

# **ERSTE RESPONSIBLE RESERVE**

**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

<b>Die Gesellschaft</b>	Erste Asset Management GmbH Am Belvedere 1, A-1100 Wien Telefon: 05 0100-19777, Telefax: 05 0100-919777
<b>Stammkapital</b>	2,50 Mio. EURO
<b>Gesellschafter</b>	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 %)
<b>Aufsichtsrat</b>	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
<b>Geschäftsführer</b>	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
<b>Prokuristen</b>	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
<b>Staatskommissäre</b>	Mag. Wolfgang EXL Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
<b>Fondsprüfer</b>	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
<b>Depotbank</b>	Erste Group Bank AG

## Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE RESPONSIBLE RESERVE 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	300,6	97,61
auf US-Dollar lautend	2,7	0,88
Wertpapiere	303,3	98,49
Financial Futures	0,1	0,04
Bankguthaben	2,6	0,83
Zinsenansprüche	2,0	0,64
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	307,9	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 Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Australien</b>								
A.N.Z.BKG.GR 22/24 MTN	XS2555209035	3,205	0	0	3.000	99,134	2.974.020,09	0,97
Summe Emissionsland Australien							2.974.020,09	0,97
<b>Emissionsland Dänemark</b>								
GN STORE NRD 21/24 MTN	XS2412258522	0,875	900	0	2.500	92,900	2.322.500,00	0,75
Summe Emissionsland Dänemark							2.322.500,00	0,75
<b>Emissionsland Deutschland</b>								
BUNDANL.V.14/24	DE0001102333	1,750	0	0	100	99,118	99.118,00	0,03
DT.KREDITBANK IS. 17/24	DE000GRN0016	0,750	2.000	0	2.000	96,218	1.924.364,02	0,62
Summe Emissionsland Deutschland							2.023.482,02	0,66
<b>Emissionsland Finnland</b>								
CASTEL.H.FI. 22/25 MTN	XS2461785185	2,000	0	0	800	92,811	742.489,26	0,24
OP YRITYSPA. 19/24 MTN	XS2014288158	0,375	4.000	0	4.000	96,690	3.867.600,00	1,26
Summe Emissionsland Finnland							4.610.089,26	1,50
<b>Emissionsland Frankreich</b>								
CIE F.FONCIER04-24FLR MTN	FR0010101832	2,238	2.000	0	6.000	98,054	5.883.240,00	1,91
CREDIT AGRI. 13-23	FR0011625482	3,150	0	0	4.100	99,640	4.085.240,00	1,33
SNCF 12/32 MTN FLR	XS0744575092	3,500	2.000	0	2.000	97,473	1.949.459,24	0,63
Summe Emissionsland Frankreich							11.917.939,24	3,87
<b>Emissionsland Irland</b>								
AIB GROUP 19/24 MTN	XS2003442436	1,250	4.000	0	4.000	97,463	3.898.520,00	1,27
Summe Emissionsland Irland							3.898.520,00	1,27
<b>Emissionsland Italien</b>								
TERNA R.E.N.07/23 FLR MTN	XS0328430003	2,731	0	0	5.000	100,282	6.724.509,79	2,18
Summe Emissionsland Italien							6.724.509,79	2,18
<b>Emissionsland Kanada</b>								
EQUITABLE BK 21/24 MTN	XS2386885581	0,010	2.000	0	3.500	95,365	3.337.761,04	1,08
Summe Emissionsland Kanada							3.337.761,04	1,08

## ERSTE RESPONSIBLE RESERVE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Emissionsland Litauen</b>								
LITAUEN 19/24	LT0000650053	0,400	0	0	1.000	97,568	975.675,00	0,32
Summe Emissionsland Litauen							975.675,00	0,32
<b>Emissionsland Niederlande</b>								
SIKA CAPITAL 23/24 FLR	XS2616008038	3,925	2.000	0	2.000	100,026	2.000.520,00	0,65
Summe Emissionsland Niederlande							2.000.520,00	0,65
<b>Emittent Nordische Investitionsbank</b>								
NORDIC INV.BK 05/25MTN	XS0232189331	3,740	0	0	500	99,226	496.129,91	0,16
Summe Emittent Nordische Investitionsbank							496.129,91	0,16
<b>Emissionsland Norwegen</b>								
SCATEC 21/25 FLR	N00010931181	5,888	0	0	1.200	92,925	1.115.102,84	0,36
Summe Emissionsland Norwegen							1.115.102,84	0,36
<b>Emissionsland Österreich</b>								
CA IMMO 17-24	AT0000A1TBC2	1,875	0	0	2.500	98,316	2.457.900,00	0,80
CA IMMO 20/25	XS2248827771	1,000	0	0	2.000	88,101	1.762.019,96	0,57
ENERGIE AG 05/25	XS0213737702	4,500	1.235	0	1.235	100,532	1.241.565,27	0,40
ERSTE GP BNK 13-23FLR MTN	AT000B119680	4,000	0	0	2.500	100,054	2.501.350,00	0,81
HYPO NOE L.F.N.W. 18/23	XS1807409450	0,875	0	0	3.400	99,335	3.377.390,00	1,10
HYPO NOE LB 20/24	XS2193956716	0,375	1.100	0	2.100	96,435	2.025.135,00	0,66
KELAG-KAERNT.ELE.14-26MTN	AT0000A17Z60	3,000	0	0	1.181	97,080	1.146.514,80	0,37
OBERBANK 19/26 MTN	AT0000A28HX3	0,750	0	0	1.400	89,077	1.247.072,60	0,40
UNICR.BK AUS. 01/29FLRMTN	XS0140838474	4,453	0	0	2.500	99,990	2.499.744,93	0,81
UNICR.BK AUS. 01/31FLRMTN	XS0140394817	4,090	0	0	3.000	93,269	2.798.070,00	0,91
WIENERBERGER 18-24	AT0000A20F93	2,000	0	0	800	98,245	785.960,00	0,26
WIENERBERGER 20/25	AT0000A2GLA0	2,750	0	0	2.500	96,769	2.419.230,08	0,79
Summe Emissionsland Österreich							24.261.952,64	7,88
<b>Emissionsland Spanien</b>								
BCO DE SABADELL 18/24 MTN	XS1876076040	1,625	1.000	0	4.000	98,530	3.941.200,00	1,28
BCO SANTAND. 22/24FLR MTN	XS2476266205	4,275	4.000	0	4.000	100,568	4.022.720,00	1,31
BCO SANTAND.22/25 FLR MTN	XS2436160779	0,100	0	0	2.300	97,980	2.253.540,00	0,73
BCO SANTANDER 17/24FLRMTN	XS1717591884	4,133	1.000	0	2.300	100,094	2.302.162,00	0,75
TELEFON.EMI. 19/24 MTN	XS1946004451	1,069	0	0	800	98,575	788.600,00	0,26
Summe Emissionsland Spanien							13.308.222,00	4,32
<b>Emissionsland Tschechische Republik</b>								
CESKA SPORIT 22/25 FLRMTN	XS2555412001	6,693	0	0	1.800	101,710	1.830.771,00	0,59
Summe Emissionsland Tschechische Republik							1.830.771,00	0,59
<b>Emissionsland Ungarn</b>								
ERSTE BK HU 22/26	AT0000A2VCV4	1,250	0	0	3.000	90,258	2.707.746,96	0,88
Summe Emissionsland Ungarn							2.707.746,96	0,88

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Emissionsland USA</b>								
AT + T 2023 FLR	XS1907118464	4,312	0	0	3.000	100,040	3.001.200,00	0,97
Summe Emissionsland USA							3.001.200,00	0,97
Summe Anleihen auf Euro lautend							87.506.141,79	28,42
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							87.506.141,79	28,42
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Andorra</b>								
ANDORRA 22/27 MTN	XS2445667236	1,250	0	0	2.800	90,390	2.530.920,00	0,82
Summe Emissionsland Andorra							2.530.920,00	0,82
<b>Emissionsland Australien</b>								
TOYOTA FIN. 22/25 MTN	XS2430285077	0,064	0	0	1.500	94,498	1.417.475,97	0,46
Summe Emissionsland Australien							1.417.475,97	0,46
<b>Emissionsland Belgien</b>								
BELFIUS BK 17/24 MTN	BE6299156735	1,000	0	0	3.000	96,363	2.890.878,06	0,94
Summe Emissionsland Belgien							2.890.878,06	0,94
<b>Emissionsland Dänemark</b>								
CARLSBERG BREW. 14/24 MTN	XS1071713470	2,500	0	0	2.500	98,780	2.469.500,00	0,80
Summe Emissionsland Dänemark							2.469.500,00	0,80
<b>Emissionsland Deutschland</b>								
AAREAL BANK MTN S.278	DE000A2E4CQ2	0,375	0	0	2.800	96,484	2.701.552,00	0,88
BAYWA AG NTS 19/24	XS2002496409	3,125	600	0	2.100	99,500	2.089.500,00	0,68
COBA 21/23 S.990	DE000CZ45WX9	4,412	1.500	0	1.500	100,232	1.503.480,00	0,49
COBA MTN 16/23	DE000CZ40LR5	0,500	0	0	2.500	99,563	2.489.075,00	0,81
DZ BANK IS.A758	DE000DG4UAS0	0,390	0	0	2.000	99,395	1.987.900,00	0,65
HOWOGE MTN 21/24	DE000A3H3GE7	0,000	2.000	0	2.000	94,451	1.889.019,92	0,61
LB HESS.-THUER.MTN 19/24	XS2080581189	0,125	0	0	3.500	94,864	3.320.254,11	1,08
LBBW MTN 19/24	DE000LB2CHW4	0,375	0	0	2.000	97,235	1.944.700,00	0,63
M.B.INT.FIN. MTN 20/23	DE000A289XH6	1,625	0	0	3.000	99,875	2.996.250,00	0,97
VONOVIA SE MTN 21/23	DE000A3MP4S3	0,000	0	0	700	99,347	695.429,00	0,23
VONOVIA SE MTN 21/25	DE000A3MP4T1	0,000	0	0	1.300	90,061	1.170.795,64	0,38
Summe Emissionsland Deutschland							22.787.955,67	7,40
<b>Emissionsland Finnland</b>								
SANOMA 21/24	FI4000490602	0,625	0	0	1.000	97,500	975.000,00	0,32
Summe Emissionsland Finnland							975.000,00	0,32

## ERSTE RESPONSIBLE RESERVE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Emissionsland Frankreich</b>								
ALD 20/23 MTN	XS2243983520	0,375	0	0	1.500	99,240	1.488.600,00	0,48
ALD 22/26 MTN REGS	XS2451372499	1,250	0	0	3.000	93,030	2.790.899,97	0,91
BANQUE POSTALE 17-24 MTN	FR0013286838	1,000	0	0	2.900	96,489	2.798.180,94	0,91
BNP PARIBAS 17/24 FLR MTN	XS1626933102	4,243	0	0	3.000	100,440	3.013.200,00	0,98
BNP PARIBAS 18/25 MTN	XS1793252419	1,250	0	0	3.000	95,680	2.870.405,97	0,93
BNP PARIBAS 19/24 MTN	FR0013405537	1,125	2.500	0	2.500	97,121	2.428.014,95	0,79
BPCE 18/23 MTN	FR0013367406	0,625	0	0	1.700	99,525	1.691.925,00	0,55
BPCE 19/24 MTN	FR0013396447	1,000	1.400	0	3.400	97,268	3.307.105,17	1,07
BPCE 19/24 MTN	FR0013464930	0,125	2.500	0	2.500	95,118	2.377.949,90	0,77
BPCE 22/26 MTN	FR0014007VF4	0,375	0	0	1.500	91,490	1.372.349,97	0,45
CIE F.FONCIER 15-25 MTN	FR0012447696	0,750	0	0	300	95,653	286.959,00	0,09
CNP ASSURANCES 14/UND.	FR0012317758	4,000	1.500	0	1.500	97,500	1.462.500,00	0,47
CREDIT AGRICOLE 14/24	FR0011659366	3,030	0	0	2.000	99,360	1.987.200,00	0,65
CREDIT AGRICOLE 14-24	FR0012304459	3,000	0	0	1.000	98,118	981.184,23	0,32
PERNOD-RICARD 19/23	FR0013456423	0,000	0	0	900	99,100	891.900,00	0,29
QUADIENT 20/25	FR0013478849	2,250	0	0	2.000	94,390	1.887.800,00	0,61
RCI BANQUE 17/24 FLR MTN	FR0013292687	3,844	0	0	3.000	99,971	2.999.130,00	0,97
RCI BANQUE 22/25 MTN	FR0014007KL5	0,500	0	0	1.200	93,037	1.116.446,41	0,36
SAINT-GOBAIN 22/25	XS2517103250	1,625	0	0	1.000	95,787	957.873,99	0,31
SEB S.A. 17/24	FR0013259116	1,500	0	0	3.000	97,782	2.933.460,00	0,95
SOC GENERALE 18/25 MTN	FR0013311503	1,125	0	0	2.000	95,745	1.914.894,56	0,62
SOC GENERALE 21/26 FLR	FR0014006IU2	0,125	0	0	3.200	90,946	2.910.278,34	0,95
STE GENERALE 17/24FLR MTN	XS1616341829	4,183	0	0	2.000	100,372	2.007.440,00	0,65
STELLANTIS N.V. 17/24 MTN	FR0013245586	2,000	1.000	0	1.000	98,714	987.140,00	0,32
URW 14/24 MTN	XS1038708522	2,500	2.100	0	2.100	99,115	2.081.415,00	0,68
URW 23/UND. FLR	FR001400IU83	7,250	900	0	900	90,169	811.522,98	0,26
Summe Emissionsland Frankreich							<u>50.355.776,38</u>	<u>16,35</u>
<b>Emissionsland Großbritannien</b>								
GLAXOSM.CAP. 19/23 MTN	XS2054626788	0,000	0	0	3.000	99,458	2.983.740,00	0,97
IN.DIS.SVCS. 14/24	XS1091654761	2,375	0	0	2.550	98,107	2.501.723,50	0,81
ITV 16/23	XS1525536840	2,000	0	0	750	99,191	743.932,50	0,24
LLOYDS BKG GRP 17/24 MTN	XS1633845158	4,331	0	0	1.500	100,403	1.506.045,00	0,49
MONDI FINANCE 16/24 MTN	XS1395010397	1,500	3.000	0	3.000	98,180	2.945.400,00	0,96
MOTABIL.OP.GRP 17/25 MTN	XS1578212299	0,875	2.000	0	2.000	95,259	1.905.184,02	0,62
TESCO C.TR.SERV.18/23 MTN	XS1896851224	1,375	0	0	2.600	99,377	2.583.802,00	0,84
VODAFONE GRP 16/24 MTN	XS1499604905	0,500	0	0	1.000	98,310	983.100,00	0,32
Summe Emissionsland Großbritannien							<u>16.152.927,02</u>	<u>5,25</u>
<b>Emissionsland Irland</b>								
FRESEN.FIN.IRE. 17/24 MTN	XS1554373248	1,500	3.000	500	2.500	98,682	2.467.050,00	0,80
GAS IRELAND 19/24	XS2088659789	0,125	0	0	1.500	94,930	1.423.950,00	0,46
Summe Emissionsland Irland							<u>3.891.000,00</u>	<u>1,26</u>
<b>Emissionsland Italien</b>								
ACEA S.P.A. 14/24 MTN 1	XS1087831688	2,625	0	0	1.300	98,519	1.280.744,39	0,42
CASSA D.PR. 19/26 FLR MTN	IT0005374043	5,517	0	1.000	6.915	103,050	7.125.907,50	2,31
INTESA SAN. 18/23 MTN	XS1873219304	2,125	0	1.700	1.800	98,610	1.774.980,00	0,58
INTESA SANP. 19/24 FLR	IT0005363772	5,029	0	0	4.200	100,642	4.226.964,00	1,37
PIEMONTE, REG. 06/36 FLR	XS0276060083	3,924	0	0	2.000	82,260	1.645.200,00	0,53
SNAM 19/24 MTN	XS2051660335	0,000	3.500	0	3.500	96,960	3.393.600,00	1,10
Summe Emissionsland Italien							<u>19.447.395,89</u>	<u>6,32</u>



Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Emissionsland Japan</b>								
ASAHI GROUP 21/24	XS2328980979	0,010	0	0	1.000	97,140	971.400,00	0,32
MIT.UFJ FIN.22/25 MTN FLR	XS2530031546	3,273	0	0	2.500	98,834	2.470.850,00	0,80
MIZUHO F.G. 19/24 MTN	XS2049630887	0,118	2.900	0	2.900	96,069	2.786.006,77	0,90
NTT FINANCE 21/25 MTN	XS2411311579	0,082	0	0	1.950	91,820	1.790.493,86	0,58
Summe Emissionsland Japan							8.018.750,63	2,60
<b>Emissionsland Kanada</b>								
BK MONTREAL 23/25 FLR MTN	XS2632933631	3,940	1.800	0	1.800	100,140	1.802.520,00	0,59
TORONTO-DOM. BK 23/25 FLR	XS2577740157	4,155	0	0	2.700	100,154	2.704.158,00	0,88
Summe Emissionsland Kanada							4.506.678,00	1,46
<b>Emissionsland Republik Korea</b>								
SHINHAN BK 19/24 MTN	XS2058731717	0,250	0	0	3.000	95,579	2.867.355,00	0,93
Summe Emissionsland Republik Korea							2.867.355,00	0,93
<b>Emissionsland Luxemburg</b>								
EUROF.SCIENTIF. 17/24	XS1651444140	2,125	0	0	3.738	97,670	3.650.904,60	1,19
Summe Emissionsland Luxemburg							3.650.904,60	1,19
<b>Emissionsland Niederlande</b>								
ABN AMRO BK 19/24 MTN	XS1935139995	0,875	0	0	2.000	98,608	1.972.160,00	0,64
ABN AMRO BK 23/25 FLR	XS2573331837	3,962	3.000	0	3.000	100,155	3.004.650,00	0,98
ABN AMRO BK 23/25 MTN	XS2613658470	3,750	2.000	0	2.000	99,553	1.991.063,54	0,65
ASML HOLDING 23/25	XS2631416950	3,500	1.500	0	1.500	99,835	1.497.524,99	0,49
CO. RABOBANK 19/24 MTN	XS1956955980	0,625	0	0	3.000	98,097	2.942.910,00	0,96
CONTI-G.FIN 20/23 MTN	XS2178585423	2,125	0	0	3.000	99,442	2.983.260,00	0,97
ING GROEP 21/25 FLR MTN	XS2413696761	0,125	0	0	1.500	94,496	1.417.440,03	0,46
KON. KPN 09/24 MTN	XS0454773713	5,625	2.100	0	2.100	101,868	2.139.232,24	0,69
M.B.INT.FIN. 19/23 MTN	DE000A2R9ZT1	0,250	1.000	2.000	2.000	99,079	1.981.580,00	0,64
RABOBK NEDERLD 18/23 MTN	XS1871439342	0,750	0	0	3.000	99,763	2.992.890,00	0,97
SIEMENS FIN 20/24 MTN	XS2182055181	0,250	2.000	0	2.000	97,120	1.942.400,00	0,63
TH.FISHER SC 21/23 FLR	XS2407911705	3,582	0	0	2.000	99,985	1.999.700,00	0,65
UPJOHN FINAN 20/24	XS2193969370	1,023	0	0	3.000	97,160	2.914.800,00	0,95
ZF EUROPE FI 19/23	XS2010040124	1,250	0	0	1.500	99,260	1.488.900,00	0,48
Summe Emissionsland Niederlande							31.268.510,80	10,15
<b>Emissionsland Norwegen</b>								
SPAREBK 1 SR 22/25 MTN	XS2534276808	2,875	0	0	1.000	97,396	973.962,02	0,32
Summe Emissionsland Norwegen							973.962,02	0,32
<b>Emissionsland Österreich</b>								
OBEROEST.LBK 16-23	XS1509009483	0,125	0	0	300	99,060	297.180,00	0,10
OESTERR. K.BK 17/24 MTN	XS1689595830	0,250	3.000	0	3.000	96,032	2.880.959,94	0,94
Summe Emissionsland Österreich							3.178.139,94	1,03

## ERSTE RESPONSIBLE RESERVE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Emissionsland Schweden</b>								
MOELNLYCKE HLDG 15/24	XS1317732771	1,750	0	0	1.000	98,592	985.920,00	0,32
STOCKHOLM GEM. 15/25 MTN	XS1195216707	0,750	0	0	3.600	95,307	3.431.051,96	1,11
SVENSKA HDBK. 23/26 MTN	XS2618499177	3,750	2.500	0	2.500	99,308	2.482.690,05	0,81
VOLVO TREAS. 21/24 MTN	XS2402009539	0,000	0	0	3.000	97,010	2.910.300,00	0,95
Summe Emissionsland Schweden							<u>9.809.962,01</u>	<u>3,19</u>
<b>Emissionsland USA</b>								
ABBVIE 16/24	XS1520899532	1,375	0	0	3.000	97,985	2.939.550,00	0,95
AT + T 14/24	XS1076018131	2,400	0	5.000	1.900	98,934	1.879.746,00	0,61
BAXTER INTL 19/24	XS1998215393	0,400	0	0	3.000	97,160	2.914.800,00	0,95
BECTON,DICK 21/23	XS2375836470	0,000	0	0	3.000	99,883	2.996.490,00	0,97
GENL MILLS 21/25	XS2405467528	0,125	3.000	0	3.000	91,841	2.755.230,09	0,89
KRAFT HEINZ 23/25 FLR	XS2622214745	3,812	1.500	0	1.500	100,194	1.502.910,00	0,49
MOLSON COORS BEV. 16/24	XS1440976535	1,250	0	0	3.000	97,236	2.917.068,09	0,95
NATL GRID NA 18/23 MTN	XS1864037541	0,750	0	0	3.000	99,940	2.998.200,00	0,97
NATL GRID NA 22/26 MTN	XS2434710799	0,410	0	0	3.000	91,703	2.751.090,09	0,89
THERMO FISH.SCI. 16/24	XS1405775708	0,750	0	0	2.300	96,550	2.220.650,07	0,72
Summe Emissionsland USA							<u>25.875.734,34</u>	<u>8,40</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>213.068.826,33</u>	<u>69,19</u>
<b>Anleihen auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland Slowenien</b>								
SLOWENIEN 14/24 REGS	XS0982709221	5,250	0	0	3.000	99,871	2.717.441,39	0,88
Summe Emissionsland Slowenien							<u>2.717.441,39</u>	<u>0,88</u>
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,10255							<u>2.717.441,39</u>	<u>0,88</u>
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							<u>215.786.267,72</u>	<u>70,07</u>
<b>Derivate</b>							<b>nicht realisiertes Ergebnis in EUR</b>	
<b>Financial Futures auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Deutschland</b>								
EURO-SCHATZ FUT Sep23	FGBS070923				-150		111.611,25	0,04
Summe Emissionsland Deutschland							<u>111.611,25</u>	<u>0,04</u>
Summe Financial Futures auf Euro lautend							<u>111.611,25</u>	<u>0,04</u>
Summe Derivate							<u>111.611,25</u>	<u>0,04</u>
<b>Gliederung des Fondsvermögens</b>								
Wertpapiere							303.292.409,51	98,49
Financial Futures							111.611,25	0,04
Bankguthaben							2.571.321,30	0,83
Zinsenansprüche							1.969.995,44	0,64
Sonstige Abgrenzungen							-1.874,29	-0,00
Fondsvermögen							<u>307.943.463,21</u>	<u>100,00</u>

**Hinweis an die Anleger:**

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A03951	Stück	332.441,390
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A03951	EUR	92,14
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XLT7	Stück	1.860,055
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XLT7	EUR	98,05
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XLW1	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XLW1	EUR	99,02
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XLY7	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XLY7	EUR	99,06
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A03969	Stück	1.603.370,430
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A03969	EUR	114,71
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XLU5	Stück	60.759,247
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XLU5	EUR	99,14
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XLX9	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XLX9	EUR	99,13
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XLZ4	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XLZ4	EUR	99,06
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0WLX3	Stück	14.762,016
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0WLX3	EUR	115,16
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XLV3	Stück	858.921,420
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XLV3	EUR	99,50
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XM19	Stück	134,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XM19	EUR	99,53
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQQ2	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQQ2	HUF	38.343,64

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
TERNA R.E.N.07/23 FLR MTN	XS0328430003	1,34112	6.724.509,79

## ERSTE RESPONSIBLE RESERVE

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 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.

### **Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind**

<b>Wertpapier-Bezeichnung</b>	<b>Kenn- nummer</b>	<b>Zinssatz</b>	<b>Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)</b>	<b>Verkäufe/ Abgänge</b>
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Australien</b>				
A.N.Z. BKG GRP 18/23 MTN	XS1774629346	0,625	0	2.500
<b>Emissionsland Dänemark</b>				
JYSKE BK 19/24 FLR MTN	XS2015231413	0,000	0	1.300
<b>Emissionsland Deutschland</b>				
DT.PFBR.BANK MTN.35304	DE000A2LQNQ6	0,750	0	1.500
INFINEON TECH. MTN 20/23	XS2194282948	0,750	0	1.800
<b>Emissionsland Frankreich</b>				
BFCM 19/23 MTN	FR0013386539	0,750	0	4.000
BPCE S.A. 18/23 FLR MTN	FR0013323672	2,602	0	6.100

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
CAPGEMINI 15-23	FR0012821940	2,500	0	1.500
CREDIT AGR. 18/23FLRMTN	XS1787278008	2,575	0	3.000
DANONE 17/UND. FLR MTN	FR0013292828	0,000	0	1.200
<b>Emissionsland Großbritannien</b>				
INFORMA 18/23 MTN	XS1853426549	1,500	0	2.000
<b>Emissionsland Italien</b>				
ACEA S.P.A. 18/23 MTN FLR	XS1767087940	2,104	0	2.000
INTESA SAN. 16-23 FLR	IT0005163602	0,100	0	600
TERNA R.E.N. 18/23 MTN	XS1858912915	1,000	0	1.800
<b>Emissionsland Niederlande</b>				
NATLBK 19/23 MTN	XS2004795725	0,375	0	2.600
ROCHE FIN.EUROPE 16/23MTN	XS1371715118	0,500	0	2.000
SIEMENS FIN 20/23 MTN	XS2118276539	0,000	0	5.200
<b>Emissionsland Österreich</b>				
RLBK OBEROEST. 17/23 MTN	XS1720806774	0,750	0	6.100
<b>Emissionsland Schweden</b>				
TELIA CO 17/78 FLR	XS1590787799	0,000	0	100
VOLVO TREAS. 14/78 FLR	XS1150695192	4,850	0	2.500
<b>Emissionsland Schweiz</b>				
UBS AG 20/23 MTN	XS2149270477	0,750	0	5.000
<b>Emissionsland Spanien</b>				
BCO SANTANDER 17/24FLRMTN	XS1611255719	4,490	0	5.000
<b>Emissionsland USA</b>				
AUTOLIV 18/23	XS1713462585	0,750	0	3.000
EASTMAN CHEM. CO. 16/23	XS1405783983	1,500	0	2.000
HARLEY DAV.F 20/23	XS2154335363	3,875	3.000	3.000
SYSCO 16/23	XS1434170426	1,250	0	2.000
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Frankreich</b>				
BPCE 18/24 MTN	FR0013312493	0,875	5.000	5.000
URW 18/UND. FLR	FR0013330529	2,125	0	1.000
<b>Emissionsland Großbritannien</b>				
VODAFONE GRP 18/79 FLR	XS1888179477	3,100	0	1.700

## ERSTE RESPONSIBLE RESERVE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
<b>Emissionsland Kanada</b>				
TORON.DOM.BK 23/25 FLRMTN	XS2652775789	4,096	2.300	2.300
<b>Emissionsland Niederlande</b>				
TH.FISHER SC 21/23	XS2407913586	0,000	3.000	4.400
<b>Emissionsland Österreich</b>				
RAIF.BK INTL 13/23 MTN	XS0981632804	6,000	0	3.200
RAIF.BK INTL 18/23 MTN166	XS1917591411	1,000	0	1.100
RAIF.BK INTL 20/25 MTN	XS2106056653	0,250	0	4.200
<b>Emissionsland USA</b>				
WARNER MEDIA 15/23 REGS	XS1266734349	1,950	0	3.200
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Deutschland</b>				
BAY.LDSBK.IS. 15/23	DE000BLB3B86	1,000	0	5.000
<b>Emissionsland Frankreich</b>				
CLARIANE 15-23	FR0012833788	3,306	1.000	2.500
UNIBAIL-Rodamco Zinsen (FR0013330529)	QOXDBM084144	1,461	1.000	1.000
<b>Emissionsland Luxemburg</b>				
TRATON FIN. 22/23 FLR MTN	DE000A3K0PP5	3,905	0	3.000
<b>Emissionsland Österreich</b>				
CA IMMO 16/23	AT0000A1JVU3	2,750	0	800
RAIF.BK INTL 20/23 MTN	AT000B014998	0,658	0	2.500

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“)).