

sWaldviertel Bond

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2024

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.08.2024.....	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 sWaldviertel Bond Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.03.2024 bis 31.08.2024 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.08.2024	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	50,2	97,31
Wertpapiere	50,2	97,31
Financial Futures	-0,0	-0,04
Bankguthaben	1,1	2,06
Zinsenansprüche	0,3	0,66
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	51,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.08.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.03.2024 bis 31.08.2024)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BUNDANL.V.17/48	DE0001102432	1,250	0	0	1.000	77,242	772.418,00	1,50
BUNDANL.V.20/30	DE0001102499	0,000	0	0	600	89,203	535.218,40	1,04
BUNDANL.V.20/35	DE0001102515	0,000	0	0	750	78,251	586.881,02	1,14
BUNDANL.V.21/28	DE0001102556	0,000	0	0	800	91,569	732.550,40	1,42
BUNDANL.V.21/31	DE0001102564	0,000	0	0	1.100	86,414	950.549,60	1,84
BUNDANL.V.22/53	DE0001102614	1,800	0	0	1.400	85,451	1.196.319,60	2,32
BUNDESUBL.V.23/28 S.188	DE000BU25018	2,400	0	0	1.000	100,827	1.008.269,50	1,96
LBBW MTN OPF 22/27	DE000LB38077	2,375	0	0	500	99,191	495.956,50	0,96
Summe Emissionsland Deutschland							6.278.163,02	12,18
Emissionsland Irland								
IRLAND 21/31	IE00BMQ5JL65	0,000	0	0	400	84,000	336.000,00	0,65
Summe Emissionsland Irland							336.000,00	0,65
Emissionsland Österreich								
ASFINAG 19/29 MTN	XS2024602240	0,100	0	0	350	88,902	311.155,39	0,60
ASFINAG 20/27 MTN	XS2203969246	0,000	0	0	500	93,046	465.229,00	0,90
HYPO NOE LB 19/26 MTN	XS2057917366	0,010	0	0	500	94,237	471.185,00	0,91
HYPO TIROL 22/27 MTN	AT0000A2XLD9	1,375	0	0	500	96,196	480.978,00	0,93
HYPO VORARL. 22/27 MTN	AT0000A3OZH4	3,250	0	0	500	100,716	503.579,00	0,98
UNICR.BK AU. 22/27 MTN	AT000B049929	2,375	0	0	500	98,750	493.748,00	0,96
Summe Emissionsland Österreich							2.725.874,39	5,29
Summe Anleihen auf Euro lautend							9.340.037,41	18,12
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							9.340.037,41	18,12
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Belgien								
BELGIQUE 14-34 73	BE0000333428	3,000	0	0	500	101,644	508.217,50	0,99
BELGIQUE 17/37 84	BE0000344532	1,450	0	0	1.100	83,414	917.558,40	1,78
BELGIQUE 19/29	BE0000347568	0,900	500	0	900	92,948	836.527,50	1,62
BELGIQUE 20/40	BE0000350596	0,400	0	0	400	65,810	263.240,80	0,51
Summe Emissionsland Belgien							2.525.544,20	4,90

sWaldviertel Bond

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emissionsland Deutschland								
K.F.W.ANL.V.17/2027	DE000A2GSFA2	0,500	0	0	1.300	94,203	1.224.641,57	2,38
KRED.F.WIED.15/30 MTN	DE000A11QTF7	0,375	0	0	700	88,767	621.366,90	1,21
KRED.F.WIED.21/31 MTN	DE000A3H2ZF6	0,000	0	0	700	85,164	596.150,80	1,16
Summe Emissionsland Deutschland							<u>2.442.159,27</u>	<u>4,74</u>
Emissionsland Frankreich								
CIE F.FONCIER 16/26 MTN	FR0013106630	1,000	0	0	400	97,427	389.707,20	0,76
CSSE DEP.CON 21/26 MTN	FR0014003RL9	0,010	0	0	400	95,189	380.757,20	0,74
FRANKREICH 20/40 O.A.T.	FR0013515806	0,500	0	0	1.100	66,293	729.227,40	1,41
FRANKREICH 23/29 O.A.T.	FR001400HI98	2,750	0	0	500	100,432	502.160,00	0,97
FRANKREICH 23/54 O.A.T.	FR001400FTH3	3,000	0	0	400	90,509	362.036,80	0,70
REP. FSE 10-26 O.A.T.	FR0010916924	3,500	0	0	500	101,348	506.741,13	0,98
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011982776	0,700	0	0	2.300	99,548	2.888.930,74	5,60
REP. FSE 15-25 O.A.T.	FR0012517027	0,500	0	0	500	98,180	490.900,00	0,95
REP. FSE 16-26 O.A.T.	FR0013131877	0,500	0	0	300	96,465	289.395,00	0,56
REP. FSE 16-36 O.A.T.	FR0013154044	1,250	0	0	2.900	82,097	2.380.818,80	4,62
REP. FSE 18-34 O.A.T.	FR0013313582	1,250	500	600	900	85,818	772.363,80	1,50
SNCF 17/29 MTN	XS1558472129	1,500	0	0	500	93,917	469.583,00	0,91
Summe Emissionsland Frankreich							<u>10.162.621,07</u>	<u>19,72</u>
Emissionsland Italien								
B.T.P. 15-25	IT0005090318	1,500	0	0	1.500	98,820	1.482.300,00	2,88
B.T.P. 15-32	IT0005094088	1,650	0	0	2.100	88,938	1.867.698,00	3,62
B.T.P. 16-26	IT0005170839	1,600	0	0	1.000	97,984	979.840,00	1,90
B.T.P. 16-36	IT0005177909	2,250	1.000	0	1.700	85,491	1.453.347,00	2,82
B.T.P. 18-28	IT0005323032	2,000	0	0	900	97,286	875.577,71	1,70
ITALIEN 20/30	IT0005413171	1,650	0	0	1.000	91,112	911.116,00	1,77
ITALIEN 20/51	IT0005425233	1,700	0	0	2.000	61,568	1.231.353,34	2,39
ITALIEN 21/26	IT0005454241	0,000	0	0	1.000	94,845	948.450,00	1,84
ITALIEN 21/28	IT0005445306	0,500	0	0	1.800	91,319	1.643.738,40	3,19
ITALIEN 23/34	IT0005560948	4,200	1.200	0	1.200	104,841	1.258.093,20	2,44
Summe Emissionsland Italien							<u>12.651.513,65</u>	<u>24,55</u>
Emissionsland Niederlande								
BNG BK 19/29 MTN	XS1940071597	0,750	0	0	500	92,454	462.269,00	0,90
Summe Emissionsland Niederlande							<u>462.269,00</u>	<u>0,90</u>
Emissionsland Österreich								
AUSTRIA 05/25 FLR MTN	XS0229808315	0,000	0	0	1.500	100,360	1.505.400,00	2,92
Summe Emissionsland Österreich							<u>1.505.400,00</u>	<u>2,92</u>

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 06-37	PTOTE50E0007	4,100	0	0	150	110,590	165.884,25	0,32
PORTUGAL 18-34	PTOTEW0E0017	2,250	400	0	600	95,272	571.634,50	1,11
PORTUGAL 23/38	PTOTEZ0E0014	3,500	500	0	500	103,406	517.030,00	1,00
PORTUGAL 24/34	PTOTES0E0021	2,875	700	0	700	99,987	699.910,75	1,36
Summe Emissionsland Portugal							1.954.459,50	3,79
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 14-24	ES00000126B2	2,750	0	0	500	99,895	499.475,00	0,97
SPANIEN 16-26	ES00000128H5	1,300	0	0	1.000	97,365	973.647,00	1,89
SPANIEN 16-46	ES00000128C6	2,900	0	0	1.100	89,268	981.952,40	1,91
SPANIEN 17-27 FLR	ES00000128S2	0,650	0	0	400	99,168	497.458,42	0,97
SPANIEN 17-33	ES00000128Q6	2,350	0	0	800	95,223	761.787,20	1,48
SPANIEN 19/29	ES0000012F43	0,600	0	0	1.700	90,178	1.533.022,60	2,97
SPANIEN 19/35	ES0000012E69	1,850	0	0	1.000	88,230	882.300,00	1,71
SPANIEN 20/30	ES0000012G34	1,250	0	0	2.400	91,660	2.199.835,20	4,27
SPANIEN 22/43	ES0000012K95	3,450	800	0	800	97,952	783.615,20	1,52
Summe Emissionsland Spanien							9.113.093,02	17,68
Summe Anleihen auf Euro lautend							40.817.059,71	79,19
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							40.817.059,71	79,19
Derivate							nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Financial Futures auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EURO-BUND FUTURE Dec24	FGBL061224				35		-18.200,00	-0,04
Summe Emissionsland Deutschland							-18.200,00	-0,04
Summe Financial Futures auf Euro lautend							-18.200,00	-0,04
Summe Derivate							-18.200,00	-0,04
Gliederung des Fondsvermögens								
Wertpapiere							50.157.097,12	97,31
Financial Futures							-18.200,00	- 0,04
Bankguthaben							1.063.138,79	2,06
Zinsenansprüche							341.211,56	0,66
Sonstige Abgrenzungen							-859,35	- 0,00
Fondsvermögen							51.542.388,12	100,00

Hinweis an die Anleger:**Die Bewertung von Vermögenswerten in illiquiden Märkten kann von ihren tatsächlichen Veräußerungspreisen abweichen.**

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A011W3	Stück	29.878,630
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A011W3	EUR	10,23
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A011X1	Stück	3.785.176,220
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A011X1	EUR	13,53

Bei folgenden Wertpapieren handelt es sich um inflationsindexierte Anleihen, bei denen das Nominale mit einem Inflationsindex abgesichert ist:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Index-Value	Kurswert in EUR
REP. FSE 14-30 O.A.T.	FR0011982776	1,26176	2.888.930,74
SPANIEN 17-27 FLR	ES00000128S2	1,25408	497.458,42

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 gelearnte 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.

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 Deutschland				
BUNDANL.V.23/33	DE000BU2Z007	2,300	0	1.400
K.F.W.ANL.V.14/2024	DE000A1R0709	1,500	0	1.000
Emissionsland Italien				
B.T.P. 14-24	IT0005001547	3,750	0	500
Emissionsland Österreich				
AUSTRIA 2037 MTN 144A	AT0000A04967	4,150	0	500
Emissionsland Spanien				
SPANIEN 14-24	ES00000124W3	3,800	0	500
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Italien				
ITALIEN 23/29 FLR	IT0005543803	1,500	0	900

Wien, im September 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“)).