

CORE Dynamic

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.12.2022.....	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. - ab 21.09.2022) Radovan JELASITY Mag. Ertan PISKIN (ab 10.10.2022) Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER (bis 21.09.2022) Gabriele SEMMELROCK-WERZER Mag. Reinhard WALTL 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 (ab 01.09.2022) 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 CORE Dynamic Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 31.12.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.12.2022	
	Mio. Euro	%
Indexzertifikate		
auf Euro lautend	4,8	5,10
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	89,1	93,80
Wertpapiere	93,9	98,90
Devisentermingeschäfte	0,3	0,27
Bankguthaben	0,8	0,84
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	95,0	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.07.2022 bis 31.12.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere							
Indezertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Jersey							
WISDOMTREE.HMS.Z12/UN.XAU	JE00B8DFY052	478.000	16.000	462.000	10,489	4.845.918,00	5,10
Summe Emissionsland Jersey						4.845.918,00	5,10
Summe Indezertifikate auf Euro lautend						4.845.918,00	5,10
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere						4.845.918,00	5,10
Investmentzertifikate							
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Irland							
VANG.IN.S.-GL.ST.I.EOA	IE00B03HD191	26.000	0	405.000	34,473	13.961.686,50	14,70
Summe Emissionsland Irland						13.961.686,50	14,70
Emissionsland Luxemburg							
AIS-A.IN.MSCI E.M.IECAPEO	LU0996175948	300	100	3.060	1.489,040	4.556.462,40	4,80
SS WO.ESG SC.IN.EQ.FD.IEO	LU1159235107	67.000	38.000	724.000	19,249	13.936.493,20	14,67
Summe Emissionsland Luxemburg						18.492.955,60	19,47
Emissionsland Österreich							
CORE EQUIT. EUR R01 T	AT0000A2GK86	1.000	0	111.400	126,480	14.089.872,00	14,83
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	1.100	1.800	28.700	128,600	3.690.820,00	3,89
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	0	11.100	166,970	1.853.367,00	1,95
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	14.400	139,610	2.010.384,00	2,12
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	3.000	0	41.800	139,110	5.814.798,00	6,12
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224	2.000	0	37.300	149,830	5.588.659,00	5,88
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	18.000	0	18.000	132,920	2.392.560,00	2,52
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	3.200	3.400	41.300	171,490	7.082.537,00	7,46
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	14.000	0	34.000	111,390	3.787.260,00	3,99
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	18.000	4.000	96.600	107,010	10.337.166,00	10,88
Summe Emissionsland Österreich						56.647.423,00	59,63
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						89.102.065,10	93,80
Summe Investmentzertifikate						89.102.065,10	93,80

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Devisentermingeschäfte				
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
FXF SPEST EUR/USD 20.01.2023	FXF_TAX_3462448	3.501.174	256.357,76	0,27
FXF SPEST EUR/USD 20.01.2023	FXF_TAX_3463194	466.938	-1.253,86	-0,00
		Summe Emissionsland Österreich	255.103,90	0,27
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	255.103,90	0,27
		Summe Devisentermingeschäfte	255.103,90	0,27

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		93.947.983,10	98,90
Devisentermingeschäfte		255.103,90	0,27
Bankguthaben		794.019,86	0,84
Zinsenansprüche		87,84	0,00
Sonstige Abgrenzungen		-2.846,46	-0,00
Fondsvermögen		94.994.348,24	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000828629	Stück	417.617,647
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000828629	EUR	94,82
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000828637	Stück	331.107,109
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000828637	EUR	167,30

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	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Amtlich gehandelte Wertpapiere			
Indezertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Jersey			
WISDOMTREE.HMS.Z12/UN.XAU	DE000A1RX996	60.000	478.000
Investmentzertifikate			
Investmentzertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Irland			
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBCS90	0	9.000
Emissionsland Österreich			
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZR9	0	4.200

Wien, im Jänner 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“)).