

RT Optimum §14 Fonds

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023/24

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.05.2024.....	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. 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 Anteilhaber:innen,

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des RT Optimum §14 Fonds Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.12.2023 bis 31.05.2024 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.05.2024	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Britische Pfund lautend	3,0	6,04
auf Euro lautend	44,0	90,00
Wertpapiere	47,0	96,05
Bankguthaben	1,9	3,93
Zinsenansprüche	0,0	0,03
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	48,9	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.12.2023 bis 31.05.2024)

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 Britische Pfund lautend							
Emissionsland Irland							
RUSS.INV.-R.I.UK EQ.A	IE0007356698	26.156	19.451	65.810	38,240	2.957.196,71	6,04
				Summe Emissionsland Irland		2.957.196,71	6,04
				Summe Investmentzertifikate auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,85100		2.957.196,71	6,04
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Frankreich							
EDR-EO SUST.EQ. K EO	FR0010850198	8.410	5.631	20.794	305,790	6.358.597,26	13,00
				Summe Emissionsland Frankreich		6.358.597,26	13,00
Emissionsland Irland							
ISHSVII-MSCI UK S.C.LSACC	IE00B3VWL682	1.355	1.029	3.673	270,800	994.648,40	2,03
				Summe Emissionsland Irland		994.648,40	2,03
Emissionsland Luxemburg							
BGF-CONT.EUR.FLEX.A.I2EO	LU0888974473	57.726	45.380	176.910	35,740	6.322.763,40	12,92
CANDR.BDS-EM.MKTS VC.EO H	LU0616945100	0	0	545	1.359,870	741.129,15	1,51
CTL.US CONT.CORE EQ.IUEO	LU0757433437	6.778	5.197	19.579	94,020	1.840.811,71	3,76
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	0	0	6.596	121,070	798.577,72	1,63
GS US DLLR CRED ICEOHI	LU0803997666	0	0	38	6.003,740	228.142,12	0,47
JPM-AMERICA EQ.JPMAE IAEO	LU1734444273	2.694	2.094	8.101	224,860	1.821.590,86	3,72
PICTET-USA INDEX I EOA	LU0474966081	1.471	1.108	4.014	457,390	1.835.963,46	3,75
				Summe Emissionsland Luxemburg		13.588.978,42	27,78
Emissionsland Österreich							
ABWEBDEMGLIFIA R01EOT	AT0000A38GM7	0	0	8.029	0,000	0,00	0,00
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	0	8.029	135,010	1.083.995,29	2,22
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	4.545	149,380	678.932,10	1,39
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	0	0	7.453	156,020	1.162.817,06	2,38
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	0	0	6.128	137,290	841.313,12	1,72
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	0	0	10.038	186,310	1.870.179,78	3,82
T 1851 T	AT0000A0K2C4	16.003	0	39.742	107,380	4.267.495,96	8,72
T 1852 T	AT0000A0K2G5	33.173	0	67.652	103,570	7.006.717,64	14,32
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	15.480	0	55.615	111,090	6.178.270,35	12,63
				Summe Emissionsland Österreich		23.089.721,30	47,20
				Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend		44.031.945,38	90,00
				Summe Investmentzertifikate		46.989.142,09	96,05

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	46.989.142,09	96,05
Bankguthaben	1.921.909,63	3,93
Zinsenansprüche	12.468,23	0,03
Sonstige Abgrenzungen	-1.756,39	-0,00
Fondsvermögen	48.921.763,56	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858923	Stück	688.021,791
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858923	EUR	27,91
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000858949	Stück	269.347,675
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000858949	EUR	110,33

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 geclearte OTC-Derivatekontrakte:

Alle OTC Derivate werden über die Erste Group Bank AG gehandelt. Für die nicht physisch abgewickelten Devisenterminkontrakte und nicht physisch abgewickelten Devisenswapkontrakte werden die Sicherheiten (Collaterals) zwischen dem Investmentfonds und der Erste Group Bank AG ausgetauscht.

Im Falle des negativen Exposures der nicht physisch abgewickelten Derivatetermin- und Devisenswapkontrakte 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 nicht physisch abgewickelten Derivatetermin- und Devisenswapkontrakte 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	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate			
Investmentzertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Luxemburg			
CANDR.M.MKT.-EURO AAA V C	LU0354092115	0	1.492
Emissionsland Österreich			
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307	0	786

Wien, im Juni 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“)).