



Az

ERSTE

NYÍLTVÉGŰ RÖVID KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

2017. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Rövid Kötvény Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Nyíltvégű Rövid Kötvény Befektetési Alap

Az Alap korábbi neve: Erste Nyíltvégű Kötvény Befektetési Alap

A névváltozást jóváhagyó Felügyeleti határozat száma és kelte: E-III-110.110-14/2009; 2009. május 08.

A névváltozás 2009. június 10-én lépett hatályba.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Rövid Kötvény Alap

Az Alap típusa, fajtája

Az Alap nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott, nyíltvégű befektetési alap.

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (1998. október 30-tól) határozatlan ideig terjed.

Alapkezelő

Erste Alapkezelő Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Cégjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Cégjegyzékszám: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Cégjegyzékszám: 01-10-041373

Nettó eszközérték számítás típusa

Tárgynapi eszközérték Tárgy +1 napon készül Tárgynapi eszközállomány

Tárgynapi árfolyam adatok

Tárgynapi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

2. Vagyonkimutatás, a befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele

Megnevezés	Záró eszközérték Tárgynap: 2016.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2017.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	27 424 497 050	100.14%	23 378 671 019	100.22%
Banki egyenlegek	5 330 446 588	19.46%	4 384 144 518	18.79%
Pénzforgalmi számla egyenleg	3 775 346 588	13.79%	1 384 014 794	5.93%
Lekötött bankbetét	1 555 100 000	5.68%	3 000 129 724	12.86%
Átruházható értékpapírok	21 859 543 336	79.82%	18 706 912 055	80.20%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	21 641 638 466	79.02%	18 490 289 877	79.27%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	8 576 131 708	31.32%	7 119 469 487	30.52%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	8 384 534 698	35.95%
Hitelintézeti kötvények	9 979 964 976	36.44%	0	0.00%
Vállalati kötvények	263 480 966	0.96%	0	0.00%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	2 822 060 816	10.30%	2 986 285 692	12.80%
Külföldi kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai tőzsdei részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai OTC részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	217 904 870	0.80%	216 622 178	0.93%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	217 904 870	0.80%	216 622 178	0.93%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származékos ügyletek	150 316 796	0.55%	286 104 320	1.22%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	150 316 796	0.55%	286 104 320	1.22%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	84 190 330	0.31%	1 510 126	0.01%
Befektetési számla egyenleg	4 818	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	84 185 512	0.31%	1 510 126	0.01%
KÖTELEZETTSÉGEK	-38 040 331	-0.14%	-52 095 363	-0.22%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-29 679 869	-0.11%	-25 815 917	-0.11%
Különadó díj	-3 307 382	-0.01%	-2 962 203	-0.01%
Alapkezelői díj	-3 325 391	-0.01%	-2 900 941	-0.01%
Forgalmazói díj	-18 843 883	-0.07%	-16 438 665	-0.07%
Letétkezelői díj	-1 773 542	-0.01%	-1 547 169	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-747 951	0.00%	-472 336	0.00%
Felügyeleti díj	-1 681 720	-0.01%	-1 494 603	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-8 360 462	-0.03%	-26 279 446	-0.11%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	27 386 456 719	100.00%	23 326 575 656	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	8 508 797 471		7 220 360 106	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	3.2186		3.2307	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2017.06.30-án (db)*	7 220 360 106
---	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2017.06.30-án (Ft)*	3.2307
--	--------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2016.12.31	2017.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	52.33%	53.82%	1.49%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	26.59%	25.27%	-1.31%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	31.63%	14.09%	-17.54%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.79%	0.93%	0.13%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	78.91%	79.09%	0.18%

Az Alap összetételében az egyéb átruházható értékpapírok, és a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok aránya kis mértékben emelkedett. A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok arány nőtt, melyet a jelzáloglevelek arányának növekedése magyaráz, míg a más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok aránya csökkent, mely az államkötvények arányának esésére vezethető vissza.

Az Alapnak vannak elkülönített eszközei.



6. Az ABA nevében alkalmazható tőkeáttétellel kapcsolatos információk bemutatása

Tőkeáttétel mértékében bekövetkezett változások, Biztosíték vagy a tőkeáttételi megállapodás értelmében nyújtott garanciák újbóli felhasználási joga, ABA által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege

Az ABA nem alkalmazott tőkeáttételt.

Budapest, 2017. augusztus 28.

Erste Alapkezelő Zrt.
1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26. 9.em.



Erste Alapkezelő Zrt.