

ERSTE BOND DANUBIA

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.11.2023	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 (bis 31.10.2023) 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 Anteilhaber:innen,

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND DANUBIA Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2023 bis 30.11.2023 vorzulegen.

Am 23.11.2023 erfolgte die Abspaltung der illiquiden Teile des ERSTE BOND DANUBIA in den ABW ERSTE BOND DANUBIA - Investmentfonds in Abwicklung. Aufgrund der Abspaltung wurde das Anteilscheingeschäft zwischen 20.11.2023 und 23.11.2023 ausgesetzt. Ab 24.11.2023 war der ERSTE BOND DANUBIA wieder handelbar.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	19,4	30,66
auf Polnische Zloty lautend	14,4	22,80
auf Rumänische Leu alt lautend	6,3	10,02
auf Tschechische Kronen lautend	11,3	17,85
auf Ungarische Forint lautend	6,5	10,33
auf US-Dollar lautend	0,5	0,72
Investmentzertifikate		
auf Euro lautend	0,3	0,50
Wertpapiere	58,6	92,86
Devisentermingeschäfte	0,0	0,00
Bankguthaben	3,7	5,84
Zinsenansprüche	0,8	1,30
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	63,1	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2023 bis 30.11.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
						Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)		
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Albanien								
ALBANIEN 18/25 REGS	XS1877938404	3,500	0	0	1.000	98,063	980.625,00	1,55
Summe Emissionsland Albanien							980.625,00	1,55
Emissionsland Mazedonien								
NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS	XS1744744191	2,750	0	0	600	97,441	584.646,00	0,93
Summe Emissionsland Mazedonien							584.646,00	0,93
Emissionsland Ukraine								
UKRAINE 20/32 REGS	XS2010033343 1)	0,000	0	0	1.350	21,500	290.250,00	0,46
Summe Emissionsland Ukraine							290.250,00	0,46
Summe Anleihen auf Euro lautend							1.855.521,00	2,94
Anleihen auf Polnische Zloty lautend								
Emissionsland Polen								
POLEN 21/32	PL0000113783	1,750	6.000	0	14.500	75,582	2.517.229,97	3,99
Summe Emissionsland Polen							2.517.229,97	3,99
Summe Anleihen auf Polnische Zloty lautend umgerechnet zum Kurs von 4,35375							2.517.229,97	3,99
Anleihen auf Ungarische Forint lautend								
Emissionsland Ungarn								
HUNGARY 11-28	HU0000402532	6,750	0	0	250.000	99,695	654.035,62	1,04
HUNGARY 14-25 25/B	HU0000402748	5,500	0	0	400.000	97,751	1.026.058,39	1,62
HUNGARY 15-31 31/A	HU0000403001	3,250	0	0	250.000	80,163	525.901,07	0,83
HUNGARY 16-27 27/A	HU0000403118	3,000	0	0	200.000	87,676	460.151,94	0,73
HUNGARY 17-26 26/D	HU0000403340	2,750	0	0	200.000	88,066	462.200,09	0,73
UNGARN 19/30 2030/A	HU0000403696	3,000	0	0	200.000	81,253	426.443,35	0,68
UNGARN 20/33	HU0000404744	2,250	0	0	420.000	70,908	781.513,56	1,24
UNGARN 22/32	HU0000405550	4,750	0	0	430.000	86,254	973.281,01	1,54
Summe Emissionsland Ungarn							5.309.585,03	8,41
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 381,07500							5.309.585,03	8,41
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							9.682.336,00	15,33

ERSTE BOND DANUBIA

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Investmentzertifikate									
Investmentzertifikate auf Euro lautend									
Emissionsland Kroatien									
ERSTE E-CONSERVATIVE	HRERSIUCONS9		0	0	2.811	112,705	316.792,56	0,50	
							Summe Emissionsland Kroatien	316.792,56	0,50
							Summe Investmentzertifikate auf Euro lautend	316.792,56	0,50
							Summe Investmentzertifikate	316.792,56	0,50
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere									
Anleihen auf Euro lautend									
Emissionsland Bulgarien									
BULGARIEN 20/30 MTN	XS2234571425	0,375	0	0	900	78,688	708.187,50	1,12	
BULGARIEN 20/50 MTN	XS2234571771	1,375	0	0	1.000	55,047	550.468,75	0,87	
							Summe Emissionsland Bulgarien	1.258.656,25	1,99
Emissionsland Kasachstan									
KASACHSTAN 18/28 MTN REGS	XS1901718335	2,375	0	0	700	93,594	655.156,25	1,04	
							Summe Emissionsland Kasachstan	655.156,25	1,04
Emissionsland Kroatien									
KROATIEN 17/27	XS1428088626	3,000	0	0	800	98,625	789.000,00	1,25	
KROATIEN 17/30	XS1713475306	2,750	0	0	1.000	96,250	962.500,00	1,52	
KROATIEN 20/31	XS2190201983	1,500	0	0	1.000	87,125	871.250,00	1,38	
							Summe Emissionsland Kroatien	2.622.750,00	4,15
Emissionsland Lettland									
LETTLAND 16/36 MTN	XS1409726731	1,375	0	0	1.000	74,768	747.675,00	1,18	
LETTLAND 18/28 MTN	XS1829276275	1,125	0	0	1.200	89,730	1.076.760,00	1,71	
							Summe Emissionsland Lettland	1.824.435,00	2,89
Emissionsland Litauen									
LITAUEN 15-35 MTN	XS1310032260	2,125	0	0	1.000	83,128	831.279,98	1,32	
LITAUEN 20/30 MTN	XS2168038847	0,750	0	0	1.000	83,259	832.585,00	1,32	
LITAUEN 20/50 MTN	XS2210006339	0,500	0	0	1.000	44,629	446.290,00	0,71	
							Summe Emissionsland Litauen	2.110.154,98	3,34
Emissionsland Mazedonien									
NORDMAZEDON. 23/27 REGS	XS2582522681 1)	6,960	0	0	100	103,453	98.451,19	0,16	
							Summe Emissionsland Mazedonien	98.451,19	0,16

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale	Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.)	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Emissionsland Polen								
BK GOSPOD.KRAJ. 16/26 MTN	XS1403619411	1,750	0	0	1.300	94,750	1.231.750,00	1,95
BKRAJOWEGO 23/33 MTN	XS2589727168	5,125	0	0	250	105,234	263.085,94	0,42
POLEN 18/26 MTN	XS1766612672	1,125	0	0	500	93,976	469.880,00	0,74
POLEN 23/43 MTN	XS2586944147	4,250	0	0	1.000	99,275	992.750,02	1,57
Summe Emissionsland Polen							<u>2.957.465,96</u>	<u>4,68</u>
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 15/25 MTN REGS	XS1312891549	2,750	0	0	1.000	97,031	970.312,50	1,54
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	0	0	900	76,500	688.500,00	1,09
RUMAENIEN 20/26 MTN REGS	XS2178857285	2,750	0	0	1.000	96,828	968.281,25	1,53
RUMAENIEN 20/29 MTN REGS	XS2262211076	1,375	0	0	750	78,938	592.031,25	0,94
RUMAENIEN 20/40 MTN REGS	XS2258400162	2,625	0	0	500	61,250	306.250,00	0,49
Summe Emissionsland Rumänien							<u>3.525.375,00</u>	<u>5,58</u>
Emissionsland Serbien inkl. Kosovo								
SERBIEN 19/29 REGS	XS2015296465	1,500	0	0	500	80,188	400.937,50	0,63
SERBIEN 21/28 MTN REGS	XS2388561677	1,000	0	0	1.000	80,813	808.125,00	1,28
Summe Emissionsland Serbien inkl. Kosovo							<u>1.209.062,50</u>	<u>1,91</u>
Emissionsland Ungarn								
HUNGARY 20/32	XS2161992511	1,625	0	0	500	77,375	386.875,00	0,61
UNGARN 20/35	XS2181689659	1,750	0	0	1.200	71,100	853.200,00	1,35
Summe Emissionsland Ungarn							<u>1.240.075,00</u>	<u>1,96</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>17.501.582,13</u>	<u>27,72</u>
Anleihen auf Polnische Zloty lautend								
Emissionsland Deutschland								
KRED.F.WIED.22/24 MTN ZY	XS2433824757	3,900	0	0	5.000	99,636	1.144.254,95	1,81
Summe Emissionsland Deutschland							<u>1.144.254,95</u>	<u>1,81</u>
Emittent Europäische Investitionsbank								
EIB EUR.INV.BK 17/24 MTN	XS1622379698	3,000	0	0	10.000	98,557	2.263.715,19	3,59
EIB EUR.INV.BK 19/29 MTN	XS1963719585	3,000	0	0	18.000	86,655	3.582.635,66	5,67
Summe Emittent Europäische Investitionsbank							<u>5.846.350,85</u>	<u>9,26</u>
Emittent Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung								
EBRD 21/26 MTN	XS2309419047	0,870	0	0	8.000	90,129	1.656.117,14	2,62
Summe Emittent Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung							<u>1.656.117,14</u>	<u>2,62</u>
Emissionsland Polen								
POLEN 14-25	PL0000108197	3,250	0	0	2.000	96,775	444.559,29	0,70

ERSTE BOND DANUBIA

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
POLEN 15-26	PL0000108866	2,500	0	4.000	4.000	93,234	856.585,70	1,36
POLEN 16-27	PL0000109427	2,500	0	0	5.000	91,000	1.045.076,08	1,66
POLEN 19/30	PL0000112736	1,250	0	0	5.000	77,140	885.902,96	1,40
Summe Emissionsland Polen							3.232.124,03	5,12
Summe Anleihen auf Polnische Zloty lautend umgerechnet zum Kurs von 4,35375							11.878.846,97	18,81

Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend

Emissionsland Rumänien

RUMAENIEN 16-31	RO1631DBN055	3,650	0	0	10.000	81,121	1.632.821,07	2,59
RUMAENIEN 18/26	ROHRVN7NLN02	4,850	0	0	5.000	97,146	977.687,87	1,55
RUMAENIEN 19/34	RO4KELYFLVK4	4,750	0	0	6.000	83,496	1.008.369,31	1,60
RUMAENIEN 20/25	ROJOLNOCKHR8	3,500	2.500	0	2.500	95,473	480.425,31	0,76
RUMAENIEN 22/32	RO07A2H5YIN8	6,700	0	0	6.000	98,798	1.193.176,53	1,89
Summe Emissionsland Rumänien							5.292.480,09	8,38
Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,96815							5.292.480,09	8,38

Anleihen auf Tschechische Kronen lautend

Emissionsland Tschechische Republik

CZECH REP. 2024 58	CZ0001002547	5,700	0	0	55.000	99,900	2.258.787,26	3,58
CZECH REP. 2025 89	CZ0001004253	2,400	0	0	29.000	95,900	1.143.309,35	1,81
CZECH REP. 2026	CZ0001004469	1,000	0	0	20.000	92,002	756.439,88	1,20
CZECH REP. 2029	CZ0001005375	2,750	0	0	20.000	92,602	761.373,07	1,21
CZECH REP. 2030 94	CZ0001004477	0,950	0	0	20.000	81,748	672.131,55	1,06
CZECH REP. 2033	CZ0001005243	2,000	0	0	43.000	82,155	1.452.268,65	2,30
CZECH REP. 2036 49	CZ0001001796	4,200	27.000	0	62.000	99,153	2.527.229,60	4,00
TSSCHECHIEN 21/32	CZ0001006233	1,750	0	0	50.000	82,557	1.696.947,58	2,69
Summe Emissionsland Tschechische Republik							11.268.486,94	17,85
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 24,32500							11.268.486,94	17,85

Anleihen auf Ungarische Forint lautend

Emittent Asiatische Entwicklungsbank

ASIAN DEV.BK 22/25 MTN	XS2502021053	9,500	0	0	250.000	103,020	675.851,21	1,07
Summe Emittent Asiatische Entwicklungsbank							675.851,21	1,07

Emissionsland Deutschland

KRED.F.WIED.22/24 MTN UF	XS2524813545	11,500	200.000	0	200.000	101,780	534.173,06	0,85
Summe Emissionsland Deutschland							534.173,06	0,85
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 381,07500							1.210.024,27	1,92

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	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	66,000	453.670,61	0,72	
							Summe Emissionsland Türkei	453.670,61	0,72
							Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,09110	453.670,61	0,72
							Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere	47.605.091,01	75,39

Nicht notierte Wertpapiere

Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend

Emissionsland Rumänien

RUMAENIEN 23/33	ROWLVEJ2A207	7,200	5.000	0	5.000	102,575	1.032.325,92	1,63	
							Summe Emissionsland Rumänien	1.032.325,92	1,63
							Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,96815	1.032.325,92	1,63
							Summe Nicht notierte Wertpapiere	1.032.325,92	1,63

Devisentermingeschäfte

**nicht realisiertes
Ergebnis in EUR**

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/PLN 19.01.2024	FXF_TAX_3466711				675.155		-12.730,02	-0,02	
FXF SPEST EUR/USD 15.12.2023	FXF_TAX_3466473				471.296		13.275,18	0,02	
							Summe Emissionsland Österreich	545,16	0,00
							Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend	545,16	0,00
							Summe Devisentermingeschäfte	545,16	0,00

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere							58.636.545,49	92,86
Devisentermingeschäfte							545,16	0,00
Bankguthaben							3.687.963,86	5,84
Zinsenansprüche							818.993,51	1,30
Sonstige Abgrenzungen							-1.339,91	-0,00
Fondsvermögen							63.142.708,11	100,00

1) Kurs beinhaltet Zinsabgrenzungen

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000831409	Stück	824.871,437
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000831409	EUR	39,22
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	EUR	73,39

ERSTE BOND DANUBIA

Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812946	Stück	209.149,205
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812946	EUR	106,95
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	Stück	58.881,106
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	EUR	131,44
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	Stück	4.674,386
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	CZK	3.197,27
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	Stück	21,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	HUF	50.149,47
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	Stück	810,959
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	EUR	80,51

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 30.11.2023 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 %
LETTLAND 16/36 MTN	XS1409726731	1.000	0,90
LITAUEN 15-35 MTN	XS1310032260	500	0,84
LITAUEN 15-35 MTN	XS1310032260	500	1,20
POLEN 15-26	PL0000108866	3.861	0,30
POLEN 16-27	PL0000109427	2.496	0,30
POLEN 16-27	PL0000109427	2.504	0,30
SERBIEN 21/28 MTN REGS	XS2388561677	500	0,75

Folgende Sicherheiten stehen für diese Leihegeschäfte zur Verfügung:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Nominale
SLOWAKEI 20/32	SK4000017166	1.490.000
SLOWAKEI 2025	SK4120007543	2.330.000
SLOWAKEI 19/30	SK4120015173	740.000

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

Allgemeine Angaben:

Betrag der verliehenen Wertpapiere

Verleihe Wertpapiere:	€	3.883.587,64
in % vom Fondsvermögen (abzüglich Barmittel oder Barmitteläquivalent):		6,53%

Betrag der eingesetzten Vermögenswerte (ausschließlich WP Leihen):

(für die Art der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte):	€	3.883.587,64
in % des Fondsvermögens:		6,15%

Angaben zur Konzentration:

Zehn wichtigste Emittenten von Sicherheiten:

- Volumen der gestellten Sicherheiten und Angabe Emittent		Kurswert in Euro	
Slowakei, Republik	SK4000017166	€	1.214.520,58
Slowakei, Republik	SK4120007543	€	2.381.938,18
Slowakei, Republik	SK4120015173	€	631.904,91
		€	4.228.363,67

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

Name der Gegenparteien:	ausschließlich Erste Group Bank AG
Bruttovolumen ausstehende Geschäfte:	3.883.587,64

Aggregierte Transaktionsdaten für Jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft und Gesamtditeswap:

	ISIN	Art der Sicherheit	Laufzeit/Tage	Rating	Währung	Kurswert in Euro	
Slowakei, Republik	SK4000017166	staatsgarantiert	unbefristet	A+	Euro	€	1.214.520,58
Slowakei, Republik	SK4120007543	staatsgarantiert	unbefristet	A+	Euro	€	2.381.938,18
Slowakei, Republik	SK4120015173	staatsgarantiert	unbefristet	A+	Euro	€	631.904,91
						€	4.228.363,67

Wertpapierleihe aufgeschlüsselt nach Laufzeiten:

Laufzeit < 1Tag	
Laufzeit 1-7 Tage	
Laufzeit 8-30 Tage	€ 2.306.630,24
Laufzeit 31-90 Tage	€ 1.171.952,28
Laufzeit 91- 360 Tage	€ 405.005,12
Laufzeit > 360 Tage	

ERSTE BOND DANUBIA

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: € 4.228.363,67

Verwahrung von Sicherheiten, die der Fonds gestellt hat:

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

% Angabe zu Rendite und Kosten der einzelnen Finanzierungsgeschäfte

an Gesamrendite 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 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.

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

Wertpapier-Bezeichnung	Kennnummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Amtlich gehandelte Wertpapiere				
Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend				
Emissionsland Rumänien				
RUMAENIEN 19/23	ROJEC97WMMUQ4	4,000	0	10.000
Anleihen auf Russische Rubel lautend				
Emissionsland Russland				
RUSS.FOEDER 19/25	RU000A100EG3	0,000	0	200.000
RUSS.FOEDER 19/30	RU000A100A82	0,000	0	300.000
RUSS.FOEDER 20/28	RU000A102BT8	0,000	300.000	600.000
RUSS.FOEDER 20/31	RU000A1028E3	0,000	0	100.000
RUSS.FOEDER 20/35	RU000A101F94	0,000	100.000	200.000
RUSSIAN FED. 12-27	RU000A0JS3W6	0,000	0	150.000
RUSSIAN FED. 13-23	RU000A0JTJL3	0,000	0	100.000
RUSSIAN FED. 17-22	RU000A0JXB41	0,000	0	50.000
RUSSIAN FED. 18-29	RU000A0ZYUA9	0,000	0	350.000
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	5.000
Anleihen auf Ungarische Forint lautend				
Emissionsland Ungarn				
HUNGARY 15-24 24/B	HU0000403068	3,000	0	250.000
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Rumänien				
RUMAENIEN 20/50 MTN REGS	XS2109813142	3,375	0	200

ERSTE BOND DANUBIA

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Emissionsland Serbien inkl. Kosovo				
SERBIEN 21/33 MTN REGS	XS2308620793	1,650	500	500
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Ungarische Forint lautend				
Emittent Internationale Finanzkorporation				
INTERN.FIN. 21/23 MTN	XS2406607411	2,625	0	360.000

Wien, im Dezember 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“)).