

ERSTE PORTFOLIO BOND EUROPE

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.12.2023.....	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 (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	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
Prokuristen	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER (bis 31.08.2023) Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER Mag. Magdalena UJWARY, MA (ab 16.08.2023)
Staatskommissäre	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 PORTFOLIO BOND EUROPE Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.07.2023 bis 31.12.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.12.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Britische Pfund lautend	17,9	18,20
auf Dänische Kronen lautend	0,7	0,75
auf Euro lautend	54,2	55,22
auf Norwegische Kronen lautend	5,2	5,34
auf Schwedische Kronen lautend	0,8	0,81
auf Tschechische Kronen lautend	2,0	2,03
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	9,9	10,07
Wertpapiere	90,8	92,42
Devisentermingeschäfte	-0,2	-0,21
Financial Futures	-0,2	-0,18
Bankguthaben	7,2	7,30
Zinsenansprüche	0,7	0,68
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	98,2	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.07.2023 bis 31.12.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BUNDANL.V.14/46	DE0001102341	2,500	0	0	200	103,826	207.652,80	0,21
BUNDANL.V.17/48	DE0001102432	1,250	0	0	2.500	81,226	2.030.645,00	2,07
BUNDESUBL.V.23/28 S.188	DE000BU25018	2,400	1.000	0	1.000	102,057	1.020.574,04	1,04
Summe Emissionsland Deutschland							<u>3.258.871,84</u>	<u>3,32</u>
Emissionsland Österreich								
ERSTE GR.BK. 23/27 MTN	AT0000A33MP9	3,125	0	0	600	101,219	607.314,01	0,62
HYPO NOE LB 19/26 MTN	XS2057917366	0,010	0	0	1.000	92,554	925.544,05	0,94
HYPO NOE LB 23/28 MTN	AT0000A33N23	3,250	0	0	600	101,580	609.482,39	0,62
HYPO TIROL 22/27 MTN	AT0000A2XLD9	1,375	0	0	800	95,516	764.127,99	0,78
HYPO VORARL. 22/27 MTN	AT0000A30ZH4	3,250	0	0	700	101,039	707.273,01	0,72
HYPO VORARLG BK 18/26 MTN	XS1856342560	0,625	0	0	800	94,329	754.632,02	0,77
OESTERR. 16/47	AT0000A1K9F1	1,500	0	1.400	400	76,638	306.552,00	0,31
OESTERREICH 20/51 MTN	AT0000A2EJ08	0,750	1.100	0	1.100	60,761	668.371,02	0,68
OMV AG 12/27 MTN	XS0834371469	3,500	0	0	200	102,251	204.501,60	0,21
UNICR.BK AU. 22/27 MTN	AT000B049929	2,375	0	0	800	98,485	787.878,42	0,80
VERBUND AG 14/24	XS1140300663	1,500	0	0	200	98,020	196.040,00	0,20
VIENNA I.GRP 21/36 MTN	AT0000A2QL75	1,000	0	0	700	80,124	560.868,01	0,57
Summe Emissionsland Österreich							<u>7.092.584,52</u>	<u>7,22</u>
Emissionsland Spanien								
TELEFONICA EM. 14/29 MTN	XS1120892507	2,932	0	0	200	98,915	197.829,19	0,20
Summe Emissionsland Spanien							<u>197.829,19</u>	<u>0,20</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>10.549.285,55</u>	<u>10,74</u>
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							<u>10.549.285,55</u>	<u>10,74</u>
Investmentzertifikate								
Investmentzertifikate auf Euro lautend								
Emissionsland Kroatien								
ERSTE E-CONSERVATIVE	HRERSIUCONS9		0	0	3.470	113,466	393.699,68	0,40
Summe Emissionsland Kroatien							<u>393.699,68</u>	<u>0,40</u>

ERSTE PORTFOLIO BOND EUROPE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emissionsland Österreich								
ERSTE ALPHA 1 T	AT0000A03DF2		545	1.064	19.249	56,120	1.080.253,88	1,10
ERSTE ALPHA 2 T	AT0000A05F50		1.261	1.944	40.678	79,440	3.231.460,32	3,29
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684		0	0	3.000	153,220	459.660,00	0,47
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224		0	0	28.500	161,400	4.599.900,00	4,68
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307		0	0	100	1.295,280	129.528,00	0,13
Summe Emissionsland Österreich							<u>9.500.802,20</u>	<u>9,67</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend							<u>9.894.501,88</u>	<u>10,07</u>
Summe Investmentzertifikate							<u>9.894.501,88</u>	<u>10,07</u>
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Britische Pfund lautend								
Emissionsland Großbritannien								
GROSSBRIT. 20/41	GB00BJQWYH73	1,250	0	0	4.500	64,950	3.372.857,73	3,43
LCR FINANCE 99/28 REGS	XS0094804126	4,500	0	0	250	103,186	297.692,37	0,30
TREASURY STK 2024	GB00BHFH458	2,750	0	0	2.000	98,720	2.278.460,56	2,32
TREASURY STK 2025	GB00BTHH2R79	2,000	0	0	800	96,992	895.431,28	0,91
TREASURY STK 2027	GB00BDRHNP05	1,250	4.000	0	4.000	92,848	4.285.869,25	4,36
TREASURY STK 2028	GB00BFX0ZL78	1,625	0	0	1.000	92,606	1.068.674,66	1,09
TREASURY STK 2047	GB00BDCHBW80	1,500	0	0	8.100	60,690	5.672.944,34	5,78
Summe Emissionsland Großbritannien							<u>17.871.930,19</u>	<u>18,20</u>
Summe Anleihen auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86655							<u>17.871.930,19</u>	<u>18,20</u>
Anleihen auf Dänische Kronen lautend								
Emissionsland Dänemark								
DANSKE STAT 2025	DK0009923138	1,750	0	0	3.000	98,704	397.223,83	0,40
DANSKE STAT 2039	DK0009922320	4,500	0	0	2.000	127,619	342.392,12	0,35
Summe Emissionsland Dänemark							<u>739.615,95</u>	<u>0,75</u>
Summe Anleihen auf Dänische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 7,45455							<u>739.615,95</u>	<u>0,75</u>
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Belgien								
BELGIQUE 15/31 75	BE0000335449	1,000	0	0	5.000	90,329	4.516.450,10	4,60
Summe Emissionsland Belgien							<u>4.516.450,10</u>	<u>4,60</u>
Emissionsland Deutschland								
DT.BANK MTN 22/27	DE000A30VQ09	4,000	0	0	400	102,714	410.854,40	0,42
HEIDELB.MAT. MTN 16/24	XS1425274484	2,250	0	0	250	99,170	247.925,00	0,25
LBBW SMT IHS 15/25	XS1246732249	3,625	0	0	200	98,783	197.565,60	0,20
MERCEDES BENZ MTN 19/31	DE000A2YPFU9	1,125	0	0	350	87,407	305.925,21	0,31
VOLKSWAGEN LEASING 21/29	XS2282095970	0,500	0	0	300	86,647	259.942,04	0,26
Summe Emissionsland Deutschland							<u>1.422.212,25</u>	<u>1,45</u>

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emittent Europäische Finanzstabilisierungsfazilität								
EFSF 13/29 MTN	EU000A1G0BL1	2,750	0	0	2.000	101,540	2.030.800,02	2,07
Summe Emittent Europäische Finanzstabilisierungsfazilität							<u>2.030.800,02</u>	<u>2,07</u>
Emissionsland Frankreich								
BNP PARIBAS 20/32 FLR MTN	FR0013476611	1,125	0	0	300	91,154	273.462,59	0,28
BPCE 20/27 FLR MTN	FR0013534674	0,500	0	0	300	92,211	276.632,40	0,28
BQUE F.C.MTL 14/24 MTN	XS1069549761	3,000	0	0	200	99,332	198.664,00	0,20
CIE F.FONCIER 16/26 MTN	FR0013106630	1,000	0	0	500	96,212	481.062,01	0,49
CREDIT AGRICOLE 15/27	XS1204154410	2,625	0	0	500	96,868	484.338,53	0,49
CSSE DEP.CON 21/26 MTN	FR0014003RL9	0,010	0	0	800	93,740	749.919,98	0,76
FRANKREICH 20/40 O.A.T.	FR0013515806	0,500	0	0	1.400	69,251	969.513,99	0,99
FRANKREICH 22/32 O.A.T.	FR0014007L00	0,000	0	0	2.400	81,844	1.964.256,05	2,00
FRANKREICH 23/54 O.A.T.	FR001400FTH3	3,000	0	0	1.900	98,211	1.866.012,74	1,90
ORANGE 20/32 MTN	FR0013506300	1,625	0	0	300	90,605	271.816,20	0,28
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011883966	2,500	0	0	600	101,329	607.975,21	0,62
REP. FSE 16-36 O.A.T.	FR0013154044	1,250	0	0	1.300	84,606	1.099.880,61	1,12
REP. FSE 16-66 O.A.T.	FR0013154028	1,750	0	0	1.000	71,317	713.170,01	0,73
SNCF 17/29 MTN	XS1558472129	1,500	0	0	900	94,045	846.406,49	0,86
SOC GENERALE 15/25 MTN	XS1195574881	2,625	0	0	500	98,485	492.424,01	0,50
Summe Emissionsland Frankreich							<u>11.295.534,82</u>	<u>11,50</u>
Emissionsland Großbritannien								
BP CAP.MKTS 20/32 MTN	XS2135801160	2,822	0	0	300	97,196	291.589,21	0,30
Summe Emissionsland Großbritannien							<u>291.589,21</u>	<u>0,30</u>
Emissionsland Italien								
B.T.P. 16-26	IT0005170839	1,600	0	1.000	2.000	97,237	1.944.740,00	1,98
B.T.P. 16-47	IT0005162828	2,700	0	0	2.000	78,836	1.576.719,98	1,61
B.T.P. 18-28	IT0005340929	2,800	0	0	800	99,243	793.943,97	0,81
ITALIEN 20/31	IT0005422891	0,900	0	0	3.000	84,565	2.536.937,94	2,58
ITALIEN 20/51	IT0005425233	1,700	0	0	2.500	61,448	1.536.200,05	1,56
ITALIEN 21/31	IT0005436693	0,600	0	500	500	81,706	408.530,01	0,42
ITALIEN 21/37	IT0005433195	0,950	0	0	800	70,051	560.409,61	0,57
Summe Emissionsland Italien							<u>9.357.481,56</u>	<u>9,53</u>
Emissionsland Niederlande								
ALLIANZ FIN. II 13/28 MTN	DE000A1HG1K6	3,000	0	0	300	101,540	304.618,79	0,31
BAYER CAP.CORP. 18/26	XS1840618059	1,500	0	0	500	95,190	475.947,61	0,48
BMW FIN. 21/33 MTN	XS2280845145	0,200	0	0	350	78,650	275.274,87	0,28
BNG BK 19/29 MTN	XS1940071597	0,750	0	0	1.000	91,661	916.612,01	0,93
DT.TELEK.INTL F.13/28 MTN	XS0875797515	3,250	0	0	200	102,780	205.560,00	0,21
ING GROEP 21/28 FLR MTN	XS2390506546	0,375	0	0	400	88,724	354.896,00	0,36
VONOVIA FINANCE 16/26 MTN	DE000A182VT2	1,500	0	0	500	95,306	476.530,00	0,49
Summe Emissionsland Niederlande							<u>3.009.439,28</u>	<u>3,06</u>

ERSTE PORTFOLIO BOND EUROPE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emissionsland Österreich								
BAWAG P.S.K. 22/27 MTN	XS2556232143	3,000	0	0	1.000	100,541	1.005.408,02	1,02
ERDOEL-LAGERGES. 13-28	XS0905658349	2,750	0	0	200	99,590	199.179,99	0,20
Summe Emissionsland Österreich							<u>1.204.588,01</u>	<u>1,23</u>
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 15-25	PTOTEKOE0011	2,875	0	0	500	100,568	502.837,98	0,51
PORTUGAL 15-45	PTOTEBOE0020	4,100	0	0	600	113,312	679.871,98	0,69
Summe Emissionsland Portugal							<u>1.182.709,96</u>	<u>1,20</u>
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 16-46	ES00000128C6	2,900	0	0	3.700	90,328	3.342.150,80	3,40
SPANIEN 18-28	ES0000012B88	1,400	0	0	2.000	95,131	1.902.619,94	1,94
SPANIEN 20/30	ES0000012F76	0,500	0	0	2.000	87,515	1.750.299,98	1,78
SPANIEN 23/33	ES0000012L52	3,150	1.000	0	1.000	101,655	1.016.553,50	1,04
Summe Emissionsland Spanien							<u>8.011.624,22</u>	<u>8,16</u>
Emissionsland USA								
AT + T 14/29	XS1144088165	2,600	0	0	500	96,389	481.946,99	0,49
BOOKING HLDGS 15/27	XS1196503137	1,800	0	0	500	96,222	481.110,00	0,49
WELLS FARGO 14/24 MTN	XS1074382893	2,125	0	0	400	99,119	396.476,00	0,40
Summe Emissionsland USA							<u>1.359.532,99</u>	<u>1,38</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>43.681.962,42</u>	<u>44,47</u>
Anleihen auf Norwegische Kronen lautend								
Emissionsland Norwegen								
NORWAY 16-26	NO0010757925	1,500	0	0	25.000	95,740	2.133.529,44	2,17
NORWAY 19-29	NO0010844079	1,750	0	0	38.000	91,840	3.110.861,52	3,17
Summe Emissionsland Norwegen							<u>5.244.390,96</u>	<u>5,34</u>
Summe Anleihen auf Norwegische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 11,21850							<u>5.244.390,96</u>	<u>5,34</u>
Anleihen auf Schwedische Kronen lautend								
Emissionsland Schweden								
SWEDEN 12-32 1056	SE0004517290	2,250	0	0	5.000	101,942	457.856,91	0,47
SWEDEN 18-29 1061	SE0011281922	0,750	0	0	4.000	93,147	334.684,94	0,34
Summe Emissionsland Schweden							<u>792.541,85</u>	<u>0,81</u>
Summe Anleihen auf Schwedische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 11,13250							<u>792.541,85</u>	<u>0,81</u>

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
------------------------	-----------------	---------------	---	----------------------	---------	------	--------------------	--------------------------------------

Anleihen auf Tschechische Kronen lautend

Emissionsland Tschechische Republik

CZECH REP. 2025 89	CZ0001004253	2,400	0	0	51.000	96,700	1.997.569,72	2,03
Summe Emissionsland Tschechische Republik							1.997.569,72	2,03
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 24,68850							1.997.569,72	2,03
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							70.328.011,09	71,60

Nicht notierte Wertpapiere

Anleihen auf Euro lautend

Emissionsland USA

LEHMAN BROTH.06/16FLR MTN	XS0268648952	0,000	0	0	500	0,000	0,00	0,00
LEHMAN BROTH.07/19FLR MTN	XS0287044969	0,000	0	0	750	0,000	0,00	0,00
Summe Emissionsland USA							0,00	0,00
Summe Anleihen auf Euro lautend							0,00	0,00
Summe Nicht notierte Wertpapiere							0,00	0,00

Derivate

**nicht realisiertes
Ergebnis in EUR**

Financial Futures auf Britische Pfund lautend

Emissionsland Großbritannien

LONG GILT FUTURE Mar24	LGR260324					-21	-132.709,51	-0,14
Summe Emissionsland Großbritannien							-132.709,51	-0,14
Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86655							-132.709,51	-0,14

Financial Futures auf Euro lautend

Emissionsland Deutschland

EURO-BOBL FUTURE Mar24	EBOB070324					110	243.100,00	0,25
Euro-BTP Future Mar24	FBTP070324					-7	-29.750,00	-0,03
EURO-BUND FUTURE Mar24	FGBL070324					53	99.350,00	0,10
EURO-BUXL 30Y BND Mar24	FGBX070324					-37	-414.528,00	-0,42
EURO-SCHATZ FUT Mar24	FGBS070324					70	58.450,00	0,06
Summe Emissionsland Deutschland							-43.378,00	-0,04
Summe Financial Futures auf Euro lautend							-43.378,00	-0,04
Summe Derivate							-176.087,51	-0,18

ERSTE PORTFOLIO BOND EUROPE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Devisentermingeschäfte				
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
FXF SPEST EUR/CHF 08.02.2024	FXF_TAX_3467008	-1.858.294	28.194,44	0,03
FXF SPEST EUR/CHF 08.02.2024	FXF_TAX_3467131	741.321	-13.266,21	-0,01
FXF SPEST EUR/CZK 08.02.2024	FXF_TAX_3467004	4.450.547	17.291,38	0,02
FXF SPEST EUR/GBP 08.02.2024	FXF_TAX_3467020	-1.159.404	-6.958,41	-0,01
FXF SPEST EUR/NOK 08.02.2024	FXF_TAX_3467002	3.999.990	-231.317,10	-0,24
FXF SPEST EUR/SEK 08.02.2024	FXF_TAX_3467010	274.827	-3.620,90	-0,00
		Summe Emissionsland Österreich	-209.676,80	-0,21
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	-209.676,80	-0,21
		Summe Devisentermingeschäfte	-209.676,80	-0,21

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		90.771.798,52	92,42
Devisentermingeschäfte		-209.676,80	-0,21
Financial Futures		-176.087,51	-0,18
Bankguthaben		7.166.819,61	7,30
Zinsenansprüche		667.838,27	0,68
Sonstige Abgrenzungen		-3.167,55	-0,00
Fondsvermögen		98.217.524,54	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858527	Stück	1.318.248,383
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858527	EUR	51,69
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812805	Stück	185.980,057
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812805	EUR	95,89
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673215	Stück	35.071,692
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673215	EUR	110,59
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000639455	Stück	75.591,579
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000639455	CZK	2.729,56

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 Dänische Kronen lautend				
Emissionsland Dänemark				
DANSKE STAT 2023	DK0009923054	1,500	0	2.000
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Niederlande				
ABN AMRO BANK 13/23 MTN	XS0937858271	2,500	0	200

ERSTE PORTFOLIO BOND EUROPE

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	61.000
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Britische Pfund lautend				
Emissionsland Großbritannien				
GROSSBRIT. 21/31	GB00BNNGP551	0,125	0	900
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Italien				
ITALIEN 19/50	IT0005398406	2,450	0	1.000
Emissionsland Portugal				
PORTUGAL 19/29	PTOTEX0E0024	1,950	0	1.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Britische Pfund lautend				
Emissionsland Großbritannien				
TREASURY STK 2023	GB00BFOHZ991	0,750	0	3.400

Wien, im Jänner 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“)).