

ERSTE MORTGAGE

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 WALTTL (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) Anteilshaber(in),

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

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.10.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf US-Dollar lautend	2,4	3,83
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	1,6	2,52
US pool		
auf US-Dollar lautend	58,2	91,64
Wertpapiere	62,3	97,99
Devisentermingeschäfte	-0,3	-0,48
Bankguthaben	1,4	2,16
Zinsenansprüche	0,2	0,34
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	63,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.10.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.05.2023 bis 31.10.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	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 Österreich									
ERSTE ALPHA 1 T	AT0000A03DF2		215	184	7.210	55,480	400.010,80	0,63	
ERSTE ALPHA 2 T	AT0000A05F50		300	323	15.148	79,100	1.198.206,80	1,89	
							<u>1.598.217,60</u>	<u>2,52</u>	
							Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	<u>1.598.217,60</u>	<u>2,52</u>
							Summe Investmentzertifikate	<u>1.598.217,60</u>	<u>2,52</u>
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere									
Anleihen auf US-Dollar lautend									
Emissionsland USA									
USA 22/32	US91282CFF32	2,750	5.000	8.000	3.000	85,578	2.436.387,90	3,83	
							Summe Emissionsland USA	<u>2.436.387,90</u>	<u>3,83</u>
							Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05375	<u>2.436.387,90</u>	<u>3,83</u>
							Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere	<u>2.436.387,90</u>	<u>3,83</u>
Nicht notierte Wertpapiere									
US pool auf US-Dollar lautend									
Emissionsland USA									
GNMA 20/50 POOL MA6600	US36179VKM18	3,500	0	0	9.000	87,244	1.988.647,20	3,13	
GNMA 20/50 POOL MA6766	US36179VQT07	3,000	0	0	13.000	84,101	3.791.721,66	5,97	
GNMA 20/50 POOL MA6820	US36179VSH41	3,000	0	0	15.000	84,070	4.750.008,94	7,48	
GNMA 20/50 POOL MA6821	US36179VSJ07	3,500	0	0	5.000	87,079	1.528.405,36	2,41	
GNMA 20/50 POOL MA6822	US36179VSK79	4,000	0	0	15.000	89,919	4.111.160,30	6,47	
GNMA 20/50 POOL MA6865	US36179VTW09	2,500	0	0	10.000	81,097	4.049.203,48	6,37	
GNMA 2034 POOL 629888	US36291JXR66	5,000	0	0	3	98,284	329,47	0,00	
GNMA 2045 POOL MA3035	US36179RLQ01	4,000	0	0	14.000	90,652	1.072.769,27	1,69	
GNMA 2045 POOL MA3173	US36179RQ281	3,500	0	0	15.000	88,175	1.512.707,49	2,38	
GNMA 2046 POOL MA3663	US36179SB893	3,500	0	0	21.000	87,821	2.417.643,74	3,80	
GNMA 2047 POOL MA4512	US36179TAM71	4,500	0	0	15.000	93,179	1.434.876,39	2,26	
GNMA 21/51 POOL MA7136	US36179V4V97	2,500	0	0	15.000	81,009	7.051.568,62	11,10	
GNMA 21/51 POOL MA7366	US36179WFF05	2,000	0	0	7.000	78,373	3.998.170,48	6,29	
GNMA 21/51 POOL MA7471	US36179WJQ24	2,000	0	0	9.000	78,323	5.374.044,74	8,46	
GNMA 22/52 POOL MA8268	US36179XFH44	4,500	0	0	5.500	91,433	4.529.983,51	7,13	
GNMA 22/52 POOL MA8428	US36179XLH79	5,000	0	0	3.000	93,765	2.551.086,55	4,02	
GNMA 23/53 POOL MA8878	US36179X2K15	5,000	5.000	0	5.000	93,674	4.395.025,07	6,92	
GNMA 23/53 POOL MA9171	US36179YFL39	5,500	4.000	0	4.000	96,774	3.666.936,95	5,77	
							Summe Emissionsland USA	<u>58.224.289,22</u>	<u>91,64</u>
							Summe US pool auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05375	<u>58.224.289,22</u>	<u>91,64</u>
							Summe Nicht notierte Wertpapiere	<u>58.224.289,22</u>	<u>91,64</u>

ERSTE MORTGAGE

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 15.12.2023	FXF_TAX_3466465	60.325.854	-304.926,32	-0,48
		Summe Emissionsland Österreich	-304.926,32	-0,48
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	-304.926,32	-0,48
		Summe Devisentermingeschäfte	-304.926,32	-0,48

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			62.258.894,72	97,99
Devisentermingeschäfte			-304.926,32	-0,48
Bankguthaben			1.369.964,62	2,16
Zinsenansprüche			216.311,37	0,34
Sonstige Abgrenzungen			-1.597,14	-0,00
Fondsvermögen			63.538.647,25	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000700778	Stück	102.121,359
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000700778	EUR	70,71
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y968	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y968	EUR	82,58
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y976	Stück	668,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1Y976	EUR	82,51
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000700786	Stück	92.897,999
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000700786	EUR	114,10
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y984	Stück	519.773,010
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1Y984	EUR	83,00
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000658984	Stück	7.236,041
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000658984	EUR	129,78
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y992	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y992	EUR	84,21
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9A6	Stück	18.510,402
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9A6	EUR	85,43

Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9B4	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9B4	CZK	2.073,98
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9C2	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1Y9C2	HUF	32.265,05

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	0,26688	1.988.647,20
GNMA 20/50 POOL MA6766	US36179VQT07	0,36545	3.791.721,66
GNMA 20/50 POOL MA6820	US36179VSH41	0,39692	4.750.008,94
GNMA 20/50 POOL MA6821	US36179VSJ07	0,36991	1.528.405,36
GNMA 20/50 POOL MA6822	US36179VSK79	0,32119	4.111.160,30
GNMA 20/50 POOL MA6865	US36179VTW09	0,52614	4.049.203,48
GNMA 2034 POOL 629888	US36291JXR66	0,11728	329,47
GNMA 2045 POOL MA3035	US36179RLQ01	0,08907	1.072.769,27
GNMA 2045 POOL MA3173	US36179RQ281	0,12052	1.512.707,49
GNMA 2046 POOL MA3663	US36179SB893	0,13814	2.417.643,74
GNMA 2047 POOL MA4512	US36179TAM71	0,10818	1.434.876,39
GNMA 21/51 POOL MA7136	US36179V4V97	0,61150	7.051.568,62
GNMA 21/51 POOL MA7366	US36179WFF05	0,76795	3.998.170,48
GNMA 21/51 POOL MA7471	US36179WJQ24	0,80335	5.374.044,74
GNMA 22/52 POOL MA8268	US36179XFH44	0,94922	4.529.983,51
GNMA 22/52 POOL MA8428	US36179XLH79	0,95565	2.551.086,55
GNMA 23/53 POOL MA8878	US36179X2K15	0,98880	4.395.025,07
GNMA 23/53 POOL MA9171	US36179YFL39	0,99821	3.666.936,95

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.

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“)).