

ERSTE RESPONSIBLE BOND MÜNDEL

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023/24

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.03.2024.....	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. 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: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 ERSTE RESPONSIBLE BOND MÜNDEL Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.10.2023 bis 31.03.2024 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.03.2024	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	611,8	98,71
Wertpapiere	611,8	98,71
Financial Futures	-0,0	-0,01
Bankguthaben	3,8	0,61
Zinsenansprüche	4,3	0,69
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	619,8	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.03.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.10.2023 bis 31.03.2024)

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
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Österreich								
ASFINAG 17/24 MTN	XS1701458017	0,250	0	7.400	5.000	98,135	4.906.750,00	0,79
AUSTRIA 09/26 MTN 144A	AT0000A0DXC2	4,850	0	0	500	103,582	517.910,00	0,08
AUSTRIA 18/28 MTN	AT0000A1ZGE4	0,750	0	0	1.000	92,970	929.700,00	0,15
BAWAG P.S.K. 23/26 MTN	XS2618704014	3,375	0	0	11.200	99,923	11.191.420,80	1,81
ERSTE GP BNK 15/25 MTN	XS1181448561	0,750	0	0	500	97,510	487.550,00	0,08
ERSTE GP BNK 17/27 MTN	XS1550203183	0,625	0	0	9.000	93,127	8.381.412,00	1,35
ERSTE GP BNK 18/24 MTN	XS1845161790	0,250	0	2.600	5.000	99,165	4.958.250,00	0,80
ERSTE GR.BK. 23/27 MTN	AT0000A33MP9	3,125	0	0	10.500	99,980	10.497.921,00	1,69
HYPO NOE L.F.N.W. 18/25	XS1875268689	0,500	0	0	700	95,790	670.527,20	0,11
HYPO NOE LB 19/26 MTN	XS2057917366	0,010	0	0	19.800	92,239	18.263.322,00	2,95
HYPO NOE LB 22/29 MTN	AT0000A2VXQ0	1,625	0	0	1.000	93,073	930.726,00	0,15
HYPO NOE LB 23/26 MTN	AT0000A36WE5	3,625	0	0	6.000	100,324	6.019.428,00	0,97
HYPO NOE LB 23/28 MTN	AT0000A33N23	3,250	0	0	9.600	100,235	9.622.540,80	1,55
HYPO TIROL 19/26 MTN	AT0000A2AYL3	0,010	0	0	10.900	92,026	10.030.855,80	1,62
HYPO TIROL 22/27 MTN	AT0000A2XLD9	1,375	0	0	15.000	94,591	14.188.650,00	2,29
HYPO VORARL. 19/27 MTN	XS1999728394	0,250	0	0	400	91,119	364.475,20	0,06
HYPO VORARL. 22/27 MTN	AT0000A30ZH4	3,250	0	0	12.000	99,831	11.979.672,00	1,93
HYPO VORARL. 22/28 MTN	XS2478521151	1,625	0	0	11.000	93,984	10.338.218,00	1,67
HYPO VORARL. 23/28 MTN	AT0000A34CR4	3,250	6.300	0	6.300	100,051	6.303.213,00	1,02
HYPO VORARLG BK 15/25 MTN	XS1188081936	0,750	0	0	2.000	97,360	1.947.200,00	0,31
HYPO VORARLG BK 17-24 MTN	XS1613238457	0,375	0	20.000	5.600	99,565	5.575.640,00	0,90
HYPO VORARLG BK 18/26 MTN	XS1856342560	0,625	0	0	4.700	94,000	4.418.009,40	0,71
OBEROEST.LBK 22/29 MTN	AT0000A2Y7L6	1,625	0	0	6.000	92,467	5.547.995,16	0,90
OBEROEST.LBK 23/27 MTN	AT0000A32695	2,875	0	0	10.000	98,718	9.871.760,00	1,59
OEBB INFRAST 14/24 MTN	XS1138366445	1,000	0	0	5.840	98,315	5.741.596,00	0,93
OEKB 22/27 MTN	XS2500414623	1,500	0	0	8.300	95,750	7.947.250,00	1,28
OESTERR. 16/26	AT0000A1K9C8	0,750	17.000	8.000	21.000	95,009	19.951.848,00	3,22
OESTERR. 17/27	AT0000A1VGK0	0,500	0	0	1.000	93,454	934.542,00	0,15
OESTERR. 97-27 6	AT0000383864	6,250	0	0	500	110,781	553.906,00	0,09
OESTERREICH 19/29 MTN	AT0000A269M8	0,500	5.000	2.000	50.000	90,203	45.101.400,00	7,28
OESTERREICH 20/30 MTN	AT0000A2CQD2	0,000	1.000	4.000	48.000	85,624	41.099.712,00	6,63
OESTERREICH 21/31 MTN	AT0000A2NW83	0,000	0	3.000	53.000	83,185	44.087.944,00	7,11
OESTERREICH 22/26 MTN	AT0000A308C5	2,000	0	6.000	14.000	98,117	13.736.380,00	2,22
OESTERREICH 22/28 MTN	AT0000A2VB47	0,000	7.000	2.000	30.000	88,690	26.607.000,00	4,29
OESTERREICH 22/32 MTN	AT0000A2WSC8	0,900	2.000	0	48.000	86,993	41.756.640,00	6,74
OESTERREICH 23/29 MTN	AT0000A33SH3	2,900	5.000	1.000	9.000	101,266	9.113.940,00	1,47
OESTERREICH 23/30 MTN	AT0000A38239	3,450	15.000	0	15.000	104,393	15.659.010,00	2,53

ERSTE RESPONSIBLE BOND MÜNDEL

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
OESTERREICH 23/33 MTN	AT0000A324S8	2,900	17.500	3.000	59.000	100,780	59.460.200,00	9,59
OESTERREICH 24/34 MTN	AT0000A39UW5	2,900	16.000	0	16.000	100,666	16.106.560,00	2,60
RLB OOE 22/27 MTN	AT0000A2XLA5	1,250	0	0	8.700	94,160	8.191.902,60	1,32
RLB OOE 23/26 MTN	AT0000A326M6	3,125	0	2.000	17.500	99,347	17.385.795,00	2,81
RLB STEIERM. 23/26 MTN	AT0000A35Y69	3,750	0	0	10.000	100,627	10.062.740,00	1,62
RLB STEIERM. 23/27 MTN	AT000B093901	3,125	0	0	3.500	99,342	3.476.970,00	0,56
UNICR.BK AU. 19/26 MTN	AT000B049739	0,625	0	0	7.500	95,111	7.133.325,00	1,15
UNICR.BK AU. 19/27 MTN	AT000B049788	0,250	0	0	2.200	91,260	2.007.720,00	0,32
UNICR.BK AU. 22/27 MTN	AT000B049929	2,375	0	0	8.700	97,436	8.476.932,00	1,37
UNICR.BK AU. 22/28 MTN	AT000B049911	1,500	0	0	13.000	93,842	12.199.434,00	1,97
UNICR.BK AU. 23/26 MTN	AT000B049937	3,000	0	0	1.400	99,236	1.389.309,60	0,22
UNICR.BK AUS. 15-25 MTN	AT000B049572	0,750	0	0	5.100	97,345	4.964.595,00	0,80
Summe Emissionsland Österreich							581.089.797,56	93,76
Summe Anleihen auf Euro lautend							581.089.797,56	93,76
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							581.089.797,56	93,76

In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere

Anleihen auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

AUSTRIA 05/25 FLR MTN	XS0229808315	0,000	0	0	2.500	98,110	2.452.750,00	0,40
BAWAG P.S.K. 22/27 MTN	XS2556232143	3,000	0	0	18.000	99,357	17.884.260,00	2,89
R.LB TIROL 22/27	AT0000A2XLB3	1,250	0	0	11.000	94,244	10.366.818,00	1,67
Summe Emissionsland Österreich							30.703.828,00	4,95
Summe Anleihen auf Euro lautend							30.703.828,00	4,95
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							30.703.828,00	4,95

Derivate

nicht realisiertes Ergebnis in EUR

Financial Futures auf Euro lautend

Emissionsland Deutschland

EURO-BOBL FUTURE Jun24	EBOB060624				-65		-40.300,00	-0,01
Summe Emissionsland Deutschland							-40.300,00	-0,01
Summe Financial Futures auf Euro lautend							-40.300,00	-0,01
Summe Derivate							-40.300,00	-0,01

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	611.793.625,56	98,71
Financial Futures	-40.300,00	- 0,01
Bankguthaben	3.771.648,37	0,61
Zinsenansprüche	4.250.305,74	0,69
Sonstige Abgrenzungen	-14.632,62	- 0,00
Fondsvermögen	619.760.647,05	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858220	Stück	54.122.996,897
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858220	EUR	7,43
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812995	Stück	16.304.134,856
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812995	EUR	13,34

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.

ERSTE RESPONSIBLE BOND MÜNDEL

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 Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
ASFINAG 10/25 MTN	XS0542825160	3,375	0	1.500
ASFINAG 20/27 MTN	XS2203969246	0,000	0	14.300
OESTERR. 15/25	AT0000A1FAP5	1,200	0	23.000
OESTERREICH 21/25 MTN	AT0000A2QRW0	0,000	0	6.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
ALLG.SPARK.OBER. 13-23MTN	AT000B100920	2,330	0	1.000

Wien, im April 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“)).