



Az  
**ERSTE**  
**NYÍLTVÉGŰ ABSZOLÚT HOZAMÚ DEVIZA**  
**SZÁRMAZTATOTT ALAP**

*2012. féléves jelentése*

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

### **Az Alap neve**

Erste Nyíltvégű Abszolút Hozamú Deviza Származtatott Alap

Az Alap korábbi neve: Erste Fregatt Alapok Alapja

A névváltozást jóváhagyó Felügyeleti határozat száma és kelte: EN-III/TTE-38/2010; 2010. március 01.

A névváltozás 2010. április 02-án lépett hatályba

### **Az Alap rövidített elnevezése**

Erste Deviza Származtatott Alap

Az Alap korábbi rövidített elnevezése: Erste Fregatt 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

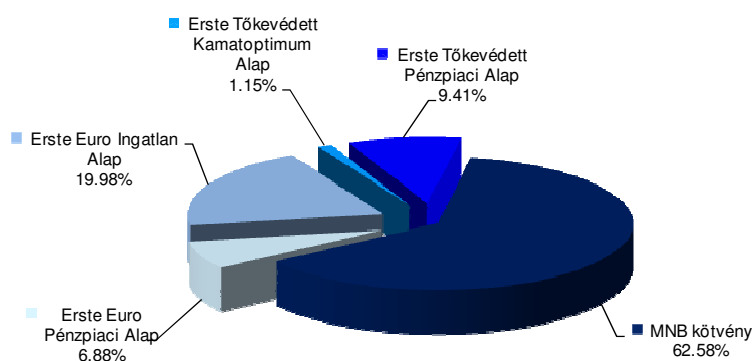
**2. Vagyonkimutatás, a befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele**

Megnevezés	Nyitó eszközérték Tárgynap: 2011.12.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2012.06.29 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>264 324 402</b>	<b>100.15 %</b>	<b>236 253 245</b>	<b>100.20 %</b>
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>2</b>	<b>0.00 %</b>	<b>6 783</b>	<b>0.00 %</b>
Pénzforgalmi számla egyenleg	2	0.00%	6 783	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>264 324 344</b>	<b>100.15 %</b>	<b>236 246 249</b>	<b>100.19 %</b>
<b>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>	<b>147 837 045</b>	<b>62.70 %</b>
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	0	0.00%	147 837 045	62.70%
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%
<b>Részvények</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>
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%
<b>Kollektív befektetési értékpapírok</b>	<b>264 324 344</b>	<b>100.15 %</b>	<b>88 409 204</b>	<b>37.49 %</b>
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	264 324 344	100.15%	88 409 204	37.49%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
<b>Származtatott ügyletek</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>
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%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>56</b>	<b>0.00 %</b>	<b>213</b>	<b>0.00 %</b>
Befektetési számla egyenleg	56	0.00%	213	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	0	0.00%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-385 213</b>	<b>-0.15 %</b>	<b>-461 905</b>	<b>-0.20 %</b>
<b>Hitelállomány</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>
<b>Költségek</b>	<b>-385 213</b>	<b>-0.15 %</b>	<b>-461 905</b>	<b>-0.20 %</b>
Alapkezelői díj	-16 134	-0.01%	-28 641	-0.01%
Forgalmazói díj	-91 428	-0.03%	-162 301	-0.07%
Letétkezelői díj	-37 647	-0.01%	-33 415	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-223 767	-0.08%	-222 541	-0.09%
PSZÁF díj	-16 237	-0.01%	-15 007	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
<b>Egyéb kötelezettség</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>	<b>0</b>	<b>0.00 %</b>
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>263 939 189</b>	<b>100.00 %</b>	<b>235 791 340</b>	<b>100.00 %</b>
<b>Befektetési jegyek darabszáma</b>	<b>215 419 352</b>		<b>215 419 352</b>	
<b>Egy jegyre jutó nettó eszközérték</b>	<b>1.2252</b>		<b>1.0946</b>	

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

Tárgydőszak: 2012.01.01 - 2012.06.30.	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012.01.01-én	215 419 352
Tárgydőszakban eladott befektetési jegyek száma	-
Tárgydőszakban visszaváltott befektetési jegyek száma	-
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012.06.29-én	215 419 352
Portfólió összesített nettó eszközértéke 2012.06.29-én (Ft) *	235 791 340
Egy jegyre jutó nettó eszközérték 2012.06.29-én (Ft) *	1.0946

\* tárgydőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

**4. A befektetési alap összetétele (az Alap tulajdonában lévő értékpapírok és bankbetétek megoszlása)****2011.12.30-i összetétel****2012.06.29-i összetétel**

Az Alap portfóliójában jelentősebb változást okozott, hogy az Erste Tőkevédett Pénzpiaci Alap aránya 90,59 %-kal csökkent, helyére 62 %-ot meghaladóan MNB kötvény, 20 %-ig Erste Euro Ingatlan Alap és további 8 %-ban egyéb pénzügyi jellegű alapok kerültek.

Budapest, 2012. augusztus 27.

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

Erste Alapkezelő Zrt.