ERSTE Asset Management

Az

ERSTE

NYÍLTVÉGŰ TŐKEVÉDETT PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP

2014. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Tőkevédett Pénzpiaci Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Nyíltvégű Tőkevédett Pénzpiaci Befektetési Alap
Az Alap korábbi neve: Erste Nyíltvégű Pénzpiaci befektetési Alap
A névváltozást jóváhagyó Felügyeleti határozat száma és kelte: E-III-110.164-13/2009; 2009. április 17.
A névváltozás 2009. május 20-án lépett hatályba

Az Alap rövidített elnevezése
Erste Tőkevédett Pénzpiaci Alap
Az Alap korábbi rövidített elnevezése: Erste Pénzpiaci 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 (2001. január 10-től) határozatlan ideig 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 Tárgynap – 1 napi eszközállomány
Tárgynap – 1 napi árfolyam adatok
Tárgynap – 2 napi 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	**83 321 131 403**	**102.84%**	**83 927 934 885**	**102.29%**
Banki egyenlegek	**63 110 805 601**	**77.90%**	**59 454 046 998**	**72.46%**
Pénzforgalmi számla egyenleg	16 916 935	0.02%	148 420	0.00%
Lekötött bankbetét	63 093 888 666	77.88%	59 453 898 578	72.46%
Átruházható értékpapírok	**17 570 353 655**	**21.69%**	**25 017 860 594**	**30.49%**
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	**17 568 273 025**	**21.68%**	**23 998 697 899**	**29.25%**
Diszkontkincstárjegyek	741 894 250	0.92%	14 503 351 900	17.68%
MNB kötvények	9 996 670 000	12.34%	6 343 231 817	7.73%
Államkötvények	6 829 708 775	8.43%	3 152 114 182	3.84%
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	**2 080 630**	**0.00%**	**1 019 162 695**	**1.24%**
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	1 019 162 695	1.24%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	2 080 630	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	**350 100 176**	**0.43%**	**-543 972 707**	**-0.66%**
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	350 100 176	0.43%	-543 972 707	-0.66%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	**2 289 871 971**	**2.83%**	**0**	**0.00%**
Befektetési számla egyenleg	22	0.00%		0.00%
Egyéb követelések	2 289 871 949	2.83%		0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	**-2 304 377 626**	**-2.84%**	**-1 881 173 792**	**-2.31%**
Hitelállomány	**0**	**0.00%**	**0**	**0.00%**
Költségek	**-99 835 867**	**-0.12%**	**-94 695 068**	**-0.13%**
Alapkezelői díj	-13 361 304	-0.02%	-12 644 384	-0.02%
Forgalmazói díj	-75 714 056	-0.09%	-71 651 507	-0.09%
Letétkezelői díj	-4 796 366	-0.01%	-4 539 010	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-889 000	0.00%	-881 693	0.00%
PSZÁF díj	-5 075 141	-0.01%	-4 978 474	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	**-2 204 541 759**	**-2.72%**	**-1 786 478 724**	**-2.18%**
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	**81 016 753 777**	**100.00%**	**82 046 761 093**	**99.98%**
Befektetési jegyek darabszáma	36 884 363 385		36 975 874 889	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	2.196507		2.218927	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2014.06.30-án*	36 975 874 889

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2014.06.30-án (Ft) *	2.218927

* 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		**1 019 162 695**	**1.24%**
Befektetési jegy	Erste Dollár Pénzpiaci Befektetési Alap	1 019 162 695	1.24%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		**23 998 697 899**	**29.25%**
Kincstárjegy	D140806	1 995 426 000	2.43%
Kincstárjegy	D140821	2 093 256 900	2.55%
Kincstárjegy	D140827	1 992 840 000	2.43%
Kincstárjegy	D140903	995 990 000	1.21%
Kincstárjegy	D140910	995 560 000	1.21%
Kincstárjegy	D140924	497 350 500	0.61%
Kincstárjegy	D141001	1 491 530 000	1.82%
Kincstárjegy	D141126	1 486 435 500	1.81%
Kincstárjegy	D150121	1 481 275 500	1.81%
Kincstárjegy	D150401	983 733 000	1.20%
Kincstárjegy	D150527	489 954 500	0.60%
Államkötvény	REPHUN 2015/02/03	2 651 355 182	3.23%
Államkötvény	2015/B MÁK	500 759 000	0.61%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB140702	3 844 669 317	4.69%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB140709	2 498 562 500	3.05%
Nettó eszközérték		**82 046 761 093**	

Az alapnak nincsenek elkülönített eszközei. A portfólióban a diszkontkincstárjegyek aránya növekedett, és a bankbetétek aránya valamelyest csökkent a félév végére.

Budapest, 2014. augusztus 27.

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

Erste Alapkezelő Zrt.