

WSTV ESPA traditionell

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.08.2022	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. - ab 21.09.2022) Radovan JELASITY Mag. Ertan PISKIN (ab 10.10.2022) Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER (bis 21.09.2022) 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 (ab 01.09.2022) Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ Mag. Wolfgang TRISKO (bis 14.05.2022)
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 WSTV ESPA traditionell Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.03.2022 bis 31.08.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.08.2022	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	19,5	84,63
auf US-Dollar lautend	2,9	12,68
Wertpapiere	22,5	97,31
Devisentermingeschäfte	-0,1	-0,54
Bankguthaben	0,7	3,17
Dividendenansprüche	0,0	0,06
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	23,1	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.03.2022 bis 31.08.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	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 Irland							
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBCS90	0	5.400	2.400	53,766	129.038,40	0,56
ISHSII-MSCI EU.QUA.DV.EOD	IE00BYHSM20	31.000	0	31.000	5,131	159.061,00	0,69
ISHSIV-E.MSCI USA QUAL.F.	IE00BD1F4L37	16.900	0	16.900	9,450	159.705,00	0,69
ISHSV-S+P500H.CA.SECT.DLA	IE00B43HR379	11.000	0	35.000	9,600	336.000,00	1,46
NOMURA FDS-JAP.STR.V.I EO	IE00B3YQ1K12	0	0	1.650	208,010	343.216,34	1,49
Summe Emissionsland Irland						<u>1.127.020,74</u>	<u>4,88</u>
Emissionsland Luxemburg							
BGF-CONT.EUR.FLEX.A.I2EO	LU0888974473	0	5.500	10.000	25,760	257.600,00	1,12
CANDR.M.MKT.-EURO AAA V C	LU0354092115	0	0	200	1.044,390	208.913,51	0,91
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	0	0	2.750	105,850	291.087,50	1,26
G.S.-JAP.EQ.P.PT.IACC.EO	LU1837047379	0	4.900	23.000	12,960	298.080,00	1,29
JPM-AMERICA EQ.JPMAE I AEO	LU1734444273	1.700	2.000	5.000	177,330	886.650,00	3,84
SISF EURO CORP.BD C ACC	LU0113258742	0	4.000	5.000	23,184	115.922,00	0,50
SSGA LUX-UK INDEX EQ.IEOA	LU1159238978	0	0	19.900	13,311	264.884,92	1,15
T.RO.PR.-RE.AS.EX.J.I EO	LU1382643945	0	0	4.600	17,100	78.660,00	0,34
T.ROWE P.-CON.EURO.EQ.I	LU0285832068	0	9.300	13.300	20,190	268.527,00	1,16
THRE.L-US CO.CORE EQ.IUEO	LU0757433437	1.600	2.400	10.000	73,321	733.208,00	3,18
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>3.403.532,93</u>	<u>14,75</u>
Emissionsland Österreich							
ALPHA DIVERSI.2 I01 TE0H	AT0000A0SEB2	0	1.100	9.000	129,280	1.163.520,00	5,04
Alpha Diversified 3 T01 I01 EUR	AT0000A0SED8	0	0	7.500	124,490	933.675,00	4,05
CORE EQUIT. EUR R01 T	AT0000A2GK86	800	0	5.000	135,100	675.500,00	2,93
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	1.400	600	2.800	133,900	374.920,00	1,62
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZR9	0	2.253	1.047	122,000	127.734,00	0,55
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	2.700	2.900	165,940	481.226,00	2,09
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	1.500	0	4.564	140,450	641.013,80	2,78
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224	1.000	0	4.200	153,300	643.860,00	2,79
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	2.000	0	3.375	175,170	591.198,75	2,56
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	0	1.000	2.400	122,840	294.816,00	1,28
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307	0	200	1.150	1.255,780	1.444.147,00	6,26
ERSTE STOCK GL R01TEO	AT0000812870	0	2.500	5.000	157,930	789.650,00	3,42
T 1851 T	AT0000A0K2C4	3.000	0	16.300	110,450	1.800.335,00	7,80
T 1852 T	AT0000A0K2G5	2.200	0	16.900	106,600	1.801.540,00	7,81
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	3.000	3.100	28.500	113,510	3.235.035,00	14,02
Summe Emissionsland Österreich						<u>14.998.170,55</u>	<u>65,00</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						<u>19.528.724,22</u>	<u>84,63</u>

WSTV ESPA traditionell

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 auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Irland							
ISIV-MSCIUSASRI U.ETF DLA	IE00BYVJRR92	18.000	10.000	81.300	11,720	953.933,02	4,13
VERITAS FDS-ASIAN CACCDL	IE00BD065N65	0	0	200	598,186	119.775,00	0,52
Summe Emissionsland Irland						<u>1.073.708,02</u>	<u>4,65</u>
Emissionsland Luxemburg							
ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCDL	LU0880945901	2.300	0	5.800	75,220	436.778,30	1,89
F.TEM.INV-LAT.AM. I ACC.	LU0229944334	8.900	0	8.900	19,750	175.977,37	0,76
JPM-US VALUE FD I ACC USD	LU0248060658	500	620	550	293,210	161.451,17	0,70
SISF EMERG.ASIA IZ CAP.DL	LU1188199936	0	0	1.800	61,699	111.186,60	0,48
UBSLFS-MSCI USA SR ADDL	LU0629460089	930	0	6.060	159,276	966.323,22	4,19
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>1.851.716,66</u>	<u>8,02</u>
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,99885						<u>2.925.424,68</u>	<u>12,68</u>
Summe Investmentzertifikate						<u>22.454.148,90</u>	<u>97,31</u>

Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/JPY 20.10.2022	FXF_TAX_3461422			592.367		-9.686,78	-0,04
FXF SPEST EUR/USD 20.10.2022	FXF_TAX_3461400			3.296.416		-102.112,11	-0,44
FXF SPEST EUR/USD 20.10.2022	FXF_TAX_3461806			-100.021		-209,21	-0,00
FXF SPEST EUR/USD 21.10.2022	FXF_TAX_3461459			375.013		-11.224,14	-0,05
FXF SPEST EUR/USD 21.10.2022	FXF_TAX_3461805			-120.016		-250,27	-0,00
Summe Emissionsland Österreich						<u>-123.482,51</u>	<u>-0,54</u>
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend						<u>-123.482,51</u>	<u>-0,54</u>
Summe Devisentermingeschäfte						<u>-123.482,51</u>	<u>-0,54</u>

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		22.454.148,90	97,31
Devisentermingeschäfte		-123.482,51	-0,54
Bankguthaben		732.433,91	3,17
Dividendenansprüche		12.984,03	0,06
Sonstige Abgrenzungen		-211,61	-0,00
Fondsvermögen		<u>23.075.872,72</u>	<u>100,00</u>

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000647599	Stück	80.000,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000647599	EUR	175,55
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000619960	Stück	48.706,367
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000619960	CZK	4.544,42
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000613518	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000613518	EUR	185,44

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.

Folgende Wertpapiere bzw. Bankguthaben wurden als Sicherheiten für Derivatgeschäfte bestellt:

Wertpapier-Bezeichnung	Stück/Nominale/absolut (Nominale in 1.000, ger.)
Bankguthaben	250.000

WSTV ESPA traditionell

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate			
Investmentzertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Irland			
SPDR S+P US CO.S.S.S.ETF	IE00BWBXM385	0	11.000
SPDR S+P US FIN.SE.S.ETF	IE00BWBXM500	0	4.400
Emissionsland Luxemburg			
JPM.-US TECHNOLOGY CACCEO	LU1303370156	0	470
JPM-EU.ST.VA.JPMESV IAEO	LU0248049412	0	1.400
Emissionsland Österreich			
ERSTE MORTGAGE R01TEO	AT0000700786	0	2.814
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend			
Emissionsland Irland			
ISHSIV-E.MSCI USA QUAL.F.	IE00BD1F4L37	0	38.800
Emissionsland Luxemburg			
BNPP US GROWTH I CAP	LU0823435044	300	300

Wien, im September 2022

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“)).