

ABW ERSTE BOND DANUBIA - Investmentfonds in Abwicklung

Abspaltungsbericht gem. § 65 Abs. 3 InvFG 2011
für den Zeitraum 23.11.2023 bis 30.11.2023

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Angaben zur Abwicklung.....	4
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens	5
Vermögensaufstellung zum 30.11.2023	7

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 %)
Aufsichtsrät:innen	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. Gerald WEBER vom Betriebsrat entsandt: Martin CECH Mag. Regina HABERHAUER Ing. Heinrich Hubert REINER Peter RIEDERER Nicole WEINHENGST Mag. Manfred ZOUREK
Geschäftsführer:innen	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Thomas KRAUS
Prokurist:innen	Karl FREUDENSCHUSS Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER Mag. Magdalena UJWARY, MA
Staatskommissär:innen	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 Abspaltungsbericht gem. § 65 Abs. 3 InvFG 2011 des ABW ERSTE BOND DANUBIA - Investmentfonds in Abwicklung für den Zeitraum vom 23.11.2023 bis 30.11.2023 vorzulegen.

Angaben zur Abwicklung

Portfolio-Bericht

Aufgrund der geltenden EU-Sanktionen gegen Russland bzw. gegen russische Banken und Zentraldepositare sowie russischen Sanktionen gegen Investoren aus „unfreundlichen“ Jurisdiktionen, darunter Österreich, waren Transaktionen mit russischen Wertpapieren bzw. Vermögenstransfers weder an der Börse in Moskau noch OTC gestattet bzw. möglich. Der Fondsmanager hat nach wie vor keinen Zugriff auf Wertpapier- sowie Geldkonten bei der Depotbank in Russland. Das Portfolio ist unverändert und besteht aus Positionen in 9 RUB-denominierten russischen Staatsanleihen.

Das Fondsmanagement verfolgt die Situation am Markt mit aller gebotenen Aufmerksamkeit weiterhin konsequent, um auf neue Entwicklungen - sofern möglich - rasch und angemessen zu reagieren. Sobald die Rahmenbedingungen es zulassen und die Abwicklung einzelner Positionen oder des gesamten Fonds möglich ist, wird die Verwaltungsgesellschaft unter Anwendung größter Sorgfalt versuchen, den Zeitpunkt und die Art und Weise für die Veräußerung der russischen Vermögenswerte im besten Interesse aller Anteilhaber: innen zu bestimmen.

Markt

In der Periode vom 23.11.2023 bis 30.11.2023 verlor der RUB gegenüber dem EUR 1,43%, die an der Moskauer Börse gehandelten Anleihen bewegten sich im Preis kaum.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2023	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Russische Rubel lautend	1,0	91,00
Wertpapiere	1,0	91,00
Bankguthaben	0,1	8,99
Zinsenansprüche	0,0	0,00
Fondsvermögen	1,1	100,00

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

2. Fondsergebnis

a. Realisiertes Fondsergebnis

Ordentliches Fondsergebnis

Erträge (ohne Kursergebnis)

Zinserträge (exkl. Ertragsausgleich)	463,48	
Dividendenerträge	0,00	
Sonstige Erträge 8)	0,00	
Summe Erträge (ohne Kursergebnis)		463,48

Sollzinsen

0,00

Aufwendungen

Vergütung an die KAG	0,00	
Kosten für Wirtschaftsprüfer u. strl. Vertretung	0,00	
Publizitätskosten	0,00	
Wertpapierdepotgebühren	0,00	
Depotbankgebühren	0,00	
Kosten für den externen Berater	0,00	
Performancefee	-	
Gebühr Fremdwährungsanteilscheine 9)	0,00	
Summe Aufwendungen		0,00
Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds 1)		0,00

Ordentl. Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

463,48

Realisiertes Kursergebnis 2) 3)

Realisierte Gewinne 4)	0,00	
Realisierte Verluste 5)	0,00	

Realisiertes Kursergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

0,00

Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)

463,48

b. Nicht realisiertes Kursergebnis 2) 3)

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses 7)	- 14.350.793,23
---	-----------------

Ergebnis des Quartals 6)

- 14.350.329,75

c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich für Erträge des Quartals	0,00
Ertragsausgleich für Gewinnvorträge von Ausschüttungsanteilen	0,00

Fondsergebnis gesamt

- 14.350.329,75

3. Entwicklung des Fondsvermögens

Fondsvermögen am Beginn des Quartals	0,00
Ausschüttung / Auszahlung im Quartal	0,00
Kapitalrückzahlung	0,00
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen	15.462.471,71
Fondsergebnis gesamt	
(das Fondsergebnis ist im Detail im Punkt 2. dargestellt)	- 14.350.329,75
Fondsvermögen am Ende des Quartals	<u>1.112.141,96</u>

- 1) Von Dritten geleistete Rückvergütungen (im Sinn von Provisionen) werden nach Abzug angemessener Aufwandsentschädigungen an den Kapitalanlagefonds weitergeleitet. Zur Deckung des administrativen Aufwands erhält die Erste Group Bank AG 25 % der errechneten Provisionen als Aufwandsentschädigung.
- 2) Realisierte Gewinne und realisierte Verluste sind nicht periodenabgegrenzt und stehen so wie die Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses nicht unbedingt in Beziehung zu der Wertentwicklung des Fonds im Quartal.
- 3) Kursergebnis gesamt, ohne Ertragsausgleich (realisiertes Kursergebnis, ohne Ertragsausgleich, zuzüglich Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses): EUR -14.350.793,23.
- 4) Davon Gewinne aus Derivatgeschäften: EUR 0,00.
- 5) Davon Verluste aus Derivatgeschäften: EUR 0,00.
- 6) Das Ergebnis des Quartals beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von EUR 0,00.
- 7) Davon Veränderung unrealisierte Gewinne EUR 0,00 und unrealisierte Verluste EUR -14.350.793,23.
- 8) Die in dieser Position ausgewiesenen Erträge entfielen auf Leihegebühren aus Wertpapierleihegeschäften iHv EUR 0,00, die mit der Erste Group Bank AG getätigt wurden, auf Erträge aus Immobilienfonds iHv EUR 0,00, auf sonstige Erträge iHv EUR 0,00 sowie auf Erträge aus Rücknahmeabschlägen iHv EUR 0,00.
- 9) Dem Fonds wird pro Fremdwährungsstranche eine monatliche Gebühr für die Administration der Fremdwährungsanteilscheine angelastet.

Vermögensaufstellung zum 30.11.2023

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 23.11.2023 bis 30.11.2023)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zins- satz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Russische Rubel lautend								
Emissionsland Russland								
RUSS.FOEDER 19/25	RU000A100EG3	0,000	200.000	0	200.000	6,000	122.677,81	11,03
RUSS.FOEDER 19/30	RU000A100A82	1) 0,000	300.000	0	300.000	6,000	184.016,72	16,55
RUSS.FOEDER 20/28	RU000A102BT8	0,000	300.000	0	300.000	6,000	184.016,72	16,55
RUSS.FOEDER 20/31	RU000A1028E3	0,000	100.000	0	100.000	6,000	61.338,91	5,52
RUSS.FOEDER 20/35	RU000A101F94	0,000	100.000	0	100.000	6,000	61.338,91	5,52
RUSSIAN FED. 12-27	RU000A0JS3W6	0,000	150.000	0	150.000	6,000	92.008,36	8,27
RUSSIAN FED. 13-23	RU000A0JTJL3	0,000	100.000	0	100.000	6,000	61.338,91	5,52
RUSSIAN FED. 17-22	RU000A0JXB41	0,000	50.000	0	50.000	6,000	30.669,45	2,76
RUSSIAN FED. 18-29	RU000A0ZYUA9	0,000	350.000	0	350.000	6,000	214.686,17	19,30
Summe Emissionsland Russland							<u>1.012.091,96</u>	<u>91,00</u>
Summe Anleihen auf Russische Rubel lautend umgerechnet zum Kurs von 97,81720							<u>1.012.091,96</u>	<u>91,00</u>
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							<u>1.012.091,96</u>	<u>91,00</u>

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	1.012.091,96	91,00
Bankguthaben	100.000,00	8,99
Zinsenansprüche	50,00	0,00
Fondsvermögen	1.112.141,96	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	AT0000A38GU0	Stück	827.504,100
Indikativer Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A38GU0	EUR	0,68
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A38GV8	Stück	209.488,290
Indikativer Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A38GV8	EUR	1,88
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GW6	Stück	58.607,080
Indikativer Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GW6	EUR	2,31
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GR6	Stück	4.636,410
Indikativer Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GR6	CZK	56,19
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GX4	Stück	21,000
Indikativer Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GX4	HUF	880,28
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GS4	Stück	810,960
Indikativer Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A38GS4	EUR	1,41

Wien, den 5. 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“)).