

ERSTE BOND EURO MÜNDELRENT

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2021/22

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.03.2022	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 BARTALSKY (ab 16.02.2022) Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN (ab 16.02.2022) Mag.(FH) Thomas SCHAUFLENER (Vorsitzender-Stv.) (bis 31.10.2021) Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER Radovan JELASITY Mag. Robert LASSHOFER (bis 16.02.2022) Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER 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. Walter MEGNER (bis 28.02.2022) Mag. Christoph SEEL (bis 30.11.2021) Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ (ab 01.03.2022) Mag. Wolfgang TRISKO (ab 01.03.2022)
Fondsprüfer	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
Depotbank	Erste Group Bank AG

Sehr geehrte(r) Anteilsinhaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND EURO MÜNDELRENT Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.10.2021 bis 31.03.2022 vorzulegen.

Weiters gestatten wir uns den Hinweis, dass mit 25.11.2021 der Fonds ERSTE RESERVE EURO MÜNDEL (übertragender Fonds) in den Fonds ERSTE BOND EURO MÜNDELRENT (übernehmender Fonds) fusioniert wurde.

Für den 27. Oktober 2021 konnte aufgrund eines technischen Problems die Berechnung des Rechenwerts nicht durchgeführt werden. Daher war die Ausgabe und Rücknahme von Anteilscheinen vorübergehend ausgesetzt.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.03.2022	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	300,4	97,21
Wertpapiere	300,4	97,21
Financial Futures	1,1	0,34
Bankguthaben	6,9	2,24
Zinsenansprüche	0,6	0,20
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	309,0	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.03.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.10.2021 bis 31.03.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Österreich								
ALLG.SPARK.OBER. 13-23MTN	AT000B100920	2,330	1.000	0	1.000	103,251	1.032.506,18	0,33
ASFINAG 15/22 MTN	XS1291264775	0,625	0	500	200	100,455	200.910,00	0,07
ASFINAG 17/24 MTN	XS1701458017	0,250	0	1.000	4.000	98,938	3.957.520,16	1,28
ASFINAG 19/29 MTN	XS2024602240	0,100	350	0	350	93,330	326.654,31	0,11
ASFINAG 20/27 MTN	XS2203969246	0,000	1.000	0	6.000	95,049	5.702.927,88	1,85
AUSTRIA 09/26 MTN 144A	AT0000A0DXC2	4,850	0	0	500	117,814	589.070,02	0,19
AUSTRIA 18/28 MTN	AT0000A1ZGE4	0,750	9.000	3.000	26.000	100,805	26.209.300,00	8,48
BK TIROL VORARLBG13-23 35	AT0000A138R4	2,650	1.200	0	1.200	103,318	1.239.816,00	0,40
ERSTE GP BNK 15/25 MTN	XS1181448561	0,750	500	0	500	99,881	499.406,02	0,16
ERSTE GP BNK 16/23 MTN	XS1346557637	0,625	0	500	8.700	100,650	8.756.550,00	2,83
ERSTE GP BNK 17/27 MTN	XS1550203183	0,625	1.500	0	1.500	98,191	1.472.865,03	0,48
ERSTE GP BNK 18/24 MTN	XS1845161790	0,250	0	0	7.600	99,167	7.536.676,88	2,44
HYPO NOE L.F.N.W. 17/23	XS1590565112	0,375	0	1.200	13.200	100,420	13.255.439,74	4,29
HYPO VORARLG BK 17-24 MTN	XS1613238457	0,375	2.200	0	14.200	99,510	14.130.420,28	4,57
OEBB INFRAST 14/24 MTN	XS1138366445	1,000	40	0	40	100,770	40.307,92	0,01
OESTERR. 15/25	AT0000A1FAP5	1,200	500	0	18.000	103,129	18.563.219,64	6,01
OESTERR. 16/26	AT0000A1K9C8	0,750	2.000	0	30.000	101,184	30.355.080,30	9,82
OESTERR. 17/27	AT0000A1VGK0	0,500	2.000	500	30.000	99,840	29.951.998,80	9,69
OESTERR. 97-27 6	AT0000383864	6,250	0	0	500	130,434	652.169,04	0,21
OESTERREICH 19/29 MTN	AT0000A269M8	0,500	2.500	2.000	21.000	98,505	20.686.007,79	6,69
OESTERREICH 20/30 MTN	AT0000A2CQD2	0,000	3.500	1.000	21.500	93,766	20.159.604,43	6,52
OESTERREICH 21/31 MTN	AT0000A2NW83	0,000	8.500	0	22.500	92,419	20.794.207,73	6,73
OESTERREICH 22/28 MTN	AT0000A2VB47	0,000	4.500	0	4.500	95,277	4.287.482,87	1,39
OESTERREICH 22/32 MTN	AT0000A2WSC8	0,900	7.500	0	7.500	99,190	7.439.250,00	2,41
RAIF.LABA NO 17/24 MTN	XS1681119167	0,375	1.800	0	1.800	99,208	1.785.740,44	0,58
RLB STEIERMARK 16-23MTN 9	AT000B092622	0,625	0	1.200	6.200	100,625	6.238.750,00	2,02
UNICR.BK AU. 19/26 MTN	AT000B049739	0,625	0	0	3.000	98,846	2.965.385,97	0,96
UNICR.BK AUS. 15-22 MTN	AT000B049598	0,750	0	1.000	15.500	100,485	15.575.175,00	5,04
UNICR.BK AUS. 15-25 MTN	AT000B049572	0,750	0	0	1.600	99,827	1.597.232,05	0,52
Summe Emissionsland Österreich							<u>266.001.674,48</u>	<u>86,08</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>266.001.674,48</u>	<u>86,08</u>
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							<u>266.001.674,48</u>	<u>86,08</u>

In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere

Anleihen auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

OBEROEST.LBK 16-23	XS1509009483	0,125	1.000	2.300	6.700	99,527	6.668.324,34	2,16
--------------------	--------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------------	------

ERSTE BOND EURO MÜNDELRENT

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
OESTERREICH 21/25 MTN	AT0000A2QRW0	0,000	1.000	0	28.000	99,102	27.748.672,56	8,98
Summe Emissionsland Österreich							34.416.996,90	11,14
Summe Anleihen auf Euro lautend							34.416.996,90	11,14
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							34.416.996,90	11,14

Derivate

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Financial Futures auf Euro lautend

Emissionsland Deutschland

EURO-BOBL FUTURE Jun22	EBOBM22				-74		89.507,98	0,03
EURO-BUND FUTURE Jun22	FGBLM22				-267		969.478,25	0,31
Summe Emissionsland Deutschland							1.058.986,23	0,34
Summe Financial Futures auf Euro lautend							1.058.986,23	0,34
Summe Derivate							1.058.986,23	0,34

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere							300.418.671,38	97,21
Financial Futures							1.058.986,23	0,34
Bankguthaben							6.925.006,16	2,24
Zinsenansprüche							632.709,59	0,20
Sonstige Abgrenzungen							-3.892,36	-0,00
Fondsvermögen							309.031.481,00	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000858220	Stück	24.603.666,255
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000858220	EUR	7,80
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812995	Stück	8.497.435,574
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812995	EUR	13,75

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.

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				
AUSTRIA 11/22 MTN 144A	AT0000A0N9A0	3,650	4.300	4.300
AUSTRIA 17/22 MTN	AT0000A1XM92	0,000	4.000	4.000
BAWAG P.S.K. 16/22 MTN	XS1369268534	0,375	1.400	7.600
HYPO NOE LB F.N.U.W.12/22	XS0780267406	3,000	1.600	1.600
HYPO TIROL 17/24 MTN	AT0000A1W509	0,500	2.000	2.000
OEBB INFRAST 07/22 MTN	XS0307792159	4,875	1.000	1.000
OESTERR. 13/23	AT0000A105W3	1,750	0	500
OESTERR. 16/23	AT0000A1PE50	0,000	0	500
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	10	19.010

Wien, im April 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“)).