



Az

ERSTE

DPM NYÍLTVÉGŰ ALTERNATÍV ALAPOK ALAPJA

KORÁBBAN:

**ERSTE NYÍLTVÉGŰ ABSZOLÚT HOZAMÚ DEVIZA
SZÁRMAZTATOTT ALAP**

2014. 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.

Céggjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.

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

Céggjegyzékszám: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.

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

Céggjegyzékszám: 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: 2013.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2014.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	764 725 933	100.13%	1 465 535 477	100.10%
Banki egyenlegek	1	0.00%	0	0.00%
Pénzforgalmi számla egyenleg	1	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	761 132 406	99.66%	1 470 556 534	100.44%
<i>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</i>	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%
<i>Részvények</i>	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%
<i>Kollektív befektetési értékpapírok</i>	761 132 406	99.66%	1 470 556 534	100.44%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	195 900 648	25.65%	415 597 375	28.39%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	565 231 758	74.01%	1 054 959 159	72.05%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	3 593 526	0.47%	-5 021 059	-0.34%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	3 593 526	0.47%	-5 021 059	-0.34%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	2	0.00%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	2	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%		0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-1 004 262	-0.13%	-1 625 237	-0.12%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-1 004 262	-0.13%	-1 625 237	-0.12%
Alapkezelői díj	-93 476	-0.01%	-168 688	-0.01%
Forgalmazói díj	-529 697	-0.07%	-955 900	-0.07%
Letétkezelői díj	-109 055	-0.01%	-196 803	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-228 600	-0.03%	-226 721	-0.02%
PSZÁF díj	-43 434	-0.01%	-77 125	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%		0.00%
Egyéb kötelezettség	0	0.00%		0.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	763 721 671	100.00%	1 463 910 240	99.98%
Befektetési jegyek darabszáma	656 389 401		1 229 041 415	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.1635		1.1911	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2014.06.30-án*	1 229 041 415
----------------------------------------------------------	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2014.06.30-án (Ft) *	1.1911
-------------------------------------------------------------------	--------

* 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		1 470 556 534	100.45%
Befektetési jegy	Allianz Discovery Europe Strategy	125 626 817	8.58%
Befektetési jegy	BlackRock Strategic Fund - European Absolut Return Fund	87 574 392	5.98%
Befektetési jegy	BNY Mellon Global Funds plc Fund	96 089 107	6.56%
Befektetési jegy	DWS Concept Kaldemorgen FC	115 390 680	7.88%
Befektetési jegy	Erste Tőkevédelem Pénzpiaci Alap	233 510 722	15.95%
Befektetési jegy	Goldman Sachs Global Strategic Income Bond Portfolio Fund	99 496 544	6.80%
Befektetési jegy	JPMorgan Funds Systematic Alpha	87 109 107	5.95%
Befektetési jegy	Loomis Sayles Multisector Income Fund	138 775 904	9.48%
Befektetési jegy	MLIS-Marshall Wace TOPS UCITS Fund	110 374 908	7.54%
Befektetési jegy	Morgan Stanley Investment Funds Diversified Alpha Plus Fund	87 696 917	5.99%
Befektetési jegy	OTP Supra Származtatott Alap	90 775 079	6.20%
Befektetési jegy	Platina Pi Származtatott Befektetési alap "B" sorozat	91 311 574	6.24%
Befektetési jegy	Threadneedle Focus Investment Fund	106 824 783	7.30%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		0	0.00%
Nettó eszközérték		1 463 910 240	

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

Budapest, 2014. augusztus 27.

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


Erste Alapkezelő Zrt.