

CORE Balanced

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 Balanced Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.07.2022 bis 31.12.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.12.2022	
	Mio. Euro	%
Indezertifikate		
auf Euro lautend	5,2	5,23
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	94,2	94,13
Wertpapiere	99,4	99,37
Devisentermingeschäfte	0,2	0,20
Bankguthaben	0,4	0,44
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	100,0	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	513.000	14.000	499.000	10,489	5.234.011,00	5,23
Summe Emissionsland Jersey						5.234.011,00	5,23
Summe Indezertifikate auf Euro lautend						5.234.011,00	5,23
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere						5.234.011,00	5,23
Investmentzertifikate							
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Luxemburg							
AIS-A.IN.MSCI E.M.IECAPEO	LU0996175948	0	0	1.700	1.489,040	2.531.368,00	2,53
SS WO.ESG SC.IN.EQ.FD.IEO	LU1159235107	26.000	83.000	623.000	19,249	11.992.313,90	11,99
Summe Emissionsland Luxemburg						14.523.681,90	14,52
Emissionsland Österreich							
CORE EQUIT. EUR R01 T	AT0000A2GK86	3.500	0	78.000	126,480	9.865.440,00	9,86
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	3.500	38.000	128,600	4.886.800,00	4,88
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	0	15.900	166,970	2.654.823,00	2,65
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	18.200	139,610	2.540.902,00	2,54
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	3.100	1.200	55.000	139,110	7.651.050,00	7,65
ERSTE BD EURO CORP.R01TEO	AT0000724224	1.100	0	84.600	149,830	12.675.618,00	12,67
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	19.000	0	19.000	132,920	2.525.480,00	2,52
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	2.500	16.000	44.000	171,490	7.545.560,00	7,54
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	44.000	0	44.000	111,390	4.901.160,00	4,90
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	26.200	5.500	228.000	107,010	24.398.280,00	24,39
Summe Emissionsland Österreich						79.645.113,00	79,62
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						94.168.794,90	94,13
Summe Investmentzertifikate						94.168.794,90	94,13
Devisentermingeschäfte						nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							
Emissionsland Österreich							
FXF SPEST EUR/USD 20.01.2023	FXF_TAX_3462447			2.778.710		203.458,55	0,20
FXF SPEST EUR/USD 20.01.2023	FXF_TAX_3463192			2.241.302		-6.018,52	-0,01
Summe Emissionsland Österreich						197.440,03	0,20
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend						197.440,03	0,20
Summe Devisentermingeschäfte						197.440,03	0,20

CORE Balanced

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	99.402.805,90	99,37
Devisentermingeschäfte	197.440,03	0,20
Bankguthaben	438.370,42	0,44
Zinsenansprüche	50,19	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-1.420,53	-0,00
Fondsvermögen	100.037.246,01	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000828603	Stück	457.947,816
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000828603	EUR	99,57
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000828611	Stück	309.119,885
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000828611	EUR	176,11

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	32.000	513.000
Investmentzertifikate			
Investmentzertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Frankreich			
AMU.EO LI.SH.TE.SRI C	FR0007435920	0	15
Emissionsland Irland			
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBCS90	0	10.500
Emissionsland Österreich			
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZR9	0	5.000

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“)).