

ERSTE BOND DANUBIA

Miteigentumsfonds gemäß InvFG

Halbjahresbericht 2019

Inhaltsübersicht

Allgemeine Informationen zur Kapitalanlagegesellschaft.....	2
Zusammensetzung des Fondsvermögens.....	3
Vermögensaufstellung zum 30. November 2019	3

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 %) VIENNA INSURANCE GROUP AG Wiener Versicherung Gruppe (0,76 %) Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG (22,17 %) DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt (1,65 %) NÖ-Sparkassen Beteiligungsgesellschaft m. b. H. (0,76 %) Salzburger Sparkasse Bank Aktiengesellschaft (1,65 %) Sieben Tiroler Sparkassen Beteiligungsgesellschaft m. b. H. (1,65 %) Steiermärkische Bank und Sparkassen Aktiengesellschaft (3,30 %) „Die Kärntner“ Trust-Vermögensverwaltungsgesellschaft m. b. H. & Co KG (1,65 %) Tiroler Sparkasse Bankaktiengesellschaft Innsbruck (1,74 %)
Aufsichtsrat	Mag. Rudolf SAGMEISTER (Vorsitzender) Mag.(FH) Thomas SCHAUFLER (Vorsitzender-Stv.) MMag. Ingo BLEIER (bis 31.10.2019) Mag. Harald GASSER Mag. Gerhard GRABNER Harald Frank GRUBER (ab 13.09.2019) Oswald HUBER Radovan JELASITY Mag. Robert LASSHOFER Dr. Franz PRUCKNER (ab 13.09.2019) Mag. Rupert RIEDER (ab 13.09.2019) Gabriele SEMMELROCK-WERZER (ab 13.09.2019) Mag. Reinhard WALTL (ab 13.09.2019) Mag. Gerald WEBER vom Betriebsrat entsandt: Martin CECH Mag. Regina HABERHAUER (ab 13.09.2019) Ing. Heinrich Hubert REINER Peter RIEDERER Nicole WEINHENGST Mag. Manfred ZOUREK
Geschäftsführer	Mag. Heinz BEDNAR Mag. Winfried BUCHBAUER Mag. Peter KARL Mag. Wolfgang TRAINDL
Prokuristen	Mag. Achim ARNHOF Karl FREUDENSCHUSS Manfred LENTNER Günther MANDL Mag. Gerold PERMOSER Mag. Magdalena REISCHL
Staatskommissäre	Mag. Caroline HABERFELLNER (bis 31.07.2019) Mag. Christoph Seel (ab 01.08.2019) Rätin Mag.(FH) Eva SCHRITTWIESER, MBA (ab 01.07.2019) Mag. Philipp VISKI-HANKA (bis 30.06.2019)
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 BOND DANUBIA Miteigentumsfonds gemäß InvFG über den Zeitraum vom 1. Juni 2019 bis 30. November 2019 vorzulegen.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

	per 30.11.2019 Mio. Euro	%
Anleihen		
auf Euro lautend	71,8	23,00
auf Polnische Zloty lautend	87,1	27,91
auf Tschechische Kronen lautend	38,0	12,19
auf Türkische Lira alt lautend	36,2	11,60
auf Ungarische Forint lautend	31,0	9,93
auf US-Dollar lautend	31,8	10,19
Wertpapiere	295,9	94,82
Devisentermingeschäfte	-0,1	-0,04
Bankguthaben	12,3	3,95
Zinsenansprüche	4,0	1,27
Sonstige Abgrenzungen	-0,0	-0,00
Fondsvermögen	312,0	100,00

Vermögensaufstellung zum 30. November 2019

(einschließlich Veränderungen im Wertpapiervermögen vom 1. Juni 2019 bis 30. November 2019)

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	500	109,125	545.625,00	0,17
Summe Emissionsland Albanien							545.625,00	0,17
Emissionsland Irland								
RZD CAPITAL 13/21	XS0919581982	3,374	0	0	2.000	104,750	2.095.000,00	0,67
VEB FINANCE 13/23 MTN	XS0893212398	4,032	0	0	2.000	111,072	2.221.439,98	0,71
Summe Emissionsland Irland							4.316.439,98	1,38

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 Mazedonien								
NORDMAZEDONIEN 18/25 REGS	XS1744744191	2,750	0	0	1.100	106,672	1.173.390,63	0,38
Summe Emissionsland Mazedonien							<u>1.173.390,63</u>	<u>0,38</u>
Emissionsland Ukraine								
UKRAINE 19/26 REGS	XS2015264778	6,750	1.000	0	1.000	108,650	1.086.500,00	0,35
Summe Emissionsland Ukraine							<u>1.086.500,00</u>	<u>0,35</u>
Summe Anleihen auf Euro lautend							<u>7.121.955,61</u>	<u>2,28</u>
Anleihen auf Polnische Zloty lautend								
Emissionsland Polen								
POLEN 18/24	PL0000111720	2,250	20.000	0	20.000	102,450	4.751.480,63	1,52
POLEN 18-24	PL0000111191	2,500	40.000	0	40.000	103,400	9.591.080,48	3,07
Summe Emissionsland Polen							<u>14.342.561,11</u>	<u>4,60</u>
Summe Anleihen auf Polnische Zloty lautend umgerechnet zum Kurs von 4,31234							<u>14.342.561,11</u>	<u>4,60</u>
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend								
Emissionsland Tschechische Republik								
PRAG 11-21	CZ0001500110	4,250	0	0	30.000	102,824	1.207.273,31	0,39
Summe Emissionsland Tschechische Republik							<u>1.207.273,31</u>	<u>0,39</u>
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 25,55106							<u>1.207.273,31</u>	<u>0,39</u>
Anleihen auf Türkische Lira alt lautend								
Emittent Inter-Amerikanische Entwicklungsbank								
INTER-AMER.DEV.BK 18/2020	XS1883241694	0,000	0	0	15.000	91,309	2.162.751,86	0,69
Summe Emittent Inter-Amerikanische Entwicklungsbank							<u>2.162.751,86</u>	<u>0,69</u>
Emissionsland Türkei								
TURKEY 12-22	TRT120122T17	9,500	0	0	18.000	95,800	2.722.966,14	0,87
TURKEY 12-22	TRT140922T17	8,500	0	15.000	15.000	92,650	2.194.526,91	0,70
TURKEY 13-23	TRT270923T11	8,800	0	0	17.000	90,338	2.425.066,32	0,78
TURKEY 14-24	TRT200324T13	10,400	20.000	0	20.000	94,550	2.986.040,93	0,96
TURKEY 14-24	TRT240724T15	9,000	29.000	0	29.000	89,250	4.087.054,70	1,31
TURKEY 15-25	TRT120325T12	8,000	15.000	0	25.000	84,900	3.351.598,03	1,07
TURKEY 16-21	TRT170221T12	10,700	0	0	10.000	99,050	1.564.079,08	0,50
TURKEY 16-21	TRT220921T18	9,200	0	5.000	15.000	96,000	2.273.875,69	0,73
TURKEY 16-26	TRT110226T13	10,600	0	0	20.000	93,550	2.954.459,32	0,95
TURKEY 17-22	TRT020322T17	11,000	0	8.000	10.500	98,550	1.633.992,86	0,52
TURKEY 17-27	TRT110827T16	10,500	2.500	0	2.500	91,900	362.793,71	0,12

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
TURKEY 17-27	TRT240227T17	11,000	10.000	0	27.500	94,450	4.101.463,81	1,31
TURKEY 18-28	TRT080328T15	12,400	10.000	0	10.000	101,400	1.601.187,47	0,51
Summe Emissionsland Türkei							32.259.104,97	10,34
Summe Anleihen auf Türkische Lira alt lautend umgerechnet zum Kurs von 6,33280							34.421.856,83	11,03

Anleihen auf Ungarische Forint lautend**Emissionsland Ungarn**

HUNGARY 04-20 20/A	HU0000402235	7,500	0	0	675.000	107,040	2.160.985,13	0,69
HUNGARY 11-22	HU0000402524	7,000	0	0	750.000	117,700	2.640.229,38	0,85
HUNGARY 11-28	HU0000402532	6,750	0	0	500.000	142,235	2.127.055,82	0,68
HUNGARY 14-20 20/B	HU0000402953	3,500	0	0	1.000.000	101,951	3.049.251,83	0,98
HUNGARY 14-25 25/B	HU0000402748	5,500	0	0	1.000.000	123,771	3.701.890,21	1,19
HUNGARY 15-24 24/B	HU0000403068	3,000	0	0	1.000.000	110,129	3.293.854,76	1,06
HUNGARY 15-31 31/A	HU0000403001	3,250	0	0	200.000	112,656	673.885,84	0,22
HUNGARY 16-21 21/B	HU0000403100	2,500	0	0	500.000	104,734	1.566.248,97	0,50
HUNGARY 16-27 27/A	HU0000403118	3,000	0	0	500.000	111,073	1.661.054,22	0,53
HUNGARY 17-20 20/C	HU0000403258	1,000	0	0	300.000	100,790	904.358,20	0,29
HUNGARY 17-22 22/B	HU0000403266	1,750	0	0	500.000	104,163	1.557.708,42	0,50
HUNGARY 17-26 26/D	HU0000403340	2,750	0	500.000	650.000	109,357	2.125.996,22	0,68
HUNGARY 18-24 2024/C	HU0000403571	2,500	0	0	1.000.000	107,522	3.215.875,65	1,03
UNGARN 19/30 2030/A	HU0000403696	3,000	700.000	0	700.000	110,672	2.317.062,61	0,74
Summe Emissionsland Ungarn							30.995.457,26	9,93
Summe Anleihen auf Ungarische Forint lautend umgerechnet zum Kurs von 334,34595							30.995.457,26	9,93
Summe Amtlich gehandelte Wertpapiere							88.089.104,12	28,23

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

BULGARIEN 14/24	XS1083844503	2,950	0	0	2.000	114,484	2.289.687,50	0,73
BULGARIEN 15/22 MTN	XS1208855616	2,000	0	1.000	1.000	105,172	1.051.718,75	0,34
BULGARIEN 15/35 MTN	XS1208856341	3,125	0	0	3.000	131,219	3.936.562,50	1,26
Summe Emissionsland Bulgarien							7.277.968,75	2,33

Emissionsland Kasachstan

KASACHSTAN 18/23 MTN REGS	XS1907130246	1,550	0	0	600	105,250	631.500,00	0,20
KASACHSTAN 18/28 MTN REGS	XS1901718335	2,375	0	0	1.800	113,469	2.042.437,50	0,65
Summe Emissionsland Kasachstan							2.673.937,50	0,86

Emissionsland Kroatien

KROAT.ENTW.BK (HBOR)13/20	XS0961637542	6,000	0	0	300	102,190	306.570,00	0,10
KROATIEN 15/25	XS1117298916	3,000	0	1.000	2.000	113,875	2.277.500,00	0,73

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
KROATIEN 17/27	XS1428088626	3,000	0	1.000	2.000	117,406	2.348.125,00	0,75
KROATIEN 17/30	XS1713475306	2,750	0	0	3.000	119,547	3.586.406,25	1,15
Summe Emissionsland Kroatien							8.518.601,25	2,73
Emissionsland Lettland								
LETTLAND 14/24 MTN	XS1063399536	2,875	0	0	2.340	114,033	2.668.372,20	0,86
LETTLAND 16/26 MTN	XS1501554874	0,375	0	1.500	1.500	102,564	1.538.460,00	0,49
LETTLAND 16/36 MTN	XS1409726731	1,375	0	0	1.000	112,797	1.127.968,75	0,36
LETTLAND 18/28 MTN	XS1829276275	1,125	0	0	2.000	108,322	2.166.440,00	0,69
Summe Emissionsland Lettland							7.501.240,95	2,40
Emissionsland Litauen								
LITAUEN 14-26 MTN	XS1130139667	2,125	0	0	1.000	114,657	1.146.570,00	0,37
LITAUEN 15-35 MTN	XS1310032260	2,125	0	0	3.500	125,402	4.389.070,00	1,41
LITAUEN 19/29 MTN	XS2013677864	0,500	1.000	0	1.000	103,131	1.031.312,90	0,33
Summe Emissionsland Litauen							6.566.952,90	2,10
Emissionsland Polen								
BK GOSPOD.KRAJ. 16/26 MTN	XS1403619411	1,750	0	0	1.300	109,410	1.422.330,05	0,46
POLEN 10/25 MTN	XS0479333311	5,250	0	0	2.000	127,528	2.550.560,00	0,82
POLEN 12/24 MTN	XS0841073793	3,375	0	0	1.500	116,066	1.740.990,00	0,56
POLEN 16/26 MTN	XS1346201616	1,500	0	0	1.000	109,486	1.094.857,10	0,35
POLEN 16/28 MTN	XS1508566392	1,000	0	0	2.000	108,250	2.165.000,00	0,69
POLEN 16/36 MTN	XS1346201889	2,375	0	0	1.000	123,984	1.239.843,75	0,40
POLEN 18/26 MTN	XS1766612672	1,125	0	0	1.000	107,501	1.075.010,00	0,34
Summe Emissionsland Polen							11.288.590,90	3,62
Emissionsland Rumänien								
RUMAENIEN 14/24 MTN	XS1060842975	3,625	0	0	1.000	115,266	1.152.656,25	0,37
RUMAENIEN 15/25 MTN REGS	XS1312891549	2,750	0	0	1.000	112,266	1.122.656,25	0,36
RUMAENIEN 16/28 MTN REGS	XS1420357318	2,875	0	0	1.000	112,406	1.124.062,50	0,36
RUMAENIEN 18/29 MTN REGS	XS1892141620	2,875	0	0	1.000	112,375	1.123.750,00	0,36
RUMAENIEN 18/30 MTN REGS	XS1768067297	2,500	1.500	0	2.000	108,250	2.165.000,00	0,69
RUMAENIEN 18/39 MTN REGS	XS1892127470	4,125	0	0	2.000	116,469	2.329.375,00	0,75
RUMAENIEN 19/49 MTN REGS	XS1968706876	4,625	0	0	940	124,359	1.168.978,13	0,37
Summe Emissionsland Rumänien							10.186.478,13	3,26
Emissionsland Serbien inkl. Kosovo								
SERBIEN 19/29 REGS	XS2015296465	1,500	900	0	900	101,950	917.550,00	0,29
Summe Emissionsland Serbien inkl. Kosovo							917.550,00	0,29
Emissionsland Türkei								
TUERKEI 17/25 INTL	XS1629918415	3,250	0	0	1.000	98,703	987.031,25	0,32

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
TURKEY 14/23 INTL	XS1057340009	4,125	0	0	1.500	105,609	1.584.140,63	0,51
TURKEY 18/26 INTL	XS1909184753	5,200	1.000	0	2.000	106,844	2.136.875,00	0,68
Summe Emissionsland Türkei							4.708.046,88	1,51
Emissionsland Ungarn								
HUNGARY 17/27	XS1696445516	1,750	0	1.000	1.000	111,875	1.118.750,00	0,36
HUNGARY 18/25	XS1887498282	1,250	0	0	1.000	106,672	1.066.718,75	0,34
MFB MAGYAR F.BK 15/21	XS1330975977	2,375	0	0	2.700	104,751	2.828.279,43	0,91
Summe Emissionsland Ungarn							5.013.748,18	1,61
Summe Anleihen auf Euro lautend							64.653.115,44	20,72
Anleihen auf Polnische Zloty lautend								
Emissionsland Polen								
POLEN 02/22 0922	PL0000102646	5,750	15.000	0	75.000	111,461	19.385.154,00	6,21
POLEN 08-29	PL0000105391	5,750	9.000	0	21.000	133,600	6.505.980,51	2,08
POLEN 13-28	PL0000107611	2,750	36.000	15.000	56.000	105,825	13.742.422,91	4,40
POLEN 14-25	PL0000108197	3,250	44.000	40.000	44.000	107,650	10.983.827,81	3,52
POLEN 15-21	PL0000108916	2,000	0	0	27.000	100,961	6.321.239,74	2,03
POLEN 15-26	PL0000108866	2,500	0	0	40.000	103,810	9.629.110,88	3,09
POLEN 16-21	PL0000109153	1,750	0	5.000	11.000	100,631	2.566.902,19	0,82
POLEN 16-27	PL0000109427	2,500	15.000	36.000	15.000	104,000	3.617.525,52	1,16
Summe Emissionsland Polen							72.752.163,56	23,31
Summe Anleihen auf Polnische Zloty lautend umgerechnet zum Kurs von 4,31234							72.752.163,56	23,31
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend								
Emissionsland Tschechische Republik								
CZECH REP. 2021 61	CZ0001002851	3,850	0	50.000	26.000	104,350	1.061.834,62	0,34
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	0,450	0	0	50.000	96,851	1.895.234,48	0,61
CZECH REP. 2024 58	CZ0001002547	5,700	55.000	0	55.000	119,751	2.577.692,47	0,83
CZECH REP. 2025 89	CZ0001004253	2,400	180.000	90.000	180.000	105,901	7.460.391,08	2,39
CZECH REP. 2026	CZ0001004469	1,000	100.000	0	170.000	97,751	6.503.677,34	2,08
CZECH REP. 2028	CZ0001003859	2,500	0	0	110.000	108,901	4.688.281,03	1,50
CZECH REP. 2029	CZ0001005375	2,750	0	50.000	80.000	111,851	3.502.038,66	1,12
CZECH REP. 2030 94	CZ0001004477	0,950	0	75.000	70.000	95,051	2.604.028,95	0,83
CZECH REP. 2036 49	CZ0001001796	4,200	0	0	120.000	139,254	6.540.010,47	2,10
Summe Emissionsland Tschechische Republik							36.833.189,10	11,80
Summe Anleihen auf Tschechische Kronen lautend umgerechnet zum Kurs von 25,55106							36.833.189,10	11,80

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

Emittent Afrikanische Entwicklungsbank

AFR. DEV. BK 18/20 MTN	XS1896663579	28,000	0	0	10.000	112,434	1.775.415,30	0,57
Summe Emittent Afrikanische Entwicklungsbank							1.775.415,30	0,57
Summe Anleihen auf Türkische Lira alt lautend umgerechnet zum Kurs von 6,33280							1.775.415,30	0,57

Anleihen auf US-Dollar lautend

Emissionsland Russland

RUSSIAN FED. 10/20 REGS	XS0504954347	5,000	0	2.000	4.000	101,301	3.674.968,26	1,18
RUSSIAN FED. 12/22 REGS	XS0767472458	4,500	0	0	4.000	105,675	3.833.666,06	1,23
RUSSIAN FED. 12/42 REGS	XS0767473852	5,625	0	0	3.400	127,050	3.917.739,89	1,26
RUSSIAN FED. 13/23 REGS	XS0971721450	4,875	0	0	6.400	109,891	6.378.559,77	2,04
RUSSIAN FED. 13/43 REGS	XS0971721963	5,875	2.000	0	11.000	130,750	13.044.168,33	4,18
RUSSIAN FED. 98/28 REGS	XS0088543193	12,750	0	0	600	171,500	933.248,68	0,30
Summe Emissionsland Russland							31.782.350,99	10,18
Summe Anleihen auf US-Dollar lautend umgerechnet zum Kurs von 1,10260							31.782.350,99	10,18
Summe In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere							207.796.234,39	66,59

Devisentermingeschäfte

nicht realisiertes
Ergebnis in EUR

Devisentermingeschäfte auf Euro lautend

Emissionsland Österreich

FXF SPEST EUR/USD 13.12.2019	FXF_TAX_3448175				11.281.588		-47.815,29	-0,02
FXF SPEST EUR/USD 13.12.2019	FXF_TAX_3448537				2.265.817		-62,56	-0,00
FXF SPEST EUR/USD 17.01.2020	FXF_TAX_3448656				17.509.398		-80.988,71	-0,03
Summe Emissionsland Österreich							-128.866,56	-0,04
Summe Devisentermingeschäfte auf Euro lautend							-128.866,56	-0,04
Summe Devisentermingeschäfte							-128.866,56	-0,04

Gliederung des Fondsvermögens

Wertpapiere	295.885.338,51	94,82
Devisentermingeschäfte	-128.866,56	-0,04
Bankguthaben	12.329.508,04	3,95
Zinsenansprüche	3.968.916,20	1,27
Sonstige Abgrenzungen	-3.744,05	-0,00
Fondsvermögen	312.051.152,14	100,00

Hinweis an die Anleger:

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

Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000831409	Stück	2.005.863,799
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000831409	EUR	56,59
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	Stück	58.228,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1X5G2	EUR	102,23
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XG74	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XG74	EUR	103,70
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XGA7	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XGA7	EUR	107,04
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQU4	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQU4	CZK	2.721,18
Umlaufende Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQV2	Stück	0,000
Anteilswert Ausschüttungsanteile	AT0000A1XQV2	HUF	35.644,62
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000812946	Stück	849.861,386
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000812946	EUR	145,98
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1X5H0	Stück	9.600,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1X5H0	EUR	105,86
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XG82	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XG82	EUR	103,70
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XGB5	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XGB5	EUR	107,04
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQT6	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQT6	CZK	2.733,45
Umlaufende Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQW0	Stück	0,000
Anteilswert Thesaurierungsanteile	AT0000A1XQW0	HUF	35.644,62
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	Stück	149.690,908
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000673199	EUR	179,40
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	Stück	39.545,942
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000639398	CZK	4.585,13
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	Stück	28,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A00GD6	HUF	60.008,41
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1X5J6	Stück	297.357,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1X5J6	EUR	105,88
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	Stück	18.983,137
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XHX7	EUR	107,69

ERSTE BOND DANUBIA

Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQS8	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQS8	CZK	2.740,86
Umlaufende Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQX8	Stück	0,000
Anteilswert Vollthesaurierungsanteile	AT0000A1XQX8	HUF	35.644,62

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 30.11.2019 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	satz in %
		Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	
LITAUEN 19/29 MTN	XS2013677864	800	0,45
CZECH REP. 2023	CZ0001004600	50.000	0,15
TURKEY 18-28	TRT080328T15	10.000	0,90
TURKEY 16-26	TRT110226T13	20.000	1,50
TURKEY 12-22	TRT140922T17	15.000	1,32
TUERKEI 17/25 INTL	XS1629918415	1.000	0,51
POLEN 14-25	PL0000108197	11.000	0,15
POLEN 16-21	PL0000109153	11.000	0,15
POLEN 16-27	PL0000109427	5.700	0,15

Folgende Sicherheiten stehen für diese Leihegeschäfte zur Verfügung:

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Nominale
POLEN 16/26 MTN	XS1346201616	16.440.000

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:	17.392.993,97
in % vom Fondsvermögen (abzüglich Barmittel oder Barmitteläquivalent):	5,80%

Betrag der eingesetzten Vermögenswerte (ausschließlich WP Leihen):

(für die Art der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte):	17.392.993,97
in % des Fondsvermögens:	5,57%

Angaben zur Konzentration:

Zehn wichtigste Emittenten von Sicherheiten:

- Volumen der gestellten Sicherheiten und Angabe Emittent	Kurswert in Euro
Republik Polen XS1346201616	18.213.621,18
	18.213.621,18

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

Name der Gegenparteien:		ausschließlich Erste Group Bank AG
Bruttovolumen ausstehende Geschäfte:		17.392.993,97

Aggregierte Transaktionsdaten für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft und Gesamtwert:

	ISIN	Art der Sicherheit	Laufzeit/Tage	Rating	Währung	Kurswert in Euro
Republik Polen	XS1346201616	staatsgarantiert	unbefristet	A-	Euro	18.213.621,18
						18.213.621,18

Wertpapierleihe aufgeschlüsselt nach Laufzeiten:

Laufzeit < 1Tag	
Laufzeit 1-7 Tage	
Laufzeit 8-30 Tage	12.788.510,88
Laufzeit 31-90 Tage	4.604.483,09
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:	18.213.621,18

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 Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2019 76	CZ0001003834	1,500	0	50.000
Anleihen auf Türkische Lira alt lautend				
Emittent Internationale Finanzkorporation				
INTL FINANCE 19/20 MTN	XS1937691100	20,000	0	20.000

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
Emissionsland Türkei				
TURKEY 15-20	TRT050220T17	7,400	0	7.000
TURKEY 15-20	TRT080720T19	9,400	0	12.000
In organisierte Märkte einbezogene Wertpapiere				
Anleihen auf Euro lautend				
Emissionsland Polen				
POLEN 15/27 MTN	XS1209947271	0,875	0	1.000
POLEN 19/29 MTN	XS1958534528	1,000	0	1.000
Emissionsland Rumänien				
RUMAENIEN 15/35 MTN REGS	XS1313004928	3,875	0	1.300
Anleihen auf Polnische Zloty lautend				
Emissionsland Polen				
POLEN 10-20	PL0000106126	5,250	0	15.200
POLEN 11-21	PL0000106670	5,750	0	15.000
POLEN 12-23	PL0000107264	4,000	0	48.000
Anleihen auf Tschechische Kronen lautend				
Emissionsland Tschechische Republik				
CZECH REP. 2020 46	CZ0001001317	3,750	0	60.000
CZECH REP. 2022 52	CZ0001001945	4,700	0	60.000
Anleihen auf US-Dollar lautend				
Emissionsland Serbien inkl. Kosovo				
SERBIEN 11/21 REGS	XS0680231908	7,250	0	2.000
Emissionsland Ungarn				
HUNGARY 11/21	US445545AE60	6,375	0	1.000

ERSTE BOND DANUBIA

Wertpapier-Bezeichnung	Kenn- nummer	Zinssatz	Käufe/ Zugänge Stück/Nominale (Nom. in 1.000, ger.)	Verkäufe/ Abgänge
-------------------------------	-------------------------	-----------------	--	------------------------------

Nicht notierte Wertpapiere

Anleihen auf Ungarische Forint lautend

Emissionsland Ungarn

HUNGARY 08-19 19/A	HU0000402433	6,500	0	500.000
--------------------	--------------	-------	---	---------

Wien, im Dezember 2019

Erste Asset Management GmbH
elektronisch gefertigt

Prüfinformation: Die elektronischen Signaturen dieses Dokumentes können unter www.signaturpruefung.gv.at geprüft werden.
Hinweis: Dieses Dokument wurde mit zwei qualifizierten elektronischen Signaturen gefertigt. Eine qualifizierte elektronische Signatur erfüllt das rechtliche Erfordernis einer eigenhändigen Unterschrift, insbesondere der Schriftlichkeit im Sinne des § 886 ABGB (§ 4 (1) Signaturgesetz).