

ERSTE ETHIK ANLEIHEN

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

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.) 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
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 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 ETHIK ANLEIHEN 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 Deutsche Mark lautend	3,8	8,46
auf Euro lautend	21,7	47,87
auf Norwegische Kronen lautend	1,9	4,29
auf US-Dollar lautend	16,5	36,42
Wertpapiere	44,0	97,04
Devisentermingeschäfte	0,1	0,23
Financial Futures	-0,2	-0,41
Bankguthaben	1,3	2,76
Zinsenansprüche	0,2	0,38
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	45,3	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
				Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)				
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
MUENCH.HYP.BK.IS.19/26	DE000MHB61E7	0,500	0	0	300	90,050	270.150,77	0,60
Summe Emissionsland Deutschland							270.150,77	0,60
Emissionsland Finnland								
NORDEA BANK 19/29 FLR MTN	XS2019260764	1,000	0	0	300	94,955	284.865,01	0,63
Summe Emissionsland Finnland							284.865,01	0,63
Emissionsland Irland								
LUNAR FUNDING V 18/26 MTN	XS1803247557	1,125	0	0	300	91,740	275.219,99	0,61
Summe Emissionsland Irland							275.219,99	0,61
Emissionsland Luxemburg								
JDCM 20/32 MTN	XS2150006562	2,200	0	0	300	91,391	274.174,21	0,61
Summe Emissionsland Luxemburg							274.174,21	0,61
Emissionsland Norwegen								
DNB BANK 21/29 FLR MTN	XS2306517876	0,250	0	0	300	83,074	249.221,40	0,55
Summe Emissionsland Norwegen							249.221,40	0,55
Emissionsland Österreich								
ASFINAG 20/27 MTN	XS2203969246	0,000	0	0	1.100	88,007	968.081,41	2,14
ERSTE GR.BK. 19/26 MTN	XS2000538343	0,875	0	0	300	91,033	273.098,99	0,60
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	800	0	800	96,464	771.711,98	1,70
OESTERREICH 20/30 MTN	AT0000A2CQD2	0,000	500	1.000	1.500	82,234	1.233.503,96	2,72
OESTERREICH 21/31 MTN	AT0000A2NW83	0,000	500	1.000	1.000	79,845	798.452,00	1,76
RAIF.BK INTL 19/26 MTN	XS2055627538	0,375	0	0	300	85,181	255.542,40	0,56
Summe Emissionsland Österreich							4.300.390,74	9,49
Emissionsland Schweden								
SEB 19/29 MTN	XS2078737215	0,625	0	0	300	79,388	238.164,00	0,53
SVENSKA HDBK 19/26 MTN	XS2049582542	0,050	0	0	300	87,515	262.543,81	0,58
Summe Emissionsland Schweden							500.707,81	1,11

ERSTE ETHIK ANLEIHEN

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
Emissionsland Spanien								
BCO SANTANDER 18/25 MTN	XS1751004232	1,125	0	0	300	95,303	285.908,41	0,63
CAIXABANK 22/28 FLR MTN	XS2434702424	0,625	0	0	300	88,623	265.870,19	0,59
Summe Emissionsland Spanien							551.778,60	1,22
Summe Anleihen auf Euro lautend							6.706.508,53	14,80
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emittent Weltbank								
WORLD BK 03/01/28 ZERO	US459051FX10	0,000	0	0	4.000	81,755	3.009.986,65	6,64
WORLD BK 03/11/31 ZERO	US45905ASE90	0,000	0	0	3.200	72,537	2.136.470,57	4,72
WORLD BK 09/17/30 ZERO	US45905APM44	0,000	0	0	9.200	74,749	6.329.692,81	13,97
WORLD BK 2029 ZO MTN	US45905ADE55	0,000	0	0	500	76,763	353.274,43	0,78
WORLD BK 2029 ZO MTN	US45905AJA79	0,000	0	0	1.900	76,265	1.333.733,72	2,94
Summe Emittent Weltbank							13.163.158,18	29,05
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,08645							13.163.158,18	29,05
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							19.869.666,71	43,85
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Deutsche Mark lautend								
Emissionsland Jersey								
EURO-DM SEC.D86/26 NK	DE0004778477	0,000	0	500	8.500	88,180	3.832.286,04	8,46
Summe Emissionsland Jersey							3.832.286,04	8,46
Summe Anleihen auf Deutsche Mark lautend umgerechnet zum Kurs von 1,95583							3.832.286,04	8,46
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Australien								
MACQUARIE G. 21/31 MTN	XS2343850033	0,950	0	0	300	74,910	224.730,01	0,50
TELSTRA CORP 19/29 MTN	XS1966038249	1,375	0	0	300	87,193	261.580,19	0,58
Summe Emissionsland Australien							486.310,20	1,07
Emissionsland Deutschland								
ALLIANZ SUB 2015/2045	DE000A14J9N8	2,241	0	0	300	93,904	281.712,59	0,62
DT. BAHN FIN. 18/31 MTN	XS1885608817	1,375	300	0	300	86,747	260.240,41	0,57
DZ BANK IS.A1536	DE000DFK0GB1	0,050	0	0	300	83,663	250.989,23	0,55
HANN RUECK SBF 14/UNBEFR.	XS1109836038	3,375	0	0	300	94,994	284.982,35	0,63
HANN RUECK SUB 2019/2039	XS2063350925	1,125	0	0	300	77,084	231.252,00	0,51
LBBW MTN 19/26	DE000LB2CLH7	0,375	0	0	300	86,811	260.432,99	0,57
MUENCH.RUECK 18/49	XS1843448314	3,250	0	0	600	90,138	540.828,00	1,19
TALANX AG NACHR.ANL 17/47	XS1729882024	2,250	0	0	300	86,158	258.473,99	0,57
Summe Emissionsland Deutschland							2.368.911,56	5,23

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
Emissionsland Finnland								
FINLD 14-24	FI4000079041	2,000	1.500	0	1.500	98,963	1.484.448,05	3,28
FINLD 17-27	FI4000278551	0,500	0	0	1.000	90,968	909.680,02	2,01
FINLD 18-28	FI4000348727	0,500	0	0	1.000	88,741	887.409,97	1,96
FINNLAN 22/32	FI4000523238	1,500	800	0	800	88,591	708.729,62	1,56
Summe Emissionsland Finnland							3.990.267,66	8,81
Emissionsland Frankreich								
AIR LIQUIDE 19/30 MTN	FR0013428067	0,625	0	0	300	83,958	251.875,19	0,56
BNP PARIBAS 20/29 FLR MTN	FR0013508710	1,125	0	0	300	85,505	256.515,61	0,57
CR.MUT.ARKEA 21/33 MTN	FR0014002BJ9	0,875	0	0	300	73,800	221.398,80	0,49
CREDIT AGR. 18/25 MTN	XS1790990474	1,375	0	0	300	95,671	287.012,40	0,63
DASSAULT SYS 19/29	FR0013444551	0,375	0	0	300	82,985	248.953,79	0,55
ESSILORLUXO. 19/27 MTN	FR0013463668	0,375	0	0	300	87,549	262.647,01	0,58
MICHELIN 18-30	FR0013357852	1,750	0	0	300	90,922	272.767,20	0,60
Summe Emissionsland Frankreich							1.801.170,00	3,98
Emissionsland Großbritannien								
LLOYDS BKG 19/25 FLR MTN	XS2078918781	0,500	0	0	300	94,653	283.960,19	0,63
Summe Emissionsland Großbritannien							283.960,19	0,63
Emissionsland Irland								
LINDE 22/31 MTN	XS2463961248	1,375	300	0	300	86,326	258.979,20	0,57
Summe Emissionsland Irland							258.979,20	0,57
Emissionsland Luxemburg								
GRD-DUCAL LUX. 17/27	LU1556942974	0,625	0	0	800	91,380	731.039,98	1,61
MEDTR.GLB HD 19/31	XS2020670852	1,000	0	0	400	82,484	329.935,21	0,73
SWISS RE FIN 19/50 FLR	XS1963116964	2,534	0	0	600	82,641	495.845,99	1,09
Summe Emissionsland Luxemburg							1.556.821,18	3,44
Emissionsland Neuseeland								
ANZ N.Z.INTL 19/29 MTN	XS2052998403	0,375	0	0	300	80,858	242.574,60	0,54
Summe Emissionsland Neuseeland							242.574,60	0,54
Emissionsland Niederlande								
ALLIANDER 18/UND. FLR	XS1757377400	1,625	0	0	300	91,121	273.361,79	0,60
ASML HOLDING 20/29	XS2166219720	0,625	300	0	300	85,041	255.123,60	0,56
CO. RABOBANK 21/33 MTN	XS2306851853	0,625	0	0	300	73,572	220.714,81	0,49
NEDERLD 14-24	NL0010733424	2,000	1.500	0	1.500	98,996	1.484.935,23	3,28
NEDERLD 20/30	NL0014555419	0,000	500	1.500	500	83,090	415.449,98	0,92
STEDIN HOLDING 18/28 MTN	XS1878266326	1,375	0	0	300	90,140	270.420,00	0,60
Summe Emissionsland Niederlande							2.920.005,41	6,44

ERSTE ETHIK ANLEIHEN

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
Emissionsland Norwegen								
SPAREBANK 1 19/26	XS2051032444	0,125	0	0	300	87,879	263.636,99	0,58
TELENOR 19/29 MTN	XS2001737910	1,125	0	0	300	85,928	257.782,79	0,57
Summe Emissionsland Norwegen							521.419,78	1,15
Emissionsland Schweiz								
UBS GROUP 22/30 MTN	CH1194000357	3,125	300	0	300	91,918	275.755,21	0,61
Summe Emissionsland Schweiz							275.755,21	0,61
Emissionsland USA								
IBM 19/27	XS1945110606	1,250	0	0	300	92,216	276.648,01	0,61
Summe Emissionsland USA							276.648,01	0,61
Summe Anleihen auf Euro lautend							14.982.823,00	33,07
Anleihen auf Norwegische Kronen lautend								
Emissionsland Norwegen								
NORWAY 14-24	N00010705536	3,000	5.000	0	5.000	99,680	438.019,07	0,97
NORWAY 15-25	N00010732555	1,750	0	0	9.000	97,340	769.925,74	1,70
NORWAY 19-29	N00010844079	1,750	4.000	0	9.000	92,900	734.806,87	1,62
Summe Emissionsland Norwegen							1.942.751,68	4,29
Summe Anleihen auf Norwegische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 11,37850							1.942.751,68	4,29
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							20.757.860,72	45,81
Nicht notierte Wertpapiere								
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emittent Weltbank								
WORLD BK 10/31/30 ZERO	US45905AQD36	0,000	0	0	4.950	73,318	3.340.466,21	7,37
Summe Emittent Weltbank							3.340.466,21	7,37
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,08645							3.340.466,21	7,37
Summe Nicht notierte Wertpapiere							3.340.466,21	7,37
Derivate								
Financial Futures auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EURO-BOBL FUTURE Jun23	EBOBM23					-13	-30.030,00	-0,07
EURO-BUND FUTURE Jun23	FGBLM23					-18	-48.860,00	-0,11
EURO-SCHATZ FUT Jun23	FGBSM23					-50	-46.000,00	-0,10
Summe Emissionsland Deutschland							-124.890,00	-0,28
Summe Financial Futures auf Euro lautend							-124.890,00	-0,28

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Financial Futures auf US-Dollar lautend				
Emissionsland USA				
US 10YR NOTE (CBT)Jun23	TN1M23	-25	-61.122,24	-0,13
		Summe Emissionsland USA	-61.122,24	-0,13
		Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,08645	-61.122,24	-0,13
		Summe Derivate	-186.012,24	-0,41

Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend**Emissionsland Österreich**

FXF SPEST EUR/USD 20.04.2023	FXF_TAX_3463766	16.755.039	110.212,44	0,24
FXF SPEST EUR/USD 20.04.2023	FXF_TAX_3463988	-564.791	-13.016,19	-0,03
FXF SPEST EUR/USD 20.04.2023	FXF_TAX_3464173	376.268	8.418,54	0,02
		Summe Emissionsland Österreich	105.614,79	0,23
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	105.614,79	0,23
		Summe Devisentermingeschäfte	105.614,79	0,23

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			43.967.993,64	97,04
Devisentermingeschäfte			105.614,79	0,23
Financial Futures			-186.012,24	-0,41
Bankguthaben			1.252.174,18	2,76
Zinsenansprüche			172.796,96	0,38
Sonstige Abgrenzungen			-1.607,25	-0,00
Fondsvermögen			45.310.960,08	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000802509	Stück	374.870,997
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000802509	EUR	53,40
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000822416	Stück	232.971,877
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000822416	EUR	108,56

ERSTE ETHIK ANLEIHEN

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.

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

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 Finnland				
FINNLD 19/29	FI4000369467	0,500	0	1.000
Emissionsland Frankreich				
SCOR SE 16/48 FLR	FR0013179314	3,625	0	300
Emissionsland Niederlande				
ASML HOLDING N.V. 16/27	XS1527556192	1,625	0	300

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“)).