



Az

ERSTE
TŐKEVÉDETT LIKVIDITÁSI
BEFEKTETÉSI ALAP

2015. féléves jelentése

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

Az Alap neve

Erste Tőkevédett Likviditási Befektetési Alap

Az Alap korábbi neve: Erste Kártya Pénzpiaci Alap

A névváltozást jóváhagyó Felügyeleti határozat száma és kelte: E-III-110.284-4/2009; 2009. március 25.

A névváltozás 2009. április 25-én lépett hatályba.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Tőkevédett Likviditási 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 (2005. szeptember 29-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: 2014.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2015.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	16 653 123 247	100.11%	17 339 170 545	106.34%
Banki egyenlegek	15 167 517 971	91.18%	12 854 908 632	78.84%
Pénzforgalmi számla egyenleg	913 481 635	5.49%	408 495 481	2.51%
Lekötött bankbetét	14 254 036 336	85.69%	12 446 413 151	76.33%
Átruházható értékpapírok	1 498 750 500	9.01%	4 491 728 100	27.55%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1 498 750 500	9.01%	4 491 728 100	27.55%
Diszkontkincstárjegyek	1 498 750 500	9.01%	4 491 728 100	27.55%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	0	0.00%	0	0.00%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Hitelintézeti kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Vállalati kötvények	0	0.00%	0	0.00%
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	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	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	-13 161 184	-0.08%	-7 466 187	-0.05%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-13 161 184	-0.08%	-7 466 187	-0.05%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	15 960	0.00%	0	0.00%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	15 960	0.00%	0	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-18 830 815	-0.11%	-1 033 306 113	-6.34%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-18 830 815	-0.11%	-21 142 193	-0.14%
Alapkezelői díj	-2 485 595	-0.01%	-2 532 645	-0.02%
Forgalmazói díj	-14 085 037	-0.08%	-14 351 654	-0.09%
Letétkezelői díj	-966 620	-0.01%	-984 917	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-254 000	0.00%	-161 038	0.00%
Felügyeleti díj	-1 039 563	-0.01%	-1 043 545	-0.01%
Fizetendő különadó	0	0.00%	-2 068 394	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	0	0.00%	-1 012 163 920	-6.20%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	16 634 292 432	100.00%	16 305 864 432	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	10 623 876 443		10 385 090 223	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.565746		1.570123	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2015.06.30-án*	10 385 090 223
--	----------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2015.06.30-án (Ft) *	1.570123
---	----------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Tétel neve	Piaci érték (Ft)	Érték a portfolió 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		4 491 728 100	27.55%
Kincstárjegy	D150722	999 115 000	6.13%
Kincstárjegy	D150805	499 319 500	3.06%
Kincstárjegy	D150826	998 053 000	6.12%
Kincstárjegy	D150902	798 313 600	4.90%
Kincstárjegy	D150916	199 524 000	1.22%
Kincstárjegy	D150930	997 403 000	6.12%
Nettó eszközérték		16 305 864 432	

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei. A félév végére a lekötött betétek aránya csökkent, míg a diszkontkincstárjegyek aránya növekedett.

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 kitettségeinek 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.