

ERSTE ALPHA 2

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 2 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	49,0	91,53
Wertpapiere	49,0	91,53
Financial Futures	0,1	0,22
Swaps	-0,2	-0,44
Bankguthaben	4,6	8,60
Zinsenansprüche	0,1	0,10
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	53,5	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	600	0	600	94,254	565.521,61	1,06
BUNDESUBL.V.19/24 S.180	DE0001141802	0,000	0	300	3.000	96,070	2.882.090,61	5,39
BUNDESUBL.V.20/25 S.181	DE0001141810	0,000	0	0	3.900	94,916	3.701.724,00	6,92
BUNDESUBL.V.20/25 S.182	DE0001141828	0,000	0	0	3.600	93,743	3.374.753,90	6,31
							<u>10.524.090,12</u>	<u>19,68</u>
Emissionsland Irland								
IRLAND 2026	IE00BV8C9418	1,000	900	0	900	94,942	854.481,58	1,60
							<u>854.481,58</u>	<u>1,60</u>
Emissionsland Österreich								
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	0	0	1.500	96,756	1.451.346,02	2,71
							<u>1.451.346,02</u>	<u>2,71</u>
							<u>12.829.917,72</u>	<u>23,99</u>
							<u>12.829.917,72</u>	<u>23,99</u>
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Belgien								
BELGIQUE 15/25 74	BE0000334434	0,800	1.800	0	1.800	95,655	1.721.789,98	3,22
BELGIQUE 17/24 82	BE0000342510	0,500	0	0	3.300	96,535	3.185.655,13	5,96
							<u>4.907.445,11</u>	<u>9,18</u>
Emissionsland Finnland								
FINLD 15-25	FI4000167317	0,875	1.200	0	1.200	95,330	1.143.960,02	2,14
FINNLD 19/24	FI4000391529	0,000	0	0	3.000	96,246	2.887.391,97	5,40
							<u>4.031.351,99</u>	<u>7,54</u>
Emissionsland Frankreich								
FRANKREICH 19/25 O.A.T.	FR0013415627	0,000	0	300	4.500	94,851	4.268.303,82	7,98
FRANKREICH 20/26 O.A.T.	FR0013508470	0,000	2.700	0	2.700	92,551	2.498.887,77	4,67
REP. FSE 10-26 O.A.T.	FR0010916924	3,500	2.100	0	2.100	101,140	2.123.939,98	3,97
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012938116	1,000	0	0	1.800	95,325	1.715.854,48	3,21
							<u>10.606.986,05</u>	<u>19,83</u>
Emissionsland Niederlande								
NEDERLD 15-25	NL0011220108	0,250	0	0	1.500	94,643	1.419.639,02	2,65
NIEDERLANDE 16-26	NL0011819040	0,500	600	0	600	93,228	559.369,22	1,05
							<u>1.979.008,24</u>	<u>3,70</u>

ERSTE ALPHA 2

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 Österreich									
OESTERREICH 21/25 MTN	AT0000A2QRW0	0,000	700	0	3.900	94,598	3.689.337,44	6,90	
							Summe Emissionsland Österreich	3.689.337,44	6,90
Emissionsland Portugal									
PORTUGAL 16-26	PTOTETOE0012	2,875	1.800	0	1.800	99,832	1.796.972,44	3,36	
							Summe Emissionsland Portugal	1.796.972,44	3,36
Emissionsland Slowakei									
SLOWAKEI 20016 ZO 230	SK4120011636	0,000	0	0	900	98,900	890.100,00	1,66	
							Summe Emissionsland Slowakei	890.100,00	1,66
Emissionsland Spanien									
SPANIEN 19/24	ES0000012E85	0,250	0	0	2.700	96,710	2.611.159,25	4,88	
SPANIEN 20/25	ES0000012F92	0,000	100	0	2.700	95,036	2.565.960,55	4,80	
SPANIEN 20/26	ES0000012G91	0,000	3.300	0	3.300	92,197	3.042.494,40	5,69	
							Summe Emissionsland Spanien	8.219.614,20	15,37
							Summe Anleihen auf Euro lautend	36.120.815,47	67,54
							Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere	36.120.815,47	67,54
Derivate							nicht realisiertes Ergebnis in EUR		
Financial Futures auf Britische Pfund lautend									
Emissionsland Großbritannien									
LONG GILT FUTURE Sep23	LGR270923				-8		7.047,70	0,01	
							Summe Emissionsland Großbritannien	7.047,70	0,01
							Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,85690	7.047,70	0,01
Financial Futures auf Euro lautend									
Emissionsland Deutschland									
EURO-BOBL FUTURE Sep23	EBOB070923				-49		76.440,00	0,14	
EURO-BUND FUTURE Sep23	FGBL070923				6		-7.200,00	-0,01	
EURO-SCHATZ FUT Sep23	FGBS070923				-749		381.256,82	0,71	
							Summe Emissionsland Deutschland	450.496,82	0,84
							Summe Financial Futures auf Euro lautend	450.496,82	0,84
Financial Futures auf US-Dollar lautend									
Emissionsland USA									
US 10YR NOTE (CBT)Sep23	TN1200923				136		-284.440,06	-0,53	
US 2YR NOTE (CBT) Sep23	CTN2290923				43		-57.692,97	-0,11	
							Summe Emissionsland USA	-342.133,03	-0,64
							Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,10255	-342.133,03	-0,64
							Summe Derivate	115.411,49	0,22

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Swaps				
Swaps auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
IRSW 39550020, FIX/VAR 0065	IRS039550020	90.000.000	-234.877,18	-0,44
		Summe Emissionsland Österreich	-234.877,18	-0,44
		Summe Swaps auf Euro lautend	-234.877,18	-0,44
		Summe Swaps	-234.877,18	-0,44

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			48.950.733,19	91,53
Financial Futures			115.411,49	0,22
Swaps			-234.877,18	-0,44
Bankguthaben			4.598.354,90	8,60
Zinsenansprüche			52.251,07	0,10
Sonstige Abgrenzungen			-1.097,49	-0,00
Fondsvermögen			53.480.775,98	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A05F50	Stück	682.394,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A05F50	EUR	78,37

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	300.000

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	600
Emissionsland Österreich				
OESTERR. 16/23	AT0000A1PE50	0,000	0	800
Emissionsland Spanien				
SPANIEN 18-23	ES0000012B62	0,350	0	1.200
SPANIEN 20/23	ES0000012F84	0,000	0	900

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Belgien				
BELGIQUE 16/23 79	BE0000339482	0,200	0	1.800
Emissionsland Frankreich				
REP. FSE 18-24 O.A.T.	FR0013344751	0,000	0	4.200
Emissionsland Niederlande				
NEDERLD 17-24	NL0012650469	0,000	0	3.600
Emissionsland Spanien				
SPANIEN 21/24	ES0000012H33	0,000	0	3.600

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“)).