

RT Optimum §14 Fonds

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022/23

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.05.2023	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 RT Optimum §14 Fonds Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.12.2022 bis 31.05.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.05.2023	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Britische Pfund lautend	2,1	5,73
auf Euro lautend	33,7	90,97
Wertpapiere	35,9	96,70
Devisentermingeschäfte	-0,1	-0,24
Bankguthaben	1,3	3,52
Zinsenansprüche	0,0	0,02
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	37,1	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.05.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.12.2022 bis 31.05.2023)

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	22.406	14.484	56.435	32,580	2.126.962,00	5,73
						Summe Emissionsland Irland	2.126.962,00 5,73
						Summe Investmentzertifikate auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86445	2.126.962,00 5,73
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Irland							
ISHSVII-MSCI UK S.C.LSACC	IE00B3VWLG82	1.218	718	3.021	232,400	702.080,40	1,89
						Summe Emissionsland Irland	702.080,40 1,89
Emissionsland Luxemburg							
BGF-CONT.EUR.FLEX.A.I2EO	LU0888974473	53.758	38.787	156.351	30,480	4.765.578,48	12,85
CANDR.BDS-EM.MKTS VC.EO H	LU0616945100	235	0	545	1.172,080	638.783,60	1,72
CANDR.M.MKT.-EURO AAA V C	LU0354092115	0	0	238	1.058,480	252.016,68	0,68
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	0	0	3.331	110,890	369.374,59	1,00
GS US DLLR CRED ICEOHI	LU0803997666	0	0	38	5.858,460	222.621,48	0,60
JPM-AMERICA EQ.JPMAE IAEO	LU1734444273	3.423	1.908	8.073	175,190	1.414.308,87	3,81
PICTET-USA INDEX I EOA	LU0474966081	1.648	954	3.755	368,270	1.382.853,85	3,73
T.ROWE P.-CON.EURO.EQ.I	LU0285832068	75.167	50.725	203.975	22,650	4.620.033,75	12,45
THRE.L-US CO.CORE EQ.IUEO	LU0757433437	8.147	4.722	19.138	73,722	1.410.882,07	3,80
						Summe Emissionsland Luxemburg	15.076.453,37 40,64
Emissionsland Österreich							
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	2.025	0	8.029	131,160	1.053.083,64	2,84
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	1.925	0	4.545	139,250	632.891,25	1,71
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	0	0	4.923	143,370	705.810,51	1,90
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	0	0	6.128	134,290	822.929,12	2,22
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	0	0	15.038	175,200	2.634.657,60	7,10
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	0	0	6.589	112,630	742.119,07	2,00
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307	1.000	1.000	786	1.267,230	996.042,78	2,69
T 1851 T	AT0000A0K2C4	3.563	0	23.739	105,560	2.505.888,84	6,76
T 1852 T	AT0000A0K2G5	6.312	0	34.479	101,840	3.511.341,36	9,47
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	7.988	0	40.135	108,670	4.361.470,45	11,76
						Summe Emissionsland Österreich	17.966.234,62 48,43
						Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	33.744.768,39 90,97
						Summe Investmentzertifikate	35.871.730,39 96,70

RT Optimum §14 Fonds

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Devisentermingeschäfte				
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
FXF SPEST EUR/USD 26.07.2023	FXF_TAX_3464568	3.717.273	-93.196,33	-0,25
FXF SPEST EUR/USD 26.07.2023	FXF_TAX_3464668	-180.167	5.703,92	0,02
FXF SPEST EUR/USD 26.07.2023	FXF_TAX_3464700	-90.396	2.541,38	0,01
FXF SPEST EUR/USD 26.07.2023	FXF_TAX_3464844	-920.228	9.222,08	0,02
FXF SPEST EUR/USD 26.07.2023	FXF_TAX_3464889	-604.266	-93,06	-0,00
FXF SPEST EUR/USD 27.07.2023	FXF_TAX_3464631	705.464	-14.783,01	-0,04
		Summe Emissionsland Österreich	-90.605,02	-0,24
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	-90.605,02	-0,24
		Summe Devisentermingeschäfte	-90.605,02	-0,24

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		35.871.730,39	96,70
Devisentermingeschäfte		-90.605,02	-0,24
Bankguthaben		1.305.400,88	3,52
Zinsenansprüche		8.181,58	0,02
Sonstige Abgrenzungen		-436,23	-0,00
Fondsvermögen		37.094.271,60	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858923	Stück	536.514,292
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858923	EUR	26,32
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000858949	Stück	225.786,967
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000858949	EUR	101,74

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.

Wien, im Juni 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“)).