

ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.09.2023	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 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 TOTAL RETURN FIXED INCOME Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.04.2023 bis 30.09.2023 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.09.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	14,1	86,08
auf Ungarische Forint lautend	0,5	3,09
auf US-Dollar lautend	0,3	1,90
Indezertifikate		
auf Euro lautend	0,0	0,23
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	0,1	0,36
Wandelschuldverschreibung		
auf Euro lautend	0,1	0,77
auf Hongkong-Dollar lautend	0,2	1,40
auf US-Dollar lautend	0,3	1,70
Wertpapiere	15,7	95,54
Devisentermingeschäfte	0,0	0,07
Financial Futures	0,1	0,38
Bankguthaben	0,4	2,47
Zinsenansprüche	0,3	1,55
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	16,4	100,00

Angaben zur erfolgsbezogenen Vergütung (Performance Fee)

ISIN	Bezeichnung	Währung	absoluter Betrag der berechneten erfolgsabhängigen Vergütung	prozentualer Anteil am NAV zum Stichtag
AT0000A23TX9	ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME A02 R01 EUR	EUR	0,00	0,000
AT0000A1E176	ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME T01 I01 EUR	EUR	0,00	0,000
AT0000A23TY7	ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME T02 R01 EUR	EUR	0,00	0,000
AT0000A2A719	ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME V01 R01 EUR	EUR	0,00	0,000

Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.04.2023 bis 30.09.2023)

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
Amtlich gehandelte Wertpapiere							
Anleihen auf Euro lautend							
Emissionsland Irland							
AIB GROUP 19/29 FLR MTN	XS2080767010	1,875	0	0	500 95,136	475.680,01	2,89
Summe Emissionsland Irland						<u>475.680,01</u>	<u>2,89</u>
Emissionsland Italien							
ENEL 21/UND. FLR	XS2312744217	1,375	0	0	300 82,012	246.036,12	1,50
ENEL 21/UND. FLR	XS2312746345	1,875	0	0	300 73,137	219.412,19	1,34
Summe Emissionsland Italien						<u>465.448,31</u>	<u>2,83</u>
Emissionsland Luxemburg							
GR.CTY PROP. 20/UND. FLR	XS2271225281	1,500	0	0	500 47,118	235.590,99	1,43
Summe Emissionsland Luxemburg						<u>235.590,99</u>	<u>1,43</u>
Emissionsland Niederlande							
TEL.EUROPE 21/UND. FLR	XS2293060658	2,376	0	0	500 78,460	392.300,00	2,39
Summe Emissionsland Niederlande						<u>392.300,00</u>	<u>2,39</u>
Emissionsland Österreich							
AT+S AUSTR.T.+S. 22-UND.	XS2432941693	5,000	0	0	100 88,219	88.219,00	0,54
CA IMMO 20/27	XS2099128055	0,875	0	0	200 85,477	170.954,59	1,04
Summe Emissionsland Österreich						<u>259.173,59</u>	<u>1,58</u>
Emissionsland Portugal							
EDP-ENERGIAS 21/81 FLR	PTEDPROM0029	1,875	0	0	300 88,500	265.500,00	1,62
Summe Emissionsland Portugal						<u>265.500,00</u>	<u>1,62</u>
Emissionsland Rumänien							
RCS + RDS 20/28 REGS	XS2107452620	3,250	0	0	300 82,925	248.773,50	1,51
Summe Emissionsland Rumänien						<u>248.773,50</u>	<u>1,51</u>
Emissionsland Senegal							
SENEGAL, REP. 18/28 REGS	XS1790104530	4,750	0	0	300 85,587	256.759,50	1,56
Summe Emissionsland Senegal						<u>256.759,50</u>	<u>1,56</u>

ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Emissionsland Spanien								
BCO SABADELL 21/31MTN FLR	XS2286011528	2,500	0	0	300	88,615	265.844,40	1,62
BCO SANTAND. 20/30 MTN	XS2247936342	1,625	0	0	300	78,949	236.847,61	1,44
						Summe Emissionsland Spanien	502.692,01	3,06
						Summe Anleihen auf Euro lautend	3.101.917,91	18,87
Indezertifikate auf Euro lautend								
Emissionsland Irland								
WITR MU.AS.I.GOLD ETP2062	IE00B8HGT870		0	0	1.400	27,120	37.968,00	0,23
						Summe Emissionsland Irland	37.968,00	0,23
						Summe Indezertifikate auf Euro lautend	37.968,00	0,23
						Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere	3.139.885,91	19,11
Investmentzertifikate								
Investmentzertifikate auf Euro lautend								
Emissionsland Kroatien								
ERSTE E-CONSERVATIVE	HRERSIUCONS9		530	0	530	111,840	59.270,96	0,36
						Summe Emissionsland Kroatien	59.270,96	0,36
						Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	59.270,96	0,36
						Summe Investmentzertifikate	59.270,96	0,36
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
BAYER AG 2023/2083	XS2684846806	7,000	500	0	500	99,000	495.000,00	3,01
BAYER AG 2019/2079	XS2077670003	2,375	0	0	100	94,340	94.340,00	0,57
BAYER AG 2019/2079	XS2077670342	3,125	0	0	400	86,875	347.500,00	2,11
DT. BAHN FIN. 19/UNBEFR.	XS2010039035	0,950	0	0	200	92,518	185.035,60	1,13
DT.BANK FIXED 22/32 SUB.	DE000DL19WN3	4,000	0	0	200	89,131	178.261,96	1,08
HANN RUECK SUB 2019/2039	XS2063350925	1,125	0	0	300	78,605	235.815,01	1,43
HANN RUECK SUB 2021/2042	XS2320745156	1,375	0	0	200	72,464	144.927,99	0,88
INFINEON TECH.19/UNBEFR.	XS2056730323	2,875	0	0	300	95,129	285.388,21	1,74
INFINEON TECH.19/UNBEFR.	XS2056730679	3,625	0	0	300	91,690	275.070,01	1,67
MERCK KGAA SUB.ANL.20/80	XS2218405772	1,625	0	0	300	89,750	269.250,00	1,64
MUENCH.RUECK 18/49	XS1843448314	3,250	0	0	300	90,516	271.548,59	1,65
MUENCH.RUECK 20/41	XS2221845683	1,250	0	0	500	75,710	378.550,53	2,30
VOSSL0H 21/UNBEFR.	DE000A3H2VA6	4,000	0	0	200	94,000	188.000,00	1,14
						Summe Emissionsland Deutschland	3.348.687,90	20,38

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Käufe/ Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Emissionsland Frankreich								
ELECT.FRANCE 19/UND. FLR	FR0013464922	3,000	0	0	400	84,570	338.281,58	2,06
ENGIE 20/UND. FLR	FR0014000RR2	1,500	0	0	100	82,019	82.019,23	0,50
LA POSTE 18-UND. FLR	FR0013331949	3,125	0	0	300	92,500	277.500,00	1,69
ORANGE 20/UND. FLR MTN	FR00140005L7	1,750	0	0	300	83,625	250.875,00	1,53
ORANGE 21/UND. FLR MTN	FR0014003B55	1,375	0	0	100	79,750	79.750,00	0,49
TOTALENE 16/UND. FLR MTN	XS1501166869	3,369	0	0	300	93,875	281.625,00	1,71
TOTALENERG. 21/UND.FLRMTN	XS2290960520	1,625	0	0	300	83,426	250.277,71	1,52
Summe Emissionsland Frankreich						<u>1.560.328,52</u>	<u>9,49</u>	
Emissionsland Großbritannien								
BP CAP.MKTS 20/UND FLR	XS2193662728	3,625	0	0	500	86,961	434.805,00	2,65
BRIT.AM.TOBA 21/UND.	XS2391779134	3,000	0	0	700	85,375	597.625,00	3,64
BRIT.TELECOM 20/80 FLR	XS2119468572	1,874	0	0	300	91,250	273.750,00	1,67
NGG FINANCE 19/82 FLR	XS2010045511	2,125	0	0	300	86,000	258.000,00	1,57
SSE 22/UND.FLR	XS2439704318	4,000	0	0	250	92,000	230.000,00	1,40
Summe Emissionsland Großbritannien						<u>1.794.180,00</u>	<u>10,92</u>	
Emissionsland Italien								
ENI 21/UND. FLR	XS2334852253	2,000	0	0	200	85,375	170.750,00	1,04
TERNA R.E.N. 22/UND. FLR	XS2437854487	2,375	0	0	100	86,010	86.010,00	0,52
Summe Emissionsland Italien						<u>256.760,00</u>	<u>1,56</u>	
Emissionsland Jersey								
G CITY EUROP 21/UND. FLR	XS2338530467	3,625	0	0	200	35,355	70.710,00	0,43
Summe Emissionsland Jersey						<u>70.710,00</u>	<u>0,43</u>	
Emissionsland Mazedonien								
NORDMAZEDON. 23/27 REGS	XS2582522681 1)	6,960	0	0	100	102,044	98.183,17	0,60
Summe Emissionsland Mazedonien						<u>98.183,17</u>	<u>0,60</u>	
Emissionsland Niederlande								
DE VOLKSBANK 20/30FLR MTN	XS2202902636	1,750	0	0	200	91,810	183.620,00	1,12
KON.FRIES.C.20/UND.FLR	XS2228900556	2,850	0	0	100	90,125	90.125,00	0,55
NATURGY FIN.21/UND.FLR	XS2406737036	2,374	0	0	300	88,250	264.750,00	1,61
REPSOL INT 20/UND. FLR	XS2186001314	4,247	0	0	300	90,990	272.971,21	1,66
TENNET HLDG 20/UND.FLR	XS2207430120	2,374	0	0	200	94,353	188.705,20	1,15
VOLKSWAGEN INTL FLR22/UND	XS2342732562	3,748	0	0	200	86,021	172.042,01	1,05
WINTERSHALL 21/UND FLR	XS2286041947	3,000	0	0	500	79,931	399.655,00	2,43
Summe Emissionsland Niederlande						<u>1.571.868,42</u>	<u>9,56</u>	
Emissionsland Österreich								
RAIF.BK INTL 20/32FLR MTN	XS2189786226	2,875	0	0	300	80,005	240.014,99	1,46
Summe Emissionsland Österreich						<u>240.014,99</u>	<u>1,46</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
Emissionsland Polen							
BKRAJOWEGO 23/33 MTN	XS2589727168	5,125	0	0	250 101,781	254.451,25	1,55
Summe Emissionsland Polen						<u>254.451,25</u>	<u>1,55</u>
Emissionsland Rumänien							
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	0	0	470 74,249	348.970,30	2,12
Summe Emissionsland Rumänien						<u>348.970,30</u>	<u>2,12</u>
Emissionsland Schweden							
TELIA CO AB 20/81 FLR	XS2082429890	1,375	0	300	300 89,058	267.172,81	1,63
Summe Emissionsland Schweden						<u>267.172,81</u>	<u>1,63</u>
Emissionsland Schweiz							
UBS GROUP 20/26 FLRMTN	CH0537261858	3,250	0	0	300 97,523	292.569,60	1,78
UBS GROUP 21/33 MTN	CH0591979627	0,625	0	0	400 68,017	272.067,20	1,66
Summe Emissionsland Schweiz						<u>564.636,80</u>	<u>3,44</u>
Emissionsland Serbien inkl. Kosovo							
SERBIEN 19/29 REGS	XS2015296465	1,500	0	0	125 77,158	96.446,88	0,59
SERBIEN 20/27 REGS	XS2170186923	3,125	0	0	300 90,530	271.588,50	1,65
Summe Emissionsland Serbien inkl. Kosovo						<u>368.035,38</u>	<u>2,24</u>
Emissionsland Tschechische Republik							
RAIFFEISENBK 23/26FLR MTN	XS2577033553	7,125	0	0	300 100,649	301.947,00	1,84
Summe Emissionsland Tschechische Republik						<u>301.947,00</u>	<u>1,84</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend						<u>11.045.946,54</u>	<u>67,21</u>
Anleihen auf Ungarische Forint lautend							
Emittent Internationale Finanzkorporation							
INTERN.FIN. 21/23 MTN	XS2404252970	2,750	0	0	200.000 98,640	508.028,07	3,09
Summe Emittent Internationale Finanzkorporation						<u>508.028,07</u>	<u>3,09</u>
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 388,32500						<u>508.028,07</u>	<u>3,09</u>
Anleihen auf US-Dollar lautend							
Emissionsland Singapur							
MEDCO BELL 20/27 REGS	USY56607AA51	6,375	0	0	350 94,349	311.897,52	1,90
Summe Emissionsland Singapur						<u>311.897,52</u>	<u>1,90</u>
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05875						<u>311.897,52</u>	<u>1,90</u>

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Wandelschuldverschreibung auf Euro lautend								
Emissionsland Österreich								
DO + CO 21/26 CV	AT0000A2N7T2	1,750	0	0	100 127,290	127.290,00	0,77	
						Summe Emissionsland Österreich	127.290,00	0,77
						Summe Wandelschuldverschreibung auf Euro lautend	127.290,00	0,77
Wandelschuldverschreibung auf Hongkong-Dollar lautend								
Emissionsland Luxemburg								
CITI G.M.FDG 20/24 MTN CV	XS2133036603	0,000	0	0	2.000 95,200	229.620,29	1,40	
						Summe Emissionsland Luxemburg	229.620,29	1,40
						Summe Wandelschuldverschreibung auf Hongkong-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 8,29195	229.620,29	1,40
Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend								
Emissionsland USA								
JPM.CH.BK 20/23 CV ZO	XS2264505566	0,000	0	0	300 98,548	279.238,72	1,70	
						Summe Emissionsland USA	279.238,72	1,70
						Summe Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05875	279.238,72	1,70
						Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere	12.502.021,14	76,07
Derivate						nicht realisiertes Ergebnis in EUR		
Financial Futures auf Britische Pfund lautend								
Emissionsland Großbritannien								
LONG GILT FUTURE Dec23	LGR271223				-6	6.017,98	0,04	
						Summe Emissionsland Großbritannien	6.017,98	0,04
						Summe Financial Futures auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86740	6.017,98	0,04
Financial Futures auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EURO-BUND FUTURE Dec23	FGBL071223				1	-1.360,00	-0,01	
						Summe Emissionsland Deutschland	-1.360,00	-0,01
						Summe Financial Futures auf Euro lautend	-1.360,00	-0,01
Financial Futures auf Japanische Yen lautend								
Emissionsland Japan								
JPN 10Y BOND(OSE) Dec23	TGB1131223				-6	38.736,15	0,24	
						Summe Emissionsland Japan	38.736,15	0,24
						Summe Financial Futures auf Japanische Yen lautend umgerechnet zum Kurs von 157,99195	38.736,15	0,24

ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Financial Futures auf US-Dollar lautend				
Emissionsland USA				
US 10YR NOTE (CBT)Dec23	TN1191223	-16	27.508,85	0,17
US 2YR NOTE (CBT) Dec23	CTN2291223	15	-9.186,85	-0,06
		Summe Emissionsland USA	<u>18.322,00</u>	<u>0,11</u>
		Summe Financial Futures auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,05875	<u>18.322,00</u>	<u>0,11</u>
		Summe Derivate	<u>61.716,13</u>	<u>0,38</u>

Devisentermingeschäfte			nicht realisiertes Ergebnis in EUR	
Devisentermingeschäfte auf Euro lautend				
Emissionsland Österreich				
FXF SPEST EUR/NOK 20.10.2023	FXF_TAX_3465827	-433.073	10.722,43	0,07
FXF SPEST EUR/USD 16.11.2023	FXF_TAX_3466051	1.673.629	-23.356,55	-0,14
FXF SPEST EUR/USD 20.10.2023	FXF_TAX_3465881	-1.060.551	24.822,59	0,15
		Summe Emissionsland Österreich	<u>12.188,47</u>	<u>0,07</u>
		Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	<u>12.188,47</u>	<u>0,07</u>
		Summe Devisentermingeschäfte	<u>12.188,47</u>	<u>0,07</u>

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere			15.701.178,01	95,54
Devisentermingeschäfte			12.188,47	0,07
Financial Futures			61.716,13	0,38
Bankguthaben			405.962,54	2,47
Zinsenansprüche			254.385,43	1,55
Sonstige Abgrenzungen			-586,57	-0,00
Fondsvermögen			<u>16.434.844,01</u>	<u>100,00</u>

1) Kurs beinhaltet Zinsabgrenzungen

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A23TX9	Stück	811,100
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A23TX9	EUR	91,34
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1E176	Stück	171.045,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1E176	EUR	95,64
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A23TY7	Stück	14,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A23TY7	EUR	94,80
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A2A719	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A2A719	EUR	90,64

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	256.759,50

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 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.

ERSTE TOTAL RETURN FIXED INCOME

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Amtlich gehandelte Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Deutschland				
LANXESS SUB.ANL.16/76	XS1405763019	0,000	0	300
Emissionsland Mazedonien				
NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS	XS1744744191	2,750	0	300
Emissionsland Österreich				
VB WIEN 21/26 MTN	AT000B122080	0,875	0	200
VIENNA I.GRP 21/36 MTN	AT0000A2QL75	1,000	0	600
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Bulgarien				
BULGARIEN 15/35 MTN	XS1208856341	3,125	0	500
Emissionsland Deutschland				
COBA MTN 19/26	DE000CZ40N46	1,125	0	300
HOCHTIEF AG MTN 18/25	DE000A2LQ5M4	1,750	0	300
METRO MTN 15/25	XS1203941775	1,500	0	250
Emissionsland Finnland				
METSAE BOARD 17-27	FI4000282629	2,750	0	300
Emissionsland Frankreich				
WENDEL SE 15-27	FR0012516417	2,500	0	300
Emissionsland Großbritannien				
VODAFONE GRP 18/79 FLR	XS1888179477	3,100	0	300
Emissionsland Kasachstan				
KASACHSTAN 18/28 MTN REGS	XS1901718335	2,375	0	800

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Emissionsland Kroatien				
KROATIEN 19/29	XS1843434876	1,125	0	500
Emissionsland Niederlande				
OI EUROPEAN GRP 16/24REGS	XS1405765907	3,125	0	300
Emissionsland Schweden				
SAMHALLSBYG. 20/UND. FLR	XS2010032618	2,624	0	100
Emissionsland USA				
BK AMERICA 21/26 FLR MTN	XS2387929834	4,934	0	500
Anleihen auf Schweizer Franken lautend				
Emissionsland Schweiz				
HOLCIM HELV. 18-UND. FLR	CH0398633724	3,500	0	500
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	25.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Wandelschuldverschreibung auf US-Dollar lautend				
Emissionsland Jungfern-Inseln (Britisch)				
ADM AG HLDG 20/23 ZO CV	XS2220527001	0,000	0	400

Wien, im Oktober 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“)).