



Az

ERSTE
MULTISTRATEGY ABSZOLÚT HOZAMÚ ALAPOK
ALAPJA

korábban

ERSTE ABSZOLÚT HOZAMÚ ALTERNATÍV ALAPOK ALAPJA

2017. féléves jelentése

1. Az Erste Multistrategy Abszolút Hozamú 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 neve jelenleg a Magyar Nemzeti Bank a H-KE-III-215/2017. számú határozata alapján 2017.05.08.-tól **Erste Multistrategy Abszolút Hozamú Alapok Alapja**.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Multistrategy Abszolút Hozamú 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.
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	1 441 213 548	100.51%	2 384 580 798	100.27%
Banki egyenlegek	2	0.00%	141 251 290	5.94%
Pénzforgalmi számla egyenleg	2	0.00%	141 251 290	5.94%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható érték papírok	1 441 815 282	100.55%	2 233 357 256	93.91%
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	1 441 815 282	100.55%	2 233 357 256	93.91%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	1 003 249 775	69.97%	1 445 269 705	60.77%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	438 565 507	30.59%	788 087 551	33.14%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származékos ügyletek	-2 072 953	-0.14%	2 997 062	0.13%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-2 072 953	-0.14%	2 997 062	0.13%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	1 471 217	0.10%	6 975 190	0.29%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	191	0.00%
Egyéb követelések	1 471 217	0.10%	6 974 999	0.29%
KÖTELEZETTSÉGEK	-7 324 892	-0.51%	-6 511 786	-0.27%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-2 072 235	-0.14%	-1 753 787	-0.07%
Különadó	-167 974	-0.01%	-98 368	0.00%
Alapkezelői díj	-179 341	-0.01%	-142 017	-0.01%
Forgalmazói díj	-1 016 266	-0.07%	-804 761	-0.03%
Letétkezelői díj	-209 231	-0.01%	-331 372	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-398 907	-0.03%	-251 912	-0.01%
Felügyeleti díj	-100 516	-0.01%	-125 357	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-5 252 657	-0.37%	-4 757 999	-0.20%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	1 433 888 656	100.00%	2 378 069 012	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	1 484 084 926		2 442 869 696	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	0.9662		0.9735	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2017.06.30-án (db)*	2 442 869 696
---	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2017.06.30-án (Ft)*	0.9735
--	--------

* 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	0.00%	0.00%	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	100.04%	93.66%	-6.38%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%

Az Alap összetételében a látra szóló betétek aránya emelkedett, míg az egyéb átruházható értékpapírok aránya csökkent a félév végére, melyet a nyíltvégű alapok befektetési jegyei arányának esése magyaráz. 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.