

SALZBURGER SPARKASSE SELECT DACHFONDS

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.12.2022.....	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 SALZBURGER SPARKASSE SELECT DACHFONDS Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 31.12.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.12.2022	
	Mio. Euro	%
Indezertifikate		
auf Euro lautend	1,4	2,66
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	37,2	71,97
auf US-Dollar lautend	11,3	21,90
Wertpapiere	49,9	96,54
Devisentermingeschäfte	0,8	1,58
Bankguthaben	1,0	1,88
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	51,7	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.07.2022 bis 31.12.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere							
Indezertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Jersey							
WITR MET.SEC.Z09/UN.XAU	JE00B588CD74	8.400	0	8.400	163,910	1.376.844,00	2,66
Summe Emissionsland Jersey						1.376.844,00	2,66
Summe Indezertifikate auf Euro lautend						1.376.844,00	2,66
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere						1.376.844,00	2,66
Investmentzertifikate							
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Irland							
ISHSII-M.EU.Q.DIV.ESG EOD	IE00BYHSM20	90.000	0	175.000	5,120	896.000,00	1,73
ISHSIV-E.MSCI USA QUAL.F.	IE00BD1F4L37	104.000	0	104.000	8,775	912.600,00	1,77
LYX CRED F SSIEOA	IE00BL71KB37	0	0	5.300	105,447	558.867,51	1,08
LYXOR EPSILON GL.TR.I EO	IE00B643RZ01	0	0	1.100	160,909	176.999,35	0,34
LYXOR/SANDLER US EQU.I EO	IE00BD8GKT91	0	1.500	3.450	114,689	395.675,67	0,77
LYXOR/TIEDEM.ARB.STR.I EO	IE00B8BS6228	0	0	3.100	117,354	363.796,16	0,70
UBS(IRL)-EQ.OP. EOQPFACC	IE00B841P542	0	0	1.700	134,460	228.582,00	0,44
Summe Emissionsland Irland						3.532.520,69	6,84
Emissionsland Luxemburg							
AB S.I.S.ABS.ALPH.P.IAEOH	LU0736560011	0	0	23.000	22,590	519.570,00	1,01
BNPPE-MSCI JAP.EX CW PCE	LU1291102108	0	0	980	1.256,467	1.231.338,05	2,38
CAND.AB.RTN-EQ.MKT N.IEOC	LU1962513328	0	0	370	1.614,260	597.276,20	1,16
CANDR.M.MKT.-EURO AAA V C	LU0354092115	0	1.350	500	1.047,360	524.184,83	1,01
CARM.PTF-L.S.EUR.EQ. FEOA	LU0992627298	0	680	3.820	147,390	563.029,80	1,09
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	0	1.900	16.140	105,490	1.702.608,60	3,30
G.S.-JAP.EQ.P.PT.IACC.EO	LU1837047379	0	0	38.500	12,590	484.715,00	0,94
LUMYNA-BOFA MLCX CA.B5 EO	LU1057468578	0	1.200	2.900	187,980	545.142,00	1,06
NN(L)-US CREDIT ICEOHI	LU0803997666	160	0	160	5.780,610	924.897,60	1,79
NORDEA1-ALP.15 MA F.BIEO	LU0607983383	0	1.270	5.900	100,455	592.685,09	1,15
PICTET-EUROL.IND.NA.ISEO	LU0255980830	1.600	0	5.600	185,590	1.039.304,00	2,01
SISF EURO CORP.BD C ACC	LU0113258742	0	0	59.100	22,569	1.333.827,90	2,58
SSGA LUX-UK INDEX EQ.IEOA	LU1159238978	0	0	56.300	13,279	747.618,96	1,45
TRP-ASEXJAEQ IEO	LU1382643945	14.500	0	27.300	15,980	436.254,00	0,84
Summe Emissionsland Luxemburg						11.242.452,03	21,76

SALZBURGER SPARKASSE SELECT DACHFONDS

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emissionsland Österreich							
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	1.800	11.300	128,600	1.453.180,00	2,81
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	1.000	8.900	166,970	1.486.033,00	2,88
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	1.200	15.600	139,610	2.177.916,00	4,22
ERSTE BD EO RENT R01TEO	AT0000812854	0	0	4.000	131,100	524.400,00	1,01
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	0	1.000	12.250	139,110	1.704.097,50	3,30
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	14.800	0	14.800	132,920	1.967.216,00	3,81
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	0	2.000	23.030	171,490	3.949.414,70	7,64
ERSTE BOND COMBIRENT T	AT0000812912	0	0	20.000	26,290	525.800,00	1,02
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	10.900	0	23.600	111,390	2.628.804,00	5,09
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307	0	1.650	1.600	1.257,620	2.012.192,00	3,89
T 1851 T	AT0000A0K2C4	5.500	0	10.200	104,070	1.061.514,00	2,05
T 1852 T	AT0000A0K2G5	5.000	0	5.000	100,450	502.250,00	0,97
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	1.400	0	11.400	107,010	1.219.914,00	2,36
XT EUROPA EURO T	AT0000697065	220	50	570	2.099,670	1.196.811,90	2,32
Summe Emissionsland Österreich						<u>22.409.543,10</u>	<u>43,37</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						<u>37.184.515,82</u>	<u>71,97</u>
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Irland							
AXA-USENINEQ	IE0033609615	0	9.500	46.300	49,590	2.152.549,57	4,17
VERITAS FDS-ASIAN CACCDL	IE00BD065N65	650	0	1.250	570,533	668.604,28	1,29
Summe Emissionsland Irland						<u>2.821.153,85</u>	<u>5,46</u>
Emissionsland Luxemburg							
ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCDL	LU0880945901	0	2.900	19.800	78,730	1.461.448,46	2,83
F.TEM.INV-LAT.AM. I ACC.	LU0229944334	0	16.000	8.900	19,320	161.203,77	0,31
G.SACHS-US CO.E.RA.IACCDL	LU1280280568	0	21.000	112.000	20,790	2.182.984,11	4,22
PICTET-USA INDEX I DL	LU0188798671	0	1.000	6.800	366,170	2.334.370,22	4,52
SISF EMERG.ASIA IZ CAP.DL	LU1188199936	5.400	0	10.600	59,603	592.318,04	1,15
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>6.732.324,60</u>	<u>13,03</u>
Emissionsland Österreich							
XT USA USD A	AT0000697081	0	0	600	3.137,200	1.764.702,57	3,42
Summe Emissionsland Österreich						<u>1.764.702,57</u>	<u>3,42</u>
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,06665						<u>11.318.181,02</u>	<u>21,90</u>
Summe Investmentzertifikate						<u>48.502.696,84</u>	<u>93,87</u>

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Devisentermingeschäfte				
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
FXF SPEST EUR/JPY 19.01.2023	FXF_TAX_3462414	1.503.877	-45.641,85	-0,09
FXF SPEST EUR/JPY 19.01.2023	FXF_TAX_3462778	129.151	-1.151,53	-0,00
FXF SPEST EUR/JPY 19.01.2023	FXF_TAX_3463259	-85.363	-841,26	-0,00
FXF SPEST EUR/USD 19.01.2023	FXF_TAX_3462391	6.849.432	481.155,77	0,93
FXF SPEST EUR/USD 19.01.2023	FXF_TAX_3462764	115.696	3.318,85	0,01
FXF SPEST EUR/USD 19.01.2023	FXF_TAX_3462908	3.856.827	110.933,27	0,21
FXF SPEST EUR/USD 19.01.2023	FXF_TAX_3463019	-1.420.886	-16.198,71	-0,03
FXF SPEST EUR/USD 20.01.2023	FXF_TAX_3462458	3.863.922	282.918,35	0,55
FXF SPEST EUR/USD 20.01.2023	FXF_TAX_3462775	125.328	3.594,61	0,01
		Summe Emissionsland Österreich	818.087,50	1,58
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	818.087,50	1,58
		Summe Devisentermingeschäfte	818.087,50	1,58

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	49.879.540,84	96,54
Devisentermingeschäfte	818.087,50	1,58
Bankguthaben	972.786,46	1,88
Zinsenansprüche	107,38	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-1.063,75	-0,00
Fondsvermögen	51.669.458,43	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000809280	Stück	170.351,026
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000809280	EUR	87,11
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000809298	Stück	237.904,684
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000809298	EUR	154,80

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	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate			
Investmentzertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Deutschland			
LBBW ROHSTOFFE 1 I	DE000A0MU8J9	0	6.000
Emissionsland Irland			
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBCS90	0	10.900
INVESCOMI BB CMTY EXAGR A	IE00BYXYX521	0	18.000
ISHSV-S+P500H.CA.SECT.DLA	IE00B43HR379	0	97.700
Emissionsland Österreich			
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZR9	0	4.800
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend			
Emissionsland Luxemburg			
JPM-US VALUE FD I ACC USD	LU0248060658	0	3.300

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Nicht notierte Wertpapiere			
Indezertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Jersey			
WITR MET.SEC.DZ09/UN.XAU	DE000A1DCTL3	0	8.400

Wien, im Jänner 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“)).