

ERSTE ALPHA 1

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 ERSTE ALPHA 1 Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.02.2023 bis 31.07.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.07.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	16,3	91,47
Wertpapiere	16,3	91,47
Financial Futures	0,3	1,91
Swaps	-0,2	-1,02
Bankguthaben	1,4	7,60
Zinsenansprüche	0,0	0,05
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	17,8	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.07.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.02.2023 bis 31.07.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
					Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)			
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BUNDANL.V.16/26	DE0001102390	0,500	200	0	200	94,254	188.507,20	1,06
BUNDESUBL.V.19/24 S.180	DE0001141802	0,000	0	100	1.000	96,070	960.696,87	5,39
BUNDESUBL.V.20/25 S.181	DE0001141810	0,000	0	0	1.300	94,916	1.233.908,00	6,92
BUNDESUBL.V.20/25 S.182	DE0001141828	0,000	0	0	1.200	93,743	1.124.917,97	6,31
Summe Emissionsland Deutschland							3.508.030,04	19,67
Emissionsland Irland								
IRLAND 2026	IE00BV8C9418	1,000	300	0	300	94,942	284.827,19	1,60
Summe Emissionsland Irland							284.827,19	1,60
Emissionsland Österreich								
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	0	0	500	96,756	483.782,01	2,71
Summe Emissionsland Österreich							483.782,01	2,71
Summe Anleihen auf Euro lautend							4.276.639,24	23,98
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							4.276.639,24	23,98
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Belgien								
BELGIQUE 15/25 74	BE0000334434	0,800	600	0	600	95,655	573.929,99	3,22
BELGIQUE 17/24 82	BE0000342510	0,500	0	0	1.100	96,535	1.061.885,04	5,95
Summe Emissionsland Belgien							1.635.815,03	9,17
Emissionsland Finnland								
FINLD 15-25	FI4000167317	0,875	400	0	400	95,330	381.320,01	2,14
FINNLD 19/24	FI4000391529	0,000	0	0	1.000	96,246	962.463,99	5,40
Summe Emissionsland Finnland							1.343.784,00	7,53
Emissionsland Frankreich								
FRANKREICH 19/25 O.A.T.	FR0013415627	0,000	0	100	1.500	94,851	1.422.767,94	7,98
FRANKREICH 20/26 O.A.T.	FR0013508470	0,000	900	0	900	92,551	832.962,59	4,67
REP. FSE 10-26 O.A.T.	FR0010916924	3,500	700	0	700	101,140	707.979,99	3,97
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012938116	1,000	0	0	600	95,325	571.951,49	3,21
Summe Emissionsland Frankreich							3.535.662,01	19,82

ERSTE ALPHA 1

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
Emissionsland Niederlande								
NEDERLD 15-25	NL0011220108	0,250	0	0	500	94,643	473.213,01	2,65
NIEDERLANDE 16-26	NL0011819040	0,500	200	0	200	93,228	186.456,41	1,05
Summe Emissionsland Niederlande							659.669,42	3,70
Emissionsland Österreich								
OESTERREICH 21/25 MTN	AT0000A2QRW0	0,000	0	0	1.300	94,598	1.229.779,15	6,89
Summe Emissionsland Österreich							1.229.779,15	6,89
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 16-26	PTOTETOE0012	2,875	600	0	600	99,832	598.990,81	3,36
Summe Emissionsland Portugal							598.990,81	3,36
Emissionsland Slowakei								
SLOWAKEI 20016 ZO 230	SK4120011636	0,000	0	0	300	98,900	296.700,00	1,66
Summe Emissionsland Slowakei							296.700,00	1,66
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 19/24	ES0000012E85	0,250	0	0	900	96,710	870.386,42	4,88
SPANIEN 20/25	ES0000012F92	0,000	0	0	900	95,036	855.320,18	4,79
SPANIEN 20/26	ES0000012G91	0,000	1.100	0	1.100	92,197	1.014.164,80	5,69
Summe Emissionsland Spanien							2.739.871,40	15,36
Summe Anleihen auf Euro lautend							12.040.271,82	67,50
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							12.040.271,82	67,50
Derivate							nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Financial Futures auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EURO-BOBL FUTURE Sep23	EBOB070923				-16		24.960,00	0,14
EURO-BUND FUTURE Sep23	FGBL070923				9		-5.800,00	-0,03
EURO-SCHATZ FUT Sep23	FGBS070923				-510		321.122,82	1,80
Summe Emissionsland Deutschland							340.282,82	1,91
Summe Financial Futures auf Euro lautend							340.282,82	1,91
Summe Derivate							340.282,82	1,91

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Swaps				
Swaps auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
IRSW 39549955, FIX/VAR 0607	IRS039549955	70.000.000	-182.682,25	-1,02
		Summe Emissionsland Österreich	-182.682,25	-1,02
		Summe Swaps auf Euro lautend	-182.682,25	-1,02
		Summe Swaps	-182.682,25	-1,02

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		16.316.911,06	91,47
Financial Futures		340.282,82	1,91
Swaps		-182.682,25	-1,02
Bankguthaben		1.355.061,28	7,60
Zinsenansprüche		8.577,20	0,05
Sonstige Abgrenzungen		-317,13	-0,00
Fondsvermögen		17.837.832,98	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A03DF2	Stück	324.617,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A03DF2	EUR	54,95

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.

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.

Folgende Wertpapiere bzw. Bankguthaben wurden als Sicherheiten für Derivatgeschäfte bestellt:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Stück/Nominale/absolut (Nominale in 1.000, ger.)
Bankguthaben	auf Euro lautend	280.000

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				
BUNDESUBL.V.18/23 S.178	DE0001141786	0,000	0	200
Emissionsland Spanien				
SPANIEN 18-23	ES0000012B62	0,350	0	400
SPANIEN 20/23	ES0000012F84	0,000	0	300
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Belgien				
BELGIQUE 16/23 79	BE0000339482	0,200	0	600

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Emissionsland Frankreich				
REP. FSE 18-24 O.A.T.	FR0013344751	0,000	0	1.400
Emissionsland Niederlande				
NEDERLD 17-24	NL0012650469	0,000	0	1.200
Emissionsland Spanien				
SPANIEN 21/24	ES0000012H33	0,000	0	1.200

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“)).