

True Rock

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2021

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.06.2021	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 SCHAUFLENER (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-WERZNER 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 (ab 01.01.2021) Mag. Wolfgang TRAINDL (bis 28.02.2021)
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 True Rock Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.01.2021 bis 30.06.2021 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.06.2021	
	Mio. Euro	%
Aktien		
auf Euro lautend	0,2	1,78
Anleihen		
auf Euro lautend	7,2	78,49
auf Kanadische Dollar lautend	0,4	3,85
auf US-Dollar lautend	0,4	4,13
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	0,8	8,13
auf US-Dollar lautend	0,0	0,48
Wertpapiere	8,9	96,85
Bankguthaben	0,2	2,30
Zinsenansprüche	0,1	0,85
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	9,2	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.01.2021 bis 30.06.2021)

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	
Amtlich gehandelte Wertpapiere									
Anleihen auf Euro lautend									
Emissionsland Deutschland									
WUESTENROT BAUSPK.17/27	DE000WBPOA20	4,125	400	0	400	108,418	433.672,00	4,70	
							Summe Emissionsland Deutschland	433.672,00	4,70
Emissionsland Mazedonien									
NORDMAZEDONIEN 14/21 REGS	XS1087984164	3,975	0	100	300	100,280	300.840,00	3,26	
							Summe Emissionsland Mazedonien	300.840,00	3,26
Emissionsland Norwegen									
DNB BANK 18/23 MTN	XS1883911924	0,600	0	200	400	101,973	407.892,00	4,42	
							Summe Emissionsland Norwegen	407.892,00	4,42
Emissionsland Österreich									
AUSTRIA 2021 MTN 144A	AT0000A001X2	3,500	500	100	900	100,850	907.650,00	9,84	
HYPO VORARLG BK 17-24 MTN	XS1613238457	0,375	0	100	400	102,290	409.160,00	4,44	
OBEROEST.LBK 18-25	XS1821420699	0,625	0	100	400	103,110	412.438,20	4,47	
OEBS INFRAS 14/24 MTN	XS1138366445	1,000	0	100	229	104,712	239.790,48	2,60	
OMV AG 18-UND. FLR	XS1713462403	2,875	0	200	400	105,500	422.000,00	4,57	
RLBK OBEROESTERR.16/26MTN	XS1495631993	0,375	0	0	300	103,128	309.383,99	3,35	
							Summe Emissionsland Österreich	2.700.422,67	29,27
Emissionsland Schweden									
SWEDBANK 17/22 MTN	XS1711933033	0,250	0	100	400	100,893	403.571,99	4,38	
							Summe Emissionsland Schweden	403.571,99	4,38
							Summe Anleihen auf Euro lautend	4.246.398,66	46,03
							Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere	4.246.398,66	46,03
Investmentzertifikate									
Investmentzertifikate auf Euro lautend									
Emissionsland Luxemburg									
LIQUID STRESSED DEBT I	LU0891019480		0	3.950	6.000	125,020	750.135,75	8,13	
							Summe Emissionsland Luxemburg	750.135,75	8,13
							Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	750.135,75	8,13

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge Stück/Nominale	Bestand (Nom. in 1.000, ger.)	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Irland								
VANECK GOLD MINERS UC.ETF	IE00BQQP9F84		1.450	0	1.450	35,880	43.870,48	0,48
Summe Emissionsland Irland							43.870,48	0,48
Summe Investmentzertifikate auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,18590							43.870,48	0,48
Summe Investmentzertifikate							794.006,23	8,61
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Aktien auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
EKOTECHNIKA AG A O.N.	DE000A161234		0	4.950	7.875	20,800	163.800,00	1,78
Summe Emissionsland Deutschland							163.800,00	1,78
Summe Aktien auf Euro lautend							163.800,00	1,78
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Deutschland								
HSH FIN.FDS. IS 17/25	DE000A2DAHX5	0,500	0	100	400	103,009	412.037,60	4,47
NORDLB MTN 00/30 VAR 1-6	XS0113243397	0,000	0	300	300	92,001	276.003,00	2,99
Summe Emissionsland Deutschland							688.040,60	7,46
Emissionsland Frankreich								
SOGECAP 14-UND.	FR0012383982	4,125	0	300	300	112,941	338.821,79	3,67
Summe Emissionsland Frankreich							338.821,79	3,67
Emissionsland Italien								
B.T.P. 14-24 FLR	IT0005004426	2,350	100	0	100	112,055	118.978,74	1,29
Summe Emissionsland Italien							118.978,74	1,29
Emissionsland Luxemburg								
GARF.HOLD.3 20/26 FLR	XS2250154494	1) 6,250	300	0	300	101,815	302.424,17	3,28
NESTLE FIN.INTL 15/23 MTN	XS1319652902	0,750	0	100	300	101,811	305.432,99	3,31
Summe Emissionsland Luxemburg							607.857,16	6,59
Emissionsland Niederlande								
ABN AMRO BANK 16/28FLRMTN	XS1346254573	2,875	100	0	100	104,214	104.214,20	1,13
ING GROEP 17/28 FLR MTN	XS1590823859	3,000	100	0	100	104,902	104.901,80	1,14
Summe Emissionsland Niederlande							209.116,00	2,27
Emissionsland Österreich								
OESTERR. K.BK 17/24 MTN	XS1689595830	0,250	0	100	400	102,129	408.514,40	4,43
Summe Emissionsland Österreich							408.514,40	4,43

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 Polen								
PKO B.HIPOTECZ. 17/23 MTN	XS1588411188	0,625	0	100	300	101,528	304.583,25	3,30
Summe Emissionsland Polen							304.583,25	3,30
Emissionsland Spanien								
AUDAX RENOVA 20/27	ES0236463008	4,200	200	0	200	99,680	199.360,00	2,16
SPANIEN 14-24 FLR	ES00000126A4	1,800	100	0	100	112,425	118.941,14	1,29
Summe Emissionsland Spanien							318.301,14	3,45
Summe Anleihen auf Euro lautend							2.994.213,08	32,46
Anleihen auf Kanadische Dollar lautend								
Emissionsland USA								
APPLE 17/24	CA037833CY47	2,513	0	0	500	104,205	354.800,82	3,85
Summe Emissionsland USA							354.800,82	3,85
Summe Anleihen auf Kanadische Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,46850							354.800,82	3,85
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Niederlande								
LUKOIL INTL FIN.16/26REGS	XS1514045886	4,750	0	0	400	112,840	380.605,45	4,13
Summe Emissionsland Niederlande							380.605,45	4,13
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,18590							380.605,45	4,13
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							3.893.419,35	42,21
Gliederung des Fondsvermögens								
Wertpapiere							8.933.824,24	96,85
Bankguthaben							212.283,61	2,30
Zinsenansprüche							78.364,03	0,85
Sonstige Abgrenzungen							-8,65	-0,00
Fondsvermögen							9.224.463,23	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A09V98	Stück	67.508,518
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A09V98	EUR	136,16
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XAG7	Stück	234,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XAG7	GBP	117,27

1) Kurs beinhaltet Zinsabgrenzungen.

Bei folgenden Wertpapieren handelt es sich um inflationsindexierte Anleihen, bei denen das Nominale mit einem Inflationsindex abgesichert ist:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Index-Value	Kurswert in EUR
SPANIEN 14-24 FLR	ES00000126A4	1,06628	118.941,14
B.T.P. 14-24 FLR	IT0005004426	1,07012	118.978,74

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.

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 Irland				
GERMAN POSTAL PEN.05/21 C	XS0222474339	3,750	0	500
Emissionsland Österreich				
AT+S AUSTR.T.+S. 17-UND.	XS1721410725	4,750	0	550
OEBB INFRAST 13/23 MTN	XS0949964810	2,250	0	1.000
RLBK OBEROEST. 17/23 MTN	XS1720806774	0,750	0	100
UNICR.BK AUS. 01/31MTNFLR	XS0136314415	0,000	0	200
VOLKSBANK WIEN 17-27 FLR	AT000B121967	2,750	0	500

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Emissionsland Ukraine				
UKRAINE 19/26 REGS	XS2015264778	6,750	0	500
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Mexiko				
MEXICO 15/2115 MTN	XS1218289103	4,000	200	200
Emissionsland Österreich				
OBEROEST.LBK 16-23	XS1509009483	0,125	0	200
Anleihen auf US-Dollar lautend				
Emissionsland Luxemburg				
GAZ CAPITAL 04/34MTN REGS	XS0191754729	8,625	0	100
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Deutschland				
EKOSEM-AGRAR AG 12/21	DE000A1MLSJ1	8,750	0	250
Emissionsland Luxemburg				
GAZ CAPITAL 14/21 MTN	XS1038646078	3,600	0	500
Anleihen auf US-Dollar lautend				
Emissionsland Zypern				
GLBL PORTS FIN.16/23 REGS	XS1405775450	6,500	0	200

Wien, im Juli 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“)).