



Az

ERSTE
NYÍLTVÉGŰ TARTÓS ÁRFOLYAMVÉDETT
KÖTVÉNY ALAP

2012. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Tartós Árfolyamvédett Kötvény Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Nyíltvégű Tartós Árfolyamvédett Kötvény Alap

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Tartós Árfolyamvédett Alap

Az Alap típusa, fajtája

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

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (2012. március 7-től) 2014. szeptember 30. napjáig terjed.

Alapkezelő

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

Letétkezelő

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

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.
Cégjegyzékszáma: 01-10-041373

Nettó eszközérték számítás típusa

Tárgynapi eszközérték Tárgy +1 napon készül Tárgynapi eszközállomány
Tárgynapi árfolyam adatok
Tárgynapi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

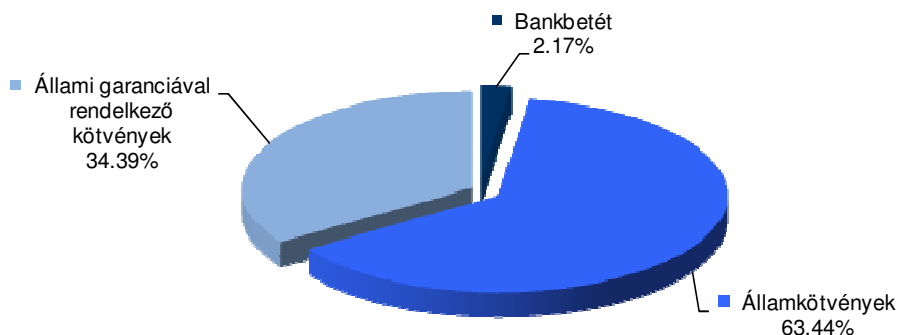
2. Vagyonkimutatás, a befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele

Megnevezés	Nyitó eszközérték Tárgynap: 2012.03.07 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2012.06.29 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	230 000 000	100.00%	2 126 314 111	101.57%
Banki egyenlegek	230 000 000	100.00%	44 729 197	2.14%
Pénzforgalmi számla egyenleg	230 000 000	100.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	44 729 197	2.14%
Átruházható értékpapírok	0	0.00%	2 019 636 149	96.47%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	2 019 636 149	96.47%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	0	0.00%	1 309 605 605	62.56%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	710 030 544	33.92%
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%
Részcények	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	0	0.00%	46 272 827	2.21%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	0	0.00%	46 272 827	2.21%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	15 675 938	0.75%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	15 675 938	0.75%
KÖTELEZETTSÉGEK	0	0.00%	-32 864 858	-1.57%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	0	0.00%	-1 778 204	-0.08%
Alapkezelői díj	0	0.00%	-201 313	-0.01%
Forgalmazói díj	0	0.00%	-1 140 776	-0.05%
Letétkezelői díj	0	0.00%	-187 893	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	0	0.00%	-166 195	-0.01%
PSZÁF díj	0	0.00%	-82 027	0.00%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	0	0.00%	-31 086 654	-1.48%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	230 000 000	100.00%	2 093 449 253	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	230 000 000		1 972 560 677	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.0000		1.0613	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma és az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Tárgyidőszak: 2012.03.07 - 2012.06.30.	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012.03.07-én	230 000 000
Tárgyidőszakban eladott befektetési jegyek száma	2 002 576 667
Tárgyidőszakban visszaváltott befektetési jegyek száma	260 015 990
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012.06.29-én	1 972 560 677
Portfólió összesített nettó eszközértéke 2012.06.29-én (Ft) *	2 093 449 253
Egy jegyre jutó nettó eszközérték 2012.06.29-én (Ft) *	1.0613

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. A befektetési alap összetétele (az Alap tulajdonában lévő értékpapírok és bankbetétek megoszlása)**2012.06.29-i összetétel**

Budapest, 2012. augusztus 27.

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

[Signature]

Erste Alapkezelő Zrt.