

ERSTE RESPONSIBLE STOCK EUROPE

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2022

Inhaltsübersicht

| | |
|--|---|
| Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft | 3 |
| Zusammensetzung des Fondsvermögens..... | 4 |
| Vermögensaufstellung zum 31.08.2022 | 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 Radovan JELASITY Dr. Peter PROBER Mag. Rupert RIEDER Gabriele SEMMELROCK-WERZER Mag. Reinhard WATTL 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. Dr. Angelika SCHÄTZ Mag. Wolfgang TRISKO (bis 14.05.2022) |
| 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 RESPONSIBLE STOCK EUROPE Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 01.03.2022 bis 31.08.2022 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

| | per 31.08.2022 | |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| | Mio. Euro | % |
| Aktien | | |
| auf Britische Pfund lautend | 34,8 | 21,22 |
| auf Dänische Kronen lautend | 10,3 | 6,31 |
| auf Euro lautend | 75,4 | 45,95 |
| auf Norwegische Kronen lautend | 3,1 | 1,86 |
| auf Schwedische Kronen lautend | 5,8 | 3,51 |
| auf Schweizer Franken lautend | 24,5 | 14,93 |
| Wertpapiere | 153,8 | 93,78 |
| Bankguthaben | 9,8 | 5,99 |
| Dividendenansprüche | 0,4 | 0,23 |
| Zinsenansprüche | 0,0 | 0,00 |
| Sonstige Abgrenzungen | -0,0 | -0,01 |
| Fondsvermögen | 164,0 | 100,00 |

Vermögensaufstellung zum 31.08.2022

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 01.03.2022 bis 31.08.2022)

| Wertpapier-Bezeichnung | Kenn- nummer | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.) | Verkäufe/ Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds- vermögen |
|---|-----------------|---|----------------------|---------|-----------|--------------------|--------------------------------------|
| Amtlich gehandelte Wertpapiere | | | | | | | |
| Aktien auf Britische Pfund lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Großbritannien | | | | | | | |
| ASTRAZENECA PLC DL-,25 | GB0009895292 | 0 | 19.300 | 61.715 | 106,440 | 7.601.625,41 | 4,63 |
| DIAGEO PLC LS-,28935185 | GB0002374006 | 0 | 0 | 103.230 | 37,640 | 4.496.415,21 | 2,74 |
| SEGRO PLC LS-,10 | GB00B5ZN1N88 | 0 | 67.000 | 37.000 | 9,430 | 403.760,92 | 0,25 |
| TESCO PLC LS-,0633333 | GB00BLGZ9862 | 0 | 0 | 694.249 | 2,487 | 1.998.029,58 | 1,22 |
| UNILEVER PLC LS-,031111 | GB00B10RZP78 | 0 | 0 | 7.950 | 39,255 | 361.137,82 | 0,22 |
| Summe Emissionsland Großbritannien | | | | | | 14.860.968,94 | 9,06 |
| Summe Aktien auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86415 | | | | | | 14.860.968,94 | 9,06 |
| Aktien auf Dänische Kronen lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Dänemark | | | | | | | |
| DSV BONUS-AKT. | DK0060079531 | 14.000 | 0 | 14.000 | 1.096,500 | 2.064.041,63 | 1,26 |
| NOVO-NORDISK NAM.B DK-,20 | DK0060534915 | 0 | 33.000 | 61.050 | 792,500 | 6.505.290,86 | 3,97 |
| ORSTED A/S DK 10 | DK0060094928 | 0 | 17.100 | 18.168 | 726,900 | 1.775.675,37 | 1,08 |
| Summe Emissionsland Dänemark | | | | | | 10.345.007,86 | 6,31 |
| Summe Aktien auf Dänische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 7,43735 | | | | | | 10.345.007,86 | 6,31 |
| Aktien auf Euro lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Belgien | | | | | | | |
| KBC GROEP N.V. | BE0003565737 | 0 | 0 | 25.490 | 47,380 | 1.207.716,20 | 0,74 |
| Summe Emissionsland Belgien | | | | | | 1.207.716,20 | 0,74 |
| Emissionsland Deutschland | | | | | | | |
| ADIDAS AG NA O.N. | DE000A1EWWW0 | 0 | 5.000 | 6.290 | 148,280 | 932.681,20 | 0,57 |
| ALLIANZ SE NA O.N. | DE0008404005 | 0 | 0 | 16.000 | 168,580 | 2.697.280,00 | 1,64 |
| MERCEDES-BENZ GRP NA O.N. | DE0007100000 | 0 | 0 | 55.000 | 56,120 | 3.086.600,00 | 1,88 |
| MUENCH.RUECKVERS.VNA O.N. | DE0008430026 | 0 | 0 | 6.794 | 238,200 | 1.618.330,80 | 0,99 |
| PUMA SE | DE0006969603 | 0 | 0 | 21.660 | 61,020 | 1.321.693,20 | 0,81 |
| SIEMENS AG NA O.N. | DE0007236101 | 26.000 | 19.740 | 26.000 | 101,080 | 2.628.080,00 | 1,60 |
| SYMRISE AG INH. O.N. | DE000SYM9999 | 0 | 0 | 8.447 | 104,350 | 881.444,45 | 0,54 |
| Summe Emissionsland Deutschland | | | | | | 13.166.109,65 | 8,03 |
| Emissionsland Großbritannien | | | | | | | |
| UNILEVER PLC LS-,031111 | GB00B10RZP78 | 0 | 0 | 114.750 | 45,300 | 5.198.175,00 | 3,17 |
| Summe Emissionsland Großbritannien | | | | | | 5.198.175,00 | 3,17 |

ERSTE RESPONSIBLE STOCK EUROPE

| Wertpapier-Bezeichnung | Kenn- nummer | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale | Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds- vermögen |
|---|-----------------|-------------------------------------|---|-----------|---------|--------------------|--------------------------------------|
| Emissionsland Irland | | | | | | | |
| CRH PLC EO-,32 | IE0001827041 | 0 | 25.000 | 41.526 | 36,795 | 1.527.949,17 | 0,93 |
| Summe Emissionsland Irland | | | | | | 1.527.949,17 | 0,93 |
| Emissionsland Niederlande | | | | | | | |
| STELLANTIS NV EO -,01 | NL00150001Q9 | 0 | 0 | 152.000 | 13,336 | 2.027.072,00 | 1,24 |
| Summe Emissionsland Niederlande | | | | | | 2.027.072,00 | 1,24 |
| Emissionsland Spanien | | | | | | | |
| CELLNEX TELECOM SA EO-,25 | ES0105066007 | 0 | 0 | 12.200 | 38,770 | 472.994,00 | 0,29 |
| Summe Emissionsland Spanien | | | | | | 472.994,00 | 0,29 |
| Summe Aktien auf Euro lautend | | | | | | 23.600.016,02 | 14,39 |
| Aktien auf Schwedische Kronen lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Schweden | | | | | | | |
| ALFA LAVAL AB SK 2,5 | SE0000695876 | 51.000 | 0 | 51.000 | 285,500 | 1.361.780,73 | 0,83 |
| ATLAS COPCO A | SE0017486889 | 194.640 | 0 | 194.640 | 108,740 | 1.979.485,48 | 1,21 |
| EPIROC AB A | SE0015658109 | 0 | 0 | 84.361 | 163,650 | 1.291.185,45 | 0,79 |
| EQT AB | SE0012853455 | 50.000 | 0 | 50.000 | 240,300 | 1.123.711,10 | 0,69 |
| Summe Emissionsland Schweden | | | | | | 5.756.162,76 | 3,51 |
| Summe Aktien auf Schwedische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 10,69225 | | | | | | 5.756.162,76 | 3,51 |
| Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere | | | | | | 54.562.155,58 | 33,27 |
| In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere | | | | | | | |
| Aktien auf Britische Pfund lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Großbritannien | | | | | | | |
| ASHTAD GRP PLC LS-,10 | GB0000536739 | 0 | 0 | 21.740 | 42,500 | 1.069.200,95 | 0,65 |
| COMPASS GROUP LS-,1105 | GB00BD6K4575 | 0 | 0 | 113.500 | 18,590 | 2.441.665,22 | 1,49 |
| CRODA INTL LS-,10609756 | GB00BJFFLV09 | 0 | 0 | 23.000 | 67,260 | 1.790.175,32 | 1,09 |
| GSK PLC LS-,3125 | GB00BN7SWP63 | 139.988 | 0 | 139.988 | 13,794 | 2.234.559,36 | 1,36 |
| HALEON PLC LS 0,01 | GB00BMX86B70 | 174.985 | 0 | 174.985 | 2,589 | 524.155,15 | 0,32 |
| ITV PLC LS -,10 | GB0033986497 | 0 | 0 | 420.900 | 0,643 | 313.184,86 | 0,19 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | GB00BYW0PQ60 | 0 | 0 | 153.220 | 6,506 | 1.153.560,52 | 0,70 |
| LEGAL GENL GRP PLCLS-,025 | GB0005603997 | 0 | 0 | 596.850 | 2,525 | 1.743.963,72 | 1,06 |
| LLOYDS BKG GRP LS-,10 | GB0008706128 | 0 | 0 | 3.232.310 | 0,439 | 1.641.309,53 | 1,00 |
| NATIONAL GRID PLC | GB00BDR05C01 | 0 | 0 | 157.740 | 10,780 | 1.967.756,99 | 1,20 |
| RECKITT BENCK.GRP LS -,10 | GB00B24CGK77 | 0 | 0 | 32.990 | 66,480 | 2.537.956,60 | 1,55 |
| STAND. CHART. PLC DL-,50 | GB0004082847 | 0 | 0 | 218.970 | 5,982 | 1.515.799,97 | 0,92 |
| VODAFONE GROUP PLC | GB00BH4HKS39 | 0 | 1.200.000 | 753.840 | 1,157 | 1.009.132,80 | 0,62 |
| Summe Emissionsland Großbritannien | | | | | | 19.942.420,99 | 12,16 |
| Summe Aktien auf Britische Pfund lautend umgerechnet zum Kurs von 0,86415 | | | | | | 19.942.420,99 | 12,16 |

| Wertpapier-Bezeichnung | Kenn- nummer | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale | Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds- vermögen |
|--|-----------------|-------------------------------------|---|---------|---------|--------------------|--------------------------------------|
| Aktien auf Euro lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Belgien | | | | | | | |
| UMICORE S.A. | BE0974320526 | 0 | 0 | 34.270 | 31,750 | 1.088.072,50 | 0,66 |
| Summe Emissionsland Belgien | | | | | | 1.088.072,50 | 0,66 |
| Emissionsland Frankreich | | | | | | | |
| AIR LIQUIDE INH. EO 5,50 | FR0000120073 | 1.558 | 10.000 | 17.138 | 125,200 | 2.145.677,60 | 1,31 |
| AXA S.A. INH. EO 2,29 | FR0000120628 | 0 | 0 | 88.580 | 23,525 | 2.083.844,50 | 1,27 |
| BNP PARIBAS INH. EO 2 | FR0000131104 | 0 | 35.000 | 39.960 | 46,485 | 1.857.540,60 | 1,13 |
| CAPGEMINI SE INH. EO 8 | FR0000125338 | 0 | 0 | 11.300 | 173,000 | 1.954.900,00 | 1,19 |
| DASSAULT SYS SE INH.EO0,1 | FR0014003TT8 | 0 | 39.200 | 19.025 | 38,575 | 733.889,38 | 0,45 |
| KERING S.A. INH. EO 4 | FR0000121485 | 0 | 0 | 4.560 | 503,000 | 2.293.680,00 | 1,40 |
| LVMH EO 0,3 | FR0000121014 | 0 | 4.000 | 11.580 | 647,500 | 7.498.050,00 | 4,57 |
| OREAL (L') INH. EO 0,2 | FR0000120321 | 0 | 0 | 10.000 | 343,250 | 3.432.500,00 | 2,09 |
| PERNOD RICARD O.N. | FR0000120693 | 9.500 | 0 | 9.500 | 183,550 | 1.743.725,00 | 1,06 |
| SANOFI SA INHABER EO 2 | FR0000120578 | 36.000 | 0 | 36.000 | 82,180 | 2.958.480,00 | 1,80 |
| SCHNEIDER ELEC. INH. EO 4 | FR0000121972 | 0 | 0 | 36.140 | 118,780 | 4.292.709,20 | 2,62 |
| ST GOBAIN EO 4 | FR0000125007 | 0 | 19.000 | 23.453 | 40,350 | 946.328,55 | 0,58 |
| Summe Emissionsland Frankreich | | | | | | 31.941.324,83 | 19,47 |
| Emissionsland Niederlande | | | | | | | |
| AHOLD DELHAIZE,KON.EO-,01 | NL0011794037 | 0 | 0 | 49.480 | 27,400 | 1.355.752,00 | 0,83 |
| ASML HOLDING EO -,09 | NL0010273215 | 0 | 0 | 16.970 | 484,650 | 8.224.510,50 | 5,01 |
| ING GROEP NV EO -,01 | NL0011821202 | 0 | 120.000 | 83.990 | 8,766 | 736.256,34 | 0,45 |
| KONINKLIJKE DSM EO 1,50 | NL0000009827 | 0 | 10.800 | 9.700 | 127,350 | 1.235.295,00 | 0,75 |
| NN GROUP NV EO -,12 | NL0010773842 | 0 | 0 | 42.495 | 40,970 | 1.741.020,15 | 1,06 |
| PROSUS NV EO -,05 | NL0013654783 | 22.000 | 0 | 22.000 | 61,750 | 1.358.500,00 | 0,83 |
| STMICROELECTRONICS | NL0000226223 | 0 | 21.000 | 46.370 | 34,745 | 1.611.125,65 | 0,98 |
| Summe Emissionsland Niederlande | | | | | | 16.262.459,64 | 9,91 |
| Emissionsland Spanien | | | | | | | |
| AMADEUS IT GRP SA EO 0,01 | ES0109067019 | 25.000 | 40.345 | 25.000 | 52,620 | 1.315.500,00 | 0,80 |
| CORPORACION A.E.R. EO 1 | ES0105563003 | 0 | 0 | 28.200 | 41,440 | 1.168.608,00 | 0,71 |
| Summe Emissionsland Spanien | | | | | | 2.484.108,00 | 1,51 |
| Summe Aktien auf Euro lautend | | | | | | 51.775.964,97 | 31,57 |
| Aktien auf Norwegische Kronen lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Norwegen | | | | | | | |
| ADEVINTA ASA NK1 | N00010844038 | 70.000 | 0 | 70.000 | 81,150 | 569.231,15 | 0,35 |
| AKER HORIZONS ASA NK 1 | N00010921232 | 0 | 0 | 81.660 | 17,960 | 146.966,32 | 0,09 |
| DNB BANK ASA NK 100 | N00010161896 | 0 | 0 | 122.670 | 190,000 | 2.335.576,32 | 1,42 |
| Summe Emissionsland Norwegen | | | | | | 3.051.773,79 | 1,86 |
| Summe Aktien auf Norwegische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 9,97925 | | | | | | 3.051.773,79 | 1,86 |

ERSTE RESPONSIBLE STOCK EUROPE

| Wertpapier-Bezeichnung | Kenn- nummer | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale | Verkäufe/ Abgänge (Nom. in 1.000, ger.) | Bestand | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds- vermögen |
|---|-----------------|-------------------------------------|---|---------|-----------|--------------------|--------------------------------------|
| Aktien auf Schweizer Franken lautend | | | | | | | |
| Emissionsland Schweiz | | | | | | | |
| ABB LTD. NA SF 0,12 | CH0012221716 | 0 | 0 | 84.720 | 26,970 | 2.328.202,98 | 1,42 |
| LANDIS+GYR GROUP AG SF 10 | CH0371153492 | 0 | 0 | 12.840 | 57,100 | 747.059,30 | 0,46 |
| LOGITECH INTL NA SF -,25 | CH0025751329 | 0 | 15.000 | 14.720 | 48,860 | 732.850,21 | 0,45 |
| LONZA GROUP AG NA SF 1 | CH0013841017 | 0 | 1.375 | 3.649 | 523,400 | 1.946.083,76 | 1,19 |
| ROCHE HLDG AG GEN. | CH0012032048 | 0 | 8.800 | 28.357 | 315,400 | 9.113.305,28 | 5,56 |
| SGS S.A. NA SF 1 | CH0002497458 | 0 | 0 | 458 | 2.156,000 | 1.006.162,62 | 0,61 |
| SIKA AG NAM. SF 0,01 | CH0418792922 | 0 | 2.850 | 8.380 | 220,400 | 1.881.956,39 | 1,15 |
| STRAUMANN HLDG NA SF 0,01 | CH1175448666 | 13.030 | 0 | 13.030 | 107,700 | 1.429.927,65 | 0,87 |
| ZURICH INSUR.GR.NA.SF0,10 | CH0011075394 | 0 | 0 | 12.000 | 434,100 | 5.307.927,45 | 3,24 |
| Summe Emissionsland Schweiz | | | | | | 24.493.475,64 | 14,93 |
| Summe Aktien auf Schweizer Franken lautend umgerechnet zum Kurs von 0,98140 | | | | | | 24.493.475,64 | 14,93 |
| Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere | | | | | | 99.263.635,39 | 60,52 |

Nicht notierte Wertpapiere

Aktien auf Euro lautend

Emissionsland Deutschland

| | | | | | | | |
|----------------------------------|--------------|---|---|--------|-------|------|------|
| ABWICKL.BIOGAS I NA O.N. | DE000SBGS111 | 0 | 0 | 42.354 | 0,000 | 0,00 | 0,00 |
| Summe Emissionsland Deutschland | | | | | | 0,00 | 0,00 |
| Summe Aktien auf Euro lautend | | | | | | 0,00 | 0,00 |
| Summe Nicht notierte Wertpapiere | | | | | | 0,00 | 0,00 |

Gliederung des Fondsvermögens

| | | |
|-----------------------|-----------------------|---------------|
| Wertpapiere | 153.825.790,97 | 93,78 |
| Bankguthaben | 9.832.987,71 | 5,99 |
| Dividendenansprüche | 385.017,28 | 0,23 |
| Zinsenansprüche | 1.673,66 | 0,00 |
| Sonstige Abgrenzungen | -23.481,95 | -0,01 |
| Fondsvermögen | 164.021.987,67 | 100,00 |

Hinweis an die Anleger:

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

| | | | |
|-----------------------------------|--------------|-------|-------------|
| Umlaufende Ausschüttungsanteile | AT0000A1E0V5 | Stück | 243.011,665 |
| Anteilswert Ausschüttungsanteile | AT0000A1E0V5 | EUR | 148,38 |
| Umlaufende Thesaurierungsanteile | AT0000645973 | Stück | 621.453,908 |
| Anteilswert Thesaurierungsanteile | AT0000645973 | EUR | 173,41 |
| Umlaufende Thesaurierungsanteile | AT0000A28E54 | Stück | 1.070,331 |
| Anteilswert Thesaurierungsanteile | AT0000A28E54 | EUR | 117,71 |

| | | | |
|---------------------------------------|--------------|-------|-------------|
| Umlaufende Vollthesaurierungsanteile | AT0000A0WM11 | Stück | 33.599,016 |
| Anteilswert Vollthesaurierungsanteile | AT0000A0WM11 | EUR | 174,63 |
| Umlaufende Vollthesaurierungsanteile | AT0000A2QP89 | Stück | 127.720,732 |
| Anteilswert Vollthesaurierungsanteile | AT0000A2QP89 | CZK | 2.343,40 |
| Umlaufende Vollthesaurierungsanteile | AT0000A2QP97 | Stück | 20.780,333 |
| Anteilswert Vollthesaurierungsanteile | AT0000A2QP97 | HUF | 38.442,39 |

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.

Wertpapierleihegeschäfte iSd der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

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 gezeichnete 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 | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.) | Verkäufe/ Abgänge |
|---|-----------------|---|----------------------|
| Amtlich gehandelte Wertpapiere | | | |
| Aktien auf Britische Pfund lautend | | | |
| Emissionsland Großbritannien | | | |
| GSK PLC | LS-,25 | GB0009252882 | 0 |
| | | | 174.985 |

ERSTE RESPONSIBLE STOCK EUROPE

| Wertpapier-Bezeichnung | Kenn- nummer | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.) | Verkäufe/ Abgänge |
|--|-----------------|---|----------------------|
| Aktien auf Dänische Kronen lautend | | | |
| Emissionsland Dänemark | | | |
| ISS AS DK 1 | DK0060542181 | 0 | 83.870 |
| VESTAS WIND SYS. DK -,20 | DK0061539921 | 0 | 50.900 |
| Aktien auf Euro lautend | | | |
| Emissionsland Deutschland | | | |
| AUMANN AG INH O.N. | DE000A2DAM03 | 0 | 65.940 |
| DAIMLER TRUCK HLDG NA ON | DE000DTROCK8 | 0 | 27.500 |
| DEUTSCHE BOERSE NA O.N. | DE0005810055 | 0 | 13.480 |
| DEUTSCHE POST AG NA O.N. | DE0005552004 | 0 | 55.390 |
| Emissionsland Frankreich | | | |
| EUROAPI SAS EO 1 | FR0014008VX5 | 1.565 | 1.565 |
| Emissionsland Irland | | | |
| KINGSPAN GRP PLC EO-,13 | IE0004927939 | 0 | 28.300 |
| Emissionsland Italien | | | |
| UNICREDIT | IT0005239360 | 0 | 110.330 |
| Emissionsland Österreich | | | |
| ERSTE GROUP BNK INH. O.N. | AT0000652011 | 0 | 16.100 |
| VOESTALPINE AG | AT0000937503 | 0 | 36.770 |
| Aktien auf Schwedische Kronen lautend | | | |
| Emissionsland Schweden | | | |
| ATLAS COPCO A | SE0011166610 | 0 | 48.660 |
| ATLAS COPCO RED. A FREE | SE0017486863 | 48.660 | 48.660 |
| Aktien auf Schweizer Franken lautend | | | |
| Emissionsland Schweiz | | | |
| STRAUMANN HLDG NA SF 0,10 | CH0012280076 | 0 | 2.095 |

| Wertpapier-Bezeichnung | Kenn- nummer | Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.) | Verkäufe/ Abgänge |
|---|-----------------|---|----------------------|
| In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere | | | |
| Aktien auf Euro lautend | | | |
| Emissionsland Frankreich | | | |
| AMUNDI S.A. EO 2,50 | FR0004125920 | 0 | 14.080 |
| CREDIT AGRICOLE INH. EO 3 | FR0000045072 | 0 | 106.100 |
| ORANGE INH. EO 4 | FR0000133308 | 0 | 82.130 |
| TELEPERFORMANCE INH.EO2,5 | FR0000051807 | 0 | 4.380 |
| Emissionsland Italien | | | |
| TECHNOGYM S.P.A. | IT0005162406 | 0 | 141.000 |
| Emissionsland Luxemburg | | | |
| APERAM S.A. | LU0569974404 | 0 | 33.600 |
| Emissionsland Niederlande | | | |
| KONINKL. PHILIPS EO -,20 | NL0000009538 | 0 | 82.641 |
| Emissionsland Spanien | | | |
| BCO BIL.VIZ.ARG.NOM.EO-49 | ES0113211835 | 0 | 301.120 |

Wien, im September 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“)).