

RT Zukunftsvorsorge Aktienfonds

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2020

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 31.10.2020.....	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. Wolfgang TRAINDL
Prokuristen	Mag. Achim ARNHOF (bis 30.06.2020) Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER (ab 06.07.2020)
Staatskommissäre	Mag. Walter MEGNER (ab 01.10.2020) Mag. Christoph SEEL Rätin Mag.(FH) Eva SCHRITTWIESER, MBA (bis 30.06.2020)
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 RT Zukunftsvorsorge Aktienfonds Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.05.2020 bis 31.10.2020 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 31.10.2020	
	Mio. Euro	%
Aktien		
auf Euro lautend	367,0	58,71
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	253,4	40,54
Wertpapiere	620,5	99,25
Bankguthaben	4,6	0,74
Dividendenansprüche	0,1	0,02
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	625,2	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.10.2020

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.05.2020 bis 31.10.2020)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere							
Aktien auf Euro lautend							
Emissionsland Österreich							
AGRANA BET.AG INH.	AT0000AGRANA3	0	0	118.000	15,500	1.829.000,00	0,29
AMAG AUSTRIA METALL INH.	AT00000AMAG3	0	0	75.000	25,300	1.897.500,00	0,30
ANDRITZ AG	AT0000730007	60.000	0	1.034.513	28,920	29.918.115,96	4,79
AT+S AUSTR.T.+SYSTEMT.	AT0000969985	0	0	197.000	15,580	3.069.260,00	0,49
BAWAG GROUP AG	AT0000BAWAG2	510.000	0	872.501	31,400	27.396.531,40	4,38
CA IMMOB.ANL.	AT0000641352	120.000	0	1.045.167	23,550	24.613.682,85	3,94
DO + CO AG	AT0000818802	16.425	0	205.582	31,150	6.403.879,30	1,02
ERSTE GROUP BNK INH. O.N.	AT0000652011	175.000	0	1.240.000	17,580	21.799.200,00	3,49
EVN AG	AT0000741053	0	0	332.957	13,700	4.561.510,90	0,73
FACC AG INH.AKT.	AT00000FACC2	0	0	260.549	4,700	1.224.580,30	0,20
FLUGHAFEN WIEN AG	AT00000VIE62	0	0	387.500	20,250	7.846.875,00	1,26
IMMOFINANZ AG INH.	AT0000A21KS2	0	0	1.374.998	11,500	15.812.477,00	2,53
KAPSCH TRAFFICOM AG	AT0000KAPSCH9	0	0	50.989	11,200	571.076,80	0,09
LENZING AG	AT0000644505	0	0	111.627	60,000	6.697.620,00	1,07
MARINOMED BIOTECH AG INH.	ATMARINOMED6	9.000	0	37.340	109,000	4.070.060,00	0,65
MAYR-MELNHOF KARTON	AT0000938204	22.500	0	167.100	140,200	23.427.420,00	3,75
OESTERREICH. POST AG	AT0000APOST4	0	0	343.295	27,250	9.354.788,75	1,50
OMV AG	AT0000743059	90.000	270.000	605.000	19,700	11.918.500,00	1,91
PALFINGER AG	AT0000758305	0	0	427.500	19,840	8.481.600,00	1,36
POLYTEC HLDG AG INH. EO 1	AT0000A00XX9	0	0	67.000	5,200	348.400,00	0,06
PORR AG	AT0000609607	0	0	77.405	11,440	885.513,20	0,14
RAIFFEISEN INTL BK-HO.INH	AT0000606306	300.000	175.000	1.530.000	12,340	18.880.200,00	3,02
S IMMO AG	AT0000652250	0	0	900.000	12,680	11.412.000,00	1,83
SCHOELLER-BLECKMANN OILF.	AT0000946652	0	0	112.500	20,750	2.334.375,00	0,37
SEMPERIT AG HLDG	AT0000785555	0	0	62.497	22,000	1.374.934,00	0,22
STRABAG SE	AT000000STR1	0	0	209.370	24,900	5.213.313,00	0,83
TELEKOM AUSTRIA AG	AT0000720008	0	0	1.100.000	5,780	6.358.000,00	1,02
UBM DEVELOPMENT AG	AT0000815402	0	0	40.000	26,900	1.076.000,00	0,17
UNIQA INSURANCE GROUP AG	AT0000821103	0	0	918.857	4,830	4.438.079,31	0,71
VERBUND AG	AT0000746409	140.000	20.000	770.059	49,380	38.025.513,42	6,08
VIENNA INSURANCE GRP INH.	AT0000908504	0	0	621.750	17,420	10.830.885,00	1,73
VOESTALPINE AG	AT0000937503	60.000	50.000	1.259.536	23,850	30.039.933,60	4,81
WIENERBERGER	AT0000831706	180.000	0	1.072.000	21,660	23.219.520,00	3,71
ZUMTOBEL GROUP AG INH. A	AT0000837307	0	0	357.075	4,800	1.713.960,00	0,27
Summe Emissionsland Österreich						367.044.304,79	58,71
Summe Aktien auf Euro lautend						367.044.304,79	58,71
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere						367.044.304,79	58,71

RT Zukunftsvorsorge Aktienfonds

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 Österreich

RT OESTERR. AKTIENFDS T	AT0000497292	0	2.380.000	36.255.000	6,990	253.422.450,00	40,54
						Summe Emissionsland Österreich	253.422.450,00 40,54
						Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	253.422.450,00 40,54
						Summe Investmentzertifikate	253.422.450,00 40,54

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere						620.466.754,79	99,25
Bankguthaben						4.610.940,98	0,74
Dividendenansprüche						112.390,50	0,02
Sonstige Abgrenzungen						-24.250,86	- 0,00
Fondsvermögen						625.165.835,41	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000659636	Stück	40.419,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000659636	EUR	4,77
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000659644	Stück	46.515.017,306
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000659644	EUR	13,43

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 Wertpapierleihegeschäfte.

Zum Halbjahresende des Fonds gab es folgende Wertpapierleihegeschäfte:

Wertpapierleihe

Die nachstehend angeführten Wertpapiere waren am 31.10.2020 mit den nachstehend angeführten (Teil-)Beträgen und den nachstehend angeführten Gebühren im Wertpapierleihsystem der Erste Group Bank AG verliehen:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	verliehener (Teil-)Betrag Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Gebühren- satz in %
ANDRITZ AG	AT0000730007	171.753	0,15
BAWAG GROUP AG	AT0000BAWAG2	19.888	0,15
UNIQA INSURANCE GROUP AG	AT0000821103	182.427	0,15
VERBUND AG	AT0000746409	127.883	0,15
VIENNA INSURANCE GRP INH.	AT0000908504	101.925	0,15
VOESTALPINE AG	AT0000937503	193.214	0,15
ZUMTOBEL GROUP AG INH. A	AT0000837307	45.068	0,15

Folgende Sicherheiten stehen für diese Leihegeschäfte zur Verfügung:

Wertpapier-Bezeichnung	Kennnummer	Nominale
OESTERR. 13/23	AT0000A105W3	17.080.000
SLOWAKEI 2025	SK4120007543	1.780.000

Ausweis gemäß Artikel 13 der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung

Allgemeine Angaben:

Betrag der verliehenen Wertpapiere

Verliehene Wertpapiere:	19.387.578,71
in % vom Fondsvermögen (abzüglich Barmittel oder Barmitteläquivalent):	3,12%

Betrag der eingesetzten Vermögenswerte (ausschließlich WP Leihen):

(für die Art der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte):	19.387.578,71
in % des Fondsvermögens:	3,10%

Angaben zur Konzentration:

Zehn wichtigste Emittenten von Sicherheiten:

		Kurswert in Euro
- Volumen der gestellten Sicherheiten und Angabe Emittent		
Republik Österreich	AT0000A105W3	18.375.368,72
Slowakei, Republik	SK4120007543	2.230.223,20
		20.605.591,92

RT Zukunftsvorsorge Aktienfonds

Zehn wichtigsten Gegenparteien für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft (ausschließlich Wertpapierleihen):

Name der Gegenparteien:	ausschließlich Erste Group Bank AG
Bruttovolumen ausstehende Geschäfte:	19.387.578,71

Aggregierte Transaktionsdaten für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft und Gesamttrenditeswap:

	ISIN	Art der Sicherheit	Laufzeit/Tage	Rating	Währung	Kurswert in Euro
Republik Österreich	AT0000A105W3	staatsgarantiert	unbefristet	AA+	Euro	18.375.368,72
Republik Österreich	SK4120007543	staatsgarantiert	unbefristet	A	Euro	2.230.223,20
						20.605.591,92

Wertpapierleihe aufgeschlüsselt nach Laufzeiten:

Laufzeit < 1Tag	
Laufzeit 1-7 Tage	0
Laufzeit 8-30 Tage	0,00
Laufzeit 31-90 Tage	0,00
Laufzeit 91- 360 Tage	19.387.578,71
Laufzeit > 360 Tage	0,00

Land der Gegenpartei:	Österreich
Abwicklung (bilateral/zentral etc.):	bilateral

Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten:

- Anteil der erhaltenen Sicherheiten, die weiterverwendet werden (...%uell):	0,00%
- Rendite des Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten:	0,00%

Verwahrer der erhaltenen Sicherheiten:

Anzahl:	1
Name der Verwahrer der Sicherheiten:	Erste Group Bank AG
Betrag der verwahrten Sicherheiten:	20.605.591,92

Verwahrung von Sicherheiten, die der Fonds gestellt hat:

Anteil der Sicherheiten, die auf gesonderten Konten gehalten werden:	Keine
--	-------

% Angabe zu Rendite und Kosten der einzelnen Finanzierungsgeschäfte

an Gesamttrendite der Finanzierungsgeschäfte:	100%
---	------

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	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Amtlich gehandelte Wertpapiere			
Aktien auf Euro lautend			
Emissionsland Österreich			
ADDIKO BANK AG INH.	AT000ADDIK00	0	78.750

Wien, im November 2020

Erste Asset Management GmbH
elektronisch gefertigt

Prüfinformation: Die elektronischen Signaturen dieses Dokumentes können unter www.signaturpruefung.gv.at geprüft werden.
Hinweis: Dieses Dokument wurde mit zwei qualifizierten elektronischen Signaturen gefertigt. Eine qualifizierte elektronische Signatur erfüllt das rechtliche Erfordernis einer eigenhändigen Unterschrift, insbesondere der Schriftlichkeit im Sinne des § 886 ABGB (§ 4 (1) Signaturgesetz).