

# **ERSTE ALPHA 2**

**Miteigentumsfonds gemäß InvFG**

Halbjahresbericht 2022

## Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft .....	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.07.2022 .....	5

## Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft

<b>Die Gesellschaft</b>	Erste Asset Management GmbH Am Belvedere 1, A-1100 Wien Telefon: 05 0100-19777, Telefax: 05 0100-919777
<b>Stammkapital</b>	2,50 Mio. EURO
<b>Gesellschafter</b>	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 %)
<b>Aufsichtsrat</b>	Mag. Rudolf SAGMEISTER (Vorsitzender) Manfred BARTALSZKY (ab 16.02.2022) Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN (ab 16.02.2022) Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER Radovan JELASITY Mag. Robert LASSHOFER (bis 16.02.2022) Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER 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
<b>Geschäftsführer</b>	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
<b>Prokuristen</b>	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
<b>Staatskommissäre</b>	Mag. Walter MEGNER (bis 28.02.2022) Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ (ab 01.03.2022) Mag. Wolfgang TRISKO (bis 14.05.2022)
<b>Fondsprüfer</b>	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
<b>Depotbank</b>	Erste Group Bank AG

## Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE ALPHA 2 Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.02.2022 bis 31.07.2022 vorzulegen.

## Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.07.2022	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	50,3	92,44
Wertpapiere	50,3	92,44
Financial Futures	-0,1	-0,21
Bankguthaben	4,2	7,72
Zinsenansprüche	0,0	0,05
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	54,4	100,00

# Vermögensaufstellung zum 31.07.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.02.2022 bis 31.07.2022)

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
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Deutschland</b>								
BUNDESUBL.V.18/23 S.178	DE0001141786	0,000	0	0	1.500	99,820	1.497.302,97	2,75
BUNDESUBL.V.19/24 S.180	DE0001141802	0,000	3.600	0	3.600	99,451	3.580.235,86	6,58
BUNDESUBL.V.20/25 S.181	DE0001141810	0,000	3.900	0	3.900	99,225	3.869.790,72	7,11
Summe Emissionsland Deutschland							<u>8.947.329,55</u>	<u>16,44</u>
<b>Emissionsland Österreich</b>								
OESTERR. 16/23	AT0000A1PE50	0,000	0	700	2.900	99,508	2.885.732,09	5,30
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	1.500	0	1.500	99,300	1.489.493,99	2,74
Summe Emissionsland Österreich							<u>4.375.226,08</u>	<u>8,04</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>13.322.555,63</u>	<u>24,49</u>
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							<u>13.322.555,63</u>	<u>24,49</u>
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Belgien</b>								
BELGIQUE 16/23 79	BE0000339482	0,200	0	700	3.200	99,907	3.197.017,57	5,88
BELGIQUE 17/24 82	BE0000342510	0,500	3.300	0	3.300	100,347	3.311.451,00	6,09
Summe Emissionsland Belgien							<u>6.508.468,57</u>	<u>11,96</u>
<b>Emissionsland Finnland</b>								
FINNLD 19/24	FI4000391529	0,000	3.000	0	3.000	99,139	2.974.170,00	5,47
Summe Emissionsland Finnland							<u>2.974.170,00</u>	<u>5,47</u>
<b>Emissionsland Frankreich</b>								
FRANKREICH 19/25 O.A.T.	FR0013415627	0,000	3.700	0	3.700	98,568	3.647.016,04	6,70
REP. FSE 17-23 O.A.T.	FR0013283686	0,000	0	2.100	1.800	99,905	1.798.290,00	3,31
REP. FSE 18-24 O.A.T.	FR0013344751	0,000	300	100	5.100	99,621	5.080.671,10	9,34
Summe Emissionsland Frankreich							<u>10.525.977,14</u>	<u>19,35</u>
<b>Emissionsland Niederlande</b>								
NEDERLD 17-24	NL0012650469	0,000	3.600	0	3.600	99,704	3.589.344,07	6,60
Summe Emissionsland Niederlande							<u>3.589.344,07</u>	<u>6,60</u>

## ERSTE ALPHA 2

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
<b>Emissionsland Österreich</b>								
OESTERREICH 21/25 MTN	AT0000A2QRW0	0,000	2.000	0	2.000	98,519	1.970.372,00	3,62
Summe Emissionsland Österreich							1.970.372,00	3,62
<b>Emissionsland Slowakei</b>								
SLOWAKEI 20016 ZO 230	SK4120011636	0,000	0	0	900	99,021	891.189,04	1,64
Summe Emissionsland Slowakei							891.189,04	1,64
<b>Emissionsland Spanien</b>								
SPANIEN 18-23	ES0000012B62	0,350	0	0	1.200	99,698	1.196.378,35	2,20
SPANIEN 19/24	ES0000012E85	0,250	0	0	2.700	99,281	2.680.579,74	4,93
SPANIEN 20/23	ES0000012F84	0,000	0	2.000	1.900	99,635	1.893.065,00	3,48
SPANIEN 20/25	ES0000012F92	0,000	600	0	600	98,185	589.109,99	1,08
SPANIEN 21/24	ES0000012H33	0,000	0	900	4.200	98,991	4.157.605,24	7,64
Summe Emissionsland Spanien							10.516.738,32	19,33
Summe Anleihen auf Euro lautend							36.976.259,14	67,96
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							36.976.259,14	67,96
<b>Derivate</b>							<b>nicht realisiertes Ergebnis in EUR</b>	
<b>Financial Futures auf Britische Pfund lautend</b>								
<b>Emissionsland Großbritannien</b>								
LONG GILT FUTURE Sep22	LGRU22				22		58.715,13	0,11
Summe Emissionsland Großbritannien							58.715,13	0,11
Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,83790							58.715,13	0,11
<b>Financial Futures auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Deutschland</b>								
EURO-BOBL FUTURE Sep22	EBOBU22				-42		-125.580,00	-0,23
EURO-BUND FUTURE Sep22	FGBLU22				18		40.196,25	0,07
EURO-SCHATZ FUT Sep22	FGBSU22				-697		-603.835,78	-1,11
Summe Emissionsland Deutschland							-689.219,53	-1,27
<b>Emissionsland Großbritannien</b>								
2YR EUR SWAPNOTE 09/22	ESW2U22				600		492.000,00	0,90
Summe Emissionsland Großbritannien							492.000,00	0,90
Summe Financial Futures auf Euro lautend							-197.219,53	-0,36

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Financial Futures auf Japanische Yen lautend</b>				
<b>Emissionsland Japan</b>				
JPN 10Y BOND(OSE) Sep22	TGB1U22	5	45.387,11	0,08
		Summe Emissionsland Japan	45.387,11	0,08
		Summe Financial Futures auf Japanische Yen lautend umgerechnet zum Kurs von 136,27625	45.387,11	0,08

**Financial Futures auf US-Dollar lautend****Emissionsland USA**

US 10YR NOTE (CBT)Sep22	TN1U22	14	21.667,97	0,04
US 2YR NOTE (CBT) Sep22	CTN2U22	-37	-42.539,11	-0,08
		Summe Emissionsland USA	-20.871,13	-0,04
		Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,01965	-20.871,13	-0,04
		Summe Derivate	-113.988,42	-0,21

**Gliederung des Fondsvermögens**

Wertpapiere		50.298.814,77	92,44
Financial Futures		-113.988,43	-0,21
Bankguthaben		4.199.343,43	7,72
Zinsenansprüche		28.765,34	0,05
Sonstige Abgrenzungen		-2.612,45	-0,00
Fondsvermögen		54.410.322,66	100,00

**Hinweis an die Anleger:**

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A05F50	Stück	712.673,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A05F50	EUR	76,34

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 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	Kennnummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Deutschland</b>				
BUNDESUBL.V.17/22 S.175	DE0001141752	0,000	0	5.400
<b>Emissionsland Finnland</b>				
FINLD 17-22	FI4000242862	0,000	0	3.300
<b>Emissionsland Frankreich</b>				
REP. FSE 16-22 O.A.T.	FR0013219177	0,000	0	4.600
<b>Emissionsland Irland</b>				
IRLAND 2022	IE00BDHDPQ37	0,000	0	1.500
IRLAND 2022	IE00BJ38CQ36	0,800	0	3.300
<b>Emissionsland Österreich</b>				
AUSTRIA 17/22 MTN	AT0000A1XM92	0,000	0	3.600
OESTERREICH 20/23 MTN	AT0000A2EJZ6	0,000	0	3.000
<b>Emissionsland Slowenien</b>				
SLOWENIEN 20/23	SI0002103974	0,200	0	600



Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
<b>Emissionsland Spanien</b>				
SPANIEN 17-22	ES0000012801	0,400	0	600
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Lettland</b>				
LETTLAND,REP 20/23 MTN	XS2156474392	0,125	0	1.200

Wien, im August 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“)).