

HALBJAHRESBERICHT
CALYPSO FUND
MITEIGENTUMSFONDS GEMÄß § 166 INVFG 2011
FÜR DAS HALBJAHR VOM
1. JÄNNER 2023 BIS
30. JUNI 2023

HALBJAHRESBERICHT

des Calypso Fund Miteigentumsfonds gemäß § 166 InvFG 2011 für das Halbjahr vom 1. Jänner 2023 bis 30. Juni 2023

Sehr geehrter Anteilinhaber,

die LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H. legt hiermit den Halbjahresbericht des Calypso Fund über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2023 / 2023 vor.

1. Anzahl der umlaufenden Anteile

zu Rechnungsjahresbeginn 54.131
zu Halbjahresende 10.906

2. Nettobestandswert je Anteil

der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A1EPD2) betrug USD 1.214,55
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A1H3H5) betrug USD 1.194,86
der Nettobestandpreis pro thesaurierendem Anteil (AT0000A1PCC8) betrug USD 1.233,29
der Nettobestandpreis pro vollthesaurierendem Anteil (AT0000A1EPE0) betrug USD 1.234,04

3. Zusammensetzung des Fondsvermögens

WERTPAPIERBEZEICHNUNG	WP-NR.	WÄHRUNG	BESTAND 30.06.2023 STK./NOM.	KÄUFE ZUGÄNGE IM BERICHTSZEITRAUM	VERKÄUFE ABGÄNGE ABGÄNGE	KURS	KURSWERT IN USD	%-ANTEIL AM FONDS- VERMÖGEN
Amtlicher Handel und organisierte Märkte								
Aktien								
Abbott Laboratories	US0028241000	USD	3.075	0	11.925	107,6600	331.054,50	2,47
Accenture Plc.(USD)	IE00B4BNMY34	USD	405	0	1.595	308,3300	124.873,65	0,93
Alphabet Inc.A shares (USD)	US02079K3059	USD	3.275	0	12.725	119,1000	390.052,50	2,91
Amazon.com Inc.	US0231351067	USD	1.105	0	4.395	127,9000	141.329,50	1,05
American Express	US0258161092	USD	1.740	0	6.760	172,0800	299.419,20	2,23
Ansys Intcorporation Shares (USD)	US03662Q1058	USD	510	0	1.990	326,0500	166.285,50	1,24
Berkshire Hathaway Incorporation Shares B (USD)	US0846707026	USD	815	0	3.185	336,9100	274.581,65	2,05
Booking Holdings Inc.	US0985711089	USD	115	0	4852.655	9100	305.429,65	2,28
Check Point Software Technologies Limited	IL0010824113	USD	1.700	1.700	0	127,9400	217.498,00	1,62
Corteva Inc.	US2205211044	USD	2.850	2.850	0	57,7000	164.445,00	1,23
Costco Wholesale Corporation	US22160K1051	USD	610	0	2.390	531,6900	324.330,90	2,42
Ecolab Incorporation	US2788651006	USD	575	0	4.925	183,8800	105.731,00	0,79
Electronic Arts Inc.	US2855121099	USD	1.025	0	3.975	130,4500	133.711,25	1,00
Entegris Inc.	US29362U1043	USD	1.005	0	3.995	108,9700	109.514,85	0,82
Estee Lauder Shares (USD)	US5184391044	USD	1.435	0	5.565	192,5300	276.280,55	2,06
Fiserv Incorporation	US3377381088	USD	3.275	0	12.725	124,0500	406.263,75	3,03
Home Depot Incorporation	US4370761029	USD	920	0	3.580	307,8200	283.194,40	2,11
International Business Machines (IBM) Shares (U\$)	US4592001014	USD	2.000	2.000	0	134,0600	268.120,00	2,00
Intuit Inc.	US4612021034	USD	510	0	1.990	455,8200	232.468,20	1,73
Intuitive Surgical Inc.	US46120E6023	USD	585	0	2.265	338,4900	198.016,65	1,48
JPMorgan Chase & Co. (USD)	US46625H1005	USD	2.050	0	7.950	143,4300	294.031,50	2,19
McCormick & Company Inc.	US5797802064	USD	1.510	0	6.490	86,7800	131.037,80	0,98
Medtronic Inc. (USD)	IE00BTN1Y115	USD	2.080	0	7.920	86,7700	180.481,60	1,35
Microsoft Corporation Shares (USD)	US5949181045	USD	1.530	0	5.970	335,0500	512.626,50	3,82
Motorola Solutions Inc. Registered Shares DL -,01	US6200763075	USD	1.435	0	5.565	288,5900	414.126,65	3,09
MSCI Incorporated Shares (USD)	US55354G1004	USD	325	0	1.275	462,0700	150.172,75	1,12
Nasdaq Stock Market Inc.	US6311031081	USD	4.920	0	19.080	49,8500	245.262,00	1,83
NextEra Energy Incorporation	US65339F1012	USD	4.300	0	16.700	72,8100	313.083,00	2,33
Nike Incorp.(USD)	US6541061031	USD	1.225	0	4.775	113,3700	138.878,25	1,04
Novo-Nordisk AS B ADRs/1 DK 10 (USD)	US6701002056	USD	3.075	0	11.925	157,0300	482.867,25	3,60
S&P Global Inc.	US78409V1044	USD	920	0	3.580	395,8400	364.172,80	2,71
Salesforce.com Inc.	US79466L3024	USD	985	0	5.515	210,4300	207.273,55	1,55
Skyworks Solution Incorporation	US83088M1027	USD	1.015	0	3.985	109,8800	111.528,20	0,83
Starbucks Corporation (USD)	US8552441094	USD	3.795	0	14.705	98,6800	374.490,60	2,79
Thermo Fisher Scientific Inc.	US8835561023	USD	385	0	1.495	514,3900	198.040,15	1,48
Union Pacific Shares (USD)	US9078181081	USD	1.105	0	4.295	204,6500	226.138,25	1,69
United Health Group Incorporation	US91324P1021	USD	690	120	2.230	476,4400	328.743,60	2,45
Ventas Inc.	US92276F1003	USD	4.830	4.830	0	47,6200	230.004,60	1,71
Versik Analytics Inc-Class A	US92345Y1064	USD	1.020	0	3.980	223,2700	227.735,40	1,70
VISA Inc. Class A Shares	US92826C8394	USD	1.075	0	4.175	234,3200	251.894,00	1,88
Wabtec Corp.(USD)	US9297401088	USD	2.050	0	7.950	108,0100	221.420,50	1,65
Walt Disney Holdings Corporation	US2546871060	USD	1.525	0	5.975	88,9500	135.648,75	1,01
Waste Connections Inc.(USD)	CA94106B1013	USD	1.230	0	4.770	140,2700	172.532,10	1,29
Zoetis Inc.	US98978V1035	USD	1.020	0	3.980	171,8700	175.307,40	1,31
							10.840.097,90	80,80
Obligationen								
0 US Treasury 05.01.2023-06.07.2023	US912796ZS11	USD	1.000.000	1.000.000	0	99,9136	999.136,00	7,45
0,824 JPMorgan Chase & Co. FRN 01.6.2021-01.6.2025	US46647PCH73	USD	175.000	850.000	675.000	95,0380	166.316,50	1,24
0,981 Bank of America Corp.FRN 25.9.2020-25.9.2025	US06051GJG55	USD	175.000	850.000	675.000	93,9060	164.335,50	1,22
1,25 General Motors 08.01.2021-08.01.2026	US37045XD057	USD	185.000	900.000	715.000	89,2990	165.203,15	1,23
1,750 US-Treasury 15.11.2019-15.11.2029	US912828YS30	USD	420.000	0	2.580.000	87,6289	368.041,42	2,74
1,95 Broadcom Inc. 19.01.2021-15.02.2028	USU1109MAP15	USD	185.000	900.000	715.000	86,4350	159.904,75	1,19
3 IBM Corp.15.05.2019-15.05.2024	US459200Y80	USD	209.000	850.000	641.000	97,7190	204.232,71	1,52
							2.227.170,03	16,60

Summe amtlicher Handel und organisierte Märkte						USD	13.067.267,93	97,40	
Summe Wertpapiervermögen						USD	13.067.267,93	97,40	
Finanzterminkontrakte mit Absicherungszweck									
Verkaufte Finanzterminkontrakte (Short-Position)									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Wertpapier-Indexkontrakte									
S&P EMini Future September 2023	ESU3	USD	-12	0	124.435,7500		-60.000,00	-0,45	
							-60.000,00	-0,45	
Summe der Finanzterminkontrakte mit Absicherungszweck						USD	-60.000,00	-0,45	
Bankguthaben									
USD-Guthaben Kontokorrent									
		USD	396.408,98				396.408,98	2,95	
Guthaben Kontokorrent in sonstigen EU-Währungen		EUR	1.065,27				1.165,19	0,01	
Guthaben Kontokorrent in nicht EU-Währungen		CAD	304,63				229,75	0,00	
		CHF	427,75				478,25	0,00	
Summe der Bankguthaben						USD	398.282,17	2,97	
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
USD-Verbindlichkeiten Kontokorrent									
		USD	-0,05				-0,05	0,00	
Summe kurzfristige Verbindlichkeiten						USD	-0,05	0,00	
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche aus Kontokorrentguthaben									
		CAD	2,66				2,01	0,00	
		CHF	0,46				0,51	0,00	
		EUR	6,83				7,47	0,00	
		USD	14.735,35				14.735,35	0,11	
Zinsansprüche aus Wertpapieren		USD	4.729,36				4.729,36	0,04	
Dividendenansprüche		USD	5.439,91				5.439,91	0,04	
Verwaltungsgebühren		USD	-14.357,67				-14.357,67	-0,11	
Depotgebühren		USD	-435,45				-435,45	0,00	
Summe sonstige Vermögensgegenstände						USD	10.121,49	0,08	
FONDSVERMÖGEN							USD	13.415.671,54	100,00
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A1EPD2	USD					1.214,55		
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1EPD2	STK					1.350,00000		
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A1H3H5	USD					1.194,86		
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1H3H5	STK					255,00000		
Anteilwert Thesaurierungsanteile	AT0000A1PCC8	USD					1.233,29		
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1PCC8	STK					9.300,44604		
Anteilwert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1EPE0	USD					1.234,04		
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1EPE0	STK					1,00000		
Umrechnungskurse/Devisenkurse									
Vermögenswerte in fremder Währung wurden zu den Umrechnungskursen/Devisenkursen per 29.06.2023 in USD umgerechnet:									
Währung	Einheiten	Kurs							
Euro	1 USD =	0,91424	EUR						
Kanadischer Dollar	1 USD =	1,32592	CAD						
Schweizer Franken	1 USD =	0,89440	CHF						
Marktschlüssel	Börseplatz								
Börse Chicago BOE	Chicago Board Options Exchange								

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				
Aktien				
Bank of America Corporation (USD)	US0605051046	USD	0	15.000
FedEx Corporation	US31428X1063	USD	0	3.730
Johnson & Johnson Shares (USD)	US4781601046	USD	0	9.000
KKR & Co. Inc. Cl.A	US48251W1045	USD	0	7.000
Markel Corp.	US5705351048	USD	0	900
Obligationen				
0,625 US-Treasury 17.08.2020-15.08.2030	US91282CAE12	USD	0	2.000.000
0 Treasury Bill 06.10.2022-06.04.2023	US912796YN33	USD	0	5.990.000
GESCHLOSSENE FINANZTERMINKONTRAKTE IM BERICHTSJAHR				
E-Mini S&P 500 Future März 2023	ESH3	USD	50,00	0
S&PEmini Future Juni 2023	ESM3	USD	50,00	50,00

Wien, am 03. Juli 2023

LLB Invest Kapitalanlagegesellschaft m.b.H.

Die Geschäftsführung