

ERSTE BOND INFLATION LINKED

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.11.2022	5

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft

Die Gesellschaft	Erste Asset Management GmbH Am Belvedere 1, A-1100 Wien Telefon: 05 0100-19777, Telefax: 05 0100-919777
Stammkapital	2,50 Mio. EURO
Gesellschafter	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 %)
Aufsichtsrat	Mag. Rudolf SAGMEISTER (Vorsitzender) Manfred BARTALSZKY Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER (Vorsitzender-Stv. - ab 21.09.2022) Radovan JELASITY Mag. Ertan PISKIN (ab 10.10.2022) Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER (bis 21.09.2022) 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
Geschäftsführer	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
Prokuristen	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
Staatskommissäre	Mag. Wolfgang EXL (ab 01.09.2022) Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
Fondsprüfer	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
Depotbank	Erste Group Bank AG

Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND INFLATION LINKED Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2022 bis 30.11.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2022	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	54,5	99,04
Wertpapiere	54,5	99,04
Financial Futures	0,0	0,01
Bankguthaben	0,4	0,81
Zinsenansprüche	0,1	0,14
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	55,0	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2022 bis 30.11.2022)

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
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BUNDANL.V. 14/30 INFL.LKD	DE0001030559	0,500	400	1.000	3.100	107,095	3.984.033,60	7,24
BUNDANL.V. 15/26 INFL.LKD	DE0001030567	0,100	0	900	2.600	101,952	3.172.552,53	5,76
Summe Emissionsland Deutschland							<u>7.156.586,13</u>	<u>13,00</u>
Emissionsland Frankreich								
FRANKREICH 19/29	FR0013410552	0,100	500	0	3.000	102,162	3.503.257,57	6,37
FRANKREICH 20/26	FR0013519253	0,100	0	100	1.900	102,362	2.201.290,72	4,00
FRANKREICH 20/31 O.A.T.	FR0014001N38	0,102	1.200	700	2.600	102,347	3.016.507,93	5,48
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	0,100	0	100	1.900	105,771	2.162.181,36	3,93
REP. FSE 11-27 O.A.T.	FR0011008705	1,850	700	400	3.000	111,098	4.231.333,98	7,69
REP. FSE 13-24 O.A.T.	FR0011427848	0,250	0	1.100	2.200	103,131	2.737.224,62	4,97
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011982776	0,700	0	1.100	2.400	107,418	3.070.229,87	5,58
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012558310	0,100	0	400	2.100	103,471	2.436.506,14	4,43
REP. FSE 17-28 O.A.T.	FR0013238268	0,100	0	900	2.400	104,983	2.820.557,26	5,12
Summe Emissionsland Frankreich							<u>26.179.089,45</u>	<u>47,57</u>
Emissionsland Italien								
B.T.P. 14-24 FLR	IT0005004426	2,350	0	1.500	1.500	105,399	1.886.889,79	3,43
B.T.P. 15-32 FLR	IT0005138828	1,250	2.100	0	2.100	97,865	2.438.083,34	4,43
B.T.P. 17-28 FLR	IT0005246134	1,300	0	300	2.200	101,122	2.638.541,96	4,79
B.T.P. 20/26 FLR	IT0005415416	0,650	600	2.200	3.400	99,963	3.850.094,94	7,00
ITALIEN 19/30 FLR	IT0005387052	0,400	900	1.100	1.900	93,076	2.032.614,16	3,69
Summe Emissionsland Italien							<u>12.846.224,19</u>	<u>23,34</u>
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 14-24 FLR	ES00000126A4	1,800	0	600	2.400	105,847	3.020.983,46	5,49
SPANIEN 15-30 FLR	ES00000127C8	1,000	0	500	2.200	105,118	2.742.623,23	4,98
SPANIEN 17-27 FLR	ES00000128S2	0,650	500	800	2.100	103,178	2.564.702,77	4,66
Summe Emissionsland Spanien							<u>8.328.309,46</u>	<u>15,13</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>54.510.209,23</u>	<u>99,04</u>
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							<u>54.510.209,23</u>	<u>99,04</u>

ERSTE BOND INFLATION LINKED

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Derivate				
Financial Futures auf Euro lautend				
Emissionsland Deutschland				
EURO-BOBL FUTURE Mar23	EBOBH23	-3	1.110,00	0,00
EURO-SCHATZ FUT Mar23	FGBSH23	-11	1.756,38	0,00
		Summe Emissionsland Deutschland	2.866,38	0,01
		Summe Financial Futures auf Euro lautend	2.866,38	0,01
		Summe Derivate	2.866,38	0,01

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		54.510.209,23	99,04
Financial Futures		2.866,38	0,01
Bankguthaben		445.941,19	0,81
Zinsenansprüche		78.272,56	0,14
Sonstige Abgrenzungen		-929,46	-0,00
Fondsvermögen		55.036.359,90	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000619887	Stück	75.040,382
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000619887	EUR	96,10
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Y1	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Y1	EUR	109,38
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Z8	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Z8	EUR	108,98
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000619895	Stück	293.995,640
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000619895	EUR	129,95
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y307	Stück	385,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y307	EUR	109,12
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1ACM9	Stück	40.923,973
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1ACM9	EUR	133,72
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y315	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y315	EUR	110,21
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y323	Stück	35.627,967
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y323	EUR	115,20
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y331	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y331	HUF	45.173,73

Bei folgenden Wertpapieren handelt es sich um inflationsindexierte Anleihen, bei denen das Nominale mit einem Inflationsindex abgesichert ist:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Index-Value	Kurswert in EUR
B.T.P. 14-24 FLR	IT0005004426	1,19349	1.886.889,79
B.T.P. 15-32 FLR	IT0005138828	1,18632	2.438.083,34
B.T.P. 17-28 FLR	IT0005246134	1,18603	2.638.541,96
B.T.P. 20/26 FLR	IT0005415416	1,13280	3.850.094,94
BUNDANL.V. 14/30 INFL.LKD	DE0001030559	1,20003	3.984.033,60
BUNDANL.V. 15/26 INFL.LKD	DE0001030567	1,19685	3.172.552,53
FRANKREICH 19/29	FR0013410552	1,14304	3.503.257,57
FRANKREICH 20/26	FR0013519253	1,13184	2.201.290,72
FRANKREICH 20/31 O.A.T.	FR0014001N38	1,13359	3.016.507,93
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	1,07590	2.162.181,36
ITALIEN 19/30 FLR	IT0005387052	1,14938	2.032.614,16
REP. FSE 11-27 O.A.T.	FR0011008705	1,26955	4.231.333,98
REP. FSE 13-24 O.A.T.	FR0011427848	1,20642	2.737.224,62
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011982776	1,19092	3.070.229,87
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012558310	1,12132	2.436.506,14
REP. FSE 17-28 O.A.T.	FR0013238268	1,11945	2.820.557,26
SPANIEN 14-24 FLR	ES00000126A4	1,18921	3.020.983,46
SPANIEN 15-30 FLR	ES00000127C8	1,18595	2.742.623,23
SPANIEN 17-27 FLR	ES00000128S2	1,18367	2.564.702,77

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 geclearte 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.

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
-------------------------------	-------------------------	-----------------	--	------------------------------

In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere**Anleihen auf Euro lautend****Emissionsland Frankreich**

REP. FSE 08-23 O.A.T.	FR0010585901	2,100	0	2.200
-----------------------	--------------	-------	---	-------

Emissionsland Italien

B.T.P. 07-23 FLR	IT0004243512	2,600	0	3.000
------------------	--------------	-------	---	-------

Emissionsland Spanien

SPANIEN 18-23 FLR	ES0000012B70	0,150	0	1.500
-------------------	--------------	-------	---	-------

Wien, im Dezember 2022

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“)).