



Az

ERSTE

NYÍLTVÉGŰ RÖVID KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

2015. 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: 2014.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2015.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	42 541 496 663	100.12%	39 939 393 028	102.97%
Banki egyenlegek	10 066 915 775	23.69%	2 679 823 954	6.91%
Pénzforgalmi számla egyenleg	9 884 028	0.02%	77 979 501	0.20%
Lekötött bankbetét	10 057 031 747	23.67%	2 601 844 453	6.71%
Átruházható értékpapírok	33 230 484 909	78.20%	35 192 831 962	90.73%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	33 130 090 573	77.97%	35 192 831 962	90.73%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	2 147 262 600	5.54%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	17 850 433 626	42.01%	22 566 714 445	58.18%
Állami garanciával rendelkező kötvények	7 128 927 790	16.78%	635 932 460	1.64%
Hitelintézeti kötvények	7 028 110 904	16.54%	8 013 755 467	20.66%
Vállalati kötvények	1 122 618 253	2.64%	1 781 027 910	4.59%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	0	0.00%	48 139 080	0.12%
Külföldi kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Részvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai tőzsdei részvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai OTC részvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részvények	0	0.00%	0	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	100 394 336	0.24%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	100 394 336	0.24%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	-764 264 992	-1.80%	-575 248 679	-1.48%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-764 264 992	-1.80%	-575 248 679	-1.48%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	8 360 971	0.02%	2 641 985 791	6.81%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	8 360 971	0.02%	2 641 985 791	6.81%
KÖTELEZETTSÉGEK	-48 940 701	-0.12%	-1 154 642 060	-2.97%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-45 775 917	-0.11%	-43 870 378	-0.11%
Alapkezelői díj	-5 668 217	-0.01%	-4 783 814	-0.01%
Forgalmazói díj	-32 119 895	-0.08%	-27 108 279	-0.07%
Letétkezelői díj	-5 038 415	-0.01%	-4 464 893	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-254 000	0.00%	-201 382	0.00%
Felügyeleti díj	-2 695 390	-0.01%	-2 453 120	-0.01%
Fizetendő különadó	0	0.00%	-4 858 890	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-3 164 784	-0.01%	-1 110 771 682	-2.86%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	42 492 555 962	100.00%	38 784 750 968	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	13 936 305 298		12 535 204 564	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	3.0491		3.0941	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2015.06.30-án*	12 535 204 564
--	----------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2015.06.30-án (Ft) *	3.0941
---	--------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Tétel neve	Piaci érték (Ft)	Érték a portfólió eszközeinek arányában
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok		0	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok		0	0.00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok		0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok		0	0.00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		35 192 831 962	90.73%
Kincstárjegy	D150708	99 966 700	0.26%
Kincstárjegy	D150715	499 689 000	1.29%
Kincstárjegy	D150722	499 557 500	1.29%
Kincstárjegy	D150819	748 678 500	1.93%
Kincstárjegy	D150902	299 370 900	0.77%
Jelzáloglevél	FJ20NF01	48 139 080	0.12%
Államkötvény	2018/A MÁK	1 136 085 000	2.93%
Államkötvény	2018/C MÁK	7 060 147 705	18.20%
Államkötvény	2019/A MÁK	344 306 700	0.89%
Államkötvény	2020/A MÁK	379 428 600	0.98%
Államkötvény	REPHUN 2019/03/25	591 058 338	1.52%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2015/X	1 513 121 998	3.90%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2016/X	1 894 863 527	4.89%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2016/Y	9 647 702 577	24.87%
Hitelintézeti kötvény	Magyar Export-Import Bank Kötvény 2018/02/12	7 666 045 238	19.77%
Hitelintézeti kötvény	Magyar Export-Import Bank Kötvény 2020/01/30	347 710 229	0.90%
Vállalati kötvény	MOL 2015/10/05	456 293 162	1.18%
Vállalati kötvény	MOL 2017/04/20	648 806 702	1.67%
Vállalati kötvény	MOL 2019/09/26	675 928 046	1.74%
EGT-állam által garantált, vagy olyan nemzetközi szervezet által kibocsátott, vagy garantált értékpapír, amelynek egy vagy több EGT állam is tagja	MFB 2020/10/21	635 932 460	1.64%
Nettó eszközérték		38 784 750 968	

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei. Az Alap összetételében az államkötvények és hitelintézeti kötvények aránya növekedett, míg az állami garanciával rendelkező kötvények és a lekötött betétek aránya csökkent a félév végére. A portfólión belül az egyéb követelések értékpapír eladásból erednek.

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 Alap teljes nettó kockázati kitettségének maximális mértéke 100% lehet, az esetleges mögöttes alapok eszközösszetételének figyelembevétele nélkül.

Az Alapkezelő jogosult hitelt felvenni az Alap nevében, az Alap eszközeinek legfeljebb tíz százaléka erejéig, 3 hónapnál rövidebb futamidőre. Az Alapkezelő jogosult az Alap eszközei terhére az Alap nevében óvadékot nyújtani a hitel fedezeteként.

Az Alap származtatott ügyleteket (határidős deviza forward) fedezeti célból alkalmazhat.

Az ABA nem alkalmazott tőkeáttételt.

Budapest, 2015. augusztus 27.



Erste Alapkezelő Zrt.