

ERSTE FIXED INCOME PLUS

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.10.2023.....	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 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(r) Anteilsinhaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE FIXED INCOME PLUS Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.05.2023 bis 31.10.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.10.2023	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	92,2	94,47
auf US-Dollar lautend	2,8	2,89
Wertpapiere	95,1	97,36
Devisentermingeschäfte	0,0	0,00
Financial Futures	0,1	0,09
Bankguthaben	2,5	2,55
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	97,6	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.10.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.05.2023 bis 31.10.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
				Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)			
Investmentzertifikate							
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Frankreich							
LAZARD CONVERT.GBL PCH-EO	FR0013185535	170	0	700	1.727,810	1.209.467,00	1,24
Summe Emissionsland Frankreich						1.209.467,00	1,24
Emissionsland Irland							
AMU.ALT2-A.CHEN.CR.SSIEOA	IE00BL71KB37	0	1.730	33.207	106,540	3.537.916,41	3,62
Summe Emissionsland Irland						3.537.916,41	3,62
Emissionsland Kroatien							
ERSTE E-CONSERVATIVE	HRERSIUCONS9	0	0	10.272	112,177	1.152.315,27	1,18
Summe Emissionsland Kroatien						1.152.315,27	1,18
Emissionsland Luxemburg							
BLUEBAY-GL.SOV.OP.QEOCERF	LU1542978124	0	1.730	31.733	114,570	3.635.649,81	3,72
CARMIG.P.-CREDIT FEOA	LU1932489690	0	1.275	28.985	126,340	3.661.964,90	3,75
DNCA INV.-ALPHA BDS I EO	LU1694789378	3.500	0	28.500	121,480	3.462.180,00	3,55
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	7.500	800	43.200	113,170	4.888.944,00	5,01
F.T.I.F.F.GL.C.S.IACCEOH1	LU1098665802	0	20.000	478.167	14,480	6.923.858,16	7,09
GS US DLLR CRED ICEOHI	LU0803997666	0	205	260	5.558,340	1.445.168,40	1,48
GS-AS.HY BD IHEOD	LU2358798911	3.600	0	46.100	63,080	2.907.988,00	2,98
JUPITER GL.FD-J.DY.B.IEOA	LU0853555893	0	0	293.000	11,910	3.489.630,00	3,57
Summe Emissionsland Luxemburg						30.415.383,27	31,15
Emissionsland Österreich							
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	0	52.724	131,670	6.942.169,08	7,11
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	0	2.000	49.666	164,430	8.166.580,38	8,36
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	0	33.055	135,140	4.467.052,70	4,58
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	7.650	1.150	50.256	145,470	7.310.740,32	7,49
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	0	27.074	26.426	128,190	3.387.548,94	3,47
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	13.000	1.532	69.711	173,270	12.078.824,97	12,37
ERSTE BOND DOLLAR T	AT0000812961	0	23.504	22.126	107,680	2.382.527,68	2,44
ERSTE T.R.FIX.IN.EOIO1TEO	AT0000A1E176	0	2.676	21.015	96,030	2.018.070,45	2,07
T 1750 T	AT0000A04FZ3	10.000	3.000	19.200	105,180	2.019.456,00	2,07

ERSTE FIXED INCOME PLUS

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
T 1851 T	AT0000A0K2C4	0	1.268	24.227	103,070	2.497.076,89	2,56
T 1852 T	AT0000A0K2G5	0	1.136	25.114	99,430	2.497.085,02	2,56
XT BOND EUR PASSIV T	AT0000A0K282	0	1.660	20.240	106,490	2.155.357,60	2,21
Summe Emissionsland Österreich						55.922.490,03	57,28
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						92.237.571,98	94,47

Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend

Emissionsland Luxemburg

ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCDL	LU0880945901	0	0	36.500	81,650	2.819.512,77	2,89
Summe Emissionsland Luxemburg						2.819.512,77	2,89
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05700						2.819.512,77	2,89
Summe Investmentzertifikate						95.057.084,75	97,36

Derivate

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Financial Futures auf Britische Pfund lautend

Emissionsland Großbritannien

LONG GILT FUTURE Dec23	LGR271223			-14		18.984,58	0,02
Summe Emissionsland Großbritannien						18.984,58	0,02
Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,87105						18.984,58	0,02

Financial Futures auf Euro lautend

Emissionsland Deutschland

EURO-BUND FUTURE Dec23	FGBL071223			-11		2.197,58	0,00
Summe Emissionsland Deutschland						2.197,58	0,00
Summe Financial Futures auf Euro lautend						2.197,58	0,00

Financial Futures auf Japanische Yen lautend

Emissionsland Japan

JPN 10Y BOND(OSE) Dec23	TGB1131223			-1		13.930,76	0,01
Summe Emissionsland Japan						13.930,76	0,01
Summe Financial Futures auf Japanische Yen lautend umgerechnet zum Kurs von 160,07740						13.930,76	0,01

Financial Futures auf US-Dollar lautend

Emissionsland USA

US 10YR NOTE (CBT)Dec23	TN1191223			-16		48.878,00	0,05
Summe Emissionsland USA						48.878,00	0,05
Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05700						48.878,00	0,05
Summe Derivate						83.990,92	0,09

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 24.01.2024	FXF_TAX_3466398	2.248.631	4.506,12	0,00
		Summe Emissionsland Österreich	4.506,12	0,00
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	4.506,12	0,00
		Summe Devisentermingeschäfte	4.506,12	0,00

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			95.057.084,75	97,36
Devisentermingeschäfte			4.506,12	0,00
Financial Futures			83.990,92	0,09
Bankguthaben			2.488.211,04	2,55
Zinsenansprüche			4.851,54	0,00
Sonstige Abgrenzungen			-2.998,38	-0,00
Fondsvermögen			97.635.645,99	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A20DF6	Stück	666.783,984
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A20DF6	EUR	86,03
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A20DG4	Stück	422.091,780
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A20DG4	EUR	94,04
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A20DH2	Stück	6.031,366
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A20DH2	EUR	95,49

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	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Investmentzertifikate			
Investmentzertifikate auf Euro lautend			
Emissionsland Österreich			
ERSTE BOND CORPORATE PL.T	AT0000A1PKM0	0	10.458

Wien, im November 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“)).