

# **ERSTE MORTGAGE**

**Miteigentumsfonds gemäß InvFG**

Halbjahresbericht 2022

## Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft .....	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.10.2022.....	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>Aufsichtsrat</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. - 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
<b>Geschäftsführer</b>	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
<b>Prokuristen</b>	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
<b>Staatskommissäre</b>	Mag. Wolfgang EXL (ab 01.09.2022) Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ Mag. Wolfgang TRISKO (bis 14.05.2022)
<b>Fondsprüfer</b>	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
<b>Depotbank</b>	Erste Group Bank AG

## Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE MORTGAGE Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.05.2022 bis 31.10.2022 vorzulegen.

## Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.10.2022	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf US-Dollar lautend	1,3	1,91
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	1,6	2,41
US pool		
auf US-Dollar lautend	60,8	91,29
Wertpapiere	63,7	95,61
Devisentermingeschäfte	0,2	0,34
Bankguthaben	2,5	3,78
Zinsenansprüche	0,2	0,27
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	66,6	100,00

# Vermögensaufstellung zum 31.10.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.05.2022 bis 31.10.2022)

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
<b>Investmentzertifikate</b>								
<b>Investmentzertifikate auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Österreich</b>								
ERSTE ALPHA 1 T	AT0000A03DF2		358	12.481	7.259	55,580	403.455,22	0,61
ERSTE ALPHA 2 T	AT0000A05F50		912	26.622	15.351	78,410	1.203.671,91	1,81
							<b>1.607.127,13</b>	<b>2,41</b>
							<b>1.607.127,13</b>	<b>2,41</b>
							<b>1.607.127,13</b>	<b>2,41</b>
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland USA</b>								
USA 21/28	US91282CBJ99	0,750	6.400	12.900	1.500	83,535	1.269.209,76	1,91
							<b>1.269.209,76</b>	<b>1,91</b>
							<b>1.269.209,76</b>	<b>1,91</b>
							<b>1.269.209,76</b>	<b>1,91</b>
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>								
<b>US pool auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland USA</b>								
GNMA 20/50 POOL MA6600	US36179VKM18	3,500	0	0	9.000	90,809	2.510.772,84	3,77
GNMA 20/50 POOL MA6766	US36179VQT07	3,000	0	0	13.000	88,028	4.745.431,99	7,13
GNMA 20/50 POOL MA6820	US36179VSH41	3,000	0	0	15.000	88,012	5.954.311,43	8,94
GNMA 20/50 POOL MA6821	US36179VSJ07	3,500	0	10.000	5.000	90,774	1.952.202,36	2,93
GNMA 20/50 POOL MA6822	US36179VSK79	4,000	0	5.000	15.000	93,795	5.158.296,23	7,75
GNMA 20/50 POOL MA6865	US36179VTW09	2,500	0	15.000	10.000	85,560	5.050.721,65	7,58
GNMA 2034 POOL 629888	US36291JXR66	5,000	0	0	3	101,358	397,27	0,00
GNMA 2045 POOL MA2757	US36179RB242	5,000	0	0	4.500	100,507	485.112,99	0,73
GNMA 2045 POOL MA3035	US36179RLQ01	4,000	0	0	14.000	94,118	1.329.139,02	2,00
GNMA 2045 POOL MA3108	US36179RNZ81	5,000	0	0	3.000	100,122	338.291,56	0,51
GNMA 2045 POOL MA3173	US36179RQ281	3,500	0	0	15.000	91,717	1.882.717,05	2,83
GNMA 2046 POOL MA3663	US36179SB893	3,500	0	0	21.000	91,463	3.011.582,54	4,52
GNMA 2047 POOL MA4512	US36179TAM71	4,500	0	0	15.000	96,555	1.769.827,10	2,66
GNMA 21/51 POOL MA7136	US36179V4V97	2,500	0	0	15.000	85,560	8.778.951,32	13,18
GNMA 21/51 POOL MA7366	US36179WFF05	2,000	0	8.000	7.000	82,640	4.912.071,99	7,38

## ERSTE MORTGAGE

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
GNMA 21/51 POOL MA7471	US36179WJQ24	2,000	0	5.000	11.000	82,577	8.055.808,94	12,10
GNMA 22/52 POOL MA8268	US36179XFH44	4,500	2.500	0	2.500	94,998	2.400.759,25	3,60
GNMA 22/52 POOL MA8269	US36179XFJ00	5,000	2.500	0	2.500	97,401	2.461.026,41	3,70
Summe Emissionsland USA							60.797.421,94	91,29
Summe US pool auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,98725							60.797.421,94	91,29
Summe Nicht notierte Wertpapiere							60.797.421,94	91,29

### Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes  
Ergebnis in EUR

#### Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

##### Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/USD 15.12.2022	FXF_TAX_3462503				63.058.350		243.007,33	0,36
FXF SPEST EUR/USD 15.12.2022	FXF_TAX_3462554				-1.018.709		-8.807,79	-0,01
FXF SPEST EUR/USD 15.12.2022	FXF_TAX_3462655				1.000.882		-8.990,64	-0,01
Summe Emissionsland Österreich							225.208,90	0,34
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							225.208,90	0,34
Summe Devisentermingeschäfte							225.208,90	0,34

#### Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere							63.673.758,83	95,61
Devisentermingeschäfte							225.208,90	0,34
Bankguthaben							2.517.150,42	3,78
Zinsenansprüche							182.732,98	0,27
Sonstige Abgrenzungen							-2.241,58	-0,00
Fondsvermögen							66.596.609,55	100,00

#### Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000700778	Stück	84.612,834
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000700778	EUR	73,80
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y968	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y968	EUR	85,08
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y976	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y976	EUR	85,59
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000700786	Stück	475.988,553
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000700786	EUR	117,75
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y984	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y984	EUR	86,11
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000658984	Stück	8.637,466
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000658984	EUR	133,94

Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y992	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y992	EUR	86,77
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9A6	Stück	35.799,626
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9A6	EUR	87,80
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9B4	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9B4	CZK	2.116,25
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9C2	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9C2	HUF	35.133,89

Der Poolfaktor gilt als Maß für Teiltilgungen von Anleihen, der das Verhältnis der noch nicht getilgten Summe zum unverändert bleibenden Nominalwert angibt.

Zu Beginn hat der Poolfaktor den Wert 1, der bis zur ersten Teiltilgung steigt und sich ab Tilgungsbeginn entsprechend der Tilgungsbedingungen reduziert, bis er am Ende den Wert 0 hat.

Folgender Poolfaktor ist für die Kurswertermittlung relevant:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Poolfaktor	Kurswert in EUR
GNMA 20/50 POOL MA6600	US36179VKM18	0,30329	2.510.772,84
GNMA 20/50 POOL MA6766	US36179VQT07	0,40939	4.745.431,99
GNMA 20/50 POOL MA6820	US36179VSH41	0,44527	5.954.311,43
GNMA 20/50 POOL MA6821	US36179VSJ07	0,42464	1.952.202,36
GNMA 20/50 POOL MA6822	US36179VSK79	0,36196	5.158.296,23
GNMA 20/50 POOL MA6865	US36179VTW09	0,58279	5.050.721,65
GNMA 2034 POOL 629888	US36291JXR66	0,12847	397,27
GNMA 2045 POOL MA2757	US36179RB242	0,10589	485.112,99
GNMA 2045 POOL MA3035	US36179RLQ01	0,09959	1.329.139,02
GNMA 2045 POOL MA3108	US36179RNZ81	0,11119	338.291,56
GNMA 2045 POOL MA3173	US36179RQ281	0,13510	1.882.717,05
GNMA 2046 POOL MA3663	US36179SB893	0,15479	3.011.582,54
GNMA 2047 POOL MA4512	US36179TAM71	0,12064	1.769.827,10
GNMA 21/51 POOL MA7136	US36179V4V97	0,67532	8.778.951,32
GNMA 21/51 POOL MA7366	US36179WFF05	0,83831	4.912.071,99
GNMA 21/51 POOL MA7471	US36179WJQ24	0,87555	8.055.808,94
GNMA 22/52 POOL MA8268	US36179XFH44	0,99798	2.400.759,25
GNMA 22/52 POOL MA8269	US36179XFJ00	0,99779	2.461.026,41

---

## ERSTE MORTGAGE

---

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**

<b>Wertpapier-Bezeichnung</b>	<b>Kenn- nummer</b>	<b>Zinssatz</b>	<b>Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)</b>	<b>Verkäufe/ Abgänge</b>
-------------------------------	-------------------------	-----------------	--	------------------------------

#### **In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere**

##### **Anleihen auf US-Dollar lautend**

###### **Emissionsland USA**

USA 22/32	US91282CDY49	1,875	4.000	4.000
USA 22/32	US91282CFF32	2,750	2.500	2.500

##### **Nicht notierte Wertpapiere**

##### **US pool auf US-Dollar lautend**

###### **Emissionsland USA**

GNMA 20/50 POOL MA6764	US36179VQR41	2,000	0	15.000
GNMA 20/50 POOL MA6866	US36179VTX81	3,000	0	20.000
GNMA 20/50 POOL MA7052	US36179VZR40	2,500	0	25.000

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
GNMA 2033 POOL 615412	US36290RVD24	5,500	0	3.083
GNMA 2034 POOL 003499	US36202D3G46	5,000	0	5.000
GNMA 2034 POOL 605389	US36200NRJ27	5,000	0	4.246
GNMA 2035 POOL 521287	US36211SCY19	4,500	0	3.185
GNMA 2039 POOL 701960	US36296UZZ64	4,500	0	4.500
GNMA 2039 POOL 710907	US36297FYC03	4,500	0	2.071
GNMA 2039 POOL 782716	US36241LAR78	5,000	0	5.000
GNMA 2041 POOL 751946	US36230LET26	4,000	0	7.492
GNMA 2041 POOL 759183	US36230UFY01	3,500	0	3.305
GNMA 2041 POOL 783261	US36241LTS50	4,500	0	1.000
GNMA 2041 POOL 783307	US36241LU870	4,000	0	1.000
GNMA 2041 POOL AM1088	US36184LF592	4,500	0	1.000
GNMA 2042 POOL AA5085	US36178CUJ07	3,500	0	2.853
GNMA 2043 POOL AF0490	US36181FRK92	3,000	0	2.229
GNMA 2043 POOL AF5077	US36181LUA42	3,500	0	1.900
GNMA 2044 POOL MA1997	US36179QGE52	4,500	0	8.000
GNMA 2044 POOL MA2227	US36179QPL94	5,500	0	1.000
GNMA 2044 POOL MA2446	US36179QWF44	4,000	0	15.000
GNMA 2045 POOL AL2705	US36183YAE86	4,000	0	2.030
GNMA 2045 POOL AL5265	US36184BZ674	3,500	0	971
GNMA 2045 POOL AM4138	US36184QS396	4,000	0	1.149
GNMA 2045 POOL AM8511	US36185BN446	3,500	0	1.000
GNMA 2045 POOL AN5419	US36186NAU37	4,000	0	3.000
GNMA 2045 POOL AO7289	US3617A8C239	3,000	0	1.000
GNMA 2045 POOL MA3033	US36179RLN79	3,000	0	15.000
GNMA 2045 POOL MA3034	US36179RLP28	3,500	0	17.000
GNMA 2045 POOL MA3105	US36179RNW50	3,500	0	15.000
GNMA 2045 POOL MA3106	US36179RNX34	4,000	0	10.000
GNMA 2045 POOL MA3107	US36179RNY17	4,500	0	10.000
GNMA 2045 POOL MA3310	US36179RVB22	3,500	0	10.000
GNMA 2046 POOL MA3738	US36179SEK96	4,500	0	10.000
GNMA 2046 POOL MA3873	US36179SJS77	3,000	0	20.000
GNMA 2047 POOL MA4452	US36179S5M51	4,000	0	5.000
GNMA 2047 POOL MA4510	US36179TAK16	3,500	0	8.000
GNMA 2047 POOL MA4652	US36179TEZ49	3,500	0	9.000

Wien, im November 2022

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“)).