



Az

ERSTE

**NYÍLTVÉGŰ ABSZOLÚT HOZAMÚ RÉSZVÉNY
SZÁRMAZTATOTT ALAP**

2013. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Részvény Származtatott Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása**Az Alap neve**

Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Részvény Származtatott Alap

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Részvény Származtatott 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 (2007. április 17-től) határozatlan ideig 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 Tárgnap: 2012.12.28 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgnap: 2013.06.28 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	394 551 810	115.52%	445 224 739	123.26%
Banki egyenlegek	2 001	0.00%	125 024 914	34.61%
Pénzforgalmi számla egyenleg	2 001	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	125 024 914	34.61%
Átruházható értékpapírok	394 549 634	115.52%	320 199 648	88.65%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	219 701 790	64.32%	139 841 400	38.71%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	219 701 790	64.32%	139 841 400	38.71%
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	174 847 844	51.19%	180 358 248	49.94%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	174 847 844	51.19%	180 358 248	49.94%
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%	0	0.00%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	175	0.00%	177	0.00%
Befektetési számla egyenleg	175	0.00%	177	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	0	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-53 002 082	-15.52%	-84 006 544	-23.26%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-577 582	-0.17%	-602 769	-0.17%
Alapkezelői díj	-39 182	-0.01%	-42 435	-0.01%
Forgalmazói díj	-222 033	-0.07%	-240 465	-0.07%
Letétkezelői díj	-45 713	-0.01%	-49 508	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-249 836	-0.07%	-249 129	-0.07%
PSZÁF díj	-20 818	-0.01%	-21 232	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-52 424 500	-15.35%	-83 403 775	-23.09%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	341 549 728	100.00%	361 218 195	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	372 411 014		397 777 528	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	0.9171		0.9081	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013.06.28-án*	397 777 528
--	-------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2013.06.28-án (Ft) *	0.9081
---	--------

* 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		180 358 248	49.93%
Befektetési jegy	Erste Tőke- és Hozamvédett Befektetési Alap	30 425 570	8.42%
Befektetési jegy	Erste Tőkevédett Kamatoptimum Alap	65 438 739	18.12%
Befektetési jegy	Erste Tőkevédett Likviditási Alap	55 220 141	15.29%
Befektetési jegy	Erste Tőkevédett Pénzpiaci Alap	29 273 798	8.10%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		139 841 400	38.71%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB130703	49 968 750	13.83%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB130710	89 872 650	24.88%
Nettó eszközérték		361 218 195	

Az alapnak nincsenek elkülönített eszközei. Az alapban a félév végére a lekötött betétek aránya jelentősen megnőtt, az egyéb kötelezettség értékpapír kölcsönből ered.

Budapest, 2013. augusztus 26.

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

Erste Alapkezelő Zrt.