

CORE Balanced

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.12.2023.....	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 (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
Geschäftsführer	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
Prokuristen	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)
Staatskommissäre	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 CORE Balanced Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.07.2023 bis 31.12.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.12.2023	
	Mio. Euro	%
Indexzertifikate		
auf Euro lautend	2,6	2,44
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	100,8	95,67
Wertpapiere	103,4	98,11
Devisentermingeschäfte	0,1	0,09
Bankguthaben	1,9	1,80
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	105,4	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.07.2023 bis 31.12.2023)

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	0	236.000	222.000	11,594	2.573.868,00	2,44	
						Summe Emissionsland Jersey	2.573.868,00	2,44
						Summe Indezertifikate auf Euro lautend	2.573.868,00	2,44
						Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere	2.573.868,00	2,44
Investmentzertifikate								
Investmentzertifikate auf Euro lautend								
Emissionsland Irland								
JPM-GLOBAL REI EQ A	IE00BF4G6Y48	247.000	0	247.000	38,590	9.531.730,00	9,04	
						Summe Emissionsland Irland	9.531.730,00	9,04
Emissionsland Luxemburg								
AIS-A.IN.MSCI E.M.IECAPEO	LU0996175948	4.800	2.100	16.100	156,490	2.519.489,00	2,39	
BNPPIC-E1D IC	LU0094219127	44.977	22.976	22.001	141,670	3.116.846,73	2,96	
GS-AS.HY BD IHEOD	LU2358798911	0	2.500	35.000	59,810	2.093.350,00	1,99	
						Summe Emissionsland Luxemburg	7.729.685,73	7,33
Emissionsland Österreich								
ABWEBDEMGLIFIA R01EOT	AT0000A38GM7	38.000	0	38.000	0,000	0,00	0,00	
CORE EQUIT. EUR R01 T	AT0000A2GK86	19.000	0	100.000	155,090	15.509.000,00	14,72	
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	1.000	38.000	136,100	5.171.800,00	4,91	
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	0	15.300	173,680	2.657.304,00	2,52	
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	18.200	148,990	2.711.618,00	2,57	
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	29.500	0	64.500	153,220	9.882.690,00	9,38	
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224	16.000	2.600	81.000	161,400	13.073.400,00	12,41	
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	0	0	22.500	110,300	2.481.750,00	2,35	
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	7.500	7.000	280.000	114,560	32.076.800,00	30,44	
						Summe Emissionsland Österreich	83.564.362,00	79,29
						Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	100.825.777,73	95,67
						Summe Investmentzertifikate	100.825.777,73	95,67

CORE Balanced

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 25.01.2024	FXF_TAX_3466445	2.311.057	94.929,10	0,09
		Summe Emissionsland Österreich	94.929,10	0,09
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	94.929,10	0,09
		Summe Devisentermingeschäfte	94.929,10	0,09

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			103.399.645,73	98,11
Devisentermingeschäfte			94.929,10	0,09
Bankguthaben			1.894.284,81	1,80
Zinsenansprüche			242,02	0,00
Sonstige Abgrenzungen			-1.804,34	-0,00
Fondsvermögen			105.387.297,32	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000828603	Stück	449.942,770
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000828603	EUR	106,11
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000828611	Stück	300.826,336
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000828611	EUR	191,61

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

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate				
Investmentzertifikate auf Euro lautend				
Emissionsland Luxemburg				
SS-WORLD SCR.IDX EF IEO	LU1159235107		0	568.000
Emissionsland Österreich				
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772		0	19.000
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491		0	29.500

Wien, im Jänner 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“)).