

True Rock

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2024

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.06.2024	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 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 True Rock Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.01.2024 bis 30.06.2024 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.06.2024	
	Mio. Euro	%
Aktien		
auf Euro lautend	0,0	0,19
Anleihen		
auf Australischer Dollar lautend	0,1	1,72
auf Euro lautend	2,9	84,41
auf US-Dollar lautend	0,3	9,59
Wertpapiere	3,3	95,92
Bankguthaben	0,1	3,25
Zinsenansprüche	0,0	0,83
Fondsvermögen	3,4	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.01.2024 bis 30.06.2024)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Verkäufe/ Zugäng Abgänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Aktien auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EKOTECHNIKA AG A O.N.	DE000A161234		0	0	980	6,800	6.664,00	0,19
						Summe Emissionsland Deutschland	6.664,00	0,19
						Summe Aktien auf Euro lautend	6.664,00	0,19
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BUNDESUBL.V.20/25 S.182	DE0001141828	0,000	0	100	100	96,287	96.286,80	2,81
BUNDESUBL.V.22/27 S.186	DE0001141869	1,300	0	150	150	96,140	144.209,46	4,21
						Summe Emissionsland Deutschland	240.496,26	7,02
Emissionsland Irland								
IRLAND 09-25	IE00B4TV0D44	5,400	100	0	100	101,310	101.310,00	2,96
IRLAND 19/29	IE00BH3SQ895	1,100	50	0	50	92,528	46.264,00	1,35
						Summe Emissionsland Irland	147.574,00	4,31
Emissionsland Österreich								
OEBB INFRAST 14/24 MTN	XS1138366445	1,000	0	0	229	98,975	226.652,75	6,61
OESTERR. 16/26	AT0000A1K9C8	0,750	0	100	200	95,073	190.146,40	5,55
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	0	200	100	99,860	99.860,00	2,91
						Summe Emissionsland Österreich	516.659,15	15,08
Emissionsland Slowenien								
SLOWENIEN 15-25	SI0002103545	2,125	100	0	150	98,733	148.098,75	4,32
						Summe Emissionsland Slowenien	148.098,75	4,32
						Summe Anleihen auf Euro lautend	1.052.828,16	30,72
						Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere	1.059.492,16	30,92

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere									
Anleihen auf Australischer Dollar lautend									
Emissionsland Australien									
AUSTRALIA 20/25	AU0000095457	0,250	0	0	100	94,545	58.913,88	1,72	
							Summe Emissionsland Australien	58.913,88	1,72
Summe Anleihen auf Australischer Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,60480							58.913,88	1,72	
Anleihen auf Euro lautend									
Emissionsland Belgien									
BELGIQUE 17/24 82	BE0000342510	0,500	0	0	50	99,105	49.552,50	1,45	
BELGIQUE 20/27	BE0000351602	0,000	0	150	50	91,130	45.565,00	1,33	
							Summe Emissionsland Belgien	95.117,50	2,78
Emissionsland Deutschland									
STADT HAMBURG IS 17/25	DE000A2DAHX5	0,500	0	0	100	97,320	97.320,00	2,84	
							Summe Emissionsland Deutschland	97.320,00	2,84
Emissionsland Finnland									
FINLD 15-25	FI4000167317	0,875	0	0	100	97,229	97.229,00	2,84	
							Summe Emissionsland Finnland	97.229,00	2,84
Emissionsland Frankreich									
FRANKREICH 21/25 O.A.T.	FR0014007TY9	0,000	0	100	100	97,775	97.775,00	2,85	
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	0,100	0	0	200	92,859	212.338,82	6,20	
FRANKREICH 22/28 O.A.T.	FR001400AIN5	0,750	0	0	200	92,240	184.480,40	5,38	
							Summe Emissionsland Frankreich	494.594,22	14,43
Emissionsland Luxemburg									
GARF.HOLD.3 20/26 FLR	XS2250154494 1)	10,085	0	0	200	66,645	129.872,31	3,79	
LUXEMBURG 24/34	LU2773894873	2,875	100	0	100	99,159	99.159,00	2,89	
							Summe Emissionsland Luxemburg	229.031,31	6,68
Emissionsland Mexiko									
MEXICO 15/2115 MTN	XS1218289103	4,000	0	0	200	73,969	147.937,50	4,32	
							Summe Emissionsland Mexiko	147.937,50	4,32

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Verkäufe/ Zugänge Abgänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Emissionsland Niederlande								
NEDERLD 18-28	NL0012818504	0,750	0	0	200	92,672	185.343,20	5,41
						Summe Emissionsland Niederlande	185.343,20	5,41
Emissionsland Österreich								
OESTERR. K.BK 17/24 MTN	XS1689595830	0,250	0	200	100	99,195	99.195,00	2,89
						Summe Emissionsland Österreich	99.195,00	2,89
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	0	0	200	82,835	165.670,00	4,83
						Summe Emissionsland Rumänien	165.670,00	4,83
Emissionsland Slowakei								
SLOWAKEI 14-29	SK4120009762	3,625	0	0	40	102,625	41.050,00	1,20
SLOWAKEI 24/26	SK4000024675	3,000	100	0	100	99,374	99.374,08	2,90
						Summe Emissionsland Slowakei	140.424,08	4,10
Emissionsland Slowenien								
SLOWENIEN 22/26	SI0002104246	0,000	0	0	50	95,114	47.557,04	1,39
						Summe Emissionsland Slowenien	47.557,04	1,39
Emissionsland Spanien								
SPANIEN 23/33	ES0000012L78	3,550	0	0	40	101,701	40.680,40	1,19
						Summe Emissionsland Spanien	40.680,40	1,19
						Summe Anleihen auf Euro lautend	1.840.099,25	53,69
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Niederlande								
LUKOIL INTL FIN.16/26REGS	XS1514045886	4,750	0	0	200	75,829	141.505,02	4,13
						Summe Emissionsland Niederlande	141.505,02	4,13
Emissionsland Panama								
PANAMA 05/26	US698299AV61	7,125	0	0	100	101,440	94.649,26	2,76
						Summe Emissionsland Panama	94.649,26	2,76

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Verkäufe/ Zugänge Abgänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Emissionsland USA								
USA 23/26	US91282CHH79	4,125	0	0	50	98,852	46.116,89	1,35
USA 24/29	US91282CKD29	4,250	50	0	50	99,551	46.443,10	1,36
						Summe Emissionsland USA	92.559,99	2,70
						Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,07175	328.714,27	9,59
						Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere	2.227.727,40	65,00

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere						3.287.219,56	95,92
Bankguthaben						111.404,77	3,25
Zinsenansprüche						28.442,46	0,83
Fondsvermögen						3.427.066,79	100,00

1) Kurs beinhaltet Zinsabgrenzungen

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A09V98	Stück	26.774,596
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A09V98	EUR	126,88
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XAG7	Stück	234,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XAG7	GBP	107,92

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
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	1,14334	212.338,82

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.

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 Finnland				
FINNLAND 23/24 ZO	FI4000560958	0,000	0	50
Emissionsland Irland				
IRLAND 2024	IE00B6X95T99	3,400	0	100
Investmentzertifikate				
Investmentzertifikate auf Euro lautend				
Emissionsland Luxemburg				
BNP-ECPIGESG U.ETFEOA	IE000FF2EBQ8		0	600
Emissionsland Niederlande				
VANECK GL.REAL EST.UC.ETF	NL0009690239		0	650

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend				
Emissionsland Irland				
VANECK GOLD MINERS UC.ETF	IE00BQQP9F84		0	1.450
Emissionsland Luxemburg				
T.ROWE P-ASIA CRD BD QDLA	LU1697875653		0	5.000
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Italien				
ITALIEN 19/25 FLR	IT0005359846	5,770	0	400
Emissionsland USA				
MICROSOFT 13/28	XS1001749289	3,125	0	100
Anleihen auf US-Dollar lautend				
Emissionsland USA				
BANK OF AMERICA 2038	US59023VAA89	7,750	0	100
JPMORGAN CHASE 2040	US46625HHV50	5,500	0	40
MORGAN STANLEY 12/42	US617482V925	6,375	0	40

Wien, im Juli 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“)).