

ERSTE SELECT BOND

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.11.2023	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-WERZNER Mag. Reinhard WALTTL (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 Anteilhaber:innen,

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE SELECT BOND Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2023 bis 30.11.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2023	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	177,4	97,18
auf US-Dollar lautend	1,5	0,83
Wertpapiere	178,9	98,01
Devisentermingeschäfte	0,3	0,17
Bankguthaben	3,3	1,81
Zinsenansprüche	0,0	0,01
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	182,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2023 bis 30.11.2023)

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 Euro lautend							
Emissionsland Frankreich							
LAZARD CONVERT.GBL PCH-EO	FR0013185535	0	240	2.800	1.800,110	5.040.308,00	2,76
Summe Emissionsland Frankreich						5.040.308,00	2,76
Emissionsland Kroatien							
ERSTE E-CONSERVATIVE	HRERSIUCONS9	0	0	18.950	112,705	2.135.729,80	1,17
Summe Emissionsland Kroatien						2.135.729,80	1,17
Emissionsland Luxemburg							
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	8.750	1.600	30.815	115,180	3.549.271,70	1,94
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	0	0	7.000	167,390	1.171.730,00	0,64
GS US DLLR CRED ICEOHI	LU0803997666	0	50	430	5.907,210	2.540.100,30	1,39
GS-AS.HY BD IHEOD	LU2358798911	3.700	0	54.935	65,600	3.603.736,00	1,97
SISF EURO CORP.BD C ACC	LU0113258742	0	0	130.000	24,032	3.124.160,00	1,71
Summe Emissionsland Luxemburg						13.988.998,00	7,67
Emissionsland Österreich							
ABWEBDEMGLIFIA R01EOT	AT0000A38GM7	45.150	0	45.150	0,000	0,00	0,00
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	0	45.150	134,260	6.061.839,00	3,32
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	40.500	142,650	5.777.325,00	3,17
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	10.640	1.500	36.178	149,120	5.394.863,36	2,96
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224	0	0	158.822	156,780	24.900.113,16	13,64
ERSTE BD IN.-LI.R01TEO	AT0000619895	0	2.000	69.601	127,300	8.860.207,30	4,86
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	0	2.700	182.238	135,080	24.616.709,04	13,49
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	0	1.000	35.070	180,550	6.331.888,50	3,47
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	0	20.000	80.450	108,290	8.711.930,50	4,77
ERSTE MORTGAGE R01TEO	AT0000700786	0	14.100	38.250	118,500	4.532.625,00	2,48
ERSTE RESPON.BD EO CORP.T	AT0000A0PHJ4	0	16.000	247.565	116,690	28.888.359,85	15,83
ERSTE T.R.FIX.IN.EOI01TEO	AT0000A1E176	0	0	73.500	98,070	7.208.145,00	3,95
T 1750 T	AT0000A04FZ3	0	14.000	34.000	105,530	3.588.020,00	1,97
T 1751	AT0000A0DEH1	0	5.000	30.500	111,720	3.407.460,00	1,87
T 1851 T	AT0000A0K2C4	0	0	43.000	106,470	4.578.210,00	2,51
T 1852 T	AT0000A0K2G5	0	0	44.000	102,720	4.519.680,00	2,48
T 1900 EURR01TEO	AT0000A1BTH1	0	0	51.541	87,210	4.494.890,61	2,46
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	0	3.000	39.250	110,090	4.321.032,50	2,37
Summe Emissionsland Österreich						156.193.298,82	85,59
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						177.358.334,62	97,18

ERSTE SELECT BOND

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 Luxemburg

ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCDL	LU0880945901	0	0	19.000	87,250	1.510.478,36	0,83
Summe Emissionsland Luxemburg						1.510.478,36	0,83
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,09750						1.510.478,36	0,83
Summe Investmentzertifikate						178.868.812,98	98,01

Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/USD 24.01.2024	FXF_TAX_3466382			8.337.884		312.299,87	0,17
Summe Emissionsland Österreich						312.299,87	0,17
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend						312.299,87	0,17
Summe Devisentermingeschäfte						312.299,87	0,17

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere						178.868.812,98	98,01
Devisentermingeschäfte						312.299,87	0,17
Bankguthaben						3.305.079,15	1,81
Zinsenansprüche						10.318,59	0,01
Sonstige Abgrenzungen						-451,87	-0,00
Fondsvermögen						182.496.058,72	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000660592	Stück	989.216,327
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000660592	EUR	96,05
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000660600	Stück	587.531,268
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000660600	EUR	148,88

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 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.

Wien, im Dezember 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“)).