



Az

**ERSTE
NYÍLTVÉGŰ TARTÓS ÁRFOLYAMVÉDETT
KÖTVÉNY ALAP**

2013. 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: 2012.12.28 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2013.06.28 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	2 505 679 786	100.10%	2 689 096 184	101.33%
Banki egyenlegek	6 196 177	0.25%	639 483	0.02%
Pénzforgalmi számla egyenleg	0	0.00%	639 483	0.02%
Lekötött bankbetét	6 196 177	0.25%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	2 563 630 400	102.42%	2 684 934 982	101.17%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	2 563 630 400	102.42%	2 684 934 982	101.17%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	19 961 740	0.80%	41 973 750	1.58%
Államkötvények	1 656 583 998	66.18%	1 748 555 033	65.89%
Állami garanciával rendelkező kötvények	887 084 662	35.44%	894 406 199	33.70%
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%
Részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai tőzsdei részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai OTC részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részesvények	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	-68 378 788	-2.73%	3 358 985	0.13%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-68 378 788	-2.73%	3 358 985	0.13%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	4 231 997	0.17%	162 734	0.01%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	4 231 997	0.17%	162 734	0.01%
KÖTELEZETTSÉGEK	-2 522 062	-0.10%	-35 071 701	-1.33%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-2 522 062	-0.10%	-3 706 457	-0.15%
Alapkezelői díj	-284 283	-0.01%	-457 247	-0.02%
Forgalmazói díj	-1 610 937	-0.06%	-2 591 064	-0.10%
Letétkezelői díj	-265 331	-0.01%	-284 509	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-213 434	-0.01%	-213 628	-0.01%
PSZÁF díj	-148 077	-0.01%	-160 009	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	0	0.00%	-31 365 244	-1.18%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	2 503 157 724	100.00%	2 654 024 483	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	2 138 176 844		2 178 946 625	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.1707		1.2180	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013.06.28-án*	2 178 946 625
--	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2013.06.28-án (Ft) *	1.2180
---	--------

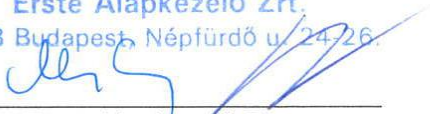
* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

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		0	0.00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		2 684 934 982	101.16%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB130703	41 973 750	1.58%
Államkötvény	HUSTHO	894 406 199	33.70%
Államkötvény	REPHUN 2014/01/29	828 873 781	31.23%
Államkötvény	REPHUN 2014/07/28	919 681 252	34.65%
Nettó eszközérték		2 654 024 483	

Az alapnak nincsenek elkülönített eszközei. Az alap összetételében számottevő változás nem történt.

Budapest, 2013. augusztus 26.

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

Erste Alapkezelő Zrt.