

True Rock

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.06.2023	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 BARTALSZKY Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER (Vorsitzender-Stv.) Radovan JELASITY Mag. Ertan PISKIN Dr. Peter PROBER Gabriele SEMMELROCK-WERZER Mag. Reinhard WALTTL 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. Wolfgang EXL Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
Fondsprüfer	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
Depotbank	Erste Group Bank AG

Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des True Rock Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 30.06.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.06.2023	
	Mio. Euro	%
Aktien		
auf Euro lautend	0,0	0,31
Anleihen		
auf Australischer Dollar lautend	0,1	1,12
auf Euro lautend	4,2	83,65
auf US-Dollar lautend	0,5	9,48
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	0,1	1,27
auf US-Dollar lautend	0,1	1,86
Wertpapiere	4,9	97,68
Bankguthaben	0,1	1,52
Zinsenansprüche	0,0	0,80
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,01
Fondsvermögen	5,0	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.01.2023 bis 30.06.2023)

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 Deutschland								
BUNDESUBL.V.20/25 S.182	DE0001141828	0,000	0	0	200	93,337	186.674,00	3,76
BUNDESUBL.V.22/27 S.186	DE0001141869	1,300	0	0	200	94,623	189.246,40	3,81
DT.PFBR.BANK MTN.35424	DE000A30WF84	5,000	50	0	50	100,891	50.445,50	1,02
Summe Emissionsland Deutschland							426.365,90	8,58
Emissionsland Irland								
IRLAND 2024	IE00B6X95T99	3,400	0	0	100	100,070	100.070,00	2,01
Summe Emissionsland Irland							100.070,00	2,01
Emissionsland Österreich								
HYPO VORARLG BK 17-24 MTN	XS1613238457	0,375	0	0	200	96,935	193.870,00	3,90
OEBB INFRAST 14/24 MTN	XS1138366445	1,000	0	0	229	96,183	220.259,07	4,43
OESTERR. 16/26	AT0000A1K9C8	0,750	0	0	200	92,829	185.657,20	3,74
OESTERREICH 19/24 MTN	AT0000A28KX7	0,000	0	0	200	96,515	193.029,21	3,89
Summe Emissionsland Österreich							792.815,48	15,96
Summe Anleihen auf Euro lautend							1.319.251,38	26,55
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							1.319.251,38	26,55
Investmentzertifikate								
Investmentzertifikate auf Euro lautend								
Emissionsland Luxemburg								
BNPP-ECPI GL ESG IN.UCEO	LU1291109293		0	0	600	68,030	40.818,00	0,82
Summe Emissionsland Luxemburg							40.818,00	0,82
Emissionsland Niederlande								
VANECK GL.REAL EST.UC.ETF	NL0009690239		0	0	650	34,141	22.191,65	0,45
Summe Emissionsland Niederlande							22.191,65	0,45
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend							63.009,65	1,27
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Irland								
VANECK GOLD MINERS UC.ETF	IE00BQQP9F84		0	0	1.450	32,710	43.473,42	0,88
Summe Emissionsland Irland							43.473,42	0,88

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	
Emissionsland Luxemburg									
T.ROWE P-ASIA CRD BD QDLA	LU1697875653		0	0	5.000	10,630	48.716,77	0,98	
							Summe Emissionsland Luxemburg	48.716,77	0,98
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,09100							92.190,19	1,86	
Summe Investmentzertifikate							155.199,84	3,12	
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere									
Aktien auf Euro lautend									
Emissionsland Deutschland									
EKOTECHNIKA AG A O.N.	DE000A161234		0	0	980	15,700	15.386,00	0,31	
							Summe Emissionsland Deutschland	15.386,00	0,31
Summe Aktien auf Euro lautend							15.386,00	0,31	
Anleihen auf Australischer Dollar lautend									
Emissionsland Australien									
AUSTRALIA 20/25	AU0000095457	0,250	0	0	100	91,290	55.698,60	1,12	
							Summe Emissionsland Australien	55.698,60	1,12
Summe Anleihen auf Australischer Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,63900							55.698,60	1,12	
Anleihen auf Euro lautend									
Emissionsland Belgien									
BELGIQUE 20/27	BE0000351602	0,000	0	0	200	88,219	176.437,61	3,55	
							Summe Emissionsland Belgien	176.437,61	3,55
Emissionsland Deutschland									
STADT HAMBURG IS 17/25	DE000A2DAHX5	0,500	0	0	100	93,655	93.655,00	1,89	
THYSSENKRUPP MTN 19/24	DE000A2TEDB8	2,875	50	0	50	98,800	49.400,00	0,99	
							Summe Emissionsland Deutschland	143.055,00	2,88
Emissionsland Finnland									
FINLD 15-25	FI4000167317	0,875	0	0	100	95,024	95.023,60	1,91	
							Summe Emissionsland Finnland	95.023,60	1,91
Emissionsland Frankreich									
FRANKREICH 20/24 O.A.T.	FR0014001N46	0,000	0	0	200	97,755	195.510,00	3,94	
FRANKREICH 21/25 O.A.T.	FR0014007TY9	0,000	0	0	200	94,664	189.328,00	3,81	
FRANKREICH 21/32 O.A.T.	FR0014003N51	0,100	0	0	200	97,854	219.239,93	4,41	
FRANKREICH 22/28 O.A.T.	FR001400AIN5	0,750	0	0	200	90,670	181.340,00	3,65	
							Summe Emissionsland Frankreich	785.417,93	15,81

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
Emissionsland Italien								
ITALIEN 19/25 FLR	IT0005359846	4,668	0	0	400	102,764	411.056,00	8,27
Summe Emissionsland Italien							411.056,00	8,27
Emissionsland Luxemburg								
GARF.HOLD.3 20/26 FLR	XS2250154494 1)	9,500	0	0	200	76,180	149.035,00	3,00
Summe Emissionsland Luxemburg							149.035,00	3,00
Emissionsland Mexiko								
MEXICO 15/2115 MTN	XS1218289103	4,000	0	0	200	74,028	148.056,00	2,98
Summe Emissionsland Mexiko							148.056,00	2,98
Emissionsland Niederlande								
NEDERLD 18-28	NL0012818504	0,750	0	0	200	90,564	181.128,01	3,65
Summe Emissionsland Niederlande							181.128,01	3,65
Emissionsland Österreich								
OESTERR. K.BK 17/24 MTN	XS1689595830	0,250	0	0	300	95,676	287.028,01	5,78
Summe Emissionsland Österreich							287.028,01	5,78
Emissionsland Portugal								
PORTUGAL 18-25 FLR	PTOTVMOE0000	3,857	0	0	200	102,920	205.840,00	4,14
Summe Emissionsland Portugal							205.840,00	4,14
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	0	0	200	77,259	154.518,00	3,11
Summe Emissionsland Rumänien							154.518,00	3,11
Emissionsland USA								
MICROSOFT 13/28	XS1001749289	3,125	0	0	100	99,927	99.927,00	2,01
Summe Emissionsland USA							99.927,00	2,01
Summe Anleihen auf Euro lautend							2.836.522,16	57,09
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Niederlande								
LUKOIL INTL FIN.16/26REGS	XS1514045886	4,750	0	0	200	77,918	142.837,76	2,88
Summe Emissionsland Niederlande							142.837,76	2,88

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
Emissionsland Panama								
PANAMA 05/26	US698299AV61	7,125	0	0	100	104,198	95.506,91	1,92
Summe Emissionsland Panama							95.506,91	1,92
Emissionsland USA								
BANK OF AMERICA 2038	US59023VAA89	7,750	100	0	100	118,685	108.785,62	2,19
JPMORGAN CHASE 2040	US46625HHV50	5,500	40	0	40	102,667	37.641,51	0,76
MORGAN STANLEY 12/42	US617482V925	6,375	40	0	40	111,505	40.881,71	0,82
USA 23/26	US91282CHH79	4,125	50	0	50	99,030	45.384,97	0,91
Summe Emissionsland USA							232.693,81	4,68
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,09100							471.038,48	9,48
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							3.378.645,24	68,01

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	4.853.096,46	97,68
Bankguthaben	75.452,57	1,52
Zinsenansprüche	39.936,96	0,80
Sonstige Abgrenzungen	-276,27	-0,01
Fondsvermögen	4.968.209,72	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	39.569,854
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A09V98	EUR	124,81
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XAG7	Stück	234,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XAG7	GBP	107,45

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	1,12024	219.239,93

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.

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
Investmentzertifikate				
Investmentzertifikate auf Euro lautend				
Emissionsland Niederlande				
VANECK MSTR.DM DIV.UC.ETF	NL0011683594		0	600
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Deutschland				
NORDLB MTN 00/30 VAR 1-6	XS0113243397	4,283	0	100
Anleihen auf US-Dollar lautend				
Emissionsland USA				
USA 22/27	US91282CFM82	4,125	0	100
USA 22/32	US91282CFF32	2,750	0	100

Wien, im Juli 2023

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“)).