

# **ERSTE BOND DOLLAR**

**Miteigentumsfonds gemäß InvFG**

Halbjahresbericht 2022/23

## Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft .....	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.03.2023 .....	5

## Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft

<b>Die Gesellschaft</b>	Erste Asset Management GmbH Am Belvedere 1, A-1100 Wien Telefon: 05 0100-19777, Telefax: 05 0100-919777
<b>Stammkapital</b>	2,50 Mio. EURO
<b>Gesellschafter</b>	Erste Group Bank AG (64,67 %) Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG (22,17 %) Steiermärkische Bank und Sparkassen Aktiengesellschaft (3,30 %) Tiroler Sparkasse Bankaktiengesellschaft Innsbruck (1,74 %) DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt (1,65 %) „Die Kärntner“ Trust-Vermögensverwaltungsgesellschaft m. b. H. & Co KG (1,65 %) Salzburger Sparkasse Bank Aktiengesellschaft (1,65 %) Sieben Tiroler Sparkassen Beteiligungsgesellschaft m. b. H. (1,65 %) NÖ-Sparkassen Beteiligungsgesellschaft m. b. H. (0,76 %) VIENNA INSURANCE GROUP AG Wiener Versicherung Gruppe (0,76 %)
<b>Aufsichtsrat</b>	Mag. Rudolf SAGMEISTER (Vorsitzender) Manfred BARTALSZKY Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER (Vorsitzender-Stv.) Radovan JELASITY Mag. Ertan PISKIN (ab 10.10.2022) Dr. Peter PROBER Gabriele SEMMELROCK-WERZER Mag. Reinhard WALTL Mag. Gerald WEBER vom Betriebsrat entsandt: Martin CECH Mag. Regina HABERHAUER Ing. Heinrich Hubert REINER Peter RIEDERER Nicole WEINHENGST Mag. Manfred ZOUREK
<b>Geschäftsführer</b>	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
<b>Prokuristen</b>	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
<b>Staatskommissäre</b>	Mag. Wolfgang EXL Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
<b>Fondsprüfer</b>	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
<b>Depotbank</b>	Erste Group Bank AG

## Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND DOLLAR Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.10.2022 bis 31.03.2023 vorzulegen.

## Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.03.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf US-Dollar lautend	202,4	92,40
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	8,9	4,07
Wertpapiere	211,3	96,47
Devisentermingeschäfte	-0,1	-0,03
Financial Futures	-0,3	-0,16
Bankguthaben	7,1	3,24
Zinsenansprüche	1,1	0,49
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	219,1	100,00

# Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.10.2022 bis 31.03.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
<b>Investmentzertifikate</b>									
<b>Investmentzertifikate auf Euro lautend</b>									
<b>Emissionsland Österreich</b>									
ERSTE ALPHA 1 T	AT0000A03DF2		19.545	1.821	40.225	55,490	2.232.085,25	1,02	
ERSTE ALPHA 2 T	AT0000A05F50		39.747	2.201	85.001	78,620	6.682.778,62	3,05	
							Summe Emissionsland Österreich	8.914.863,87	4,07
							Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	8.914.863,87	4,07
							Summe Investmentzertifikate	8.914.863,87	4,07
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>									
<b>Anleihen auf US-Dollar lautend</b>									
<b>Emissionsland Israel</b>									
ISRAEL 20/30	US46513JB346	2,750	1.500	0	2.500	90,420	2.080.629,53	0,95	
							Summe Emissionsland Israel	2.080.629,53	0,95
<b>Emissionsland Panama</b>									
PANAMA 14/24	US698299BD54	4,000	0	0	2.000	98,236	1.808.385,11	0,83	
							Summe Emissionsland Panama	1.808.385,11	0,83
<b>Emissionsland Portugal</b>									
PORTUGAL 14/24 MTN REGS	XS1085735899	5,125	0	0	2.000	99,950	1.839.937,41	0,84	
							Summe Emissionsland Portugal	1.839.937,41	0,84
<b>Emissionsland Ungarn</b>									
HUNGARY 14/24	US445545AL04	5,375	0	0	1.000	100,056	920.944,36	0,42	
							Summe Emissionsland Ungarn	920.944,36	0,42
<b>Emissionsland Uruguay</b>									
URUGUAY 13/24	US760942AZ58	4,500	0	0	1.000	100,100	614.232,90	0,28	
							Summe Emissionsland Uruguay	614.232,90	0,28
<b>Emissionsland USA</b>									
US TREASURY 2023	US912828S927	1,250	3.000	0	8.500	98,759	7.726.554,37	3,53	
US TREASURY 2024	US912828XT22	2,000	9.700	0	20.500	97,195	18.339.582,28	8,37	

## ERSTE BOND DOLLAR

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
US TREASURY 2025	US912828K742	2,000	17.700	5.500	23.000	95,668	20.252.780,04	9,25
US TREASURY 2026	US912828U246	2,000	8.400	0	16.900	94,047	14.629.225,35	6,68
US TREASURY 2027	US9128282R06	2,250	6.700	0	16.200	94,332	14.065.800,56	6,42
US TREASURY 2028	US9128283W81	2,750	2.000	0	13.200	96,055	11.670.319,68	5,33
US TREASURY 2028	US9128285M81	3,125	7.100	0	13.100	97,484	11.754.294,38	5,37
US TREASURY 2036	US912810FT08	4,500	12.500	5.500	15.000	111,172	15.348.871,32	7,01
US TREASURY 2044	US912810RJ97	3,000	13.000	7.000	14.000	87,227	11.240.019,16	5,13
US TREASURY 2048	US912810SA79	3,000	3.800	0	11.400	87,227	9.152.587,03	4,18
USA 19/29	US912828YB05	1,625	12.200	11.000	9.500	89,195	7.799.304,84	3,56
USA 20/30	US912828Z948	1,500	1.000	0	6.700	87,664	5.406.132,10	2,47
USA 20/30	US91282CAV37	0,875	4.600	0	10.200	82,781	7.771.814,17	3,55
USA 20/40	US912810SQ22	1,125	11.500	0	23.500	66,098	14.296.975,62	6,53
USA 22/29	US91282CFL00	3,875	5.000	0	5.000	101,641	4.677.648,53	2,14
USA 22/32	US91282CFF32	2,750	14.000	0	14.000	94,109	12.126.938,65	5,54
USA 22/52	US912810TJ79	3,000	18.500	7.500	11.000	87,844	8.893.932,07	4,06
Summe Emissionsland USA							195.152.780,15	89,08
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,08645							202.416.909,46	92,40
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							202.416.909,46	92,40

### Derivate

nicht realisiertes  
Ergebnis in EUR

#### Financial Futures auf US-Dollar lautend

##### Emissionsland USA

US 10YR NOTE (CBT) Jun23	TN1M23				-115		-278.012,68	-0,13
US 5YR NOTE (CBT) Jun23	CTNM23				-6		-2.372,99	-0,00
US LONG BOND(CBT) Jun23	\$TBDM23				-16		-68.399,37	-0,03
Summe Emissionsland USA							-348.785,04	-0,16
Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,08645							-348.785,04	-0,16
Summe Derivate							-348.785,04	-0,16

### Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes  
Ergebnis in EUR

#### Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

##### Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/USD 20.04.2023	FXF_TAX_3463768				-10.261.547		-69.515,80	-0,03
Summe Emissionsland Österreich							-69.515,80	-0,03
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							-69.515,80	-0,03
Summe Devisentermingeschäfte							-69.515,80	-0,03

**Gliederung des Fondsvermögens**

Wertpapiere	211.331.773,33	96,47
Devisentermingeschäfte	-69.515,80	- 0,03
Financial Futures	-348.785,04	- 0,16
Bankguthaben	7.091.730,85	3,24
Zinsenansprüche	1.069.761,35	0,49
Sonstige Abgrenzungen	-9.144,78	- 0,00
<b>Fondsvermögen</b>	<b>219.065.819,91</b>	<b>100,00</b>

**Hinweis an die Anleger:**

**Die Bewertung von Vermögenswerten in illiquiden Märkten kann von ihren tatsächlichen Veräußerungspreisen abweichen.**

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000982723	Stück	51.625,600
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000982723	USD	58,13
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858360	Stück	321.293,027
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858360	EUR	53,44
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR62	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR62	USD	118,80
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR70	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR70	EUR	109,35
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000817523	Stück	29.902,540
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000817523	USD	122,01
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812961	Stück	662.796,682
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812961	EUR	112,34
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR88	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR88	USD	118,80
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR96	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR96	EUR	108,23
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673207	Stück	91.619,056
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673207	EUR	124,21
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000605324	Stück	31.358,860
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000605324	USD	135,06
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRA2	Stück	924.645,965
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRA2	USD	120,65
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRB0	Stück	30.049,008
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRB0	EUR	111,09

---

## ERSTE BOND DOLLAR

---

Der Poolfaktor gilt als Maß für Teiltilgungen von Anleihen, der das Verhältnis der noch nicht getilgten Summe zum unverändert bleibenden Nominalwert angibt.

Zu Beginn hat der Poolfaktor den Wert 1, der bis zur ersten Teiltilgung steigt und sich ab Tilgungsbeginn entsprechend der Tilgungsbedingungen reduziert, bis er am Ende den Wert 0 hat.

Folgender Poolfaktor ist für die Kurswertermittlung relevant:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Poolfaktor	Kurswert in EUR
URUGUAY 13/24	US760942AZ58	0,66667	614.232,90

Pensionsgeschäfte iSd der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Pensionsgeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

Für den Investmentfonds wurden keine Total Return Swaps (Gesamtrenditeswaps) iSd VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) in der Berichtsperiode abgeschlossen.

Der Einsatz von Wertpapierleihegeschäften iSd der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) ist gemäß den Fondsbestimmungen zulässig. Während der Berichtsperiode gab es keine Wertpapierleihegeschäfte.

### **Erläuterung zum Ausweis gemäß der delegierten Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards zu Risikominderungstechniken für nicht durch eine zentrale Gegenpartei gelearnte OTC-Derivatekontrakte:**

Alle OTC Derivate werden über die Erste Group Bank AG gehandelt.

Im Falle des negativen Exposures der Derivate werden unter Berücksichtigung der vertraglich vereinbarten Schwelle Sicherheiten in Form von Barmitteln oder Anleihen an die Erste Group Bank AG geleistet.

Im Falle des positiven Exposures der Derivate werden unter Berücksichtigung der vertraglich vereinbarten Schwelle auf EUR lautende Staatsanleihen der Republik Österreich und/oder Bundesrepublik Deutschland von der Erste Group Bank AG als Sicherheit an den Investmentfonds geleistet. Für diese Sicherheiten wurde ein einheitlicher Abschlag in Höhe von 4 % mit dem Counterpart vereinbart. Sicherheiten, die gem. Anhang II der delegierten Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 einen höheren Abschlag erfordern würden, werden nicht anerkannt.

Wien, im April 2023

Erste Asset Management GmbH  
elektronisch gefertigt

Prüfinformation: Die elektronischen Signaturen dieses Dokumentes können auf der Homepage der Rundfunk und Telekom Regulierungs-GmbH (<https://www.signatur.rtr.at/de/vd/Pruefung.html>) geprüft werden.

Hinweis: Dieses Dokument wurde mit zwei qualifizierten elektronischen Signaturen gefertigt. Eine qualifizierte elektronische Signatur hat die gleiche Rechtswirkung wie eine handschriftliche Unterschrift (Art 25 der Verordnung (EU) Nr. 910/2014 („eIDAS-Verordnung“)).