

ERSTE BOND EURO MÜNDELRENT

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 WATTL 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 BOND EURO MÜNDELRENT 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 Euro lautend	615,2	99,03
Wertpapiere	615,2	99,03
Financial Futures	-0,4	-0,06
Bankguthaben	3,7	0,60
Zinsenansprüche	2,7	0,43
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	621,3	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 Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Österreich								
ALLG.SPARK.OBER. 13-23	AT000B100920	2,330	0	0	1.000	99,305	993.052,73	0,16
ASFINAG 17/24 MTN	XS1701458017	0,250	2.900	0	12.400	95,445	11.835.155,32	1,91
ASFINAG 19/29 MTN	XS2024602240	0,100	0	0	350	83,835	293.421,80	0,05
ASFINAG 20/27 MTN	XS2203969246	0,000	3.400	0	14.300	88,007	12.585.058,34	2,03
AUSTRIA 09/26 MTN 144A	AT0000A0DXC2	4,850	0	0	500	105,882	529.408,76	0,09
AUSTRIA 18/28 MTN	AT0000A1ZGE4	0,750	0	13.000	13.000	91,017	11.832.235,61	1,90
ERSTE GP BNK 15/25 MTN	XS1181448561	0,750	0	0	500	95,139	475.695,00	0,08
ERSTE GP BNK 17/27 MTN	XS1550203183	0,625	7.500	0	9.000	90,581	8.152.308,00	1,31
ERSTE GP BNK 18/24 MTN	XS1845161790	0,250	0	0	7.600	96,098	7.303.448,00	1,18
HYPO NOE L.F.N.W. 17/23	XS1590565112	0,375	0	6.000	15.300	99,990	15.298.470,00	2,46
HYPO NOE L.F.N.W. 18/25	XS1875268689	0,500	0	0	700	93,214	652.497,07	0,11
HYPO NOE LB 19/26 MTN	XS2057917366	0,010	19.800	0	19.800	89,118	17.645.363,21	2,84
HYPO NOE LB 22/29 MTN	AT0000A2VXQ0	1,625	0	15.000	2.000	91,091	1.821.824,04	0,29
HYPO TIROL 19/26 MTN	AT0000A2AYL3	0,010	9.000	0	9.000	88,784	7.990.559,73	1,29
HYPO TIROL 22/27 MTN	AT0000A2XLD9	1,375	0	0	15.000	92,533	13.879.949,55	2,23
HYPO VORARL. 19/27 MTN	XS1999728394	0,250	400	0	400	88,177	352.709,60	0,06
HYPO VORARL. 22/27 MTN	AT0000A30ZH4	3,250	12.000	0	12.000	99,484	11.938.080,12	1,92
HYPO VORARL. 22/28 MTN	XS2478521151	1,625	0	0	11.000	92,187	10.140.526,00	1,63
HYPO VORARLG BK 17-24	XS1613238457	0,375	0	0	25.600	96,517	24.708.455,17	3,98
HYPO VORARLG BK 18/26	XS1856342560	0,625	4.700	0	4.700	91,491	4.300.076,86	0,69
OBERBK 13-23 MTN	AT000B112552	2,000	0	0	1.000	99,952	999.520,00	0,16
OBEROEST.LBK 22/29 MTN	AT0000A2Y7L6	1,625	0	5.000	7.000	90,828	6.357.956,99	1,02
OBEROEST.LBK 23/27 MTN	AT0000A32695	2,875	10.000	0	10.000	97,872	9.787.205,50	1,58
OEBB INFRAST 13/23 MTN	XS0949964810	2,250	0	0	200	99,770	199.540,00	0,03
OEBB INFRAST 14/24 MTN	XS1138366445	1,000	0	0	40	96,260	38.504,16	0,01
OEKB 22/27 MTN	XS2500414623	1,500	0	0	8.300	93,924	7.795.725,20	1,25
OESTERR. 15/25	AT0000A1FAP5	1,200	19.800	15.000	35.000	96,230	33.680.640,00	5,42
OESTERR. 16/26	AT0000A1K9C8	0,750	5.000	42.800	12.200	93,510	11.408.220,24	1,84
OESTERR. 17/27	AT0000A1VGK0	0,500	7.000	35.000	2.000	91,519	1.830.372,00	0,29
OESTERR. 97-27 6	AT0000383864	6,250	0	0	500	113,845	569.226,00	0,09
OESTERREICH 19/29 MTN	AT0000A269M8	0,500	26.000	7.000	45.000	87,550	39.397.501,35	6,34
OESTERREICH 20/30 MTN	AT0000A2CQD2	0,000	6.000	2.500	49.000	82,234	40.294.462,53	6,49
OESTERREICH 21/31 MTN	AT0000A2NW83	0,000	5.000	3.000	54.000	79,845	43.116.408,00	6,94
OESTERREICH 22/26 MTN	AT0000A308C5	2,000	23.500	6.500	17.000	97,644	16.599.417,27	2,67
OESTERREICH 22/28 MTN	AT0000A2VB47	0,000	9.500	5.000	25.000	85,883	21.470.649,75	3,46
OESTERREICH 22/32 MTN	AT0000A2WSC8	0,900	16.500	9.000	45.500	84,296	38.354.679,09	6,17
OESTERREICH 23/33 MTN	AT0000A324S8	2,900	26.000	0	26.000	99,449	25.856.739,22	4,16
RAIF.BK INTL 22/26 MTN	XS2537097409	2,875	15.000	5.000	10.000	97,874	9.787.380,20	1,58
RLB OOE 22/27 MTN	AT0000A2XLA5	1,250	0	0	8.700	92,097	8.012.472,84	1,29
RLB OOE 23/26 MTN	AT0000A326M6	3,125	19.500	0	19.500	99,073	19.319.234,61	3,11

ERSTE BOND EURO MÜNDELRENT

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
UNICR.BK AU. 19/26 MTN	AT000B049739	0,625	2.500	0	7.500	92,663	6.949.694,85	1,12
UNICR.BK AU. 19/27 MTN	AT000B049788	0,250	0	0	2.200	88,298	1.942.551,56	0,31
UNICR.BK AU. 22/27 MTN	AT000B049929	2,375	8.700	0	8.700	96,276	8.376.041,32	1,35
UNICR.BK AU. 22/28 MTN	AT000B049911	1,500	0	0	13.000	91,775	11.930.724,39	1,92
UNICR.BK AU. 23/26 MTN	AT000B049937	3,000	1.400	0	1.400	99,004	1.386.054,04	0,22
UNICR.BK AUS. 15-25 MTN	AT000B049572	0,750	3.500	0	5.100	94,970	4.843.459,95	0,78
Summe Emissionsland Österreich							533.032.675,97	85,80
Summe Anleihen auf Euro lautend							533.032.675,97	85,80
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							533.032.675,97	85,80

In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere

Anleihen auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

AUSTRIA 05/25 FLR MTN	XS0229808315	0,000	0	0	2.500	96,550	2.413.750,00	0,39
BAWAG P.S.K. 22/27 MTN	XS2556232143	3,000	18.000	0	18.000	98,701	17.766.237,06	2,86
OBEROEST.LBK 16-23	XS1509009483	0,125	0	0	10.700	98,100	10.496.700,00	1,69
OESTERREICH 21/25 MTN	AT0000A2QRW0	0,000	3.000	5.000	36.000	94,400	33.984.072,00	5,47
R.LB TIROL 22/27	AT0000A2XLB3	1,250	0	0	11.000	92,119	10.133.123,11	1,63
RAIF.BK INTL 22/27 MTN	XS2481491160	1,500	0	10.000	8.000	92,472	7.397.760,00	1,19
Summe Emissionsland Österreich							82.191.642,17	13,23
Summe Anleihen auf Euro lautend							82.191.642,17	13,23
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							82.191.642,17	13,23

Derivate

nicht realisiertes Ergebnis in EUR

Financial Futures auf Euro lautend

Emissionsland Deutschland

EURO-BOBL FUTURE Jun23	EBOBM23				-65		-150.150,00	-0,02
EURO-BUND FUTURE Jun23	FGBLM23				-223		-236.274,74	-0,04
Summe Emissionsland Deutschland							-386.424,74	-0,06
Summe Financial Futures auf Euro lautend							-386.424,74	-0,06
Summe Derivate							-386.424,74	-0,06

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		615.224.318,14	99,03
Financial Futures		-386.424,74	- 0,06
Bankguthaben		3.745.671,82	0,60
Zinsenansprüche		2.696.107,51	0,43
Sonstige Abgrenzungen		-22.049,85	- 0,00
Fondsvermögen		621.257.622,88	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858220	Stück	54.503.974,544
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858220	EUR	7,30
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812995	Stück	17.278.164,721
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812995	EUR	12,90

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.

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 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.

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
Amtlich gehandelte Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
BK TIROL VORARLBG13-23 35	AT0000A138R4	2,650	0	1.200
ERSTE GP BNK 16/23 MTN	XS1346557637	0,625	0	8.300
OBERBANK 22/29 MTN	AT0000A2VLR3	1,500	0	6.000
RLB STEIERMARK 16-23MTN 9	AT000B092622	0,625	0	6.200

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“)).