

ERSTE RESERVE EURO

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2020/21

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft	3
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	4
Vermögensaufstellung zum 28.02.2021	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.) 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. Thomas KRAUS (ab 01.01.2021) Mag. Wolfgang TRAINDL (bis 28.02.2021)
Prokuristen	Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL Oliver RÖDER
Staatskommissäre	Mag. Walter MEGNER (ab 01.10.2020) Mag. Christoph SEEL
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 RESERVE EURO Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.09.2020 bis 28.02.2021 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 28.02.2021	
	Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	310,4	96,41
Wertpapiere	310,4	96,41
Bankguthaben	11,5	3,57
Zinsenansprüche	0,1	0,02
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,01
Fondsvermögen	321,9	100,00

Vermögensaufstellung zum 28.02.2021

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.09.2020 bis 28.02.2021)

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Bestand	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
					(Nom. in 1.000, ger.)			
Amtlich gehandelte Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Dänemark								
DANSKE BK 16/21 MTN	XS1390245329	0,500	200	0	200	100,175	200.350,00	0,06
Summe Emissionsland Dänemark							200.350,00	0,06
Emissionsland Deutschland								
DT.PFBR.BANK MTN.35346VAR	DE000A2YNV36	0,361	0	0	5.000	101,095	5.054.750,00	1,57
Summe Emissionsland Deutschland							5.054.750,00	1,57
Emissionsland Finnland								
CT.BK.SAV.BKS 18/21FLRMTN	XS1788972765	0,000	100	0	100	100,005	100.005,00	0,03
OP.YRITYSPA. 21/24 FLR	XS2287753987 1)	0,450	7.000	0	7.000	102,395	7.163.975,00	2,23
Summe Emissionsland Finnland							7.263.980,00	2,26
Emissionsland Frankreich								
BPCE S.A. 18/23 FLR MTN	FR0013309317	0,000	1.500	0	1.500	100,510	1.507.650,00	0,47
CR.MUT.ARKEA 19/21 FLRMTM	FR0013463742	0,111	200	0	200	100,369	200.738,00	0,06
Summe Emissionsland Frankreich							1.708.388,00	0,53
Emissionsland Italien								
INTESA SAN. 17/22 FLR MTN	XS1599167589	0,398	6.000	0	6.000	100,730	6.043.800,00	1,88
Summe Emissionsland Italien							6.043.800,00	1,88
Emissionsland Luxemburg								
INTESA SANP. 19/21 FLRMTN	XS2057069507	0,208	2.000	0	2.000	100,238	2.004.760,00	0,62
Summe Emissionsland Luxemburg							2.004.760,00	0,62
Emissionsland Niederlande								
BMW FINANCE 20/22 FLR MTN	XS2122422921	0,000	0	0	5.000	100,380	5.019.000,00	1,56
SIEMENS FIN 19/21 MTN FLR	XS2093242373	0,156	0	0	6.000	100,465	6.027.900,00	1,87
Summe Emissionsland Niederlande							11.046.900,00	3,43
Emissionsland Norwegen								
SPAREBANKEN SOER 18/21FLR	XS1815076838	0,000	200	0	6.200	100,075	6.204.650,00	1,93
Summe Emissionsland Norwegen							6.204.650,00	1,93

ERSTE RESERVE EURO

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 Österreich								
KOMMUNALKRED. 17/21 MTN	XS1645257590	0,375	200	0	200	99,968	199.936,00	0,06
OMV AG 19/21 FLR MTN	XS2009169132	0,000	0	0	5.000	100,110	5.005.500,00	1,55
RAIF.BK INTL 18/21 MTN	XS1852213930	0,250	4.000	0	4.000	100,220	4.008.800,00	1,25
Summe Emissionsland Österreich							<u>9.214.236,00</u>	<u>2,86</u>
Emissionsland Schweden								
NORDEA BK 17/21 FLR MTN	XS1689534029	0,000	0	0	4.000	100,310	4.012.400,00	1,25
NORDEA BK 18/22 FLR MTN	XS1766857434	0,000	3.000	0	3.000	100,490	3.014.700,00	0,94
VOLVO TREAS.19/21 FLR MTN	XS2036918824	0,000	100	0	100	100,140	100.140,00	0,03
Summe Emissionsland Schweden							<u>7.127.240,00</u>	<u>2,21</u>
Emissionsland Schweiz								
UBS AG LDN 18/21 FLR MTN	XS1810806049	0,000	200	0	8.838	100,035	8.841.093,30	2,75
Summe Emissionsland Schweiz							<u>8.841.093,30</u>	<u>2,75</u>
Emissionsland Spanien								
BBVA 17/22 FLR MTN	XS1594368539	0,050	0	0	5.000	100,560	5.028.000,00	1,56
BBVA 18/23 FLR MTN	XS1788584321	0,066	4.000	0	7.000	100,515	7.036.050,00	2,19
BCO SANTAND. 21/26FLR MTN	XS2293577354	0,137	2.000	0	2.000	99,960	1.999.200,00	0,62
BCO SANTANDER 17/22FLRMTN	XS1578916261	0,479	0	0	2.000	100,950	2.019.000,00	0,63
BCO SANTANDER 17/23 FLR	XS1689234570	0,209	4.000	0	5.000	100,865	5.043.250,00	1,57
BCO SANTANDER 17/24FLRMTN	XS1717591884	0,207	3.000	0	3.000	100,855	3.025.650,00	0,94
Summe Emissionsland Spanien							<u>24.151.150,00</u>	<u>7,50</u>
Emissionsland USA								
AT + T 2023 FLR	XS1907118464	0,326	0	0	3.000	101,320	3.039.600,00	0,94
Summe Emissionsland USA							<u>3.039.600,00</u>	<u>0,94</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>91.900.897,30</u>	<u>28,55</u>
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							<u>91.900.897,30</u>	<u>28,55</u>
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere								
Anleihen auf Euro lautend								
Emissionsland Belgien								
KBC GROEP 16/21 MTN	BE6286238561	1,000	200	0	200	100,230	200.460,00	0,06
KBC GROEP 17/22 MTN FLR	BE0002281500	0,007	0	0	8.500	100,695	8.559.075,00	2,66
Summe Emissionsland Belgien							<u>8.759.535,00</u>	<u>2,72</u>
Emissionsland Dänemark								
JYSKE BK 17/22 MTN FLR	XS1726323436	0,072	1.000	0	6.000	100,845	6.050.700,00	1,88
Summe Emissionsland Dänemark							<u>6.050.700,00</u>	<u>1,88</u>

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 Deutschland								
COBA MTN 17/22 VAR880	DE000CZ40L22	0,218	0	0	3.000	100,125	3.003.750,00	0,93
DAIMLER MTN 17/24	DE000A2GSCY9	0,000	0	0	5.000	100,095	5.004.750,00	1,55
SAP SE MTN FLR 18/21	DE000A2G8VS7	0,000	0	0	5.000	100,015	5.000.750,00	1,55
VOLKSWAGEN BK. MTN 17/21	XS1734547919	0,000	500	0	500	100,095	500.475,00	0,16
VOLKSWAGEN BK. MTN 18/21	XS1830992563	0,168	1.000	0	5.000	100,345	5.017.250,00	1,56
VOLKSWAGEN LEASING 17/21	XS1642546078	0,000	0	0	5.000	100,110	5.005.500,00	1,55
Summe Emissionsland Deutschland							23.532.475,00	7,31
Emissionsland Frankreich								
BNP PARIBAS 17/22 FLR MTN	XS1584041252	0,313	0	0	4.500	101,155	4.551.975,00	1,41
BNP PARIBAS 17/24 FLR MTN	XS1626933102	0,223	2.500	0	2.500	101,220	2.530.500,00	0,79
BNP PARIBAS 18/23 FLR MTN	XS1756434194	0,000	0	0	5.000	100,640	5.032.000,00	1,56
BNP PARIBAS 18/23 FLR MTN	XS1823532996	0,077	3.000	0	3.000	100,860	3.025.800,00	0,94
BPCE S.A. 18/23 FLR MTN	FR0013323672	0,000	0	0	8.500	100,585	8.549.725,00	2,66
CARREFOUR BNQ. 16/21 MTN	FR0013155868	0,127	0	0	2.000	100,018	2.000.360,00	0,62
CARREFOUR BNQ. 18/22 MTN	FR0013342664	0,077	500	0	500	100,310	501.550,00	0,16
CREDIT AGR.LN 17/22FLRMTN	XS1598861588	0,247	0	0	5.000	100,800	5.040.000,00	1,57
CREDIT AGR.LN 18/23FLRMTN	XS1787278008	0,073	0	0	10.000	100,715	10.071.500,00	3,13
GECINA 17-22 FLR MTN	FR0013266343	0,000	0	0	3.000	100,355	3.010.650,00	0,94
RCI BANQUE 17/21 FLR MTN	FR0013250685	0,100	0	0	3.000	100,050	3.001.500,00	0,93
RCI BANQUE 18/23 FLR MTN	FR0013309606	0,000	0	0	3.000	99,940	2.998.200,00	0,93
STE GENERALE 17/22FLR MTN	XS1586146851	0,309	0	0	5.000	100,785	5.039.250,00	1,57
STE GENERALE 17/24FLR MTN	XS1616341829	0,257	0	0	4.100	101,260	4.151.660,00	1,29
STE GENERALE 18/23FLR MTN	FR0013321791	0,000	0	0	5.000	100,505	5.025.250,00	1,56
STE GENERALE 19/21FLR MTN	FR0013444841	0,123	200	0	200	100,325	200.650,00	0,06
Summe Emissionsland Frankreich							64.730.570,00	20,11
Emissionsland Großbritannien								
ASTRAZENECA 16/21 MTN	XS1411403709	0,250	0	0	500	100,043	500.215,00	0,16
COCA-COLA EU.P. 17/21 FLR	XS1717567587	0,000	0	0	3.000	100,230	3.006.900,00	0,93
GLAXOSM.CAP. 19/21 FLRMTN	XS2054626358	0,068	200	0	200	100,253	200.506,00	0,06
HSBC BANK 19/21 FLR MTN	XS2008290426	0,073	200	0	200	100,160	200.320,00	0,06
HSBC HLDGS 17/22 FLR MTN	XS1586214956	0,158	0	0	5.000	100,350	5.017.500,00	1,56
HSBC HLDGS 17/23 FLR MTN	XS1681855539	0,000	4.000	0	7.000	100,405	7.028.350,00	2,18
LLOYDS BKG GRP 17/24 MTN	XS1633845158	0,239	2.000	0	5.000	101,175	5.058.750,00	1,57
NM PLC 18/21 FLR MTN	XS1884702207	0,358	0	0	7.000	100,460	7.032.200,00	2,18
SANTAN.UK GRP 18/24FLRMTN	XS1799039976	0,308	2.000	0	2.000	100,775	2.015.500,00	0,63
Summe Emissionsland Großbritannien							30.060.241,00	9,34
Emissionsland Italien								
ACEA S.P.A. 18/23 MTN FLR	XS1767087940	0,000	0	0	500	100,240	501.200,00	0,16
Summe Emissionsland Italien							501.200,00	0,16

ERSTE RESERVE EURO

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 Kanada								
BK MONTREAL 18/22 FLR MTN	XS1791326728	0,000	0	0	1.000	100,490	1.004.900,00	0,31
BK NOVA SCOT. 17/22 FLR	XS1694774420	0,055	0	0	5.000	100,825	5.041.250,00	1,57
Summe Emissionsland Kanada							<u>6.046.150,00</u>	<u>1,88</u>
Emissionsland Niederlande								
ABN AMRO BANK 18/21 FLR	XS1917574755	0,000	0	0	4.500	100,390	4.517.550,00	1,40
BAYER CAP.CORP. 18/22 FLR	XS1840614736	0,009	1.200	0	6.200	100,350	6.221.700,00	1,93
BMW FINANCE 20/22 FLR MTN	XS2221879153	0,061	0	0	2.000	100,585	2.011.700,00	0,62
DAIMLER INTL FIN.17/22FLR	DE000A19HBM3	0,000	0	0	5.000	100,295	5.014.750,00	1,56
DAIMLER INTL FIN.18/23FLR	DE000A19UNN9	0,000	0	0	7.000	100,655	7.045.850,00	2,19
DT. BAHN FIN.14/22FLR MTN	XS1107266782	0,000	0	0	1.500	100,590	1.508.850,00	0,47
ING BANK 19/21 FLR MTN	XS1976945995	0,000	0	0	6.000	100,055	6.003.300,00	1,86
ING GROEP 18/23 MTN FLR	XS1882544205	0,309	3.000	0	3.000	101,595	3.047.850,00	0,95
VOLKSWAGEN INTL 18/24 FLR	XS1910947941	1,003	3.000	0	3.000	103,660	3.109.800,00	0,97
Summe Emissionsland Niederlande							<u>38.481.350,00</u>	<u>11,95</u>
Emissionsland Schweiz								
CR.SUISSE GR 21/26 FLRMTN	CH0591979635	0,450	3.000	0	3.000	101,200	3.036.000,00	0,94
CS AG LDN 20/21 FLR MTN	XS2124933842	0,061	0	0	6.000	100,285	6.017.100,00	1,87
CS LONDON 20/22 FLR MTN	XS2176687270	0,407	0	0	5.000	101,105	5.055.250,00	1,57
UBS GROUP 17-22 FLR MTN	CH0359915425	0,159	0	0	5.000	100,345	5.017.250,00	1,56
Summe Emissionsland Schweiz							<u>19.125.600,00</u>	<u>5,94</u>
Emissionsland USA								
B.A.T. CAP. 17/21 FLR MTN	XS1664643746	0,000	0	0	5.000	100,145	5.007.250,00	1,56
BANK AMERI. 17/23 FLRMTN	XS1602557495	0,240	4.000	0	4.000	100,630	4.025.200,00	1,25
CITIGROUP 18/23 FLR MTN	XS1795253134	0,000	3.000	0	3.000	100,580	3.017.400,00	0,94
GOLDMAN S.GRP 17/23 FLR	XS1691349523	0,079	3.000	0	4.000	100,375	4.015.000,00	1,25
JPM.CH.BK 19/21 FLR MTN	XS1752918901	0,213	0	0	3.000	100,225	3.006.750,00	0,93
MORGAN STANLEY 17/22FLR J	XS1603892065	0,157	1.000	0	2.000	100,395	2.007.900,00	0,62
MORGAN STANLEY 18/21 FLR	XS1824289901	0,000	100	0	100	100,110	100.110,00	0,03
Summe Emissionsland USA							<u>21.179.610,00</u>	<u>6,58</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>218.467.431,00</u>	<u>67,86</u>
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							<u>218.467.431,00</u>	<u>67,86</u>

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	310.368.328,30	96,41
Bankguthaben	11.505.140,85	3,57
Zinsenansprüche	64.787,41	0,02
Sonstige Abgrenzungen	-19.835,30	-0,01
Fondsvermögen	321.918.421,26	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000724299	Stück	46.596,824
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000724299	EUR	992,52
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1YF17	Stück	420.104,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1YF17	EUR	99,49
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1YF25	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1YF25	EUR	99,70
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000724307	Stück	132.597,163
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000724307	EUR	1.268,04
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1YF33	Stück	2.000,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1YF33	EUR	99,81
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A2B5B8	Stück	7.704,764
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A2B5B8	EUR	100,34
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0H8D4	Stück	12.951,216
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A0H8D4	EUR	1.279,63
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YF41	Stück	192.506,669
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YF41	EUR	99,86
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YF58	Stück	289.774,305
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1YF58	EUR	99,94

1) Kurs beinhaltet Zinsabgrenzungen.

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 28.2.2021 mit den nachstehend angeführten (Teil-)Beträgen und den nachstehend angeführten Gebühren im Wertpapierleihsystem der Erste Group Bank AG verliehen:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	verliehener (Teil-)Betrag Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Gebühren- satz in %
UBS GROUP 17-22 FLR MTN	CH0359915425	4.000	0,15

ERSTE RESERVE EURO

Folgende Sicherheiten stehen für diese Leihegeschäfte zur Verfügung:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Nominale
OESTERR. 13/23	AT0000A105W3	4.040.000,00

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:	€	4.015.054,33
in % vom Fondsvermögen (abzüglich Barmittel oder Barmitteläquivalent):		1,29%

Betrag der eingesetzten Vermögenswerte (ausschließlich WP Leihen):

(für die Art der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte):	€	4.015.054,33
in % des Fondsvermögens:		1,25%

Angaben zur Konzentration:

Zehn wichtigste Emittenten von Sicherheiten:

- Volumen der gestellten Sicherheiten und Angabe Emittent		Kurswert in Euro	
Republik Österreich	AT0000A105W3	€	4.314.900,85
		€	4.314.900,85

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

Name der Gegenparteien:	ausschließlich Erste Group Bank AG
Bruttovolumen ausstehende Geschäfte:	4.015.054,33

Aggregierte Transaktionsdaten für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft und Gesamtrenditeswap:

	ISIN	Art der Sicherheit	Laufzeit/Tage	Rating	Währung	Kurswert in Euro
Republik Österreich	AT0000A105W3	staatsgarantiert	unbefristet	AA+	Euro €	4.314.900,85
					€	4.314.900,85

Wertpapierleihe aufgeschlüsselt nach Laufzeiten:

Laufzeit < 1Tag	
Laufzeit 1-7 Tage	
Laufzeit 8-30 Tage	
Laufzeit 31-90 Tage	€ 4.015.054,33
Laufzeit 91- 360 Tage	
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:	€	4.314.900,85

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 Gesamtrendite 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	Verkäufe/ Abgänge
Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)				

Amtlich gehandelte Wertpapiere**Anleihen auf Euro lautend****Emissionsland Frankreich**

BNP PARIBAS 10/20 MTN	XS0562852375	3,750	0	1.700
-----------------------	--------------	-------	---	-------

In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere**Anleihen auf Euro lautend****Emissionsland Belgien**

AB INBEV 18/24 FLR MTN	BE6301509012	0,000	0	4.000
------------------------	--------------	-------	---	-------

ERSTE RESERVE EURO

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Nicht notierte Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Deutschland				
COBA MTN 18/20 VAR919	DE000CZ40NL4	0,000	0	1.500
SAP SE IS FLR 18/20	DE000A2TSTC2	0,000	0	2.500
VOLKSW.FIN.SERV.MTN.19/21	XS1952701982	0,287	0	1.000
Emissionsland Finnland				
AKTIA BK 17/20 FLR MTN	XS1697551080	0,000	0	3.000
Emissionsland Luxemburg				
MEDTR.GLB HD 19/21	XS1960676127	0,000	0	2.000
Emissionsland Niederlande				
ABN AMRO BK 19/21 FLR	XS1935134095	0,000	0	6.500
ING BK NV 18/20 FLR MTN	XS1914936999	0,000	0	1.800
Emissionsland Österreich				
HYPO NOE L.F.N.W. 14/21	XS1019711479	0,393	0	700
KA FINANZ AG 14/21 MTN	XS1033673440	1,625	3.000	3.000
Emissionsland Schweden				
SCANIA CV 18/20 FLR MTN	XS1808497264	0,000	0	7.000
SKAND.ENSJ. 15/20 FLR MTN	XS1291152624	0,112	0	3.000
Emissionsland USA				
BANK AMERI. 17/21 FLRMTN	XS1687279841	0,000	0	1.000

Wien, im März 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“)).