



Az

ERSTE

**NYÍLTVÉGŰ ABSZOLÚT HOZAMÚ ALTERNATÍV
ALAPOK ALAPJA**

2016. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Alternatív Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Klipper Alapok Alapjáról a PSZÁF EN-III/TTE-39/2010. számú határozata alapján 2010. április 02-ai hatállyal Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Részvény Származtatott Alapra módosult, majd 2013. október 07-től a PSZÁF H-K-III-634/2013. számú határozata alapján **Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Alternatív Alapok Alapjára** változott.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Abszolút Hozamú Alternatív Alapok Alapja

Az Alap típusa, fajtája

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

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (2007. április 17-től) határozatlan ideig terjed.

Alapkezelő

Erste Alapkezelő Zrt.
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.
Céggjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.
Céggjegyzékszám: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.
Céggjegyzékszám: 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: 2015.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2016.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	2 997 450 381	100.89%	2 117 745 724	101.06%
Banki egyenlegek	0	0.00%	23 343 284	1.11%
Pénzforgalmi számla egyenleg	0	0.00%	23 343 284	1.11%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	2 996 237 335	100.85%	2 116 670 271	101.01%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
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	2 996 237 335	100.85%	2 116 670 271	101.01%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	660 584 426	22.23%	290 669 144	13.87%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	2 335 652 909	78.61%	1 826 001 127	87.13%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	1 213 046	0.04%	-22 318 149	-1.06%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	1 213 046	0.04%	-22 318 149	-1.06%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	50 318	0.00%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	319	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	49 999	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-26 366 381	-0.89%	-22 142 669	-1.06%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-3 927 977	-0.13%	-2 815 294	-0.13%
Különadó	-343 526	-0.01%	-254 075	-0.01%
Alapkezelői díj	-384 404	-0.01%	-265 114	-0.01%
Forgalmazói díj	-2 178 290	-0.07%	-1 502 315	-0.07%
Letétkezelői díj	-448 472	-0.02%	-309 300	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-374 015	-0.01%	-340 395	-0.02%
Felügyeleti díj	-199 270	-0.01%	-144 095	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-22 438 404	-0.76%	-19 327 375	-0.93%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	2 971 084 000	100.00%	2 095 603 055	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	3 007 197 529		2 135 238 309	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	0.9880		0.9814	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2016.06.30-án (db)*	2 135 238 309
---	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2016.06.30-án (Ft)*	0.9814
--	--------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2015.12.31	2016.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	6.38%	0.00%	-6.38%
Egyéb átruházható értékpapírok	99.96%	99.95%	-0.01%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%

Az Alapnak vannak elkülönített eszközei. Az Alap összetételében számottevő változás nem történt.

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, 2016. augusztus 26.

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



Erste Alapkezelő Zrt.