

HALBJAHRESBERICHT

Vom 01. Februar 2022 bis 31. Juli 2022

für den

European ABS Fund

Miteigentumsfonds gem. InvFG 2011

Ausschütter: ISIN AT0000648589 (Institutionelle Tranche)

der

MASTERINVEST KAPITALANLAGE GMBH

Landstraßer Hauptstraße 1, Top 27

1030 Wien



AT0000648589

ANGABEN ZUM EUROPEAN ABS FUND

ANTEILSGATTUNGEN

Ausschütter / AT0000648589 / Institutionelle Tranche

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

MASTERINVEST Kapitalanlage GmbH, Landstraßer Hauptstraße 1, Top 27, 1030 Wien, Österreich

DEPOTBANK / VERWAHRSTELLE

Hypo Vorarlberg Bank AG, Hypo-Passage 1, 6900 Bregenz, Österreich

FONDSMANAGEMENTGESELLSCHAFT

DWS International GmbH, Mainzer Landstrasse 11 - 17, 60329 Frankfurt am Main, Deutschland

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten der Taxonomie-Verordnung.

		BEGINN HALBJAHR	ENDE HALBJAHR
FONDSVERMÖGEN IN EUR		12.264.272,98	10.847.190,31
ERRECHNETER WERT JE ANTEIL IN EUR			
Ausschütter (I)	AT0000648589	106.119,87	102.748,80
ANTEILE IM UMLAUF			
Ausschütter (I)	AT0000648589	115,5700	105,5700

European ABS Fund

MASTERINVEST Kapitalanlage GmbH | Landstraßer Hauptstraße 1, Top 27 | 1030 Wien | T: +43 1 533 76 68-0
office@masterinvest.at | www.masterinvest.at | FN 80746w | Handelsgericht Wien | UID: ATU 56163724

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31. Juli 2022
EINSCHLIESSLICH VERÄNDERUNGEN IM WERTPAPIERVERMÖGEN VOM 01. Februar 2022 BIS 31. Juli 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Wkg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum		Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bestandspositionen								EUR	9.980.750,29	92,01
Börsennotierte Wertpapiere								EUR	8.531.295,29	78,65
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	8.531.295,29	78,65
0,0000 % BANCAJA 8 Fondo de TDA EO-FLR Bonos 2005(37) Cl.A	ES0312887005		EUR	334,00	-	62	%	98,67	330.002,77	3,04
0,7070 % BP Mortgages S.r.l. 2007-2 EO-FLR Notes 2007(44) Cl.C	IT0004239395		EUR	500,00	-	-	%	97,93	489.629,00	4,51
0,1030 % BPCE Home Loans FCT 2020 EO-FLR Notes 2020(25/54) Cl.A	FR0013531175		STK	3,05	-	-	EUR	100.819,80	307.175,65	2,83
0,6380 % Brignole CO 2021-1 S.r.l. EO-FLR Nts 2021(24/36) Cl.C	IT0005451924		EUR	500,00	-	-	%	97,11	485.553,00	4,48
0,0000 % Cordusio RMBS - UCFin S.r.l. EO-FLR Nts 2006(23/42) Cl.C	IT0004144934		EUR	500,00	-	-	%	99,31	496.570,50	4,58
0,0000 % Euromax V ABS PLC EO-FLR Comb.Nts 2006(11/95) D2	XS0274619211		EUR	4.000,00	-	-	%	0,00	4,00	0,00
0,4190 % F.T. -RMBS Prado VII- EO-FLR Nts 2020(25/55) Cl.A	ES0305508006		EUR	648,00	-	52	%	99,05	641.634,20	5,92
0,5780 % Finance Ireland RMBS No.3 DAC EO-FLR Notes 21(24/61) A Reg.S	XS2345322940		EUR	541,77	-	22	%	99,00	536.333,74	4,94
0,9720 % FT-Sant.Cons.Spain Auto 2021-1 EO-FLR Notes 2021(35) Cl.C	ES0305599021		EUR	500,00	-	-	%	94,78	473.916,94	4,37
0,7480 % FTA - Hipocat 7 EO-FLR Bonds 2004(36) Cl.D	ES0345783049		EUR	247,00	-	-	%	91,21	224.949,85	2,07
0,0000 % Great Hall Mtg.No.1 PLC S.07-1 EO-FLR MTN 07(39) Cl.A2b Reg.S	XS0288627507		EUR	377,43	-	83	%	98,63	372.265,21	3,43
0,0000 % Newgate Funding PLC 2006-3 EO-FLR MTN 2006(50)Cl.Mb Reg.S	XS0272627836		EUR	898,21	-	65	%	88,72	796.889,18	7,35
1,6020 % Palmerston Park CLO DAC EO-FLR Nts 17(30) A2A Reg.S	XS1566961618		EUR	750,00	-	-	%	96,41	723.082,50	6,67
0,0740 % Paragon Mortgages (No. 12) PLC EO-FLR Nts 06(11/38) B1b Reg.S	XS0261648850		EUR	670,81	-	43	%	89,70	601.697,12	5,55
0,0000 % Rural Hipotecario IX F.T.A. EO-FLR Notes 2007(50) Cl.A3	ES0374274027		EUR	1.000,00	-	-	%	91,75	917.544,00	8,46
1,2640 % Sestante Finance 1 S.r.l. EO-FLR Nts 2003(26/40) Cl.C	IT0003604854		EUR	500,00	-	-	%	89,14	445.580,00	4,11
0,9290 % Silver Arrow S.A. (Compart.10) EO-FLR Notes 2019(27.27) Cl.C	XS2015251288		EUR	500,00	-	-	%	99,67	498.358,00	4,59
0,3220 % TDA 19-Mixto F.T.A. EO-FLR Notes 04(18.36) Cl.B	ES0377964012		EUR	189,00	-	-	%	100,27	190.009,63	1,75
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								EUR	1.449.455,00	13,36
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	1.449.455,00	13,36
0,7200 % Adagio V CLO D.A.C. EO-FLR Nts 2021(31)A-R-R Reg.S	XS2312387942		EUR	500,00	-	-	%	97,11	485.550,00	4,48
1,7950 % Cairn CLO VI DAC EO-FLR Nts 2018(29) Cl.B Reg.S	XS1850309896		EUR	500,00	-	-	%	97,77	488.845,00	4,51
1,7000 % CIBC European Fund.CLO I DAC EO-FLR Nts 21(32)Cl.B-1R Reg.S	XS2370636271		EUR	500,00	-	-	%	95,01	475.060,00	4,38
Summe Wertpapiervermögen								EUR	9.980.750,29	92,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	869.002,93	8,01
Bankguthaben								EUR	869.002,93	8,01
EUR - Guthaben bei:										
Hypo Vorarlberg Bank AG			EUR	869.002,93			%	100,00	869.002,93	8,01
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	3.435,01	0,03
Zinsansprüche			EUR	3.435,01					3.435,01	0,03
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-5.997,92	-0,06
Zinsverbindlichkeiten			EUR	-572,02					-572,02	-0,01
Verwaltungsvergütung			EUR	-4.702,44					-4.702,44	-0,04
Verwahrstellenvergütung			EUR	-158,26					-158,26	0,00
Administrationsvergütung			EUR	-565,20					-565,20	-0,01
Fondsvermögen								EUR	10.847.190,31	100,00
Anteilwert								EUR	102.748,80	
Ausgabepreis								EUR	107.886,24	
Anteile im Umlauf								STK	105,5700	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)										92,01
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)										-

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31. Juli 2022

EINSCHLIESSLICH VERÄNDERUNGEN IM WERTPAPIERVERMÖGEN VOM 01. Februar 2022 BIS 31. Juli 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
---------------------	------	-------	---	-----------------------	---	-----------------------	------	--------------------	------------------------------

Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.
Die Bewertung von Vermögenswerten in wenig liquiden Märkten kann von ihren tatsächlichen Veräußerungspreisen abweichen.

Es liegen keine OTC-Derivate zum Stichtag vor.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
---------------------	------	-------------------------------------	--------------------------	-----------------------------	---------------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

1,5000 % CVC Cordatus Loan Fund XI DAC EO-FLR Nts 2021(31) B-1R Reg.S	XS2310127456	EUR	0	750	
---	--------------	-----	---	-----	--

Nichtnotierte Wertpapiere *)

Verzinsliche Wertpapiere

0,9980 % F-E Mortgages S.r.l. EO-FLR MTN 03(22.43) S.1 Cl.C	IT0003575088	EUR	0	500	
---	--------------	-----	---	-----	--

*) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Hinweise:

Der Bericht per Stichtag 31. Juli 2022 berücksichtigt die jüngsten Ereignisse nicht.

Der Ukraine-Russland Konflikt, sowie die internationalen Sanktionen haben weiterhin weitreichende Auswirkungen auf die gesamte Entwicklung der Kapitalmärkte. Die zukünftigen Auswirkungen sind aus derzeitiger Sicht nicht abschätzbar.

In einem Worst Case Szenario kann es bis hin zu einem Totalausfall einzelner Positionen kommen.

Wien, im September 2022

MASTERINVEST Kapitalanlage GmbH
Die Geschäftsführung



DI Andreas Müller



Mag. Georg Rixinger