

ERSTE BOND DANUBIA

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

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. - 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
Geschäftsführer	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
Prokuristen	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
Staatskommissäre	Mag. Wolfgang EXL (ab 01.09.2022) 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 BOND DANUBIA Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2022 bis 30.11.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2022	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	20,2	26,07
auf Polnische Zloty lautend	16,4	21,22
auf Rumänische Leu alt lautend	7,6	9,85
auf Russische Rubel lautend	11,3	14,61
auf Tschechische Kronen lautend	11,9	15,42
auf Ungarische Forint lautend	6,7	8,62
auf US-Dollar lautend	0,5	0,61
Wertpapiere	74,7	96,40
Devisentermingeschäfte	-0,0	-0,02
Bankguthaben	1,9	2,41
Zinsenansprüche	0,9	1,21
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	77,5	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2022 bis 30.11.2022)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Amtlich gehandelte Wertpapiere									
Anleihen auf Euro lautend									
Emissionsland Albanien									
ALBANIEN 18/25 REGS	XS1877938404	3,500	0	500	1.000	92,624	926.235,00	1,20	
							Summe Emissionsland Albanien	926.235,00	1,20
Emissionsland Mazedonien									
NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS	XS1744744191	2,750	0	500	600	94,064	564.384,00	0,73	
							Summe Emissionsland Mazedonien	564.384,00	0,73
Emissionsland Ukraine									
UKRAINE 20/32 REGS	XS2010033343 1)	0,000	0	0	1.350	20,100	271.350,00	0,35	
							Summe Emissionsland Ukraine	271.350,00	0,35
							Summe Anleihen auf Euro lautend	1.761.969,00	2,27
Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend									
Emissionsland Rumänien									
RUMAENIEN 19/23	ROJEC97WMUQ4	4,000	0	0	10.000	97,181	1.969.020,36	2,54	
							Summe Emissionsland Rumänien	1.969.020,36	2,54
							Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,93550	1.969.020,36	2,54
Anleihen auf Russische Rubel lautend									
Emissionsland Russland									
RUSS.FOEDER 19/25	RU000A100EG3 2)	0,000	0	0	200.000	43,000	1.371.483,98	1,77	
RUSS.FOEDER 19/30	RU000A100A82 1); 2)	0,000	0	0	300.000	43,000	2.057.225,97	2,66	
RUSS.FOEDER 20/28	RU000A102BT8 2)	0,000	0	-300.000	300.000	43,000	2.057.225,97	2,66	
RUSS.FOEDER 20/31	RU000A1028E3 2)	0,000	100.000	0	100.000	43,000	685.741,99	0,89	
RUSS.FOEDER 20/35	RU000A101F94 2)	0,000	0	-100.000	100.000	43,000	685.741,99	0,89	
RUSSIAN FED. 12-27	RU000A0JS3W6 2)	0,000	0	-150.000	150.000	43,000	1.028.612,98	1,33	
RUSSIAN FED. 13-23	RU000A0JTJL3 2)	0,000	0	0	100.000	43,000	685.741,99	0,89	
RUSSIAN FED. 17-22	RU000A0JXB41 2)	0,000	0	0	50.000	43,000	342.870,99	0,44	
RUSSIAN FED. 18-29	RU000A0ZYUA9 2)	0,000	0	0	350.000	43,000	2.400.096,96	3,10	
							Summe Emissionsland Russland	11.314.742,82	14,61
							Summe Anleihen auf Russische Rubel lautend umgerechnet zum Kurs von 62,70580	11.314.742,82	14,61

ERSTE BOND DANUBIA

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
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend								
Emissionsland Tschechische Republik								
TSCHECHIEN 21/32	CZ0001006233	1,750	0	0	50.000	77,908	1.599.852,15	2,07
Summe Emissionsland Tschechische Republik							1.599.852,15	2,07
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 24,34850							1.599.852,15	2,07
Anleihen auf Ungarische Forint lautend								
Emittent Internationale Finanzkorporation								
INTERN.FIN. 21/23 MTN	XS2406607411	2,625	0	0	360.000	91,417	802.832,71	1,04
Summe Emittent Internationale Finanzkorporation							802.832,71	1,04
Emissionsland Ungarn								
HUNGARY 11-28	HU0000402532	6,750	0	250.000	250.000	91,866	560.257,97	0,72
HUNGARY 14-25 25/B	HU0000402748	5,500	0	0	400.000	90,055	878.750,02	1,13
HUNGARY 15-24 24/B	HU0000403068	3,000	0	250.000	250.000	89,786	547.574,56	0,71
HUNGARY 15-31 31/A	HU0000403001	3,250	0	0	250.000	69,683	424.975,30	0,55
HUNGARY 16-27 27/A	HU0000403118	3,000	0	0	200.000	77,427	377.763,49	0,49
HUNGARY 17-26 26/D	HU0000403340	2,750	0	0	200.000	78,966	385.269,26	0,50
UNGARN 19/30 2030/A	HU0000403696	3,000	0	0	400.000	70,742	690.294,08	0,89
UNGARN 20/33	HU0000404744	2,250	420.000	0	420.000	59,635	611.006,89	0,79
UNGARN 22/32	HU0000405550	4,750	300.000	0	430.000	76,475	802.201,62	1,04
Summe Emissionsland Ungarn							5.278.093,19	6,81
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 409,92500							6.080.925,90	7,85
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							22.726.510,23	29,34
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Bulgarien								
BULGARIEN 20/30 MTN	XS2234571425	0,375	0	0	900	75,242	677.175,75	0,87
BULGARIEN 20/50 MTN	XS2234571771	1,375	0	0	1.000	58,620	586.203,99	0,76
Summe Emissionsland Bulgarien							1.263.379,74	1,63
Emissionsland Kasachstan								
KASACHSTAN 18/28 MTN REGS	XS1901718335	2,375	0	300	700	90,472	633.305,75	0,82
Summe Emissionsland Kasachstan							633.305,75	0,82
Emissionsland Kroatien								
KROATIEN 17/27	XS1428088626	3,000	0	200	800	100,437	803.498,00	1,04
KROATIEN 17/30	XS1713475306	2,750	0	0	1.000	95,170	951.695,00	1,23
KROATIEN 20/31	XS2190201983	1,500	0	0	1.000	85,131	851.312,50	1,10
Summe Emissionsland Kroatien							2.606.505,50	3,37

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 Lettland								
LETTLAND 16/36 MTN	XS1409726731	1,375	0	0	1.000	75,418	754.177,50	0,97
LETTLAND 18/28 MTN	XS1829276275	1,125	0	0	1.700	89,455	1.520.735,00	1,96
Summe Emissionsland Lettland							2.274.912,50	2,94
Emissionsland Litauen								
LITAUEN 15-35 MTN	XS1310032260	2,125	0	0	1.000	83,868	838.682,02	1,08
LITAUEN 20/30 MTN	XS2168038847	0,750	0	0	1.000	82,298	822.982,50	1,06
LITAUEN 20/50 MTN	XS2210006339	0,500	0	0	1.000	47,828	478.277,50	0,62
Summe Emissionsland Litauen							2.139.942,02	2,76
Emissionsland Polen								
BK GOSPOD.KRAJ. 16/26 MTN	XS1403619411	1,750	0	0	1.300	92,741	1.205.633,00	1,56
POLEN 16/36 MTN	XS1346201889	2,375	0	0	1.000	84,532	845.317,50	1,09
POLEN 18/26 MTN	XS1766612672	1,125	0	0	500	93,752	468.757,50	0,61
Summe Emissionsland Polen							2.519.708,00	3,25
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 15/25 MTN REGS	XS1312891549	2,750	0	0	1.000	97,029	970.292,50	1,25
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	500	0	900	75,498	679.477,50	0,88
RUMAENIEN 20/26 MTN REGS	XS2178857285	2,750	0	0	1.200	94,880	1.138.554,00	1,47
RUMAENIEN 20/29 MTN REGS	XS2262211076	1,375	0	0	750	74,693	560.195,63	0,72
RUMAENIEN 20/40 MTN REGS	XS2258400162	2,625	0	0	500	58,483	292.416,25	0,38
RUMAENIEN 20/50 MTN REGS	XS2109813142	3,375	500	0	1.200	61,199	734.382,00	0,95
Summe Emissionsland Rumänien							4.375.317,88	5,65
Emissionsland Serbien inkl. Kosovo								
SERBIEN 19/29 REGS	XS2015296465	1,500	0	1.500	500	75,346	376.727,50	0,49
SERBIEN 21/28 MTN REGS	XS2388561677	1,000	0	0	1.000	75,468	754.677,50	0,97
SERBIEN 21/36 MTN REGS	XS2388562139	2,050	0	0	500	60,836	304.180,00	0,39
Summe Emissionsland Serbien inkl. Kosovo							1.435.585,00	1,85
Emissionsland Ungarn								
HUNGARY 20/32	XS2161992511	1,625	0	0	500	73,267	366.332,50	0,47
UNGARN 20/35	XS2181689659	1,750	0	0	1.200	67,957	815.478,00	1,05
Summe Emissionsland Ungarn							1.181.810,50	1,53
Summe Anleihen auf Euro lautend							18.430.466,89	23,79
Anleihen auf Polnische Zloty lautend								
Emissionsland Deutschland								
KRED.F.WIED.22/24 MTN ZY	XS2433824757	3,900	0	0	5.000	94,740	1.013.370,41	1,31
Summe Emissionsland Deutschland							1.013.370,41	1,31

ERSTE BOND DANUBIA

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
Emittent Europäische Investitionsbank								
EIB EUR.INV.BK 17/24 MTN	XS1622379698	3,000	0	0	10.000	92,577	1.980.468,50	2,56
EIB EUR.INV.BK 19/29 MTN	XS1963719585	3,000	3.000	0	18.000	76,588	2.949.158,20	3,81
Summe Emittent Europäische Investitionsbank							4.929.626,70	6,36
Emittent Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung								
EBRD 20/22 MTN	XS2275666126	0,200	0	0	15.000	99,489	3.192.485,83	4,12
EBRD 21/26 MTN	XS2309419047	0,870	0	0	8.000	80,376	1.375.556,74	1,78
Summe Emittent Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung							4.568.042,57	5,90
Emissionsland Polen								
POLEN 08-29	PL0000105391	5,750	0	0	7.000	95,700	1.433.094,45	1,85
POLEN 14-25	PL0000108197	3,250	0	0	2.000	91,227	390.317,68	0,50
POLEN 15-26	PL0000108866	2,500	0	0	8.000	85,836	1.469.008,45	1,90
POLEN 16-27	PL0000109427	2,500	0	5.000	5.000	83,289	890.886,73	1,15
POLEN 19/30	PL0000112736	1,250	0	0	12.000	67,950	1.744.357,69	2,25
Summe Emissionsland Polen							5.927.665,00	7,65
Summe Anleihen auf Polnische Zloty lautend umgerechnet zum Kurs von 4,67450							16.438.704,68	21,22
Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend								
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 13/23	R01323DBN018	5,850	0	0	15.000	99,342	3.019.192,58	3,90
RUMAENIEN 16-31	R01631DBN055	3,650	0	0	10.000	74,903	1.517.637,52	1,96
Summe Emissionsland Rumänien							4.536.830,10	5,86
Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,93550							4.536.830,10	5,86
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend								
Emissionsland Tschechische Republik								
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	45.000	5.000	95,060	195.207,10	0,25
CZECH REP. 2024 58	CZ0001002547	5,700	0	0	55.000	100,110	2.261.350,80	2,92
CZECH REP. 2025 89	CZ0001004253	2,400	29.000	0	29.000	92,932	1.106.855,86	1,43
CZECH REP. 2026	CZ0001004469	1,000	0	0	20.000	87,359	717.571,92	0,93
CZECH REP. 2029	CZ0001005375	2,750	0	0	20.000	88,895	730.184,61	0,94
CZECH REP. 2030 94	CZ0001004477	0,950	0	0	20.000	76,515	628.494,57	0,81
CZECH REP. 2033	CZ0001005243	2,000	43.000	0	43.000	77,543	1.369.426,86	1,77
CZECH REP. 2036 49	CZ0001001796	4,200	0	0	85.000	95,554	3.335.766,06	4,31
Summe Emissionsland Tschechische Republik							10.344.857,78	13,36
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 24,34850							10.344.857,78	13,36
Anleihen auf Ungarische Forint lautend								
Emittent Asiatische Entwicklungsbank								
ASIAN DEV.BK 22/25 MTN	XS2502021053	9,500	250.000	0	250.000	97,190	592.730,38	0,77
Summe Emittent Asiatische Entwicklungsbank							592.730,38	0,77
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 409,92500							592.730,38	0,77

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	
Anleihen auf US-Dollar lautend									
Emissionsland Türkei									
TURKEY 13/43	US900123CB40	4,875	0	0	750	65,375	476.193,37	0,61	
							Summe Emissionsland Türkei	476.193,37	0,61
							Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,02965	476.193,37	0,61
							Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere	50.819.783,20	65,61

Nicht notierte Wertpapiere

Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend

Emissionsland Rumänien

RUMAENIEN 22/32	RO07A2H5YIN8	6,700	6.000	0	6.000	92,481	1.124.275,15	1,45	
							Summe Emissionsland Rumänien	1.124.275,15	1,45
							Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,93550	1.124.275,15	1,45
							Summe Nicht notierte Wertpapiere	1.124.275,15	1,45

Devisentermingeschäfte

**nicht realisiertes
Ergebnis in EUR**

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/PLN 15.12.2022	FXF_TAX_3462477				1.028.073		-39.417,35	-0,05	
FXF SPEST EUR/USD 15.12.2022	FXF_TAX_3462505				506.900		21.748,13	0,03	
							Summe Emissionsland Österreich	-17.669,22	-0,02
							Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	-17.669,22	-0,02
							Summe Devisentermingeschäfte	-17.669,22	-0,02

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	74.670.568,58	96,40
Devisentermingeschäfte	-17.669,22	-0,02
Bankguthaben	1.868.802,43	2,41
Zinsenansprüche	938.106,91	1,21
Sonstige Abgrenzungen	-1.597,23	-0,00
Fondsvermögen	77.458.211,47	100,00

1) Kurs beinhaltet Zinsabgrenzungen

2) Die russischen Anleihen werden mit JPM Kursen bewertet. Die erhöhte Wahrscheinlichkeit der Ausfälle und die vorhandenen Beschränkungen spiegeln sich in den von JPM beobachteten Marktbewertungen und den Handelseinschätzungen wider. JPM betrachtet die Bewertung dieser Wertpapiere aus der Position internationaler Investoren.

Hinweis an die Anleger:

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

ERSTE BOND DANUBIA

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000831409	Stück	957.544,015
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000831409	EUR	41,80
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	Stück	20.380,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	EUR	77,04
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XG74	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XG74	EUR	79,99
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XGA7	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XGA7	EUR	82,57
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQU4	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQU4	CZK	2.000,22
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQV2	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQV2	HUF	33.712,23
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812946	Stück	237.690,177
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812946	EUR	112,54
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1X5H0	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1X5H0	EUR	81,70
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XG82	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XG82	EUR	79,99
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XGB5	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XGB5	EUR	82,57
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQT6	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQT6	CZK	2.009,48
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQW0	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQW0	HUF	33.712,23
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	Stück	62.014,257
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	EUR	138,31
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	Stück	3.360,318
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	CZK	3.368,61
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	Stück	21,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	HUF	56.709,02
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1X5J6	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1X5J6	EUR	82,34
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	Stück	774,975
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	EUR	84,29
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQS8	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQS8	CZK	2.014,83
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQX8	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQX8	HUF	33.712,23

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 30.11.2022 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 %
LITAUEN 20/30 MTN	XS2168038847	1.000	0,60
POLEN 15-26	PL0000108866	3.750	0,30
POLEN 16-27	PL0000109427	1.105	0,30
RUMAENIEN 15/25 MTN REGS	XS1312891549	1.000	0,36
RUMAENIEN 20/29 MTN REGS	XS2262211076	750	0,36

Folgende Sicherheiten stehen für diese Leihegeschäfte zur Verfügung:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Nominale
SLOWAKEI 2025	SK4120007543	2.140.000
SLOWAKEI 19/30	SK4120015173	1.560.000

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: € 3.254.883,67
 in % vom Fondsvermögen (abzüglich Barmittel oder Barmitteläquivalent): 4,31%

Betrag der eingesetzten Vermögenswerte (ausschließlich WP Leihen):

(für die Art der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte): € 3.254.883,67
 in % des Fondsvermögens: 4,20%

Angaben zur Konzentration:

Zehn wichtigste Emittenten von Sicherheiten:

		Kurswert in Euro	
- Volumen der gestellten Sicherheiten und Angabe Emittent			
Republik Österreich	SK4120007543	€	2.251.678,83
Slowakei, Republik	SK4120015173	€	1.326.220,35
		€	3.577.899,18

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

Name der Gegenparteien: ausschließlich Erste Group Bank AG
 Bruttovolumen ausstehende Geschäfte: € 3.254.883,67

Aggregierte Transaktionsdaten für Jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft und Gesamttrenditeswap:

	ISIN	Art der Sicherheit	Laufzeit/Tage	Rating	Währung	Kurswert in Euro
Slowakei, Republik	SK4120007543	staatsgarantiert	unbefristet	A+	Euro €	2.251.678,83
Slowakei, Republik	SK4120015173	staatsgarantiert	unbefristet	A+	Euro €	1.326.220,35
						€ 3.577.899,18

Wertpapierleihe aufgeschlüsselt nach Laufzeiten:

Laufzeit < 1Tag
 Laufzeit 1-7 Tage
 Laufzeit 8-30 Tage
 Laufzeit 31-90 Tage 1.454.827,85
 Laufzeit 91- 360 Tage 1.800.055,82
 Laufzeit > 360 Tage

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: € 3.577.899,18

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	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Amtlich gehandelte Wertpapiere				
Anleihen auf Polnische Zloty lautend				
Emissionsland Polen				
POLEN 02/22 0922	PL0000102646	5,750	0	4.000
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2022 52	CZ0001001945	4,700	0	26.000
Anleihen auf Ungarische Forint lautend				
Emissionsland Ungarn				
HUNGARY 17-22 22/B	HU0000403266	1,750	0	500.000

ERSTE BOND DANUBIA

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Polen				
POLEN 10/25 MTN	XS0479333311	5,250	0	1.000
POLEN 12/24 MTN	XS0841073793	3,375	0	1.000
Emissionsland Türkei				
TURKEY 14/23 INTL	XS1057340009	4,125	0	500
Emissionsland Ungarn				
UNGARN 20/30	XS2259191273	0,500	0	1.000

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“)).