



Az

ERSTE
TŐKEVÉDETT KAMATOPTIMUM NYÍLTVÉGŰ
BEFEKTETÉSI ALAP

2014. féléves jelentése

1. Az Erste Tőkevédett Kamatoptimum Nyíltvégű Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Tőkevédett Kamatoptimum Nyíltvégű Befektetési Alap

Az Alap korábbi neve: Erste Tőkevédett Nyugdíj Nyíltvégű Befektetési Alap

A névváltozást jóváhagyó Felügyeleti határozat száma és kelte: EN-III/TTE-135/2010; 2010. április 06.

A névváltozás 2010. április 07-én lépett hatályba

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Tőkevédett Kamatoptimum Alap

Az Alap típusa, fajtája

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

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (2009. október 21-től) 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

Tárgynap – 1 napi eszközállomány

Tárgynap – 1 napi árfolyam adatok

Tárgynap – 2 napi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

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

Megnevezés	Záró eszközérték Tárgynap: 2013.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2014.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	103 523 535 813	100.20%	122 806 023 830	101.89%
Banki egyenlegek	33 624 600 507	32.55%	35 305 883 841	29.30%
Pénzforgalmi számla egyenleg	33 802 976	0.03%	1 454 329 289	1.21%
Lekötött bankbetét	33 590 797 531	32.51%	33 851 554 552	28.09%
Átruházható értékpapírok	68 493 034 986	66.30%	87 749 470 836	72.80%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	67 177 797 685	65.02%	87 749 470 836	72.80%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	11 989 098 000	11.60%	9 896 650 100	8.21%
Államkötvények	55 058 430 422	53.29%	58 551 357 785	48.58%
Állami garanciával rendelkező kötvények	130 269 263	0.13%	16 006 172 354	13.28%
Hitelintézeti kötvények	0	0.00%	3 124 219 571	2.59%
Vállalati kötvények	0	0.00%	171 071 026	0.14%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	0	0.00%	0	0.00%
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	1 315 237 301	1.27%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	1 315 237 301	1.27%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	1 029 263 866	1.00%	-904 871 081	-0.75%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	1 029 263 866	1.00%	-904 871 081	-0.75%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	376 636 454	0.36%	655 540 234	0.54%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	376 636 454	0.36%	655 540 234	0.54%
KÖTELEZETTSÉGEK	-210 549 796	-0.20%	-2 273 846 178	-1.89%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-125 258 587	-0.12%	-149 392 527	-0.13%
Alapkezelői díj	-16 171 757	-0.02%	-19 181 829	-0.02%
Forgalmazói díj	-91 639 955	-0.09%	-108 697 030	-0.09%
Letétkezelői díj	-11 610 492	-0.01%	-13 771 569	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-381 000	0.00%	-377 868	0.00%
PSZÁF díj	-5 455 383	-0.01%	-7 364 231	-0.01%
Közzétételi költség		0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-85 291 209	-0.08%	-2 124 453 651	-1.76%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	103 312 986 017	100.00%	120 532 177 652	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	77 453 578 317		88 616 074 086	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.3339		1.3602	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2014.06.30-án*	88 616 074 086
--	----------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2014.06.30-án (Ft) *	1.3602
---	--------

* 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		87 749 470 836	72.80%
Államkötvény	2017/A MÁK	466 020 400	0.39%
Államkötvény	2017/B MÁK	45 067 560	0.04%
Államkötvény	2018/B MÁK	337 636 181	0.28%
Államkötvény	2019/A MÁK	114 502 900	0.09%
Államkötvény	2017/C MÁK	495 087 500	0.41%
Államkötvény	REPHUN 2015/02/03	17 451 690 338	14.48%
Államkötvény	REPHUN 2019/03/25	1 419 316 291	1.18%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2015/X	2 046 181 869	1.70%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2016/X	1 873 431 558	1.55%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2016/Y	34 302 423 188	28.46%
Vállalati kötvény	Magyar Export-Import Bank Kötvény	3 124 219 571	2.59%
Vállalati kötvény	MOL 2017/04/20	171 071 026	0.14%
EGT-állam által garantált, vagy olyan nemzetközi szervezet által kibocsátott, vagy garantált értékpapír, amelynek egy vagy több EGT állam is tagja	MFB 2016/05/31	16 006 172 354	13.28%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB140702	5 299 295 100	4.40%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB140709	4 597 355 000	3.81%
Nettó eszközérték		120 532 177 652	

Az alapnak nincsenek elkülönített eszközei. A félév végére a lekötött betétek aránya valamelyest csökkent, és az állami garanciával rendelkező kötvények állománya növekedett.

Budapest, 2014. augusztus 27.

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


Erste Alapkezelő Zrt.