

ERSTE BOND INFLATION LINKED

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.11.2023	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 WATTL (bis 31.10.2023) 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 Anteilhaber:innen,

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND INFLATION LINKED Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2023 bis 30.11.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	48,1	98,62
Wertpapiere	48,1	98,62
Financial Futures	-0,0	-0,00
Bankguthaben	0,6	1,23
Zinsenansprüche	0,1	0,15
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	48,8	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2023 bis 30.11.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BUNDANL.V. 14/30 INFL.LKD	DE0001030559	0,500	100	200	2.800	101,334	3.549.981,33	7,28
BUNDANL.V. 15/26 INFL.LKD	DE0001030567	0,100	0	200	2.400	97,513	2.920.358,33	5,99
BUNDANL.V. 21/33 INFL.LKD	DE0001030583	0,100	1.300	0	1.300	98,297	1.517.408,82	3,11
Summe Emissionsland Deutschland							<u>7.987.748,48</u>	<u>16,38</u>
Emissionsland Frankreich								
FRANKREICH 19/29	FR0013410552	0,100	400	0	3.400	97,340	3.944.135,03	8,09
FRANKREICH 20/26	FR0013519253	0,100	0	400	1.500	98,211	1.738.423,09	3,56
FRANKREICH 20/31 O.A.T.	FR0014001N38	0,100	0	200	2.400	96,224	2.730.536,90	5,60
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	0,100	0	300	1.600	96,105	1.733.857,21	3,56
REP. FSE 02-32 O.A.T.	FR0000188799	3,150	400	0	400	120,130	735.618,46	1,51
REP. FSE 11-27 O.A.T.	FR0011008705	1,850	200	300	2.900	104,506	4.011.551,64	8,23
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011982776	0,700	0	0	2.400	100,932	3.007.757,45	6,17
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012558310	0,100	0	500	1.600	98,487	1.851.855,00	3,80
REP. FSE 17-28 O.A.T.	FR0013238268	0,100	0	300	1.900	97,746	2.178.892,25	4,47
Summe Emissionsland Frankreich							<u>21.932.627,03</u>	<u>44,97</u>
Emissionsland Italien								
B.T.P. 15-32 FLR	IT0005138828	1,250	0	0	1.900	93,870	2.205.994,75	4,52
B.T.P. 17-28 FLR	IT0005246134	1,300	0	200	2.000	98,620	2.438.990,94	5,00
B.T.P. 20/26 FLR	IT0005415416	0,650	0	0	3.000	97,460	3.453.212,47	7,08
ITALIEN 19/30 FLR	IT0005387052	0,400	0	0	1.900	91,110	2.074.469,01	4,25
ITALIEN 22/33 FLR	IT0005482994	0,100	2.100	0	2.100	82,740	1.999.943,29	4,10
ITALIEN 23/29 FLR	IT0005543803	1,500	500	0	500	98,185	504.273,25	1,03
Summe Emissionsland Italien							<u>12.676.883,71</u>	<u>25,99</u>
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 14-24 FLR	ES00000126A4	1,800	0	1.500	300	99,733	370.970,86	0,76
SPANIEN 15-30 FLR	ES00000127C8	1,000	0	0	2.200	99,097	2.695.692,09	5,53
SPANIEN 17-27 FLR	ES00000128S2	0,650	200	300	2.000	98,545	2.432.287,69	4,99
Summe Emissionsland Spanien							<u>5.498.950,64</u>	<u>11,28</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>48.096.209,86</u>	<u>98,62</u>
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							<u>48.096.209,86</u>	<u>98,62</u>

ERSTE BOND INFLATION LINKED

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Derivate				
Financial Futures auf Euro lautend				
Emissionsland Deutschland				
EURO-SCHATZ FUT Mar24	FGBS070324	-10	-841,38	-0,00
Summe Emissionsland Deutschland			-841,38	-0,00
Summe Financial Futures auf Euro lautend			-841,38	-0,00
Summe Derivate			-841,38	-0,00

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			48.096.209,86	98,62
Financial Futures			-841,38	-0,00
Bankguthaben			601.776,10	1,23
Zinsenansprüche			74.227,80	0,15
Sonstige Abgrenzungen			-831,78	-0,00
Fondsvermögen			48.770.540,60	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000619887	Stück	63.218,145
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000619887	EUR	93,83
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Y1	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Y1	EUR	108,70
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Z8	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y2Z8	EUR	108,31
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000619895	Stück	287.114,319
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000619895	EUR	127,42
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y307	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y307	EUR	108,57
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1ACM9	Stück	24.444,207
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1ACM9	EUR	132,85
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y315	Stück	8.748,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y315	EUR	109,78
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y323	Stück	17.800,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y323	EUR	114,94
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y331	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y331	HUF	41.735,33

Bei folgenden Wertpapieren handelt es sich um inflationsindexierte Anleihen, bei denen das Nominale mit einem Inflationsindex abgesichert ist:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Index-Value	Kurswert in EUR
B.T.P. 15-32 FLR	IT0005138828	1,23687	2.205.994,75
B.T.P. 17-28 FLR	IT0005246134	1,23656	2.438.990,94
B.T.P. 20/26 FLR	IT0005415416	1,18107	3.453.212,47
BUNDANL.V. 14/30 INFL.LKD	DE0001030559	1,25116	3.549.981,33
BUNDANL.V. 15/26 INFL.LKD	DE0001030567	1,24785	2.920.358,33
BUNDANL.V. 21/33 INFL.LKD	DE0001030583	1,18746	1.517.408,82
FRANKREICH 19/29	FR0013410552	1,19174	3.944.135,03
FRANKREICH 20/26	FR0013519253	1,18006	1.738.423,09
FRANKREICH 20/31 O.A.T.	FR0014001N38	1,18237	2.730.536,90
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	1,12758	1.733.857,21
ITALIEN 19/30 FLR	IT0005387052	1,19836	2.074.469,01
ITALIEN 22/33 FLR	IT0005482994	1,15102	1.999.943,29
ITALIEN 23/29 FLR	IT0005543803	1,02719	504.273,25
REP. FSE 02-32 O.A.T.	FR0000188799	1,53088	735.618,46
REP. FSE 11-27 O.A.T.	FR0011008705	1,32365	4.011.551,64
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011982776	1,24166	3.007.757,45
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012558310	1,17519	1.851.855,00
REP. FSE 17-28 O.A.T.	FR0013238268	1,17323	2.178.892,25
SPANIEN 14-24 FLR	ES00000126A4	1,23988	370.970,86
SPANIEN 15-30 FLR	ES00000127C8	1,23648	2.695.692,09
SPANIEN 17-27 FLR	ES00000128S2	1,23410	2.432.287,69

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 Deutschland				
BUNDANL.V.23/33	DE000BU2Z007	2,300	0	1.200
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Frankreich				
REP. FSE 13-24 O.A.T.	FR0011427848	0,250	0	1.000
Emissionsland Italien				
B.T.P. 14-24 FLR	IT0005004426	2,350	0	1.500

Wien, im Dezember 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“)).