

ERSTE FIXED INCOME PLUS

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2021

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.10.2021.....	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) Mag.(FH) Thomas SCHAUFLER (Vorsitzender-Stv.) Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER Radovan JELASITY Mag. Robert LASSHOFER Dr. Franz PRUCKNER Mag. Rupert RIEDER 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. Walter MEGNER Mag. Christoph SEEL
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 ERSTE FIXED INCOME PLUS Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.05.2021 bis 31.10.2021 vorzulegen.

Für den 27. Oktober 2021 konnte aufgrund eines technischen Problems die Berechnung des Rechenwerts nicht durchgeführt werden. Daher war die Ausgabe- und Rücknahme von Anteilscheinen vorübergehend ausgesetzt.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.10.2021	
	Mio. Euro	%
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	124,5	93,89
auf US-Dollar lautend	4,9	3,69
Wertpapiere	129,4	97,57
Financial Futures	0,0	0,03
Bankguthaben	2,9	2,20
Dividendenansprüche	0,3	0,20
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	132,6	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.10.2021

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.05.2021 bis 31.10.2021)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentzertifikate							
Investmentzertifikate auf Euro lautend							
Emissionsland Frankreich							
LAZARD CONVERT.GBL PCH-EO	FR0013185535	200	0	950	2.301,580	2.186.501,00	1,65
Summe Emissionsland Frankreich						2.186.501,00	1,65
Emissionsland Irland							
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBCS90	71.200	0	71.200	48,744	3.470.572,80	2,62
LYX CRED F SSIEOA	IE00BL71KB37	44.192	0	44.192	108,331	4.787.403,53	3,61
LYX.NEW.II-L./W.C.F.C.IEO	IE00BZ00NG13	0	0	38.010	124,215	4.721.396,95	3,56
Summe Emissionsland Irland						12.979.373,28	9,79
Emissionsland Luxemburg							
BLUEBAY-GL.SOV.OP.QEOCERF	LU1542978124	2.500	0	49.222	96,210	4.735.648,62	3,57
CANDR.BDS-EM.MKTS VC.EO H	LU0616945100	1.150	0	1.966	1.479,360	2.908.421,76	2,19
CARMIG.P.-CREDIT FEOA	LU1932489690	0	0	34.740	138,300	4.804.542,00	3,62
DWS I.-EO HY CORP. IC	LU1054331407	50.000	0	50.000	116,590	5.829.500,00	4,40
F.T.I.F.GL.C.S.IACCEOH1	LU1098665802	0	0	498.167	18,900	9.415.356,30	7,10
JUPITER GL.FD-J.DY.B.IEOA	LU0853555893	0	0	330.200	14,360	4.741.672,00	3,58
NN(L)-US CREDIT ICEOHI	LU0803997666	0	35	165	7.122,510	1.175.214,15	0,89
Summe Emissionsland Luxemburg						33.610.354,83	25,35
Emissionsland Österreich							
ERS.BD EM GOV.LOC.R01TEO	AT0000A0AUF7	0	44.500	37.314	130,230	4.859.402,22	3,66
ERST.BD CHINA EO R01	AT0000A27ZR9	31.500	0	31.500	110,140	3.469.410,00	2,62
ERSTE BD EM CORP.R01TEO	AT0000A05HR3	2.000	0	104.746	185,750	19.456.569,50	14,67
ERSTE BD EM GOVE.R01TEO	AT0000809165	0	28.000	39.815	171,920	6.844.994,80	5,16
ERSTE BD EU.HI.YI.R01TEO	AT0000805684	8.000	35.000	63.526	160,390	10.188.935,14	7,68
ERSTE BD USA COR.R01TEO	AT0000675772	0	0	17.500	162,240	2.839.200,00	2,14
ERSTE BD USA HY R01TEO	AT0000637491	4.500	0	82.313	198,830	16.366.293,79	12,34
ERSTE BOND CORPORATE PL.T	AT0000A1PKM0	0	0	10.458	114,290	1.195.244,82	0,90
ERSTE MORTGAGE R01TEO	AT0000700786	0	0	23.000	137,650	3.165.950,00	2,39
ERSTE RESERVE EO R01TEO	AT0000724307	0	1.500	2.000	1.265,880	2.531.760,00	1,91
ERSTE T.R.FIX.IN.EOIO1TEO	AT0000A1E176	0	0	23.691	104,150	2.467.417,65	1,86
T 1750 T	AT0000A04FZ3	0	0	10.000	103,350	1.033.500,00	0,78
T 1900 EURR01TEO	AT0000A1BTH1	0	0	13.228	98,200	1.298.989,60	0,98
Summe Emissionsland Österreich						75.717.667,52	57,10
Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend						124.493.896,63	93,89

ERSTE FIXED INCOME PLUS

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Luxemburg							
ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCDL	LU0880945901	29.000	0	64.000	88,370	4.887.172,18	3,69
Summe Emissionsland Luxemburg						4.887.172,18	3,69
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,15725						4.887.172,18	3,69
Summe Investmentzertifikate						129.381.068,81	97,57
Derivate						nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Financial Futures auf Britische Pfund lautend							
Emissionsland Großbritannien							
LONG GILT FUTURE Dec21	LGRZ21			-12		6.214,50	0,00
Summe Emissionsland Großbritannien						6.214,50	0,00
Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,84425						6.214,50	0,00
Financial Futures auf Euro lautend							
Emissionsland Deutschland							
EURO-BUND FUTURE Dec21	FGBLZ21			-6		12.617,64	0,01
Summe Emissionsland Deutschland						12.617,64	0,01
Summe Financial Futures auf Euro lautend						12.617,64	0,01
Financial Futures auf Japanische Yen lautend							
Emissionsland Japan							
JPN 10Y BOND(OSE) Dec21	TGB1Z21			-3		4.853,42	0,00
Summe Emissionsland Japan						4.853,42	0,00
Summe Financial Futures auf Japanische Yen lautend umgerechnet zum Kurs von 131,95545						4.853,42	0,00
Financial Futures auf US-Dollar lautend							
Emissionsland USA							
US 10YR NOTE (CBT)Dec21	TN1Z21			-16		17.714,41	0,01
Summe Emissionsland USA						17.714,41	0,01
Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,15725						17.714,41	0,01
Summe Derivate						41.399,98	0,03

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	129.381.068,81	97,57
Financial Futures	41.399,97	0,03
Bankguthaben	2.920.825,20	2,20
Dividendenansprüche	259.598,74	0,20
Sonstige Abgrenzungen	-5.029,13	-0,00
Fondsvermögen	132.597.863,59	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A20DF6	Stück	813.515,164
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A20DF6	EUR	101,79
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A20DG4	Stück	453.921,004
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A20DG4	EUR	107,52
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A20DH2	Stück	9.037,679
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A20DH2	EUR	108,05

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.

ERSTE FIXED INCOME PLUS

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 Irland			
LYXOR/CHENAVARI CREDI.IEO	IE00BWFBRBY02	0	42.165

Wien, im November 2021

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“)).