

ERSTE BOND DANUBIA

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2021

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 30.11.2021.....	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.) (bis 31.10.2021) 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 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. Walter MEGNER Mag. Christoph SEEL
Fondsprüfer	Ernst & Young Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H.
Depotbank	Erste Group Bank AG

Sehr geehrte(r) Anteilssinhaber(in),

wir erlauben uns, Ihnen nachstehend den Halbjahresbericht des ERSTE BOND DANUBIA Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.06.2021 bis 30.11.2021 vorzulegen.

Für den 27. Oktober 2021 konnte aufgrund eines technischen Problems die Berechnung des Rechenwerts nicht durchgeführt werden. Daher war die Ausgabe- und Rücknahme von Anteilscheinen vorübergehend ausgesetzt.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2021	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	41,6	34,00
auf Polnische Zloty lautend	21,0	17,18
auf Rumänische Leu alt lautend	5,8	4,77
auf Russische Rubel lautend	21,2	17,32
auf Tschechische Kronen lautend	12,7	10,42
auf Türkische Lira alt lautend	2,9	2,40
auf Ungarische Forint lautend	10,3	8,38
auf US-Dollar lautend	1,7	1,38
Wertpapiere	117,3	95,83
Devisentermingeschäfte	-0,0	-0,02
Bankguthaben	3,3	2,69
Zinsenansprüche	1,8	1,50
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	122,4	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.11.2021

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.06.2021 bis 30.11.2021)

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	0	1.500	104,000	1.560.000,00	1,27
Summe Emissionsland Albanien							1.560.000,00	1,27
Emissionsland Irland								
VEB FINANCE 13/23 MTN	XS0893212398	4,032	0	0	2.000	103,053	2.061.064,00	1,68
Summe Emissionsland Irland							2.061.064,00	1,68
Emissionsland Mazedonien								
NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS	XS1744744191	2,750	0	0	1.100	102,606	1.128.668,75	0,92
Summe Emissionsland Mazedonien							1.128.668,75	0,92
Emissionsland Ukraine								
UKRAINE 20/30 REGS	XS2010033343	4,375	0	500	1.200	85,850	1.030.200,00	0,84
Summe Emissionsland Ukraine							1.030.200,00	0,84
Summe Anleihen auf Euro lautend							5.779.932,75	4,72
Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend								
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 16-31	RO1631DBN055	3,650	0	0	10.000	86,098	1.740.232,44	1,42
Summe Emissionsland Rumänien							1.740.232,44	1,42
Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,94750							1.740.232,44	1,42
Anleihen auf Russische Rubel lautend								
Emissionsland Russland								
RUSS.FOEDER 19/25	RU000A100EG3	7,150	0	100.000	200.000	95,677	2.285.544,34	1,87
RUSS.FOEDER 19/30	RU000A100A82	7,650	0	0	400.000	96,411	4.606.156,45	3,76
RUSS.FOEDER 20/28	RU000A102BT8	5,700	0	0	300.000	87,000	3.117.400,59	2,55
RUSS.FOEDER 20/31	RU000A1028E3	5,900	100.000	0	100.000	85,200	1.017.634,22	0,83
RUSS.FOEDER 20/35	RU000A101F94	6,100	0	0	100.000	83,200	993.746,09	0,81
RUSSIAN FED. 17-22	RU000A0JXB41	7,400	0	200.000	100.000	99,050	1.183.059,50	0,97
RUSSIAN FED. 18-29	RU000A0ZYUA9	6,900	0	50.000	350.000	92,492	3.866.556,14	3,16
Summe Emissionsland Russland							17.070.097,33	13,94
Summe Anleihen auf Russische Rubel lautend umgerechnet zum Kurs von 83,72360							17.070.097,33	13,94

ERSTE BOND DANUBIA

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
Anleihen auf Türkische Lira alt lautend								
Emissionsland Türkei								
TURKEY 12-22	TRT140922T17	8,500	0	0	10.000	92,700	620.255,66	0,51
TURKEY 13-23	TRT270923T11	8,800	0	0	5.000	83,424	279.094,98	0,23
TURKEY 14-24	TRT200324T13	10,400	0	0	5.000	82,350	275.501,91	0,23
TURKEY 14-24	TRT240724T15	9,000	0	0	5.000	77,200	258.272,58	0,21
TURKEY 18-28	TRT080328T15	12,400	0	5.000	5.000	71,050	237.697,76	0,19
Summe Emissionsland Türkei							1.670.822,89	1,36
Summe Anleihen auf Türkische Lira alt lautend umgerechnet zum Kurs von 14,94545							1.670.822,89	1,36
Anleihen auf Ungarische Forint lautend								
Emittent Internationale Finanzkorporation								
INTERN.FIN. 21/23 MTN	XS2406607411	2,625	360.000	0	360.000	97,596	961.839,66	0,79
Summe Emittent Internationale Finanzkorporation							961.839,66	0,79
Emissionsland Ungarn								
HUNGARY 11-28	HU0000402532	6,750	0	0	500.000	114,042	1.561.000,31	1,28
HUNGARY 14-25 25/B	HU0000402748	5,500	0	0	400.000	104,289	1.141.995,98	0,93
HUNGARY 15-24 24/B	HU0000403068	3,000	0	0	500.000	97,312	1.331.994,20	1,09
HUNGARY 15-31 31/A	HU0000403001	3,250	0	400.000	250.000	90,820	621.569,46	0,51
HUNGARY 16-27 27/A	HU0000403118	3,000	0	0	500.000	93,294	1.277.002,89	1,04
HUNGARY 17-22 22/B	HU0000403266	1,750	0	0	500.000	98,668	1.350.561,89	1,10
HUNGARY 17-26 26/D	HU0000403340	2,750	0	250.000	400.000	93,429	1.023.080,61	0,84
UNGARN 19/30 2030/A	HU0000403696	3,000	0	200.000	400.000	89,995	985.477,09	0,81
Summe Emissionsland Ungarn							9.292.682,43	7,59
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 365,28500							10.254.522,09	8,38
Anleihen auf US-Dollar lautend								
Emissionsland Irland								
VEB FINANCE 10/25MTN REGS	XS0559915961	6,800	0	0	1.000	115,157	1.023.074,36	0,84
Summe Emissionsland Irland							1.023.074,36	0,84
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,12560							1.023.074,36	0,84
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							37.538.681,86	30,67
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Bulgarien								
BULGARIEN 20/30 MTN	XS2234571425	0,375	0	400	900	98,125	883.125,00	0,72

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
BULGARIEN 20/50 MTN	XS2234571771	1,375	0	0	1.000	94,688	946.875,00	0,77
						Summe Emissionsland Bulgarien	1.830.000,00	1,49
Emissionsland Kasachstan								
KASACHSTAN 18/28 MTN REGS	XS1901718335	2,375	0	800	1.000	110,150	1.101.500,00	0,90
						Summe Emissionsland Kasachstan	1.101.500,00	0,90
Emissionsland Kroatien								
KROATIEN 17/27	XS1428088626	3,000	0	0	1.000	112,364	1.123.635,00	0,92
KROATIEN 17/30	XS1713475306	2,750	0	0	1.000	112,303	1.123.030,00	0,92
KROATIEN 20/31	XS2190201983	1,500	0	500	1.500	100,750	1.511.250,00	1,23
						Summe Emissionsland Kroatien	3.757.915,00	3,07
Emissionsland Lettland								
LETTLAND 16/36 MTN	XS1409726731	1,375	0	0	1.000	111,908	1.119.082,50	0,91
LETTLAND 18/28 MTN	XS1829276275	1,125	0	0	2.000	106,695	2.133.900,00	1,74
						Summe Emissionsland Lettland	3.252.982,50	2,66
Emissionsland Litauen								
LITAUEN 15-35 MTN	XS1310032260	2,125	0	1.000	1.000	121,193	1.211.925,96	0,99
LITAUEN 20/30 MTN	XS2168038847	0,750	0	0	1.000	103,920	1.039.202,50	0,85
LITAUEN 20/50 MTN	XS2210006339	0,500	0	0	1.000	89,804	898.042,50	0,73
						Summe Emissionsland Litauen	3.149.170,96	2,57
Emissionsland Polen								
BK GOSPOD.KRAJ. 16/26 MTN	XS1403619411	1,750	0	0	1.300	106,884	1.389.495,25	1,14
POLEN 10/25 MTN	XS0479333311	5,250	0	0	1.000	116,636	1.166.360,00	0,95
POLEN 12/24 MTN	XS0841073793	3,375	0	500	1.000	109,063	1.090.630,00	0,89
POLEN 16/36 MTN	XS1346201889	2,375	0	0	1.000	120,003	1.200.030,00	0,98
POLEN 18/26 MTN	XS1766612672	1,125	0	0	1.000	104,908	1.049.080,00	0,86
						Summe Emissionsland Polen	5.895.595,25	4,82
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 15/25 MTN REGS	XS1312891549	2,750	0	0	1.000	107,775	1.077.750,00	0,88
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	500	200	1.300	112,250	1.459.250,00	1,19
RUMAENIEN 20/26 MTN REGS	XS2178857285	2,750	0	0	1.200	106,725	1.280.700,00	1,05
RUMAENIEN 20/29 MTN REGS	XS2262211076	1,375	0	0	750	95,375	715.312,50	0,58
RUMAENIEN 20/40 MTN REGS	XS2258400162	2,625	0	0	500	88,813	444.062,50	0,36
RUMAENIEN 20/50 MTN REGS	XS2109813142	3,375	700	0	1.700	93,813	1.594.812,50	1,30
						Summe Emissionsland Rumänien	6.571.887,50	5,37

ERSTE BOND DANUBIA

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 Serbien inkl. Kosovo								
SERBIEN 19/29 REGS	XS2015296465	1,500	0	1.000	2.500	94,625	2.365.625,00	1,93
SERBIEN 21/28 MTN REGS	XS2388561677	1,000	1.000	0	1.000	93,086	930.859,99	0,76
Summe Emissionsland Serbien inkl. Kosovo							3.296.484,99	2,69
Emissionsland Türkei								
TURKEY 14/23 INTL	XS1057340009	4,125	0	0	1.500	102,687	1.540.297,50	1,26
Summe Emissionsland Türkei							1.540.297,50	1,26
Emissionsland Ungarn								
MFB MAGYAR F.BK 15/21	XS1330975977	2,375	0	0	2.700	100,135	2.703.645,00	2,21
UNGARN 20/30	XS2259191273	0,500	0	1.000	1.000	97,435	974.350,00	0,80
UNGARN 20/35	XS2181689659	1,750	0	0	1.700	104,108	1.769.836,00	1,45
Summe Emissionsland Ungarn							5.447.831,00	4,45
Summe Anleihen auf Euro lautend							35.843.664,70	29,28
Anleihen auf Polnische Zloty lautend								
Emittent Europäische Investitionsbank								
EIB EUR.INV.BK 17/24 MTN	XS1622379698	3,000	0	0	10.000	99,736	2.142.188,24	1,75
Summe Emittent Europäische Investitionsbank							2.142.188,24	1,75
Emittent Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung								
EBRD 20/22 MTN	XS2275666126	0,200	0	0	15.000	97,093	3.128.130,50	2,56
EBRD 21/26 MTN	XS2309419047	0,870	8.000	0	8.000	91,970	1.580.308,43	1,29
Summe Emittent Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung							4.708.438,93	3,85
Emissionsland Polen								
POLEN 02/22 0922	PL0000102646	5,750	0	10.000	15.000	103,050	3.320.052,41	2,71
POLEN 14-25	PL0000108197	3,250	0	8.000	7.000	100,711	1.514.190,90	1,24
POLEN 15-26	PL0000108866	2,500	0	0	8.000	97,456	1.674.573,65	1,37
POLEN 16-27	PL0000109427	2,500	0	5.000	10.000	96,563	2.074.036,69	1,69
POLEN 18/29	PL0000111498	2,750	0	0	11.000	97,557	2.304.925,04	1,88
POLEN 19/30	PL0000112736	1,250	0	0	7.000	86,100	1.294.514,37	1,06
POLEN 20/25	PL0000112728	0,750	10.000	0	10.000	92,830	1.993.857,12	1,63
Summe Emissionsland Polen							14.176.150,18	11,58
Summe Anleihen auf Polnische Zloty lautend umgerechnet zum Kurs von 4,65580							21.026.777,35	17,18

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
Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend								
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 13/23	RO1323DBN018	5,850	0	5.000	15.000	102,013	3.092.849,92	2,53
Summe Emissionsland Rumänien							3.092.849,92	2,53
Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,94750							3.092.849,92	2,53
Anleihen auf Russische Rubel lautend								
Emissionsland Russland								
RUSSIAN FED. 12-27	RU000A0JS3W6	8,150	0	50.000	150.000	99,045	1.774.499,66	1,45
RUSSIAN FED. 13-23	RU000A0JTJL3	7,000	0	130.000	200.000	98,450	2.351.786,12	1,92
Summe Emissionsland Russland							4.126.285,78	3,37
Summe Anleihen auf Russische Rubel lautend umgerechnet zum Kurs von 83,72360							4.126.285,78	3,37
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend								
Emissionsland Tschechische Republik								
CZECH REP. 2022 52	CZ0001001945	4,700	26.000	0	26.000	101,460	1.036.995,11	0,85
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	0	50.000	95,720	1.881.400,24	1,54
CZECH REP. 2024 58	CZ0001002547	5,700	0	0	55.000	106,950	2.312.341,53	1,89
CZECH REP. 2026	CZ0001004469	1,000	0	30.000	40.000	93,050	1.463.136,58	1,20
CZECH REP. 2028	CZ0001003859	2,500	32.000	0	32.000	99,550	1.252.275,09	1,02
CZECH REP. 2029	CZ0001005375	2,750	0	0	20.000	100,950	793.678,87	0,65
CZECH REP. 2036 49	CZ0001001796	4,200	0	5.000	85.000	120,003	4.009.753,92	3,28
Summe Emissionsland Tschechische Republik							12.749.581,34	10,42
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 25,43850							12.749.581,34	10,42
Anleihen auf Türkische Lira alt lautend								
Emittent Asiatische Entwicklungsbank								
ASIAN DEV.BK 20/22 MTN	XS2215768370	20,500	0	0	10.000	97,898	655.035,48	0,54
Summe Emittent Asiatische Entwicklungsbank							655.035,48	0,54
Emittent Weltbank								
WORLD BK 21/23 MTN	XS2303825223	13,250	0	0	10.000	90,720	607.007,48	0,50
Summe Emittent Weltbank							607.007,48	0,50
Summe Anleihen auf Türkische Lira alt lautend umgerechnet zum Kurs von 14,94545							1.262.042,96	1,03

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 US-Dollar lautend

Emissionsland Türkei

TURKEY 13/43	US900123CB40	4,875	0	0	1.000	75,568	671.357,50	0,55
Summe Emissionsland Türkei							671.357,50	0,55
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,12560							671.357,50	0,55
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							78.772.559,55	64,35

Nicht notierte Wertpapiere

Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend

Emissionsland Rumänien

RUMAENIEN 19/23	ROJEC97WMUQ4	4,000	0	0	5.000	99,245	1.002.981,30	0,82
Summe Emissionsland Rumänien							1.002.981,30	0,82
Summe Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend umgerechnet zum Kurs von 4,94750							1.002.981,30	0,82
Summe Nicht notierte Wertpapiere							1.002.981,30	0,82

Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/RUB 17.12.2021	FXF_TAX_3458204				1.202.436		12.401,25	0,01
FXF SPEST EUR/RUB 17.12.2021	FXF_TAX_3458320				-1.182.463		7.576,95	0,01
FXF SPEST EUR/USD 17.12.2021	FXF_TAX_3457827				1.815.133		-50.013,08	-0,04
Summe Emissionsland Österreich							-30.034,88	-0,02
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							-30.034,88	-0,02
Summe Devisentermingeschäfte							-30.034,88	-0,02

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	117.314.222,71	95,83
Devisentermingeschäfte	-30.034,88	-0,02
Bankguthaben	3.297.603,68	2,69
Zinsenansprüche	1.837.308,27	1,50
Sonstige Abgrenzungen	-5.606,73	-0,00
Fondsvermögen	122.413.493,05	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000831409	Stück	1.312.410,585
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000831409	EUR	50,35
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	Stück	20.380,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	EUR	92,21
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XG74	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XG74	EUR	95,05
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XGA7	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XGA7	EUR	98,12
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQU4	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQU4	CZK	2.483,30
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQV2	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQV2	HUF	35.695,65
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812946	Stück	326.292,114
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812946	EUR	133,75
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1X5H0	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1X5H0	EUR	97,08
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XG82	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XG82	EUR	95,05
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XGB5	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XGB5	EUR	98,12
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQT6	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQT6	CZK	2.494,75
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQW0	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQW0	HUF	35.695,65
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	Stück	62.012,015
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	EUR	164,37
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	Stück	2.505,374
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	CZK	4.182,59
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	Stück	21,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	HUF	60.041,89
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1X5J6	Stück	753,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1X5J6	EUR	97,74
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	Stück	1.172,568
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	EUR	99,67

ERSTE BOND DANUBIA

Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQS8	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQS8	CZK	2.501,36
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQX8	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQX8	HUF	35.695,65

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 30.11.2021 mit den nachstehend angeführten (Teil-)Beträgen und den nachstehend angeführten Gebühren im Wertpapierleihsystem der Erste Group Bank AG verliehen:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	verliehener	Gebühren-
		(Teil-)Betrag Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	satz in %
LITAUEN 20/30 MTN	XS2168038847	1.000	0,30
POLEN 15-26	PL0000108866	5.000	0,15
POLEN 16/36 MTN	XS1346201889	200	0,30
POLEN 16-27	PL0000109427	4.000	0,15
POLEN 18/29	PL0000111498	5.100	0,15
POLEN 20/25	PL0000112728	10.000	0,15
RUMAENIEN 20/29 MTN REGS	XS2262211076	500	0,20

Folgende Sicherheiten stehen für diese Leihegeschäfte zur Verfügung:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Stück/Nominale/absolut (Nominale in 1.000, ger.)
OESTERR. 13/23	AT0000A105W3	3.604
SLOWAKEI 2025	SK4120007543	3.100

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:	€	6.733.054,94
in % vom Fondsvermögen (abzüglich Barmittel oder Barmitteläquivalent):		5,65%

Betrag der eingesetzten Vermögenswerte (ausschließlich WP Leihen):

(für die Art der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte):	€	6.733.054,94
in % des Fondsvermögens:		5,50%

Angaben zur Konzentration:

Zehn wichtigste Emittenten von Sicherheiten:

		Kurswert in Euro
- Volumen der gestellten Sicherheiten und Angabe Emittent		
Republik Österreich AT0000A105W3	€	3.783.254,63
Slowakei, Republik SK4120007543	€	3.748.366,70
	€	7.531.621,32

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

Name der Gegenparteien:		ausschließlich Erste Group Bank AG
Bruttovolumen ausstehende Geschäfte:		6.733.054,94

Aggregierte Transaktionsdaten für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft und Gesamtwert:

	ISIN	Art der Sicherheit	Laufzeit/Tage	Rating	Währung		Kurswert in Euro
Republik Österreich	AT0000A105W3	staatsgarantiert	unbefristet	AA+	Euro	€	3.783.254,63
Slowakei, Republik	SK4120007543	staatsgarantiert	unbefristet	A	Euro	€	3.748.366,70
						€	7.531.621,32

Wertpapierleihe aufgeschlüsselt nach Laufzeiten:

Laufzeit < 1Tag	
Laufzeit 1-7 Tage	
Laufzeit 8-30 Tage	2.153.037,78
Laufzeit 31-90 Tage	3.059.663,98
Laufzeit 91- 360 Tage	1.520.353,18
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:	€ 7.531.621,32

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 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 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 Mazedonien				
NORDMAZEDON. 20/26 REGS	XS2181690665	3,675	0	300
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2021 61	CZ0001002851	3,850	0	26.000
TSCHECHIEN 21/32	CZ0001006233	1,750	25.000	25.000
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Kasachstan				
KASACHSTAN 18/23 MTN REGS	XS1907130246	1,550	0	600
Emissionsland Rumänien				
RUMAENIEN 15/35 MTN REGS	XS1313004928	3,875	0	1.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Rumänische Leu alt lautend				
Emissionsland Rumänien				
RUMAENIEN 20/30	ROINPAL298G4	4,150	0	10.000

Wien, im Dezember 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“)).