSF)13.02.17-13.02.43	EU000A1G0DL7	EUR	600.000	0	0	126,6340	759.804,00	0,36
1,7 Kingdom of Belgium 05.02.2019-22.06.2050	BE0000348574	EUR	900.000	0	0	124,4120	1.119.708,00	0,54
1,7 Societe Du Grand Paris 03.06.2019-25.05.2050	FR0013422383	EUR	800.000	0	0	120,4230	963.384,00	0,46
1,75 Buoni Poliennali del Tes 01.04.19-01.07.24	IT0005367492	EUR	1.500.000	0	0	105,0920	1.576.380,00	0,76
1,75 Orange S.A. 15.10.2020-OE	FR00140005L7	EUR	1.000.000	0	0	100,1360	1.001.360,00	0,48
1,875 Ageas SA FLR 24.11.2020-24.11.2051	BE6325355822	EUR	1.500.000	1.000.000	0	100,1980	1.502.970,00	0,72
1,875 CNP Assurances SA FRN 12.10.2021-12.10.2053	FR00140005X9	EUR	1.400.000	1.400.000	0	98,9940	1.385.916,00	0,66
1,875 Volkswagen Intl.Finance 30.03.2017-2027	XS1586555945	EUR	400.000	0	0	107,2740	429.096,00	0,21
2 Buoni Poliennali del Tes 01.09.15-01.12.25	IT0005127086	EUR	1.800.000	1.800.000	0	107,8980	1.942.164,00	0,93
2 Ireland Treasury Bonds 10.02.15-18.02.45	IE00BV8C9186	EUR	300.000	0	0	130,0960	390.288,00	0,19
2,121 Allianz SE FRN 22.05.2020-08.07.2050	DE000A254TM8	EUR	100.000	0	0	105,2180	105.218,00	0,05
2,125 Intesa Sanpaolo SPA 30.08.2018-30.08.2023	XS1873219304	EUR	700.000	0	0	103,9050	727.335,00	0,35
2,125 Obrigacoes Do Tesouro 17.01.18-17.10.28	PTOTEV0E0018	EUR	300.000	0	0	115,0340	345.102,00	0,17
2,5 Achmea B.V. FRN 24.09.2019-24.09.2039	XS2056491660	EUR	500.000	0	0	101,8830	509.415,00	0,24
2,5 Netherlands Government 09.03.2012 - 15.01.2033	NL0010071189	EUR	400.000	0	0	129,2380	516.952,00	0,25
2,5 Sampo OYJ FRN 03.09.2020-03.09.2052	XS2226645278	EUR	1.500.000	500.000	0	105,5690	1.583.535,00	0,76
2,6 Allianz SE FRN 07.09.2021-OE	DE000A3E5TR0	EUR	5.000.000	5.000.000	0	95,0410	4.752.050,00	2,28
2,7 Bonos y Oblig del Estado 27.02.18-31.10.48	ES0000012B47	EUR	400.000	0	0	135,5870	542.348,00	0,26
2,714 Swiss Re Finance (UK) FRN 4.6.2020-4.6.2052	XS2181959110	EUR	2.200.000	1.200.000	0	107,6090	2.367.398,00	1,14
2,75 Helvetia Europe SA FRN 30.06.2020-30.09.2041	XS2197076651	EUR	1.900.000	400.000	0	108,0160	2.052.304,00	0,98
2,75 Netherlands Government 21.02.2014-15.01.2047	NL0010721999	EUR	700.000	0	0	167,1630	1.170.141,00	0,56
2,75 Peugeot S.A. 15.05.2020-2026	FR0013512944	EUR	500.000	0	0	109,2660	546.330,00	0,26
2,8 Buoni Poliennali del Tes 11.10.16-01.03.67	IT0005217390	EUR	900.000	0	0	114,9980	1.034.982,00	0,50
2,875 Merck KGAA FRN 25.06.2019-25.06.2079	XS2011260705	EUR	1.500.000	0	0	107,1470	1.607.205,00	0,77
2,875 Obrigacoes do Tesouro 21.01.16-21.07.2026	PTOTET0E0012	EUR	500.000	0	0	115,3580	576.790,00	0,28
3 Fresenius Finance Ireland PLC 30.01.2017-2032	XS1554373834	EUR	500.000	0	0	118,2080	591.040,00	0,28
3,25 Bundesrepublik Deutschland 23.07.10-04.07.42	DE0001135432	EUR	800.000	0	0	172,1430	1.377.144,00	0,66
3,35 Buoni Poliennali Del Tes 22.1.2019-1.3.2035	IT0005358806	EUR	1.500.000	0	0	125,6160	1.884.240,00	0,90
3,375 ASR Nederland NV FRN 02.05.2019-02.05.2049	XS1989708836	EUR	1.900.000	900.000	0	109,3200	2.077.080,00	1,00
3,45 Bonos y Oblig del Estado 18.05.2016-2066	ES00000128E2	EUR	1.050.000	0	0	157,3010	1.651.660,00	0,79
3,85 Republik Italien 13.02.2019-01.09.2049	IT0005363111	EUR	1.500.000	0	0	144,7620	2.171.430,00	1,04
3,875 Ageas FRN 10.12.2019-Open End	BE6317598850	EUR	3.400.000	3.200.000	0	101,5640	3.453.176,00	1,66
3,875 Volkswagen Intl. Fin. NV FRN 17.06.2020-OE	XS2187689380	EUR	3.500.000	1.000.000	0	107,8030	3.773.105,00	1,81
3,941 AXA S.A. FRN 07.11.2014-OEnd	XS1134541306	EUR	700.000	0	0	108,6650	760.655,00	0,36
4.1 Obrigacoes Do Tesouro 20.01.2015-15.02.2045	PTOTEB0E0020	EUR	200.000	0	0	165,1610	330.322,00	0,16
4,375 La Mondiale FRN 24.10.2019-Open End	FR0013455854	EUR	2.100.000	2.000.000	0	106,2940	2.232.174,00	1,07
4,5 Italien, Republik 01.03.2013-01.05.2023	IT0004898034	EUR	1.700.000	0	0	107,1550	1.821.635,00	0,87
4,5 Italien, Republik 01.08.2013-01.03.2024	IT0004953417	EUR	2.000.000	0	0	110,8160	2.216.320,00	1,06
4,75 Bundesrep. Deutschland 31.01.2003-04.07.2034	DE0001135226	EUR	1.650.000	0	0	165,6910	2.733.901,50	1,31
4,75 Italien, Republik 22.01.2013-01.09.2028	IT0004889033	EUR	2.400.000	0	0	128,2030	3.076.872,00	1,48
5 Italien, Republik 01.03.2009-01.03.2025	IT0004513641	EUR	2.800.000	1.800.000	0	116,6310	3.265.668,00	1,57
5,15 Spanien 16.07.2013-31.10.2028	ES00000124C5	EUR	1.590.000	0	910.000	135,4740	2.154.036,60	1,03
5,25 Italien, Republik 01.11.1998-01.11.2029	IT0001278511	EUR	2.750.000	0	0	135,8980	3.737.195,00	1,79
5,5 Italien, Republik 01.05.2012-01.11.2022	IT0004848831	EUR	1.600.000	0	0	105,5350	1.688.560,00	0,81
5,75 Spanien 30.07.2002-30.07.2032	ES0000012411	EUR	500.000	0	0	155,7620	778.810,00	0,37
5,9 Bonos Y Oblig del Estado 15.03.2011-30.07.2026	ES00000123C7	EUR	1.400.000	0	0	129,1310	1.807.834,00	0,87
							197.976.771,85	94,93
Summe amtlicher Handel und organisierte M�rkte		EUR					197.976.771,85	94,93
Neuemissionen "Zulassung zum Amtlichen Handel vorgesehen"								
Obligationen								
0 FCA Bank SPA Ireland 16.04.2021-16.04.2024	XS2332254015	EUR	750.000	0	0	99,7450	748.087,50	0,36
0,325 UniCredit S.p.A. 19.01.2021-19.01.2026	XS2289133915	EUR	2.500.000	0	0	99,2920	2.482.300,00	1,19
0,75 Intesa Sanpaolo SPA 16.03.2021-16.03.2028	XS2317069685	EUR	500.000	0	500.000	99,8420	499.210,00	0,24
							3.729.597,50	1,79
Summe der Neuemissionen "Zulassung zum amtlichen Handel vorgesehen"		EUR					3.729.597,50	1,79

Summe Wertpapiervermögen					EUR	201.706.369,35	96,72
Finanzterminkontrakte mit Absicherungszweck							
Verkaufte Finanzterminkontrakte (Short-Position)							
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Zinsterminkontrakte							
Euro-Buxl Future Dezember 2021	DE000C58EEK2	EUR	-35	215,5800		-240.100,00	-0,12
Euro-BTP Future Dezember 2021	DE000C58EEE5	EUR	-60	151,4000		152.400,00	0,07
Euro-BUND Future Dezember 2021	DE000C58EEG0	EUR	-59	172,0200		14.750,00	0,01
						-72.950,00	-0,03
Summe der Finanzterminkontrakte mit Absicherungszweck					EUR	-72.950,00	-0,03
Finanzterminkontrakte ohne Absicherungszweck							
Gekaufte Finanzterminkontrakte (Long-Position)							
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Zinsterminkontrakte							
Euro-BOBL Future Dezember 2021	DE000C58EEH8	EUR	173	135,5400		-31.140,00	-0,01
						-31.140,00	-0,01
Summe der Finanzterminkontrakte ohne Absicherungszweck					EUR	-31.140,00	-0,01
Bankguthaben							
EUR-Guthaben Kontokorrent							
		EUR	6.074.376,48			6.074.376,48	2,91
Summe der Bankguthaben					EUR	6.074.376,48	2,91
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsansprüche aus Wertpapieren							
		EUR	931.873,21			931.873,21	0,45
Spesen Zinsertrag							
		EUR	-3.278,20			-3.278,20	0,00
Verwaltungsgebühren							
		EUR	-52.147,13			-52.147,13	-0,03
Depotgebühren							
		EUR	-2.522,21			-2.522,21	0,00
Depotbankgebühren							
		EUR	-2.607,36			-2.607,36	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände					EUR	871.318,31	0,42
FONDSVERMÖGEN							
					EUR	208.547.974,14	100,00
Anteilwert Ausschüttungsanteile	AT0000A1E2B3	EUR				137,59	
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1E2B3	STK				492.468,67300	
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000818059	EUR				144,01	
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000818059	STK				977.626,37400	
Marktschlüssel	Börseplatz						
EUREX Frankfurt AG	EUREX Frankfurt Aktiengesellschaft						

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.

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

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
Amtlicher Handel und organisierte Märkte				
Obligationen				
0 Bundesrep. Deutschland 19.06.2020-15.08.2030	DE0001102507	EUR	0	4.700.000
0 Bundesrep. Deutschland Anl.v.2019-2050	DE0001102481	EUR	0	600.000
0 BRD 31.01.2020-11.04.2025	DE0001141810	EUR	0	1.750.000
0 EFSF 13.10.2020-13.10.2027	EU000A1G0EK7	EUR	0	700.000
0 Kreditanst.f.Wiederaufbau 20.10.2020-15.12.2027	DE000A289F29	EUR	0	1.600.000
0 Veolia Environnement S.A. 14.01.2021-14.01.2027	FR0014001150	EUR	0	1.000.000
0,01 Belfius Bank S.A. 15.10.2020-15.10.2025	BE6324720299	EUR	0	400.000
0,1 Bundesrep.Inf.Linkd 11.02.2021-15.04.2033	DE0001030583	EUR	0	7.100.000
0,125 Belfius Bank SA/NV 08.02.2021-2028	BE6326784566	EUR	0	700.000
0,25 Banco Santander SA 10.07.2019-10.07.2029	ES0413900566	EUR	0	1.300.000
0,3 American Honda Finance 09.07.2021-07.07.2028	XS2363117321	EUR	1.900.000	1.900.000
0,375 Daimler AG 08.08.2019-08.11.2026	DE000A2YNZW8	EUR	0	300.000
0,5 European Union 06.02.2018-04.04.2025	EU000A19VVY6	EUR	1.750.000	1.750.000
0,625 Banque Fed Cred Mutuel 21.10.2020-21.02.2031	FR0014000717	EUR	0	500.000
0,75 Austria Republic 23.02.2016-20.10.2026	AT0000A1K9C8	EUR	0	1.000.000
0,75 Daimler AG 10.09.2020-10.09.2030	DE000A289QR9	EUR	0	1.100.000
0,75 Finnland, Republik 10.03.2015-15.04.2031	FI4000148630	EUR	0	200.000
0,875 Hera S.p.A. 05.07.2019-05.07.2027	XS2020608548	EUR	0	500.000
1,25 Banco Santander SA 26.09.2017-26.09.2027	PTBSRJOM0023	EUR	0	400.000
1,25 Buoni Poliennalo Del Tes 14.10.2015-2032	IT0005138828	EUR	0	7.950.000
1,625 Ausnet Services Holdings FRN 11.03.2021-2081	XS2308313860	EUR	0	1.400.000
1,75 Danone SA FRN 30.10.17-oe	FR0013292828	EUR	0	500.000
1,807 Telefonica Emisiones 21.05.2020-2032	XS2177442295	EUR	0	500.000
2 Daimler AG 22.05.2020-22.08.2026	DE000A289XJ2	EUR	0	500.000
2,625 Allianz SE FLR 17.11.2020-OE	DE000A289FK7	EUR	800.000	3.400.000
2,875 Obrigaçoos do Tesouro 20.01.2015-15.10.2025	PTOTEKOE0011	EUR	0	1.500.000
3,375 Europ.Fin.Stab.Facility 19.06.12-03.04.37	EU000A1G0AT6	EUR	0	1.000.000
5,5 Italien, Republik 01.03.2012-01.09.2022	IT0004801541	EUR	0	1.200.000
Neuemissionen "Zulassung zum Amtlichen Handel vorgesehen"				
Obligationen				
0,25 Acea S.p.a. 28.01.2021-28.07.2030	XS2292487076	EUR	0	500.000
0,8 UniCredit SPA FRN 05.07.2021-2029	XS2360310044	EUR	1.000.000	1.000.000
0 Italien Buoni Ordinari del Tes 14.07.2020-2021	IT0005415945	EUR	0	3.000.000
GESCHLOSSENE FINANZTERMINKONTRAKTE IM BERICHTSJAHR				
Euro-Buxl Future Juni 2021	DE000C5SRQDD3	EUR	35,00	0
Euro-Buxl Future September 2021	DE000C52GUH2	EUR	35,00	35,00
Euro-BTP Future Dezember 2021	DE000C58EEE5	EUR	5,00	5,00
Euro-BTP Future Juni 2021	DE000C5SRQD86	EUR	18,00	0
Euro-BTP Future Juni 2021	DE000C5SRQD86	EUR	47,00	0
Euro-BUND Future Dezember 2021	DE000C58EEG0	EUR	180,00	180,00
Euro-BUND Future Juni 2021	DE000C5SRQDA9	EUR	80,00	0
Euro-BUND Future Juni 2021	DE000C5SRQDA9	EUR	90,00	0
Euro-BUND Future Juni 2021	DE000C5SRQDA9	EUR	35,00	0
Euro-BUND Future Juni 2021	DE000C5SRQDA9	EUR	35,00	0
Euro-BUND Future September 2021	DE000C52GUE9	EUR	240,00	240,00
EURO-BTP Future September 2021	DE000C52GUC3	EUR	65,00	65,00
Euro-BOBL Future Juni 2021	DE000C5SRQDB7	EUR	0	173,00
Euro-BOBL Future September 2021	DE000C52GUF6	EUR	173,00	173,00

Wien, am 20. Dezember 2021

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung