

ERSTE RESPONSIBLE BOND

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2024

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.09.2024	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 Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER (Vorsitzender-Stv.) Radovan JELASITY Michael KOREN Mag. Ertan PISKIN Dr. Peter PROBER 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 Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.04.2024 bis 30.09.2024 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.09.2024	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	60,8	98,75
Wertpapiere	60,8	98,75
Bankguthaben	0,1	0,18
Zinsenansprüche	0,7	1,07
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	61,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.04.2024 bis 30.09.2024)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
			Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)					
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BERLIN HYP AG IS114	DE000BHYOGS9	1,125	0	0	1.000	94,373	943.728,00	1,53
BUNDESUBL.V.23/28 S.187	DE000BU25000	2,200	0	0	1.500	100,955	1.514.317,50	2,46
Summe Emissionsland Deutschland							2.458.045,50	4,00
Emissionsland Großbritannien								
THE WELLCOME TRUST 15/27	XS1171485722	1,125	0	0	2.300	97,070	2.232.610,00	3,63
Summe Emissionsland Großbritannien							2.232.610,00	3,63
Emissionsland Niederlande								
GIVAU.FIN.EU 20/27	XS2126169742	1,000	0	0	1.000	95,932	959.315,00	1,56
Summe Emissionsland Niederlande							959.315,00	1,56
Emissionsland Norwegen								
SPAREBK 1 B. 21/31 MTN	XS2342589582	0,125	1.200	0	1.200	84,749	1.016.988,00	1,65
Summe Emissionsland Norwegen							1.016.988,00	1,65
Emissionsland Österreich								
ERSTE GR.BK. 19/30 MTN	XS2083210729	1,000	0	0	1.200	97,795	1.173.540,00	1,91
KELAG-KAERNT.ELE.14-26MTN	AT0000A17Z60	3,000	0	0	1.020	101,020	1.030.404,00	1,67
OEBB INFRAST 11/26 MTN	XS0691970601	3,500	0	0	1.500	102,300	1.534.500,00	2,49
OESTERREICH 22/32 MTN	AT0000A2WSC8	0,900	0	0	1.800	89,290	1.607.214,60	2,61
RLBK OBEROESTERR.16/26MTN	XS1495631993	0,375	0	0	600	95,732	574.392,00	0,93
WIENERBERGER 20/25	AT0000A2GLA0	2,750	0	0	1.000	99,350	993.500,00	1,61
Summe Emissionsland Österreich							6.913.550,60	11,24
Emissionsland Schweden								
SVENSKA HDBK 20/30 MTN	XS2121207828	0,500	700	0	1.500	87,566	1.313.490,00	2,14
Summe Emissionsland Schweden							1.313.490,00	2,14
Emissionsland Slowenien								
SLOWENIEN 15-45	SI0002103552	3,125	500	0	1.000	96,758	967.575,00	1,57
Summe Emissionsland Slowenien							967.575,00	1,57

ERSTE RESPONSIBLE BOND

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 Spanien									
BCO SANTAND. 23/31 MTN	XS2705604234	4,875	700	0	1.300	108,436	1.409.661,50	2,29	
							Summe Emissionsland Spanien	1.409.661,50	2,29
							Summe Anleihen auf Euro lautend	17.271.235,60	28,07
							Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere	17.271.235,60	28,07
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere									
Anleihen auf Euro lautend									
Emittent Afrikanische Entwicklungsbank									
AFR. DEV. BK 18/28 MTN	XS1824248626	0,875	0	0	1.000	95,080	950.800,00	1,55	
							Summe Emittent Afrikanische Entwicklungsbank	950.800,00	1,55
Emissionsland Andorra									
ANDORRA 22/27 MTN	XS2445667236	1,250	500	0	1.500	95,745	1.436.175,00	2,33	
							Summe Emissionsland Andorra	1.436.175,00	2,33
Emissionsland Australien									
SYDNEY AIRPORT FIN. 18/28	XS1811198701	1,750	0	0	600	95,877	575.260,80	0,94	
							Summe Emissionsland Australien	575.260,80	0,94
Emissionsland Belgien									
KBC GROEP 24/32 MTN	BE0390124874	3,750	0	0	700	102,803	719.621,00	1,17	
							Summe Emissionsland Belgien	719.621,00	1,17
Emissionsland Dänemark									
ORSTED 17/29 MTN	XS1721760541	1,500	0	0	1.000	92,964	929.643,50	1,51	
							Summe Emissionsland Dänemark	929.643,50	1,51
Emissionsland Deutschland									
DT. BAHN FIN. 22/42 MTN	XS2541394750	3,875	0	0	1.000	105,639	1.056.390,00	1,72	
HESSEN SCHA.24/34	DE000A1RQEX0	2,625	1.000	0	1.000	100,097	1.000.970,00	1,63	
LBBW NACHR.MTN 16/26	DE000LB1B2E5	2,875	0	0	1.000	98,786	987.859,00	1,61	
							Summe Emissionsland Deutschland	3.045.219,00	4,95
Emissionsland Frankreich									
AGENCE FSE DEV. 14/26 MTN	XS1072438366	2,250	0	0	1.100	99,423	1.093.651,90	1,78	
BPCE 23/29 MTN	FR001400KLW9	3,375	0	0	700	103,150	722.048,60	1,17	
CARREFOUR 15/25 MTN	XS1179916017	1,250	0	0	1.000	98,625	986.250,00	1,60	
CR.MUT.ARKEA 24/33 MTN	FR001400P1Y4	3,625	0	0	1.000	102,639	1.026.385,00	1,67	
CREDIT AGRI. 23/33 FLRMTN	FR001400KDS4	5,500	0	0	1.000	106,272	1.062.718,00	1,73	
KERING 23/31 MTN	FR001400KHW7	3,625	0	0	1.000	102,388	1.023.884,00	1,66	

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
RCI BANQUE 18/26 MTN	FR0013334695	1,625	0	0	1.000	97,270	972.700,00	1,58
RTE RESEAU 19/49 MTN	FR0013445152	1,125	0	0	700	60,294	422.059,40	0,69
SNCF RESEAU 17/34 MTN	XS1588061777	1,875	0	0	1.500	89,498	1.342.462,50	2,18
SOC.GR.PROJ. 19/50 MTN	FR0013422383	1,700	0	0	1.300	67,649	879.442,20	1,43
Summe Emissionsland Frankreich							<u>9.531.601,60</u>	<u>15,49</u>
Emissionsland Großbritannien								
MOTABILITY 23/31 MTN	XS2574870759	3,500	600	0	1.200	101,486	1.217.832,00	1,98
VODAFONE GRP 17/25 MTN	XS1721423462	1,125	0	0	800	98,243	785.942,40	1,28
Summe Emissionsland Großbritannien							<u>2.003.774,40</u>	<u>3,26</u>
Emissionsland Island								
ISLAND, REP. 24/34 MTN	XS2788435050	3,500	1.000	0	1.000	104,530	1.045.300,00	1,70
Summe Emissionsland Island							<u>1.045.300,00</u>	<u>1,70</u>
Emissionsland Italien								
CA ITALIA 24/36 MTN	IT0005585622	3,500	0	0	1.000	104,250	1.042.496,00	1,69
CAS.DEP.PRES 21/29 MTN	IT0005451197	0,750	0	0	1.300	89,897	1.168.654,50	1,90
ERG 20/27 MTN	XS2229434852	0,500	0	0	500	92,831	464.154,00	0,75
INTESA SAN. 14/26 MTN	IT0004992787	3,250	0	0	1.500	100,665	1.509.974,40	2,45
ITALIEN 21/31	IT0005436693	0,600	0	0	1.300	85,396	1.110.142,20	1,80
TERNA R.E.N. 16/28 MTN	XS1503131713	1,000	0	0	800	93,736	749.886,40	1,22
Summe Emissionsland Italien							<u>6.045.307,50</u>	<u>9,83</u>
Emissionsland Japan								
TAKEDA PHARMA.18/30 REGS	XS1843449395	3,000	0	0	800	99,797	798.376,00	1,30
Summe Emissionsland Japan							<u>798.376,00</u>	<u>1,30</u>
Emissionsland Kanada								
TORON.DOM.BK 23/31 MTN	XS2676779304	3,666	0	0	1.500	105,847	1.587.700,50	2,58
Summe Emissionsland Kanada							<u>1.587.700,50</u>	<u>2,58</u>
Emissionsland Lettland								
LETTLAND 23/28 MTN	XS2576364371	3,500	0	0	1.200	102,904	1.234.848,00	2,01
Summe Emissionsland Lettland							<u>1.234.848,00</u>	<u>2,01</u>
Emissionsland Litauen								
LITAUEN 24/31 MTN	XS2841247583	3,500	1.100	0	1.100	102,673	1.129.397,50	1,84
Summe Emissionsland Litauen							<u>1.129.397,50</u>	<u>1,84</u>
Emissionsland Niederlande								
DE VOLKSBANK 21/28 MTN	XS2308298962	0,375	0	0	1.000	90,640	906.404,00	1,47
FMO NED.M.O. 20/31 FLRMTN	XS2205081966	0,625	0	0	600	97,514	585.081,00	0,95

ERSTE RESPONSIBLE BOND

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
HEINEKEN 16/26 MTN	XS1401174633	1,000	0	0	1.000	97,270	972.696,00	1,58
NAT.-NEDERL.BANK 18/28MTN	NL0013088990	1,000	0	0	1.500	94,141	1.412.112,00	2,30
					Summe Emissionsland Niederlande		3.876.293,00	6,30
Emissionsland Österreich								
MONDI F.EUR. 20/28 MTN	XS2151059206	2,375	0	0	600	98,103	588.616,80	0,96
					Summe Emissionsland Österreich		588.616,80	0,96
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 22/42	PTOTEPOE0032	1,150	0	0	1.000	73,030	730.300,00	1,19
					Summe Emissionsland Portugal		730.300,00	1,19
Emissionsland Schweden								
STOCKHOLM GEM. 15/25 MTN	XS1195216707	0,750	0	0	1.250	99,005	1.237.562,50	2,01
VOLVO TREAS. 23/26 MTN	XS2671621402	3,875	0	0	500	101,766	508.828,50	0,83
					Summe Emissionsland Schweden		1.746.391,00	2,84
Emissionsland Slowakei								
SLOVENSK.SPO 23/26 MTN	SK4000022398	3,250	0	0	1.200	100,396	1.204.746,00	1,96
					Summe Emissionsland Slowakei		1.204.746,00	1,96
Emissionsland Spanien								
JUNTA GALICI 21/28	ES0001352618	0,268	0	0	800	91,538	732.300,80	1,19
SPANIEN 18-48	ES0000012B47	2,700	0	0	1.000	86,391	863.914,66	1,40
					Summe Emissionsland Spanien		1.596.215,46	2,59
Emissionsland USA								
AT + T 14/29	XS1144088165	2,600	0	0	800	98,120	784.957,60	1,28
MOODY'S CORP 19/30	XS2010038227	0,950	0	0	1.000	90,540	905.400,00	1,47
PRO.EUR.FIN. 23/43	XS2580271752	4,250	0	0	1.000	101,690	1.016.896,00	1,65
					Summe Emissionsland USA		2.707.253,60	4,40
					Summe Anleihen auf Euro lautend		43.482.840,66	70,68
					Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere		43.482.840,66	70,68
Gliederung des Fondsvermögens								
Wertpapiere							60.754.076,26	98,75
Bankguthaben							110.399,78	0,18
Zinsenansprüche							658.112,31	1,07
Sonstige Abgrenzungen							-1.048,68	-0,00
Fondsvermögen							61.521.539,67	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A01G95	Stück	130.485,830
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A01G95	EUR	119,32
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A21LN1	Stück	320,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A21LN1	EUR	91,16
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000686084	Stück	176.280,080
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000686084	EUR	161,31
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A2KVX3	Stück	1.446,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A2KVX3	EUR	90,97
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0WLW5	Stück	74.912,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0WLW5	EUR	165,14
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A21LP6	Stück	50.362,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A21LP6	EUR	98,93

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. Für die nicht physisch abgewickelten Devisenterminkontrakte und nicht physisch abgewickelten Devisenswapkontrakte werden die Sicherheiten (Collaterals) zwischen dem Investmentfonds und der Erste Group Bank AG ausgetauscht.

Im Falle des negativen Exposures der nicht physisch abgewickelten Derivatetermin- und Devisenswapkontrakte 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 nicht physisch abgewickelten Derivatetermin- und Devisenswapkontrakte 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

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 Island				
ISLAND 19/24 MTN	XS2015295814	0,100	0	1.500
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Großbritannien				
SSE PLC 23/31 MTN	XS2675685700	4,000	0	1.000
Emissionsland Litauen				
LITAUEN 20/30 MTN	XS2168038847	0,750	0	1.500
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Dänemark				
NYKREDIT 19/24 MTN	DK0009525404	0,125	0	800
Emissionsland Tschechische Republik				
TSCHECHIEN 22/24	CZ0001006480	0,000	0	1.000

Wien, im Oktober 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“)).