



Az

ERSTE
KORVETT KÖTVÉNY ALAPOK ALAPJA

2016. féléves jelentése

1. Az Erste Korvett Kötvény Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Korvett Alapok Alapjáról 2009. október 15-ével **Erste Korvett Kötvény Alapok Alapjára** változott, a névváltozást a PSZÁF EN-III/TTE-37/2010. számú határozatával engedélyezte.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Korvett Kötvény Alapok Alapja

Az Alap típusa, fajtája

Az Alap nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott, nyíltvégű 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: 2015.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2016.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	3 901 137 845	100.07%	4 407 724 190	100.07%
Banki egyenlegek	329 625	0.01%	4 505 513	0.10%
Pénzforgalmi számla egyenleg	329 625	0.01%	4 505 513	0.10%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	3 900 709 917	100.06%	4 380 194 660	99.44%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	328 464 496	8.43%	162 919 225	3.69%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	99 802 500	2.26%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	276 349 546	7.09%	63 116 725	1.43%
Állami garanciával rendelkező kötvények	52 114 950	1.34%	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	3 572 245 421	91.64%	4 217 275 435	95.75%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	3 572 245 421	91.64%	4 217 275 435	95.75%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	98 303	0.00%	307 829	0.01%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	98 303	0.00%	307 829	0.01%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	22 716 188	0.52%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	22 716 188	0.52%
KÖTELEZETTSÉGEK	-2 845 105	-0.07%	-3 057 972	-0.07%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-2 845 105	-0.07%	-3 057 972	-0.07%
Különadó	-41 047	0.00%	-22 946	0.00%
Alapkezelői díj	-246 245	-0.01%	-269 231	-0.01%
Forgalmazói díj	-1 395 388	-0.04%	-1 525 642	-0.03%
Letétkezelői díj	-574 572	-0.01%	-628 205	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-344 805	-0.01%	-342 921	-0.01%
Felügyeleti díj	-243 048	-0.01%	-269 027	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	0	0.00%	0	0.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	3 898 292 740	100.00%	4 404 666 218	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	2 305 594 302		2 543 700 088	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.6908		1.7316	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2016.06.30-án*	2 543 700 088
--	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2016.06.30-án (Ft) *	1.7316
---	--------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2015.12.31	2016.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	2.29%	0.84%	-1.45%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	6.13%	2.86%	-3.27%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	1.31%	2.26%	0.95%
Egyéb átruházható értékpapírok	91.57%	95.68%	4.11%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	8.42%	3.70%	-4.72%

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei. Az Alap összetételében a nyíltvégű alapok befektetési jegyeinek aránya emelkedett, államkötvények és az állami garanciával rendelkező kötvények aránya csökkent a félév végére, melynek következménye képen csökkent a tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok, valamint a más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok aránya is.

6. Az ABA nevében alkalmazható tőkeáttétellel kapcsolatos információk bemutatása

Tőkeáttétel mértékében bekövetkezett változások, Biztosíték vagy a tőkeáttételi megállapodás értelmében nyújtott garanciák újbóli felhasználási joga, ABA által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege

Az Alap teljes nettó kockázati kitettségeinek maximális mértéke 100% lehet, az esetleges mögöttes alapok eszközösszetételének figyelembevételével.

Az Alapkezelő jogosult hitelt felvenni az Alap nevében, az Alap eszközeinek legfeljebb tíz százaléka erejéig, 3 hónapnál rövidebb futamidőre. Az Alapkezelő jogosult az Alap eszközei terhére az Alap nevében óvadékot nyújtani a hitel fedezeteként.

Az Alap származtatott ügyleteket (határidős deviza forward) fedezeti célból alkalmazhat.

Az ABA nem alkalmazott tőkeáttételt.

Budapest, 2016. augusztus 26.

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


Erste Alapkezelő Zrt.