

Alpha Diversified 1

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022/23

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.01.2023.....	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. - 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 Alpha Diversified 1 Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.08.2022 bis 31.01.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.01.2023	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	28,2	75,10
auf US-Dollar lautend	5,7	15,08
Wertpapiere	33,8	90,18
Devisentermingeschäfte	0,1	0,19
Bankguthaben	3,6	9,61
Zinsenansprüche	0,0	0,01
Fondsvermögen	37,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.01.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.08.2022 bis 31.01.2023)

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 Irland							
LYX.N.IE3-BCGMF IE0A	IE00BKDKNQ35	0	0	35.000	94,791	3.317.685,00	8,85
LYXOR EPSILON GL.TR.I EO	IE00B643RZ01	7.500	0	37.500	161,342	6.050.310,00	16,14
UBS FDSO-CMCI CO.CR.SFAAD	IE00BKFB6L02	10.000	0	40.000	127,160	5.086.400,00	13,57
Summe Emissionsland Irland						<u>14.454.395,00</u>	<u>38,56</u>
Emissionsland Luxemburg							
FTC FUTURES-FTC FUT.CLAS.	LU0082076828	5.000	0	165.000	18,770	3.097.050,00	8,26
L.MW-LMWE.MN)T BEOA	LU2367661365	17.725	0	17.725	109,337	1.937.996,55	5,17
MAN U.-AHL TR.AL.IN HEOA	LU0428380124	5.500	0	32.500	160,930	5.230.225,00	13,95
SCHRODER GAIA BLUE.C AEOH	LU1293073828	5.000	0	30.000	114,560	3.436.800,00	9,17
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>13.702.071,55</u>	<u>36,55</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						<u>28.156.466,55</u>	<u>75,10</u>
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Jersey							
MANAG./BRIDGEWATER FD B	GB00B02KKD01	0	0	7.171	207,720	1.363.840,28	3,64
MANAG./BRIDGEWATER S DL	JE00B8B9FW89	0	0	10.121	110,200	1.021.191,51	2,72
Summe Emissionsland Jersey						<u>2.385.031,79</u>	<u>6,36</u>
Emissionsland Luxemburg							
L.MW-LMWE.MN)T BDLA	LU2367661449	158	0	30.158	118,354	3.268.120,45	8,72
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>3.268.120,45</u>	<u>8,72</u>
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,09215						<u>5.653.152,24</u>	<u>15,08</u>
Summe Investmentzertifikate						<u>33.809.618,79</u>	<u>90,18</u>
Devisentermingeschäfte						nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							
Emissionsland Österreich							
FXF SPEST EUR/USD 20.04.2023	FXF_TAX_3463521			9.551.984		72.600,92	0,19
Summe Emissionsland Österreich						<u>72.600,92</u>	<u>0,19</u>
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend						<u>72.600,92</u>	<u>0,19</u>
Summe Devisentermingeschäfte						<u>72.600,92</u>	<u>0,19</u>

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	33.809.618,79	90,18
Devisentermingeschäfte	72.600,92	0,19
Bankguthaben	3.603.454,88	9,61
Zinsenansprüche	4.207,00	0,01
Fondsvermögen	37.489.881,59	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A0SE90	Stück	62.425,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A0SE90	EUR	115,51
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A0SE82	Stück	285.776,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A0SE82	EUR	105,95

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 Irland			
LYX CRED F SSIEOA	IE00BL71KB37	4.500	20.702
Emissionsland Luxemburg			
CAND.AB.RTN-EQ.MKT N.IEOC	LU1962513328	0	1.750

Wien, im Februar 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“)).