

DELPHIN TREND GLOBAL

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.07.2023	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 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 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 DELPHIN TREND GLOBAL Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.02.2023 bis 31.07.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.07.2023	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	37,6	60,48
auf US-Dollar lautend	16,0	25,68
Wertpapiere	53,6	86,16
Bankguthaben	8,6	13,82
Zinsenansprüche	0,0	0,01
Fondsvermögen	62,2	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.07.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.02.2023 bis 31.07.2023)

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							
UBS(I)-FA.MSCI US.QU.ADDL	IE00BX7RRJ27	120.000	0	120.000	38,030	4.563.600,00	7,34
Summe Emissionsland Irland						<u>4.563.600,00</u>	<u>7,34</u>
Emissionsland Luxemburg							
CANDR.M.MKT.-EURO AAA V C	LU0354092115	9.996	0	9.996	1.064,180	10.637.993,43	17,10
JPM-AMERICA EQ.JPMAE IAEO	LU1734444273	0	0	32.000	186,090	5.954.880,00	9,57
JPM-EM.MK.EQ.JPMEME IAEO	LU0383004313	215.000	216.000	215.000	23,780	5.112.700,00	8,22
SISF GL.EM.MKT.OPP. CA EO	LU0279459969	208.000	211.000	208.000	25,635	5.332.142,40	8,57
THRE.L-US CO.CORE EQ.IUEO	LU0757433437	0	0	77.000	78,293	6.028.530,20	9,69
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>33.066.246,03</u>	<u>53,15</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						<u>37.629.846,03</u>	<u>60,48</u>
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Luxemburg							
PICTET-EM.MKTS IN.NAM.IDL	LU0188497985	18.000	18.000	18.000	317,250	5.174.663,59	8,32
STATE STR.E.M.ESG S.E.E.I	LU0446997610	370.000	375.000	364.000	16,020	5.283.945,45	8,49
UBSLFS-MSCI USA SR ADDL	LU0629460089	0	0	32.000	190,340	5.519.351,18	8,87
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>15.977.960,22</u>	<u>25,68</u>
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,10355						<u>15.977.960,22</u>	<u>25,68</u>
Summe Investmentzertifikate						<u>53.607.806,25</u>	<u>86,16</u>

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	53.607.806,25	86,16
Bankguthaben	8.600.147,05	13,82
Zinsenansprüche	7.396,68	0,01
Fondsvermögen	62.215.349,98	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A09UQ0	Stück	263.512,873
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A09UQ0	EUR	18,68
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A09UR8	Stück	2.816.797,091
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A09UR8	EUR	20,33

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 gelearnte 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 Frankreich			
AMJ.EO LI.SH.TE.SRI C	FR0007435920	1.000	1.000
Emissionsland Irland			
ISHSIV-E.MSCI EUR.V.F.EOA	IE00BQN1K901	0	950.000
Emissionsland Luxemburg			
AIS-AM.MSCI EU.Q.F. EOC	LU1681041890	38.000	38.000
ELEVA LEAD.S+MC EUR.ICEO	LU1920216006	0	2.400
GS EUR.SUS.EQ.ICEO	LU0991964247	0	380
UNIDYNAMICFDS EUR. A	LU0085167236	0	38.000

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend			
Emissionsland Luxemburg			
BNPP US SMALL CAP I CAP	LU0823411292	0	10.700

Wien, im August 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“)).