

# **ERSTE ALTERNATIVE EQUITY**

**Miteigentumsfonds gemäß InvFG**

Halbjahresbericht 2023/24

## Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft .....	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.01.2024.....	5

## Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft

<b>Die Gesellschaft</b>	Erste Asset Management GmbH Am Belvedere 1, A-1100 Wien Telefon: 05 0100-19777, Telefax: 05 0100-919777
<b>Stammkapital</b>	2,50 Mio. EURO
<b>Gesellschafter</b>	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 %)
<b>Aufsichtsrät:innen</b>	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 (bis 31.12.2023) Mag. Reinhard WALTL (bis 31.10.2023) Mag. Gerald WEBER vom Betriebsrat entsandt: Martin CECH Mag. Regina HABERHAUER Ing. Heinrich Hubert REINER Peter RIEDERER Nicole WEINHENGST Mag. Manfred ZOUREK
<b>Geschäftsführer:innen</b>	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
<b>Prokurist:innen</b>	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER (bis 31.08.2023) Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER Mag. Magdalena UJWARY, MA (ab 16.08.2023)
<b>Staatskommissär:innen</b>	Mag. Wolfgang EXL Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
<b>Fondsprüfer</b>	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
<b>Depotbank</b>	Erste Group Bank AG

## Sehr geehrte Anteilhaber:innen,

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE ALTERNATIVE EQUITY Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.08.2023 bis 31.01.2024 vorzulegen.

Wir erlauben uns Ihnen mitzuteilen, dass der Fondsname mit 26.12.2023 von Alpha Diversified 3 auf ERSTE ALTERNATIVE EQUITY geändert wurde.

Weiters wurde die Ausgabe und Rücknahme von Fondsanteilen in Artikel 4 der Fondsbestimmungen per 26.12.2023 von wöchentlich auf täglich geändert.

## Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.01.2024	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	37,9	78,06
auf US-Dollar lautend	8,6	17,82
Wertpapiere	46,5	95,88
Devisentermingeschäfte	-0,1	-0,12
Bankguthaben	2,0	4,22
Zinsenansprüche	0,0	0,02
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	48,5	100,00

# Vermögensaufstellung zum 31.01.2024

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.08.2023 bis 31.01.2024)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Investmentzertifikate</b>							
<b>Investmentzertifikate auf Euro lautend</b>							
<b>Emissionsland Irland</b>							
AMU.ALT2-S.GR.EV.DR.EBEOA	IE000QWXD8F2	15.000	0	30.000	104,655	3.139.641,00	6,47
BRF I.B.R.GL.U. D HGDEOA	IE00BNG8NB00	10.000	0	60.000	127,442	7.646.520,00	15,75
BRF I.B.R.GL.U. DEOA	IE00BNG8N985	13.000	10.000	10.000	160,266	1.602.660,00	3,30
LAF.A.-D.ASIA P. B2EOA	IE00BFXZM884	0	0	3.500	2.140,420	7.491.470,00	15,43
Summe Emissionsland Irland						<u>19.880.291,00</u>	<u>40,96</u>
<b>Emissionsland Luxemburg</b>							
AQR II-S.S.PR.GL EQ.B1EO	LU1285432289	25.000	0	25.000	179,140	4.478.500,00	9,23
BLACK.EUR.OPPO.EXT.D2 EO	LU0418791066	6.500	0	6.500	633,140	4.115.410,00	8,48
BLACKR.ST.AS.P.ABS.R.D2EO	LU1495982602	35.000	0	35.000	140,460	4.916.100,00	10,13
JPM-EEAA JPMEEAA CPAEO	LU1001748398	0	5.750	30.000	149,980	4.499.400,00	9,27
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>18.009.410,00</u>	<u>37,10</u>
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						<u>37.889.701,00</u>	<u>78,06</u>
<b>Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend</b>							
<b>Emissionsland Luxemburg</b>							
FAST-GLOBAL FUND I A DL	LU0966156555	32.000	0	32.000	292,910	8.649.582,43	17,82
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>8.649.582,43</u>	<u>17,82</u>
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,08365						<u>8.649.582,43</u>	<u>17,82</u>
Summe Investmentzertifikate						<u>46.539.283,43</u>	<u>95,88</u>
<b>Devisentermingeschäfte</b>						<b>nicht realisiertes Ergebnis in EUR</b>	
<b>Devisentermingeschäfte auf Euro lautend</b>							
<b>Emissionsland Österreich</b>							
FXF SPEST EUR/USD 10.04.2024	FXF_TAX_3467420			9.154.592		-48.034,05	-0,10
FXF SPEST EUR/USD 10.04.2024	FXF_TAX_3467478			-2.766.397		-5.462,92	-0,01
FXF SPEST EUR/USD 10.04.2024	FXF_TAX_3467488			-2.765.380		-4.452,89	-0,01
Summe Emissionsland Österreich						<u>-57.949,86</u>	<u>-0,12</u>
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend						<u>-57.949,86</u>	<u>-0,12</u>
Summe Devisentermingeschäfte						<u>-57.949,86</u>	<u>-0,12</u>

## ERSTE ALTERNATIVE EQUITY

### Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	46.539.283,43	95,88
Devisentermingeschäfte	-57.949,86	- 0,12
Bankguthaben	2.048.668,44	4,22
Zinsenansprüche	8.033,51	0,02
Sonstige Abgrenzungen	-660,61	- 0,00
Fondsvermögen	48.537.374,91	100,00

### Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A0SED8	Stück	115.007,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A0SED8	EUR	127,79
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A0SECO	Stück	159.178,265
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A0SECO	EUR	115,77
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A38148	Stück	3.575,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A38148	EUR	101,57
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0SFS3	Stück	104.792,589
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0SFS3	EUR	128,72
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0SFR5	Stück	13.057,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0SFR5	EUR	119,37

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 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**

<b>Wertpapier-Bezeichnung</b>	<b>Kenn- nummer</b>	<b>Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)</b>	<b>Verkäufe/ Abgänge</b>
<b>Investmentzertifikate</b>			
<b>Investmentzertifikate auf Euro lautend</b>			
<b>Emissionsland Frankreich</b>			
LAZARD CONVERT.GBL PCH-EO	FR0013185535	0	2.800
<b>Emissionsland Luxemburg</b>			
AB S.I-S.ABS.ALPH.P.IAEOH	LU0736560011	0	200.000
BNPPIC-E1D IC	LU0094219127	19.996	19.996
JPML-E.S.M.M.V. JPWEOA	LU2095451287	475	475
L.MW-LMWTEF BEOA	LU2367661365	0	45.000
LUMYNA-BOFA MLCX CA.B5 EO	LU1057468578	0	30.000
NORDEA1-ALP.15 MA F.BIEO	LU0607983383	0	70.000

Wien, im Februar 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“)).