



Az

ERSTE

DPM NYÍLTVÉGŰ ALTERNATÍV ALAPOK ALAPJA

KORÁBBAN:

**ERSTE NYÍLTVÉGŰ ABSZOLÚT HOZAMÚ DEVIZA
SZÁRMAZTATOTT ALAP**

2013. féléves jelentése

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

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Fregatt Alapok Alapjáról a PSZÁF EN-III/TTE-38/2010.számú határozata alapján 2010. április 02-ai hatállyal Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Deviza Származtatott Alapra változott, majd 2012. október 30-ai hatállyal ismét változott az Alap neve a PSZÁF H-KE-III-432/2012. számú határozata alapján, így az Alap új neve: **Erste DPM Nyíltvégű Alternatív Alapok Alapja**.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste DPM Alternatív Alapok Alapja

Az Alap korábbi rövidített elnevezése: Erste Deviza 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.

Céjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Céjegyzékszám: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Céjegyzékszám: 01-10-041373

Könyvvizsgáló

Az Alap éves beszámolójának könyvvizsgálatáról a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. törvény XX. fejezete rendelkezik.

Az Alap könyvvizsgálója: Ecocomplex Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft.

Székhelye: 2096 Üröm, Kert u. 49.

Céjegyzékszám: 13-09-074516

MKVK tagsági szám: 000608; Pénzügyi intézményi minősítési szám: T-000608/04

Eljáró könyvvizsgáló neve: Szabó Katalin

Lakcíme: 2096 Üröm, Kert u. 49.

MKVK tagsági szám: 001350; Pénzügyi intézményi minősítési szám: E-001350/04

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	69 982 444	100.40%	542 321 896	101.65%
Banki egyenlegek	0	0.00%	0	0.00%
Pénzforgalmi számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	70 472 464	101.11%	541 614 890	101.52%
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	70 472 464	101.11%	541 614 890	101.52%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	25 873 271	37.12%	158 698 506	29.75%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	44 599 193	63.99%	382 916 384	71.77%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	-490 020	-0.70%	485 195	0.09%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-490 020	-0.70%	485 195	0.09%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	221 811	0.04%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	5	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	221 806	0.04%
KÖTELEZETTSÉGEK	-281 845	-0.40%	-8 839 990	-1.65%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-269 410	-0.39%	-720 200	-0.13%
Alapkezelői díj	-5 074	-0.01%	-59 899	-0.01%
Forgalmazói díj	-28 755	-0.04%	-339 430	-0.06%
Letétkezelői díj	-5 920	-0.01%	-69 883	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-224 852	-0.32%	-224 216	-0.04%
PSZÁF díj	-4 809	-0.01%	-26 772	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-12 435	-0.02%	-8 119 790	-1.52%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	69 700 599	100.00%	533 481 906	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	62 272 715		469 250 070	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.1193		1.1369	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013.06.28-án*	469 250 070
--	-------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2013.06.28-án (Ft) *	1.1369
---	--------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Tétel neve	Piaci érték (Ft)	Érték a portfolió 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		541 614 890	101.52%
Befektetési jegy	BlackRock Strategic Fund - European Absolut Return Fund	83 412 511	15.64%
Befektetési jegy	Concorde VM Abszolút Befektetési Alap	63 286 980	11.86%
Befektetési jegy	Erste Tőkevédett Kamatoptimum Alap	7 869 513	1.48%
Befektetési jegy	Erste Tőkevédett Pénzpiaci Alap	24 204 130	4.54%
Befektetési jegy	Franklin Templeton Global Total Return fund	94 795 634	17.77%
Befektetési jegy	ING L Invest Altern Beta-EURXC	76 932 589	14.42%
Befektetési jegy	OTP Supra Származtatott Alap	63 337 883	11.87%
Befektetési jegy	PIMCO Total Return Bond Fund	52 570 948	9.85%
Befektetési jegy	Threadneedle Focus Investment Fund	75 204 702	14.10%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		0	0.00%
Nettó eszközérték		533 481 906	

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.