

# **CORE Equities**

**Miteigentumsfonds gemäß InvFG**

Halbjahresbericht 2022

## Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft .....	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.11.2022 .....	5

## Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft

<b>Die Gesellschaft</b>	Erste Asset Management GmbH Am Belvedere 1, A-1100 Wien Telefon: 05 0100-19777, Telefax: 05 0100-919777
<b>Stammkapital</b>	2,50 Mio. EURO
<b>Gesellschafter</b>	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 %)
<b>Aufsichtsrat</b>	Mag. Rudolf SAGMEISTER (Vorsitzender) Manfred BARTALSZKY Dkfm. Maximilian CLARY UND ALDRINGEN Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER Oswald HUBER (Vorsitzender-Stv. - ab 21.09.2022) Radovan JELASITY Mag. Ertan PISKIN (ab 10.10.2022) Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER (bis 21.09.2022) 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
<b>Geschäftsführer</b>	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
<b>Prokuristen</b>	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
<b>Staatskommissäre</b>	Mag. Wolfgang EXL (ab 01.09.2022) Mag. Dr. Angelika SCHÄTZ
<b>Fondsprüfer</b>	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
<b>Depotbank</b>	Erste Group Bank AG

## Sehr geehrte(r) Anteilshaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des CORE Equities Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2022 bis 30.11.2022 vorzulegen.

## Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2022	
	Mio. Euro	%
<b>Aktien</b>		
auf Britische Pfund lautend	16,0	8,65
auf Euro lautend	14,4	7,78
auf Japanische Yen lautend	11,4	6,13
auf Schweizer Franken lautend	11,0	5,93
auf US-Dollar lautend	127,2	68,56
<b>Wertpapiere</b>	<b>180,0</b>	<b>97,04</b>
Financial Futures	0,2	0,09
Bankguthaben	5,0	2,72
Dividendenansprüche	0,3	0,15
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
<b>Fondsvermögen</b>	<b>185,5</b>	<b>100,00</b>

# Vermögensaufstellung zum 30.11.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2022 bis 30.11.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Amtlich gehandelte Wertpapiere</b>							
<b>Aktien auf Britische Pfund lautend</b>							
<b>Emissionsland Großbritannien</b>							
ASTRAZENECA PLC DL-,25	GB0009895292	4.720	0	25.535	111,660	3.297.753,99	1,78
DIAGEO PLC LS-,28935185	GB0002374006	43.216	0	68.192	38,080	3.003.413,56	1,62
RELX PLC LS-,144397	GB00B2BODG97	62.030	0	92.286	23,120	2.467.791,26	1,33
UNILEVER PLC LS-,031111	GB00B10RZP78	6.065	31.354	42.303	41,440	2.027.569,19	1,09
				Summe Emissionsland Großbritannien		10.796.528,00	5,82
				Summe Aktien auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86460		10.796.528,00	5,82
<b>Aktien auf Euro lautend</b>							
<b>Emissionsland Deutschland</b>							
ALLIANZ SE NA O.N.	DE0008404005	4.774	0	7.814	204,350	1.596.790,90	0,86
SAP SE O.N.	DE0007164600	1.737	9.400	11.696	104,460	1.221.764,16	0,66
SIEMENS AG NA O.N.	DE0007236101	615	1.877	5.582	131,220	732.470,04	0,39
				Summe Emissionsland Deutschland		3.551.025,10	1,91
				Summe Aktien auf Euro lautend		3.551.025,10	1,91
<b>Aktien auf US-Dollar lautend</b>							
<b>Emissionsland Irland</b>							
LINDE PLC EO 0,001	IE00BZ12WP82	5.698	0	7.159	336,480	2.339.494,31	1,26
				Summe Emissionsland Irland		2.339.494,31	1,26
<b>Emissionsland USA</b>							
BLACKROCK CL. A DL -,01	US09247X1019	1.667	0	2.620	716,000	1.821.900,65	0,98
				Summe Emissionsland USA		1.821.900,65	0,98
				Summe Aktien auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,02965		4.161.394,96	2,24
				Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere		18.508.948,06	9,98
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>							
<b>Aktien auf Britische Pfund lautend</b>							
<b>Emissionsland Großbritannien</b>							
GSK PLC LS-,3125	GB00BN7SWP63	105.966	0	105.966	14,068	1.724.184,24	0,93
HSBC HLDGS PLC DL-,50	GB0005405286	151.843	0	596.796	5,097	3.518.238,73	1,90
				Summe Emissionsland Großbritannien		5.242.422,97	2,83
				Summe Aktien auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86460		5.242.422,97	2,83

## CORE Equities

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Aktien auf Euro lautend</b>							
<b>Emissionsland Frankreich</b>							
AIR LIQUIDE INH. EO 5,50	FR0000120073	1.071	0	4.871	138,220	673.269,62	0,36
AXA S.A. INH. EO 2,29	FR0000120628	40.602	0	57.408	27,020	1.551.164,16	0,84
BNP PARIBAS INH. EO 2	FR0000131104	11.536	0	26.878	53,430	1.436.091,54	0,77
LVMH EO 0,3	FR0000121014	2.318	0	3.607	737,300	2.659.441,10	1,43
OREAL (L') INH. EO 0,2	FR0000120321	610	0	3.267	354,800	1.159.131,60	0,62
SANOFI SA INHABER EO 2	FR0000120578	4.085	0	13.893	86,480	1.201.466,64	0,65
SCHNEIDER ELEC. INH. EO 4	FR0000121972	1.822	0	6.922	138,920	961.604,24	0,52
Summe Emissionsland Frankreich						9.642.168,90	5,20
<b>Emissionsland Niederlande</b>							
ASML HOLDING EO -,09	NL0010273215	373	2.306	2.216	561,100	1.243.397,60	0,67
Summe Emissionsland Niederlande						1.243.397,60	0,67
Summe Aktien auf Euro lautend						10.885.566,50	5,87
<b>Aktien auf Japanische Yen lautend</b>							
<b>Emissionsland Japan</b>							
DAIICHI SANKYO CO. LTD	JP3475350009	78.900	0	78.900	4.518,000	2.481.046,60	1,34
MITSUBISHI UFJ FINL GRP	JP3902900004	32.600	117.300	265.500	755,100	1.395.342,06	0,75
NIPPON TEL. TEL.	JP3735400008	6.600	9.400	68.600	3.820,000	1.823.892,21	0,98
SONY GROUP CORP.	JP3435000009	21.900	0	48.600	11.255,000	3.807.092,77	2,05
TOYOTA MOTOR CORP.	JP3633400001	11.800	0	132.800	2.010,500	1.858.291,51	1,00
Summe Emissionsland Japan						11.365.665,15	6,13
Summe Aktien auf Japanische Yen lautend umgerechnet zum Kurs von 143,67735						11.365.665,15	6,13
<b>Aktien auf Schweizer Franken lautend</b>							
<b>Emissionsland Schweiz</b>							
NOVARTIS NAM. SF 0,50	CH0012005267	3.989	8.939	39.499	83,650	3.368.084,96	1,82
ROCHE HLDG AG GEN.	CH0012032048	5.701	0	11.852	307,800	3.718.700,92	2,00
ZURICH INSUR.GR.NA.SFO,10	CH0011075394	4.668	0	8.464	452,900	3.907.589,81	2,11
Summe Emissionsland Schweiz						10.994.375,69	5,93
Summe Aktien auf Schweizer Franken lautend umgerechnet zum Kurs von 0,98100						10.994.375,69	5,93
<b>Aktien auf US-Dollar lautend</b>							
<b>Emissionsland Irland</b>							
ACCENTURE A DL-,0000225	IE00B4BNMY34	1.797	0	3.167	300,930	925.601,23	0,50
MEDTRONIC PLC DL-,0001	IE00BTN1Y115	2.050	19.050	5.843	79,040	448.531,75	0,24
Summe Emissionsland Irland						1.374.132,98	0,74

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Emissionsland Schweiz</b>							
CHUBB LTD. SF 24,15	CH0044328745	8.290	0	8.290	219,590	1.767.980,48	0,95
Summe Emissionsland Schweiz						1.767.980,48	0,95
<b>Emissionsland USA</b>							
3M CO. DL-,01	US88579Y1010	639	4.058	3.696	125,970	452.178,04	0,24
ABBOTT LABS	US0028241000	4.555	0	9.898	107,580	1.034.163,88	0,56
ABBVIE INC. DL-,01	US00287Y1091	7.284	0	10.235	161,180	1.602.172,87	0,86
ADOBE INC.	US00724F1012	355	0	1.735	344,930	581.220,37	0,31
ADVANCED MIC.DEV. DL-,01	US0079031078	2.632	17.996	13.969	77,630	1.053.186,49	0,57
AIR PROD. CHEM. DL 1	US0091581068	3.841	0	3.841	310,160	1.157.018,95	0,62
ALPHABET INC.CL C DL-,001	US02079K1079	17.874	6.312	12.382	101,450	1.219.981,45	0,66
ALPHABET INC.CL.A DL-,001	US02079K3059	20.955	4.105	17.811	100,990	1.746.936,23	0,94
AMER. EXPRESS DL -,20	US0258161092	6.531	0	12.682	157,590	1.941.005,56	1,05
AMERICAN TOWER DL -,01	US03027X1000	1.136	0	3.002	221,250	645.066,28	0,35
AMGEN INC. DL-,0001	US0311621009	185	430	1.821	286,400	506.516,19	0,27
ANALOG DEVICES INC.DL-166	US0326541051	1.463	0	4.591	171,910	766.511,74	0,41
APPLE INC.	US0378331005	0	0	104.949	148,030	15.088.234,32	8,13
APPLIED MATERIALS INC.	US0382221051	621	614	6.931	109,600	737.762,93	0,40
AT + T INC. DL 1	US00206R1023	4.894	0	28.468	19,280	533.057,87	0,29
AUTOM. DATA PROC. DL -,10	US0530151036	881	6.070	4.625	264,140	1.186.468,70	0,64
BECTON, DICKINSON DL 1	US0758871091	398	0	2.528	249,340	612.180,37	0,33
BOOKING HLDGS DL-,008	US09857L1089	1.621	0	1.621	2.079,450	3.273.722,58	1,76
BOSTON SCIENTIFIC DL-,01	US1011371077	2.400	18.850	10.305	45,270	453.073,71	0,24
BRISTOL-MYERS SQUIBBDL-10	US1101221083	1.265	9.405	5.957	80,280	464.456,82	0,25
BROADCOM INC. DL-,001	US11135F1012	940	0	940	551,030	503.052,69	0,27
CATERPILLAR INC. DL 1	US1491231015	4.573	0	23.226	236,410	5.332.742,83	2,87
CIGNA CORP. NEW DL 1	US1255231003	296	2.118	1.478	328,890	472.101,61	0,25
CISCO SYSTEMS DL-,001	US17275R1023	11.234	0	26.258	49,720	1.267.952,95	0,68
CME GROUP INC. DL-,01	US12572Q1058	678	4.897	3.335	176,500	571.677,27	0,31
COLGATE-PALMOLIVE DL 1	US1941621039	782	3.515	5.985	77,480	450.364,49	0,24
COMCAST CORP. A DL-,01	US20030N1019	3.303	16.227	23.893	36,640	850.230,19	0,46
COSTCO WHOLESALE DL-,005	US22160K1051	3.175	0	3.175	539,250	1.662.816,25	0,90
CROWN CASTLE INC.	US22822V1017	355	1.204	3.103	141,430	426.219,87	0,23
CSX CORP. DL 1	US1264081035	3.439	1.824	39.941	32,690	1.268.072,93	0,68
CVS HEALTH CORP. DL-,01	US1266501006	1.043	0	5.590	101,880	553.109,50	0,30
DANAHER CORP. DL-,01	US2358511028	1.298	0	2.850	273,410	756.779,97	0,41
DEERE CO. DL 1	US2441991054	981	1.463	10.455	441,000	4.477.885,69	2,41
DISNEY (WALT) CO.	US2546871060	2.410	7.408	21.862	97,870	2.078.020,63	1,12
EDWARDS LIFESCIENCES	US28176E1082	611	2.552	4.867	77,250	365.149,08	0,20
ELEVANCE HEALTH DL-,01	US0367521038	422	0	1.463	532,920	757.210,66	0,41
ELI LILLY	US5324571083	205	442	2.045	371,080	737.006,36	0,40
EQUINIX INC. DL-,001	US29444U7000	147	0	751	690,650	503.742,19	0,27
FISERV INC. DL-,01	US3377381088	426	939	4.233	104,360	429.034,99	0,23
FORD MOTOR DL-,01	US3453708600	227.173	0	227.173	13,900	3.066.774,83	1,65
GILEAD SCIENCES DL-,001	US3755581036	669	1.622	6.503	87,830	554.711,30	0,30
HOME DEPOT INC. DL-,05	US4370761029	1.417	0	4.565	323,990	1.436.424,37	0,77
HUMANA INC. DL-,166	US4448591028	91	155	950	549,900	507.361,72	0,27
ILL. TOOL WKS	US4523081093	2.660	0	2.660	227,470	587.646,48	0,32

## CORE Equities

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
INTEL CORP. DL-,001	US4581401001	9.974	0	25.883	30,070	755.889,68	0,41
INTERCONTINENTAL EXCH.INC	US45866F1049	650	3.224	4.671	108,310	491.347,55	0,26
INTL BUS. MACH. DL-,20	US4592001014	603	3.661	3.659	148,900	529.136,21	0,29
INTUIT INC. DL-,01	US4612021034	1.839	0	2.801	407,590	1.108.784,14	0,60
INTUITIVE SURGIC. DL-,001	US46120E6023	656	5.123	2.843	270,390	746.582,60	0,40
JOHNSON + JOHNSON DL 1	US4781601046	1.201	6.359	8.230	178,000	1.422.755,31	0,77
LAM RESEARCH CORP.DL-,001	US5128071082	97	114	1.065	472,380	488.597,78	0,26
LOWE'S COS INC. DL-,50	US5486611073	381	1.383	3.251	212,550	671.101,88	0,36
MARSH+MCLENNAN COS.INC.D1	US5717481023	5.142	0	5.142	173,180	864.848,79	0,47
MASTERCARD INC.A DL-,0001	US57636Q1040	2.058	0	3.433	356,400	1.188.288,45	0,64
MCKESSON DL-,01	US58155Q1031	1.218	0	1.218	381,680	451.499,29	0,24
MERCK CO. DL-,01	US58933Y1055	1.304	3.610	12.222	110,120	1.307.130,23	0,70
MICRON TECHN. INC. DL-,10	US5951121038	806	2.019	7.776	57,650	435.377,46	0,23
MICROSOFT DL-,00000625	US5949181045	6.402	0	51.928	255,140	12.867.391,75	6,94
MORGAN STANLEY DL-,01	US6174464486	3.509	0	22.344	93,070	2.019.672,78	1,09
NIKE INC. B	US6541061031	1.186	8.706	5.693	109,690	606.482,95	0,33
NORFOLK STHN CORP. DL 1	US6558441084	4.294	0	6.268	256,500	1.561.445,15	0,84
NVIDIA CORP. DL-,01	US67066G1040	844	0	3.221	169,230	529.393,32	0,29
ORACLE CORP. DL-,01	US68389X1054	1.030	0	6.768	83,030	545.765,10	0,29
PALO ALTO NETWKS DL-,0001	US6974351057	6.465	0	6.465	169,900	1.066.773,66	0,58
PAYPAL HDGS INC.DL-,0001	US70450Y1038	2.498	25.274	5.067	78,410	385.862,64	0,21
PEPSICO INC. DL-,0166	US7134481081	347	1.157	3.056	185,510	550.593,46	0,30
PFIZER INC. DL-,05	US7170811035	2.460	0	14.990	50,130	729.809,84	0,39
PNC FINL SERVICES GRP DL5	US6934751057	941	2.315	9.118	168,260	1.490.015,71	0,80
PROCTER GAMBLE	US7427181091	393	1.479	3.294	149,160	477.184,52	0,26
PROLOGIS INC. DL-,01	US74340W1036	5.159	0	7.913	117,790	905.232,14	0,49
QUALCOMM INC. DL-,0001	US7475251036	918	6.768	4.384	126,490	538.563,74	0,29
REGENERON PHARMAC.DL-,001	US75886F1075	108	745	571	751,700	416.860,78	0,22
S+P GLOBAL INC. DL 1	US78409V1044	338	0	1.717	352,800	588.314,09	0,32
SALESFORCE INC. DL-,001	US79466L3024	689	3.984	4.381	160,250	681.838,73	0,37
SERVICENOW INC. DL-,001	US81762P1021	883	0	1.783	416,300	720.888,55	0,39
SHERWIN-WILLIAMS DL 1	US8243481061	4.124	0	5.885	249,180	1.424.196,86	0,77
SNOWFLAKE INC. A DL-,0001	US8334451098	8.095	0	8.095	142,900	1.123.464,77	0,61
STRYKER CORP. DL-,10	US8636671013	5.871	0	8.164	233,890	1.854.492,26	1,00
TARGET CORP. DL-,0833	US87612E1064	9.641	0	9.641	167,070	1.564.339,21	0,84
TEXAS INSTR. DL 1	US8825081040	759	5.188	4.027	180,460	705.785,87	0,38
THERMO FISH.SCIENTIF.DL 1	US8835561023	673	0	1.435	560,220	780.765,99	0,42
TJX COS INC. DL 1	US8725401090	2.666	0	11.322	80,050	880.227,36	0,47
U.S. BANCORP DL-,01	US9029733048	31.130	0	31.130	45,390	1.372.301,95	0,74
UNION PAC. DL 2,50	US9078181081	2.835	0	7.203	217,430	1.521.049,18	0,82
UNITED PARCEL SE.B DL-01	US9113121068	556	361	6.386	189,730	1.176.725,86	0,63
UNITEDHEALTH GROUP DL-,01	US91324P1021	2.362	0	5.552	547,760	2.953.589,59	1,59
VERTEX PHARMAC. DL-,01	US92532F1003	150	413	1.410	316,400	433.277,33	0,23
VISA INC. CL. A DL -,0001	US92826C8394	4.153	0	6.293	217,000	1.326.257,47	0,71
WASTE MANAGEMENT	US94106L1098	549	3.448	3.225	167,720	525.321,23	0,28
ZOETIS INC. CL.A DL -,01	US98978V1035	2.752	0	2.752	154,140	411.978,13	0,22
Summe Emissionsland USA						119.868.205,54	64,62
Summe Aktien auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,02965						123.010.319,00	66,31
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere						161.498.349,31	87,06



Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Bestand	nicht realisiertes Ergebnis in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Derivate</b>				
<b>Financial Futures auf Euro lautend</b>				
<b>Emissionsland Deutschland</b>				
MSCI Wor NTR Inde Dec22	FMWNZ22	130	159.665,00	0,09
Summe Emissionsland Deutschland			159.665,00	0,09
Summe Financial Futures auf Euro lautend			159.665,00	0,09
Summe Derivate			159.665,00	0,09

**Gliederung des Fondsvermögens**

Wertpapiere	180.007.297,37	97,04
Financial Futures	159.665,00	0,09
Bankguthaben	5.048.731,93	2,72
Dividendenansprüche	284.829,89	0,15
Zinsenansprüche	5.603,52	0,00
Sonstige Abgrenzungen	-3.546,61	- 0,00
<b>Fondsvermögen</b>	<b>185.502.581,10</b>	<b>100,00</b>

**Hinweis an die Anleger:**

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A2GK78	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A2GK78	EUR	138,43
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A2GK86	Stück	1.365.221,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A2GK86	EUR	135,87
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A2GK94	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A2GK94	EUR	138,43

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.

## CORE Equities

Der CORE Equities ist ein indexnaher Aktienfonds und verfolgt eine passive Veranlagungspolitik und hat das Ziel die Wertentwicklung des Solactive ERSTE DM Equity ESG Base Index NTR nachzubilden (Disclaimer des Indexanbieters, <https://www.erste-am.com/index-disclaimer>). Die diskretionäre Auswahl der für den Investmentfonds zulässigen Vermögensgegenstände ist beschränkt. Der Ermessensspielraum der Verwaltungsgesellschaft ist eingeschränkt. Der Investmentfonds ist Nutzer im Sinne der VO (EU) 2016/1011 (Referenzwerte-VO).

Der Solactive ERSTE DM Equity ESG Base Index NTR repräsentiert die Wertentwicklung von Aktien von Unternehmen mit Sitz oder Geschäftstätigkeit in den USA, Euroland, Großbritannien, Schweiz und/oder Japan, unter Berücksichtigung von nachhaltigen Mindestkriterien. Der Index ist ein Net Return Index, und beinhaltet 120 Aktien großkapitalisierter Unternehmen aus dem Euroraum, Großbritannien, der Schweiz, den USA und Japan und berücksichtigt den Ausschluss von Aktivitäten im Bereich kontroverser Waffen und/oder das Kriterium von weniger als 30 % der Einnahmen aus dem Abbau und der Produktion von Kohle. Das Rebalancing des Index und damit auch des Fonds erfolgt zwei Mal pro Jahr, im Mai und November. Der Fonds geht keinerlei aktive Wetten ein, nicht veranlagten Barmitteln werden Futures des MSCI World Net Return Index entgegengestellt. Größere Zu- und Abflüsse werden aliquot auf sämtliche Titel des Fonds aufgeteilt. Die Methode, mit der der Index nachgebildet wird, ist die (annähernd) vollständige physische Nachbildung, dh die Strategie zielt darauf ab, alle Wertpapiere des Index annähernd in denselben Gewichtungen wie der Index zu halten. Nähere Informationen zu den Auswirkungen der ausgewählten Methode für Anleger in Bezug auf das Exposure gegenüber dem Index und das Kontrahentenrisiko, zur Indexzusammensetzung und -berechnung, zur prognostizierten Performance-Abweichung gegenüber dem Index sowie die Beschreibung von Faktoren, welche sich wahrscheinlich auf die Fähigkeit des Investmentfonds auswirken, die Wertentwicklung des Index nachzubilden, finden Sie im Prospekt, Abschnitt II, Punkt 12.

Die Höhe des Tracking Errors zum Ende des überprüften Zeitraums beträgt 0,72 %.

### **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 gezeichnete 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.

### **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
------------------------	-----------------	---	----------------------

#### **Amtlich gehandelte Wertpapiere**

#### **Aktien auf Britische Pfund lautend**

#### **Emissionsland Großbritannien**

GSK PLC	LS-,25	GB0009252882	0	74.380
---------	--------	--------------	---	--------

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
<b>Aktien auf Euro lautend</b>			
<b>Emissionsland Deutschland</b>			
MERCEDES-BENZ GRP NA O.N.	DE0007100000	606	7.363
<b>Emissionsland Frankreich</b>			
EUROAPI SAS EO 1	FR0014008VX5	0	675
<b>In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere</b>			
<b>Aktien auf Britische Pfund lautend</b>			
<b>Emissionsland Großbritannien</b>			
HALEON PLC LS 0,01	GB00BMX86B70	81.054	81.054
NATIONAL GRID PLC	GB00BDR05C01	5.419	65.809
<b>Aktien auf Euro lautend</b>			
<b>Emissionsland Spanien</b>			
BCO SANTANDER N.E00,5	ES0113900J37	28.083	341.047
<b>Aktien auf Japanische Yen lautend</b>			
<b>Emissionsland Japan</b>			
NINTENDO CO. LTD	JP3756600007	64.600	70.400
RECRUIT HOLDINGS CO.LTD	JP3970300004	3.500	41.000
SHIN-ETSU CHEM.	JP3371200001	1.100	12.800
TOKYO ELECTRON LTD	JP3571400005	700	8.500
<b>Aktien auf Schweizer Franken lautend</b>			
<b>Emissionsland Schweiz</b>			
UBS GROUP AG SF -,10	CH0244767585	12.272	149.028

---

## CORE Equities

---

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
<b>Aktien auf US-Dollar lautend</b>			
<b>Emissionsland USA</b>			
BLOCK INC. A	US8522341036	1.455	17.662
FIDELITY NATL INF. SVCS	US31620M1062	409	4.961
HCA HEALTHCARE INC.DL-,01	US40412C1018	161	1.956
MODERNA INC. DL-,0001	US60770K1079	351	4.263
NEWMONT CORP. DL 1,60	US6516391066	4.548	55.232
PUBLIC STORAGE DL-,10	US74460D1090	102	1.237
STARBUCKS CORP.	US8552441094	587	7.133
WB DISCOVERY SER.A DL-,01	US9344231041	508	6.165

Wien, im Dezember 2022

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“)).