

ERSTE BOND DOLLAR

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023/24

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.03.2024.....	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 %)
Aufsichtsrät:innen	Mag. Rudolf SAGMEISTER (Vorsitzender) Manfred BARTALSZKY Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN Klaus FELDERER (ab 28.02.2024) Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER (Vorsitzender-Stv.) Radovan JELASITY Michael KOREN (ab 28.02.2024) Mag. Ertan PISKIN Dr. Peter PROBER Gabriele SEMMELROCK-WERZER (bis 31.12.2023) Mag. Reinhard WALTL (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:innen	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
Prokuristen:innen	Karl FREUDENSCHUSS Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER Mag. Magdalena UJWARY, MA
Staatskommissär:innen	Mag. Wolfgang EXL Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
Fondsprüfer	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
Depotbank	Erste Group Bank AG

Sehr geehrte Anteilshaber:innen,

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND DOLLAR Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.10.2023 bis 31.03.2024 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.03.2024	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf US-Dollar lautend	54,4	92,66
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	2,4	4,03
Wertpapiere	56,8	96,69
Devisentermingeschäfte	-0,0	-0,01
Financial Futures	0,0	0,00
Bankguthaben	1,6	2,65
Zinsenansprüche	0,4	0,67
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	58,7	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.10.2023 bis 31.03.2024)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
					Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)			
Investmentzertifikate								
Investmentzertifikate auf Euro lautend								
Emissionsland Österreich								
ERSTE ALPHA 1 T	AT0000A03DF2		26	14.558	10.522	56,170	591.020,74	1,01
ERSTE ALPHA 2 T	AT0000A05F50		72	30.828	22.140	80,150	1.774.521,00	3,02
Summe Emissionsland Österreich							2.365.541,74	4,03
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend							2.365.541,74	4,03
Summe Investmentzertifikate							2.365.541,74	4,03
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 14/24 MTN REGS	XS1085735899	5,125	0	0	2.000	99,795	1.857.601,56	3,16
Summe Emissionsland Portugal							1.857.601,56	3,16
Emissionsland Uruguay								
URUGUAY 13/24	US760942AZ58	4,500	0	0	1.000	99,771	309.525,80	0,53
Summe Emissionsland Uruguay							309.525,80	0,53
Emissionsland USA								
US TREASURY 2024	US912828XT22	2,000	0	7.900	3.200	99,460	2.962.185,30	5,04
US TREASURY 2025	US912828K742	2,000	0	10.700	4.800	96,172	4.296.384,20	7,32
US TREASURY 2026	US912828U246	2,000	2.000	6.900	6.200	93,656	5.404.334,78	9,20
US TREASURY 2027	US9128282R06	2,250	0	6.500	4.100	93,051	3.550.730,16	6,05
US TREASURY 2028	US9128283W81	2,750	0	5.400	3.200	94,043	2.800.851,61	4,77
US TREASURY 2028	US9128285M81	3,125	0	5.300	3.200	94,805	2.823.537,64	4,81
US TREASURY 2036	US912810FT08	4,500	3.500	8.200	5.000	102,824	4.784.969,94	8,15
US TREASURY 2044	US912810RJ97	3,000	2.000	6.900	4.600	78,762	3.371.994,11	5,74
US TREASURY 2048	US912810SA79	3,000	2.000	5.600	3.800	76,805	2.716.346,17	4,62
USA 19/29	US912828YB05	1,625	0	3.900	2.300	87,270	1.868.117,84	3,18
USA 20/30	US912828Z948	1,500	0	1.750	3.250	85,430	2.584.080,10	4,40
USA 20/30	US91282CAV37	0,875	0	4.200	2.500	80,359	1.869.779,31	3,18
USA 20/40	US912810SQ22	1,125	0	11.200	4.200	60,828	2.377.757,22	4,05
USA 21/41	US912810TA60	1,750	0	2.000	2.300	66,359	1.420.508,75	2,42
USA 22/29	US91282CFL00	3,875	2.000	1.500	3.700	97,695	3.364.257,56	5,73
USA 22/32	US91282CFF32	2,750	0	5.800	3.300	88,926	2.731.212,03	4,65
USA 22/52	US912810TJ79	3,000	2.000	7.300	4.700	76,098	3.328.763,40	5,67
Summe Emissionsland USA							52.255.810,12	88,97
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,07445							54.422.937,48	92,66
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							54.422.937,48	92,66

ERSTE BOND DOLLAR

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Derivate				
Financial Futures auf US-Dollar lautend				
Emissionsland USA				
US 10YR NOTE (CBT)Jun24	TN1180624	-6	2.763,04	0,00
US LONG BOND(CBT) Jun24	\$TBD180624	-1	-116,34	-0,00
		Summe Emissionsland USA	2.646,70	0,00
		Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,07445	2.646,70	0,00
		Summe Derivate	2.646,70	0,00

Devisentermingeschäfte			nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
FXF SPEST EUR/USD 19.04.2024	FXF_TAX_3467580	-4.178.424	6.965,01	0,01
FXF SPEST EUR/USD 19.04.2024	FXF_TAX_3467617	703.374	-3.488,04	-0,01
FXF SPEST EUR/USD 19.04.2024	FXF_TAX_3467747	294.263	-3.359,04	-0,01
FXF SPEST EUR/USD 19.04.2024	FXF_TAX_3467933	348.472	-4.953,25	-0,01
		Summe Emissionsland Österreich	-4.835,32	-0,01
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	-4.835,32	-0,01
		Summe Devisentermingeschäfte	-4.835,32	-0,01

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			56.788.479,22	96,69
Devisentermingeschäfte			-4.835,32	-0,01
Financial Futures			2.646,70	0,00
Bankguthaben			1.555.177,59	2,65
Zinsenansprüche			392.993,95	0,67
Sonstige Abgrenzungen			-2.079,57	-0,00
Fondsvermögen			58.732.382,57	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000982723	Stück	53.327,600
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000982723	USD	55,25
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858360	Stück	92.003,890
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858360	EUR	51,35
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR62	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR62	USD	116,87

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR70	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1YR70	EUR	108,78
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000817523	Stück	19.086,540
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000817523	USD	119,73
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812961	Stück	256.252,662
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812961	EUR	111,52
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR88	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR88	USD	116,87
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR96	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1YR96	EUR	107,67
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673207	Stück	8.415,885
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673207	EUR	123,31
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000605324	Stück	43.354,256
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000605324	USD	132,54
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRA2	Stück	102.601,270
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRA2	USD	118,97
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRB0	Stück	25.351,885
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YRB0	EUR	110,82

Der Poolfaktor gilt als Maß für Teiltilgungen von Anleihen, der das Verhältnis der noch nicht getilgten Summe zum unverändert bleibenden Nominalwert angibt.

Zu Beginn hat der Poolfaktor den Wert 1, der bis zur ersten Teiltilgung steigt und sich ab Tilgungsbeginn entsprechend der Tilgungsbedingungen reduziert, bis er am Ende den Wert 0 hat.

Folgender Poolfaktor ist für die Kurswertermittlung relevant:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Poolfaktor	Kurswert in EUR
URUGUAY 13/24	US760942AZ58	0,33333	309.525,80

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 US-Dollar lautend				
Emissionsland Ungarn				
HUNGARY 14/24	US445545AL04	5,375	0	1.000
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf US-Dollar lautend				
Emissionsland Israel				
ISRAEL 20/30	US46513JB346	2,750	0	2.500
Emissionsland Panama				
PANAMA 14/24	US698299BD54	4,000	0	2.000

Wien, im April 2024

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“)).