

sWaldviertel Bond

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.08.2023	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 Dr. Peter PROBER Gabriele SEMMELROCK-WERZER Mag. Reinhard WALTTL 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 (bis 31.08.2023) Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER Mag. Magdalena UJWARY, MA (ab 16.08.2023)
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 sWaldviertel Bond Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.03.2023 bis 31.08.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.08.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	49,1	99,04
Wertpapiere	49,1	99,04
Financial Futures	0,0	0,03
Optionen	0,0	0,00
Bankguthaben	0,1	0,29
Zinsenansprüche	0,3	0,64
Fondsvermögen	49,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.03.2023 bis 31.08.2023)

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 Deutschland								
BUNDANL.V.17/48	DE0001102432	1,250	500	350	1.000	76,284	762.839,97	1,54
BUNDANL.V.20/30	DE0001102499	0,000	0	300	600	85,899	515.392,82	1,04
BUNDANL.V.20/35	DE0001102515	0,000	0	0	750	74,720	560.396,98	1,13
BUNDANL.V.21/28	DE0001102556	0,000	300	0	800	88,281	706.249,58	1,43
BUNDANL.V.21/31	DE0001102564	0,000	0	0	1.100	82,991	912.896,61	1,84
BUNDANL.V.22/53	DE0001102614	1,800	400	0	400	83,680	334.719,08	0,68
LBBW MTN OPF 22/27	DE000LB38077	2,375	0	0	500	96,976	484.879,99	0,98
Summe Emissionsland Deutschland							4.277.375,03	8,64
Emissionsland Irland								
IRLAND 21/31	IE00BMQ5JL65	0,000	0	0	400	79,767	319.067,99	0,64
Summe Emissionsland Irland							319.067,99	0,64
Emissionsland Österreich								
ASFINAG 19/29 MTN	XS2024602240	0,100	0	0	350	84,472	295.652,69	0,60
ASFINAG 20/27 MTN	XS2203969246	0,000	0	0	500	88,702	443.508,00	0,90
AUSTRIA 2037 MTN 144A	AT0000A04967	4,150	0	0	500	109,956	549.779,02	1,11
HYPO NOE LB 19/26 MTN	XS2057917366	0,010	0	0	500	89,858	449.289,02	0,91
HYPO TIROL 22/27 MTN	AT0000A2XLD9	1,375	0	0	500	92,739	463.694,00	0,94
HYPO VORARL. 22/27 MTN	AT0000A30ZH4	3,250	0	0	500	98,960	494.800,00	1,00
HYPO VORARLG BK 18/26	XS1856342560	0,625	0	0	500	91,971	459.856,00	0,93
OESTERR. 13/34	AT0000A10683	2,400	0	0	900	93,809	844.284,62	1,70
OESTERREICH 21/36 MTN	AT0000A2T198	0,250	0	0	500	68,714	343.569,99	0,69
UNICR.BK AU. 22/27 MTN	AT000B049929	2,375	0	0	500	96,089	480.443,19	0,97
Summe Emissionsland Österreich							4.824.876,53	9,74
Summe Anleihen auf Euro lautend							9.421.319,55	19,02
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							9.421.319,55	19,02
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Belgien								
BELGIQUE 14-34 73	BE0000333428	3,000	0	0	500	98,559	492.794,00	0,99
BELGIQUE 17/37 84	BE0000344532	1,450	0	0	1.100	79,746	877.210,39	1,77

sWaldviertel Bond

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
BELGIQUE 19/29	BE0000347568	0,900	0	0	400	89,913	359.650,39	0,73
BELGIQUE 20/40	BE0000350596	0,400	0	0	400	61,986	247.944,00	0,50
Summe Emissionsland Belgien							<u>1.977.598,78</u>	<u>3,99</u>
Emissionsland Deutschland								
K.F.W.ANL.V.14/2024	DE000A1R0709	1,500	0	0	1.000	98,475	984.750,00	1,99
K.F.W.ANL.V.17/2027	DE000A2GSFA2	0,500	0	0	1.300	90,445	1.175.779,84	2,37
KRED.F.WIED.15/30 MTN	DE000A11QTF7	0,375	0	0	700	84,685	592.794,99	1,20
KRED.F.WIED.21/31 MTN	DE000A3H2ZF6	0,000	0	0	700	80,532	563.723,99	1,14
Summe Emissionsland Deutschland							<u>3.317.048,82</u>	<u>6,70</u>
Emissionsland Frankreich								
CIE F.FONCIER 16/26 MTN	FR0013106630	1,000	400	0	400	94,099	376.396,79	0,76
CSSE DEP.CON 21/26 MTN	FR0014003RL9	0,010	0	0	400	91,422	365.689,60	0,74
FRANKREICH 19/29	FR0013407236	0,500	0	0	1.000	88,007	880.065,99	1,78
FRANKREICH 20/40 O.A.T.	FR0013515806	0,500	0	0	1.100	64,264	706.904,00	1,43
FRANKREICH 23/29 O.A.T.	FR001400HI98	2,750	500	0	500	99,552	497.759,02	1,00
FRANKREICH 23/54 O.A.T.	FR001400FTH3	3,000	400	0	400	91,371	365.483,18	0,74
REP. FSE 10-26 O.A.T.	FR0010916924	3,500	0	0	500	101,258	506.292,00	1,02
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011883966	2,500	0	0	2.800	98,157	2.748.384,83	5,55
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012517027	0,500	0	0	500	95,583	477.914,01	0,96
REP. FSE 16-26 O.A.T.	FR0013131877	0,500	0	0	300	93,632	280.894,80	0,57
REP. FSE 16-36 O.A.T.	FR0013154044	1,250	0	0	2.900	80,139	2.324.025,26	4,69
REP. FSE 18-34 O.A.T.	FR0013313582	1,250	0	0	1.000	83,664	836.640,01	1,69
SNCF 17/29 MTN	XS1558472129	1,500	0	0	500	90,938	454.690,02	0,92
Summe Emissionsland Frankreich							<u>10.821.139,51</u>	<u>21,85</u>
Emissionsland Italien								
B.T.P. 13-24	IT0004953417	4,500	0	0	500	100,340	501.700,00	1,01
B.T.P. 14-24	IT0005001547	3,750	0	0	500	100,052	500.262,26	1,01
B.T.P. 15-25	IT0005090318	1,500	0	0	1.500	96,507	1.447.611,02	2,92
B.T.P. 15-32	IT0005094088	1,650	0	0	1.100	84,040	924.440,01	1,87
B.T.P. 16-26	IT0005170839	1,600	0	0	1.000	95,071	950.711,98	1,92
B.T.P. 16-36	IT0005177909	2,250	0	0	700	80,378	562.645,99	1,14
ITALIEN 19/27	IT0005390874	0,850	500	0	1.500	91,660	1.374.903,03	2,78
ITALIEN 19/29	IT0005365165	3,000	0	0	1.000	96,450	964.499,97	1,95
ITALIEN 20/30	IT0005413171	1,650	0	0	1.400	86,380	1.209.319,96	2,44
ITALIEN 20/51	IT0005425233	1,700	1.550	0	2.000	58,206	1.164.115,98	2,35
ITALIEN 21/26	IT0005454241	0,000	0	0	1.000	90,386	903.858,03	1,82
ITALIEN 21/28	IT0005445306	0,500	400	0	1.800	86,302	1.553.439,60	3,14
Summe Emissionsland Italien							<u>12.057.507,83</u>	<u>24,34</u>
Emissionsland Niederlande								
BNG BK 19/29 MTN	XS1940071597	0,750	0	0	500	88,363	441.813,01	0,89
Summe Emissionsland Niederlande							<u>441.813,01</u>	<u>0,89</u>

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 Österreich								
AUSTRIA 05/25 FLR MTN	XS0229808315	0,000	0	0	1.500	97,100	1.456.500,00	2,94
BAWAG P.S.K. 22/27 MTN	XS2556232143	3,000	0	0	500	98,280	491.402,02	0,99
Summe Emissionsland Österreich							1.947.902,02	3,93
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 06-37	PTOTE50E0007	4,100	0	0	150	106,048	159.071,70	0,32
PORTUGAL 18-34	PTOTEW0E0017	2,250	0	0	200	90,617	181.234,41	0,37
PORTUGAL 19/29	PTOTEX0E0024	1,950	0	0	500	94,728	473.639,99	0,96
Summe Emissionsland Portugal							813.946,10	1,64
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 13-23	ES00000123X3	4,400	0	0	500	100,100	500.500,00	1,01
SPANIEN 14-24	ES00000124W3	3,800	0	0	500	100,070	500.350,00	1,01
SPANIEN 14-24	ES00000126B2	2,750	0	0	500	99,106	495.529,56	1,00
SPANIEN 16-26	ES00000128H5	1,300	0	0	1.000	94,449	944.489,97	1,91
SPANIEN 16-46	ES00000128C6	2,900	0	0	600	84,528	507.168,00	1,02
SPANIEN 17-27	ES0000012A89	1,450	0	0	500	93,499	467.492,98	0,94
SPANIEN 17-33	ES00000128Q6	2,350	0	0	500	91,059	455.294,99	0,92
SPANIEN 19/29	ES0000012F43	0,600	500	0	1.700	85,762	1.457.950,12	2,94
SPANIEN 19/35	ES0000012E69	1,850	0	0	1.000	83,500	835.000,00	1,69
SPANIEN 20/30	ES0000012G34	1,250	900	0	2.400	87,386	2.097.264,05	4,23
Summe Emissionsland Spanien							8.261.039,67	16,68
Summe Anleihen auf Euro lautend							39.637.995,74	80,02
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							39.637.995,74	80,02
Derivate							nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Financial Futures auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EURO-SCHATZ FUT Dec23	FGBS071223				80		12.800,00	0,03
Summe Emissionsland Deutschland							12.800,00	0,03
Summe Financial Futures auf Euro lautend							12.800,00	0,03
Optionen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EURO-BUND OPT. Oct23P 130	FGBLP13000220923		0	1.000	-1.000	0,000	0,00	0,00
Summe Emissionsland Deutschland							0,00	0,00
Summe Optionen auf Euro lautend							0,00	0,00
Summe Derivate							12.800,00	0,03

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	49.059.315,29	99,04
Financial Futures	12.800,00	0,03
Optionen	0,00	0,00
Bankguthaben	145.685,00	0,29
Zinsenansprüche	315.890,22	0,64
Fondsvermögen	49.533.690,51	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A011W3	Stück	28.098,688
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A011W3	EUR	10,00
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A011X1	Stück	3.795.344,482
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A011X1	EUR	12,97

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 Schuldverschreibungen der Zentralstaaten oder Zentralbanken der Länder der Eurozone 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. Im Falle regulatorischer Vorgaben, die einen anderen Abschlag oder Bereitstellung alternativer Sicherheiten erfordern, wird diese entsprechende Vorgabe eingehalten.

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 Italien				
B.T.P. 13-23	IT0004898034	4,500	0	800
Emissionsland Österreich				
OESTERR. 16/47	AT0000A1K9F1	1,500	0	600
OESTERREICH 19/29 MTN	AT0000A269M8	0,500	0	300
RAIF.BK INTL 22/26 MTN	XS2537097409	2,875	0	500

Wien, im September 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“)).