

# **ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME**

**Miteigentumsfonds gemäß InvFG**

Halbjahresbericht 2022

## Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft .....	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.09.2022 .....	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) Anteilsinhaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.04.2022 bis 30.09.2022 vorzulegen.

## Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.09.2022	
	Mio. Euro	%
<b>Anleihen</b>		
auf Euro lautend	17,8	75,47
auf Schweizer Franken lautend	0,5	2,17
auf Tschechische Kronen lautend	1,0	4,04
auf Ungarische Forint lautend	0,4	1,78
auf US-Dollar lautend	0,3	1,30
<b>Indezertifikate</b>		
auf Euro lautend	0,0	0,15
<b>Investmentzertifikate</b>		
auf Euro lautend	0,4	1,71
<b>Wandelschuldverschreibung</b>		
auf Euro lautend	0,1	0,44
auf Hongkong-Dollar lautend	0,2	1,02
auf US-Dollar lautend	0,7	2,89
<b>Wertpapiere</b>	21,5	90,98
Devisentermingeschäfte	0,0	0,00
Financial Futures	0,2	0,94
Bankguthaben	1,6	6,75
Zinsenansprüche	0,3	1,34
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,01
<b>Fondsvermögen</b>	<b>23,6</b>	<b>100,00</b>

# Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.04.2022 bis 30.09.2022)

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>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Irland</b>								
AIB GROUP 19/29 FLR MTN	XS2080767010	1,875	0	0	500	90,170	450.849,99	1,91
Summe Emissionsland Irland							<u>450.849,99</u>	<u>1,91</u>
<b>Emissionsland Italien</b>								
ENEL 21/UND. FLR	XS2312744217	1,375	0	0	300	74,011	222.032,41	0,94
ENEL 21/UND. FLR	XS2312746345	1,875	0	0	300	65,569	196.706,41	0,83
Summe Emissionsland Italien							<u>418.738,82</u>	<u>1,77</u>
<b>Emissionsland Luxemburg</b>								
GR.CTY PROP. 20/UND. FLR	XS2271225281	1,500	0	0	500	70,226	351.132,01	1,49
Summe Emissionsland Luxemburg							<u>351.132,01</u>	<u>1,49</u>
<b>Emissionsland Mazedonien</b>								
NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS	XS1744744191	2,750	0	0	300	90,485	271.454,25	1,15
Summe Emissionsland Mazedonien							<u>271.454,25</u>	<u>1,15</u>
<b>Emissionsland Niederlande</b>								
TEL.EUROPE 21/UND. FLR	XS2293060658	2,375	0	0	500	70,725	353.624,99	1,50
Summe Emissionsland Niederlande							<u>353.624,99</u>	<u>1,50</u>
<b>Emissionsland Österreich</b>								
AT+S AUSTR.T.+S. 22-UND.	XS2432941693	5,000	0	0	100	84,335	84.335,00	0,36
CA IMMO 20/27	XS2099128055	0,875	0	0	200	76,100	152.200,00	0,64
VB WIEN 21/26 MTN	AT000B122080	0,875	0	0	200	87,219	174.438,00	0,74
VIENNA I.GRP 21/36 MTN	AT0000A2QL75	1,000	0	0	600	64,070	384.418,81	1,63
Summe Emissionsland Österreich							<u>795.391,81</u>	<u>3,37</u>
<b>Emissionsland Portugal</b>								
EDP-ENERGIAS 21/81 FLR	PTEDPROM0029	1,875	0	0	300	81,397	244.191,61	1,03
Summe Emissionsland Portugal							<u>244.191,61</u>	<u>1,03</u>
<b>Emissionsland Rumänien</b>								
RCS + RDS 20/28 REGS	XS2107452620	3,250	0	0	300	76,463	229.389,00	0,97
Summe Emissionsland Rumänien							<u>229.389,00</u>	<u>0,97</u>

## ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

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>Emissionsland Senegal</b>								
SENEGAL, REP. 18/28 REGS	XS1790104530	4,750	0	0	300	81,750	245.250,00	1,04
Summe Emissionsland Senegal							245.250,00	1,04
<b>Emissionsland Spanien</b>								
BCO SABADELL 21/31MTN FLR	XS2286011528	2,500	0	0	300	80,000	240.000,00	1,02
BCO SANTAND. 20/30 MTN	XS2247936342	1,625	0	0	300	72,886	218.659,19	0,93
Summe Emissionsland Spanien							458.659,19	1,94
Summe Anleihen auf Euro lautend							3.818.681,67	16,18
<b>Anleihen auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland Cayman Inseln</b>								
YUZH.GR.HLDG 22/23	XS2429784809	7,813	0	0	285	7,157	20.821,16	0,09
Summe Emissionsland Cayman Inseln							20.821,16	0,09
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,97965							20.821,16	0,09
<b>Indezertifikate auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Irland</b>								
WITR MU.AS.I.GOLD ETP2062	IE00B8HGT870		0	0	1.400	25,354	35.495,60	0,15
Summe Emissionsland Irland							35.495,60	0,15
Summe Indezertifikate auf Euro lautend							35.495,60	0,15
<b>Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland Jungfern-Inseln (Britisch)</b>								
ADM AG HLDG 20/23 ZO CV	XS2220527001	0,000	0	0	400	96,350	393.405,81	1,67
Summe Emissionsland Jungfern-Inseln (Britisch)							393.405,81	1,67
Summe Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,97965							393.405,81	1,67
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							4.268.404,24	18,09
<b>Investmentzertifikate</b>								
<b>Investmentzertifikate auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Österreich</b>								
1.RES.BD G.H.Y. R01EOT	AT0000A2DY00		0	0	1.285	91,070	117.024,95	0,50
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZQ1		0	0	2.500	114,620	286.550,00	1,21
Summe Emissionsland Österreich							403.574,95	1,71
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend							403.574,95	1,71
Summe Investmentzertifikate							403.574,95	1,71

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>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>								
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Bulgarien</b>								
BULGARIEN 15/35 MTN	XS1208856341	3,125	0	0	500	79,526	397.628,13	1,68
Summe Emissionsland Bulgarien							<u>397.628,13</u>	<u>1,68</u>
<b>Emissionsland Deutschland</b>								
BAYER AG 2019/2079	XS2077670003	2,375	0	0	100	86,659	86.659,00	0,37
BAYER AG 2019/2079	XS2077670342	3,125	0	0	400	79,755	319.019,99	1,35
BAYWA AG NTS.17/UNBEFR.	XS1695284114	4,250	0	0	200	99,985	199.970,00	0,85
COBA MTN 19/26	DE000CZ40N46	1,125	0	0	300	87,315	261.945,01	1,11
DT. BAHN FIN. 19/UNBEFR.	XS2010039035	0,950	0	0	200	87,997	175.993,61	0,75
DT.BANK FIXED 22/32 SUB.	DE000DL19WN3	4,000	0	0	200	84,785	169.569,60	0,72
HANN RUECK SUB 2019/2039	XS2063350925	1,125	0	0	300	74,790	224.371,19	0,95
HANN RUECK SUB 2021/2042	XS2320745156	1,375	0	0	200	69,981	139.961,59	0,59
HOCHTIEF AG MTN 18/25	DE000A2LQ5M4	1,750	0	0	300	93,725	281.173,64	1,19
INFINEON TECH.19/UNBEFR.	XS2056730323	2,875	0	0	300	91,250	273.750,00	1,16
INFINEON TECH.19/UNBEFR.	XS2056730679	3,625	0	0	300	87,095	261.285,60	1,11
LANXESS SUB.ANL.16/76	XS1405763019	4,500	0	0	300	97,915	293.745,00	1,24
MERCK KGAA SUB.ANL.20/80	XS2218405772	1,625	0	0	300	86,336	259.006,60	1,10
METRO MTN 15/25	XS1203941775	1,500	0	0	250	95,374	238.433,99	1,01
MUENCH.RUECK 18/49	XS1843448314	3,250	0	0	300	87,230	261.690,01	1,11
MUENCH.RUECK 20/41	XS2221845683	1,250	0	0	500	71,323	356.615,98	1,51
VOSSLOH 21/UNBEFR.	DE000A3H2VA6	4,000	0	0	200	92,500	185.000,00	0,78
Summe Emissionsland Deutschland							<u>3.988.190,81</u>	<u>16,90</u>
<b>Emissionsland Finnland</b>								
METSAE BOARD 17-27	FI4000282629	2,750	0	0	300	90,498	271.494,00	1,15
Summe Emissionsland Finnland							<u>271.494,00</u>	<u>1,15</u>
<b>Emissionsland Frankreich</b>								
ELECT.FRANCE 19/UND. FLR	FR0013464922	3,000	0	0	400	72,623	290.492,00	1,23
ENGIE 20/UND. FLR	FR0014000RR2	1,500	0	0	100	76,375	76.375,00	0,32
LA POSTE 18-UND. FLR	FR0013331949	3,125	0	0	300	89,550	268.650,01	1,14
ORANGE 21/UND. FLR MTN	FR0014003B55	1,375	0	0	100	74,500	74.500,00	0,32
TOTALENERG. 21/UND.FLRMTN	XS2290960520	1,625	0	0	300	77,798	233.393,99	0,99
URW 18/UND. FLR	FR0013330537	2,875	0	0	300	77,251	231.753,00	0,98
VEOLIA ENV. 20/UND. FLR	FR00140007L3	2,500	0	0	400	76,356	305.424,01	1,29
WENDEL SE 15-27	FR0012516417	2,500	0	0	300	90,953	272.860,20	1,16
Summe Emissionsland Frankreich							<u>1.753.448,21</u>	<u>7,43</u>

## ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

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>Emissionsland Großbritannien</b>								
BP CAP.MKTS 20/UND FLR	XS2193662728	3,625	0	0	500	80,600	402.999,99	1,71
BRIT.AM.TOBA 21/UND.	XS2391779134	3,000	0	0	700	73,293	513.049,61	2,17
BRIT.TELECOM 20/80 FLR	XS2119468572	1,874	0	0	300	83,500	250.500,00	1,06
SSE 22/UND.FLR	XS2439704318	4,000	250	0	250	87,250	218.125,00	0,92
VODAFONE GRP 18/79 FLR	XS1888179477	3,100	0	0	300	96,000	288.000,00	1,22
Summe Emissionsland Großbritannien							<u>1.672.674,60</u>	<u>7,09</u>
<b>Emissionsland Italien</b>								
ENI 21/UND. FLR	XS2334852253	2,000	0	0	200	77,500	155.000,00	0,66
TERNA R.E.N. 22/UND. FLR	XS2437854487	2,450	0	0	100	76,400	76.400,00	0,32
Summe Emissionsland Italien							<u>231.400,00</u>	<u>0,98</u>
<b>Emissionsland Jersey</b>								
G CITY EUROP 21/UND. FLR	XS2338530467	3,625	0	0	200	50,322	100.644,40	0,43
Summe Emissionsland Jersey							<u>100.644,40</u>	<u>0,43</u>
<b>Emissionsland Kasachstan</b>								
KASACHSTAN 18/28 MTN REGS	XS1901718335	2,375	0	0	800	88,789	710.310,00	3,01
Summe Emissionsland Kasachstan							<u>710.310,00</u>	<u>3,01</u>
<b>Emissionsland Kroatien</b>								
KROATIEN 19/29	XS1843434876	1,125	0	0	500	83,337	416.683,75	1,77
Summe Emissionsland Kroatien							<u>416.683,75</u>	<u>1,77</u>
<b>Emissionsland Niederlande</b>								
DE VOLKSBANK 20/30FLR MTN	XS2202902636	1,750	0	0	200	88,643	177.285,60	0,75
KON.FRIES.C.20/UND.FLR	XS2228900556	2,850	0	0	100	83,875	83.875,00	0,36
NATURGY FIN.21/UND.FLR	XS2406737036	2,374	0	0	300	76,500	229.500,00	0,97
OI EUROPEAN GRP 16/24REGS	XS1405765907	3,125	0	0	300	92,578	277.734,01	1,18
REPSOL INT 20/UND. FLR	XS2186001314	4,247	0	0	300	82,125	246.375,00	1,04
REPSOL INTL F. 15/75 FLR	XS1207058733	4,500	0	0	300	93,659	280.976,99	1,19
TENNET HLDG 20/UND.FLR	XS2207430120	2,374	0	0	200	90,125	180.250,00	0,76
TENNET HOLDING 17/UND.FLR	XS1591694481	2,995	0	0	300	95,885	287.656,20	1,22
VOLKSWAGEN INTL FLR22/UND	XS2342732562	3,748	0	0	200	84,014	168.028,00	0,71
WINTERSHALL 21/UND FLR	XS2286041947	3,000	0	0	500	70,879	354.396,02	1,50
Summe Emissionsland Niederlande							<u>2.286.076,82</u>	<u>9,69</u>
<b>Emissionsland Österreich</b>								
RAIF.BK INTL 20/32FLR MTN	XS2189786226	2,875	0	0	300	78,326	234.979,20	1,00
Summe Emissionsland Österreich							<u>234.979,20</u>	<u>1,00</u>

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>Emissionsland Rumänien</b>								
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	0	0	470	66,081	310.580,70	1,32
Summe Emissionsland Rumänien							310.580,70	1,32
<b>Emissionsland Schweden</b>								
SAMHALLSBYG. 20/UND. FLR	XS2010032618	2,624	0	0	100	43,250	43.250,00	0,18
TELIA CO AB 20/81 FLR	XS2082429890	1,375	0	0	600	85,647	513.879,59	2,18
Summe Emissionsland Schweden							557.129,59	2,36
<b>Emissionsland Schweiz</b>								
CR.SUISSE GR 21/33 MTN	CH0591979627	0,625	0	0	400	59,593	238.372,00	1,01
Summe Emissionsland Schweiz							238.372,00	1,01
<b>Emissionsland Serbien inkl. Kosovo</b>								
SERBIEN 19/29 REGS	XS2015296465	1,500	0	0	125	66,642	83.301,88	0,35
SERBIEN 20/27 REGS	XS2170186923	3,125	0	0	300	81,813	245.437,50	1,04
Summe Emissionsland Serbien inkl. Kosovo							328.739,38	1,39
<b>Emissionsland USA</b>								
BK AMERICA 21/26 FLR MTN	XS2387929834	2,100	0	0	500	98,995	494.975,00	2,10
Summe Emissionsland USA							494.975,00	2,10
Summe Anleihen auf Euro lautend							13.993.326,59	59,29
<b>Anleihen auf Schweizer Franken lautend</b>								
<b>Emissionsland Schweiz</b>								
HOLCIM HELV. 18-UND. FLR	CH0398633724	3,500	0	0	500	98,860	512.652,98	2,17
Summe Emissionsland Schweiz							512.652,98	2,17
Summe Anleihen auf Schweizer Franken lautend umgerechnet zum Kurs von 0,96420							512.652,98	2,17
<b>Anleihen auf Tschechische Kronen lautend</b>								
<b>Emissionsland Tschechische Republik</b>								
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	0	25.000	93,810	954.459,43	4,04
Summe Emissionsland Tschechische Republik							954.459,43	4,04
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 24,57150							954.459,43	4,04

## ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

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>Anleihen auf Ungarische Forint lautend</b>								
<b>Emittent Internationale Finanzkorporation</b>								
INTERN.FIN. 21/23 MTN	XS2404252970	2,750	200.000	0	200.000	88,810	419.831,00	1,78
Summe Emittent Internationale Finanzkorporation							419.831,00	1,78
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 423,07500							419.831,00	1,78
<b>Anleihen auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland Singapur</b>								
MEDCO BELL 20/27 REGS	USY56607AA51	6,375	0	0	350	80,125	286.262,95	1,21
Summe Emissionsland Singapur							286.262,95	1,21
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,97965							286.262,95	1,21
<b>Wandelschuldverschreibung auf Euro lautend</b>								
<b>Emissionsland Österreich</b>								
DO + CO 21/26 CV	AT0000A2N7T2	1,750	0	0	100	103,180	103.180,00	0,44
Summe Emissionsland Österreich							103.180,00	0,44
Summe Wandelschuldverschreibung auf Euro lautend							103.180,00	0,44
<b>Wandelschuldverschreibung auf Hongkong-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland Luxemburg</b>								
CITI G.M.FDG 20/24 MTN CV	XS2133036603	0,000	0	0	2.000	92,600	240.827,55	1,02
Summe Emissionsland Luxemburg							240.827,55	1,02
Summe Wandelschuldverschreibung auf Hongkong-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 7,69015							240.827,55	1,02
<b>Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend</b>								
<b>Emissionsland USA</b>								
JPM.CH.BK 20/23 CV ZO	XS2264505566	0,000	0	0	300	94,245	288.608,18	1,22
Summe Emissionsland USA							288.608,18	1,22
Summe Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,97965							288.608,18	1,22
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							16.799.148,68	71,18

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Derivate</b>				
<b>Financial Futures auf Britische Pfund lautend</b>				
<b>Emissionsland Großbritannien</b>				
LONG GILT FUTURE Dec22	LGRZ22	2	-32.862,35	-0,14
			Summe Emissionsland Großbritannien	-32.862,35 -0,14
			Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,87760	-32.862,35 -0,14
<b>Financial Futures auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Deutschland</b>				
EURO-BOBL FUTURE Dec22	EBOBZ22	-30	96.634,53	0,41
EURO-BUND FUTURE Dec22	FGBLZ22	-5	21.728,00	0,09
EURO-SCHATZ FUT Dec22	FGBSZ22	-46	45.540,00	0,19
			Summe Emissionsland Deutschland	163.902,53 0,69
			Summe Financial Futures auf Euro lautend	163.902,53 0,69
<b>Financial Futures auf Japanische Yen lautend</b>				
<b>Emissionsland Japan</b>				
JPN 10Y BOND(OSE) Dec22	TGB1Z22	-10	11.283,55	0,05
			Summe Emissionsland Japan	11.283,55 0,05
			Summe Financial Futures auf Japanische Yen lautend umgerechnet zum Kurs von 141,79940	11.283,55 0,05
<b>Financial Futures auf US-Dollar lautend</b>				
<b>Emissionsland USA</b>				
US 10YR NOTE (GBT)Dec22	TN1Z22	-20	79.109,89	0,34
			Summe Emissionsland USA	79.109,89 0,34
			Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,97965	79.109,89 0,34
			Summe Derivate	221.433,61 0,94
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
<b>Devisentermingeschäfte auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Österreich</b>				
FXF SPEST EUR/NOK 15.12.2022	FXF_TAX_3462158	-481.400	-14.113,85	-0,06
FXF SPEST EUR/USD 10.11.2022	FXF_TAX_3462006	1.792.207	-40.582,29	-0,17

## ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
FXF SPEST EUR/USD 21.10.2022	FXF_TAX_3461788	-1.152.038	20.448,55	0,09
FXF SPEST EUR/USD 21.10.2022	FXF_TAX_3462157	2.385.739	40.739,03	0,17
	Summe Emissionsland Österreich		6.491,44	0,03
	Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend		6.491,44	0,03

### Devisentermingeschäfte auf US-Dollar lautend

#### Emissionsland Österreich

FXF SPEST USD/NOK 15.12.2022	FXF_TAX_3462159	-466.694	-6.852,55	-0,03
FXF SPEST USD/NOK 15.12.2022	FXF_TAX_3462213	460.897	976,50	0,00
	Summe Emissionsland Österreich		-5.876,05	-0,02
	Summe Devisentermingeschäfte auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 0,97965		-5.876,05	-0,02
	Summe Devisentermingeschäfte		615,39	0,00

### Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere		21.471.127,87	90,98
Devisentermingeschäfte		615,39	0,00
Financial Futures		221.433,62	0,94
Bankguthaben		1.592.137,24	6,75
Zinsenansprüche		316.627,42	1,34
Sonstige Abgrenzungen		-1.260,98	-0,01
Fondsvermögen		23.600.680,56	100,00

### Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A23TX9	Stück	851,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A23TX9	EUR	86,97
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1E176	Stück	263.721,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1E176	EUR	89,20
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A23TY7	Stück	10,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A23TY7	EUR	88,56
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A2A719	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A2A719	EUR	84,11

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
SENEGAL, REP. 18/28 REGS	XS1790104530	1,00000	245.250,00

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.

Der Einsatz von Wertpapierleihegeschäften iSd der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) ist gemäß den Fondsbestimmungen zulässig. Während der Berichtsperiode gab es keine Wertpapierleihegeschäfte.

**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.

---

## ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

---

**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>
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Deutschland</b>				
MAHLE MTN 15/22	XS1233299459	2,375	0	200
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Anleihen auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Großbritannien</b>				
NGG FINANCE 19/82 FLR	XS2010045511	2,125	0	400
<b>Neuemission</b>				
<b>Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend</b>				
<b>Emissionsland Kanada</b>				
LITHIUM AMER 21/27 144A	US53680QAB41	1,750	200	200

Wien, im Oktober 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“)).