

ERSTE SELECT BOND

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 SELECT BOND Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2022 bis 30.11.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2022	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	187,7	97,60
auf US-Dollar lautend	1,4	0,73
Wertpapiere	189,1	98,33
Devisentermingeschäfte	0,4	0,20
Bankguthaben	2,8	1,47
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	192,3	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2022 bis 30.11.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentzertifikate							
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Frankreich							
LAZARD CONVERT.GBL PCH-EO	FR0013185535	400	0	3.190	1.763,700	5.626.203,00	2,93
Summe Emissionsland Frankreich						<u>5.626.203,00</u>	<u>2,93</u>
Emissionsland Irland							
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBCS90	0	0	31.555	49,449	1.560.363,20	0,81
Summe Emissionsland Irland						<u>1.560.363,20</u>	<u>0,81</u>
Emissionsland Luxemburg							
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	0	0	53.000	106,350	5.636.550,00	2,93
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	0	0	7.000	154,070	1.078.490,00	0,56
NN(L)-US CREDIT ICEOHI	LU0803997666	0	0	320	5.770,930	1.846.697,60	0,96
SISF EURO CORP.BD C ACC	LU0113258742	0	0	130.000	22,939	2.982.096,00	1,55
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>11.543.833,60</u>	<u>6,00</u>
Emissionsland Österreich							
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	1.800	9.150	131,050	1.199.107,50	0,62
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZR9	0	7.500	14.305	112,500	1.609.312,50	0,84
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	0	12.000	164,400	1.972.800,00	1,03
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	25.500	139,030	3.545.265,00	1,84
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	0	0	61.283	140,530	8.612.099,99	4,48
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224	0	10.000	190.322	152,010	28.930.847,22	15,04
ERSTE BD IN.-LI.R01TEO	AT0000619895	0	0	73.601	129,520	9.532.801,52	4,96
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	0	11.520	128.138	133,430	17.097.453,34	8,89
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	0	0	45.270	172,270	7.798.662,90	4,05
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	30.000	0	78.450	114,950	9.017.827,50	4,69
ERSTE MORTGAGE R01TEO	AT0000700786	0	5.000	54.350	120,370	6.542.109,50	3,40
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307	0	2.500	7.500	1.255,740	9.418.050,00	4,90
ERSTE RESPON.BD EO CORP.T	AT0000A0PHJ4	0	26.000	286.630	113,320	32.480.911,60	16,89
ERSTE T.R.FIX.IN.EOIO1TEO	AT0000A1E176	0	0	138.500	91,850	12.721.225,00	6,61
T 1750 T	AT0000A04FZ3	0	0	15.000	102,850	1.542.750,00	0,80
T 1751	AT0000A0DEH1	0	0	3.500	108,880	381.080,00	0,20
T 1851 T	AT0000A0K2C4	0	0	43.000	108,790	4.677.970,00	2,43
T 1852 T	AT0000A0K2G5	0	0	44.000	104,970	4.618.680,00	2,40
T 1900 EURR01TEO	AT0000A1BTH1	0	0	76.541	91,990	7.041.006,59	3,66
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	0	9.500	2.250	111,680	251.280,00	0,13
Summe Emissionsland Österreich						<u>168.991.240,16</u>	<u>87,86</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						<u>187.721.639,96</u>	<u>97,60</u>

ERSTE SELECT BOND

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Luxemburg							
ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCDL	LU0880945901	0	0	19.000	76,960	1.411.905,57	0,73
Summe Emissionsland Luxemburg						1.411.905,57	0,73
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,03565						1.411.905,57	0,73
Summe Investmentzertifikate						189.133.545,53	98,33

Devisentermingeschäfte						nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							
Emissionsland Österreich							
FXF SPEST EUR/USD 19.01.2023	FXF_TAX_3462389			8.687.699		386.499,13	0,20
Summe Emissionsland Österreich						386.499,13	0,20
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend						386.499,13	0,20
Summe Devisentermingeschäfte						386.499,13	0,20

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	189.133.545,53	98,33
Devisentermingeschäfte	386.499,13	0,20
Bankguthaben	2.823.226,76	1,47
Zinsenansprüche	4.256,01	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-416,76	-0,00
Fondsvermögen	192.347.110,67	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000660592	Stück	1.050.128,800
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000660592	EUR	96,04
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000660600	Stück	624.369,600
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000660600	EUR	146,53

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 Luxemburg			
AGIF-A.EO INF-LKD BD WTEO	LU0988443767	0	1.940

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“)).