



Az

ERSTE

NYÍLTVÉGŰ RÖVID KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

2014. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Rövid Kötvény Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Nyíltvégű Rövid Kötvény Befektetési Alap

Az Alap korábbi neve: Erste Nyíltvégű Kötvény Befektetési Alap

A névváltozást jóváhagyó Felügyeleti határozat száma és kelte: E-III-110.110-14/2009; 2009. május 08.

A névváltozás 2009. június 10-én lépett hatályba

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Rövid Kötvény Alap

Az Alap korábbi rövidített elnevezése: Erste Kötvény 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 (1998. november 02-től) határozatlan ideig terjed.

Alapkezelő

Erste Alapkezelő Zrt.

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

Cégjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.

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

Cégjegyzékszám: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.

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

Cégjegyzékszám: 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	28 136 048 342	100.15%	41 748 442 636	102.09%
Banki egyenlegek	337 218 728	1.20%	1 476 453 172	3.61%
Pénzforgalmi számla egyenleg	27 095 759	0.10%	616 160 031	1.51%
Lekötött bankbetét	310 122 969	1.10%	860 293 141	2.10%
Átruházható értékpapírok	27 355 953 918	97.37%	40 411 945 423	98.82%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	26 556 263 504	94.53%	40 405 550 928	98.80%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	126 465 987	0.31%
MNB kötvények	1 698 227 600	6.04%	7 197 495 400	17.60%
Államkötvények	16 711 274 616	59.48%	25 260 733 846	61.76%
Állami garanciával rendelkező kötvények	8 146 761 288	29.00%	6 604 262 192	16.15%
Hitelintézeti kötvények	0	0.00%	547 497 456	1.34%
Vállalati kötvények	0	0.00%	669 096 047	1.64%
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	799 690 414	2.85%	6 394 495	0.02%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	6 394 495	0.02%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	799 690 414	2.85%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	395 300 150	1.41%	-222 225 000	-0.54%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	395 300 150	1.41%	-222 225 000	-0.54%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	47 575 546	0.17%	82 269 041	0.20%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%		0.00%
Egyéb követelések	47 575 546	0.17%	82 269 041	0.20%
KÖTELEZETTSÉGEK	-42 395 788	-0.15%	-847 720 732	-2.08%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-35 357 009	-0.13%	-49 596 728	-0.13%
Alapkezelői díj	-4 529 489	-0.02%	-6 376 729	-0.02%
Forgalmazói díj	-25 664 784	-0.09%	-36 131 526	-0.09%
Letétkezelői díj	-3 251 941	-0.01%	-4 578 164	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-254 000	0.00%	-251 912	0.00%
PSZÁF díj	-1 656 795	-0.01%	-2 258 397	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-7 038 779	-0.03%	-798 124 004	-1.95%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	28 093 652 554	100.00%	40 900 721 904	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	9 734 002 201		13 594 490 378	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	2.8861		3.0086	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2014.06.30-án*	13 594 490 378
--	----------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2014.06.30-án (Ft) *	3.0086
---	--------

* 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		6 394 495	0.02%
Befektetési jegy	Erste Dollár Pénzpiaci Befektetési Alap	6 394 495	0.02%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		40 405 550 928	98.79%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2015/X	1 490 083 774	3.64%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2016/X	1 866 602 446	4.56%
Államkötvény	Prémium Euro Magyar Államkötvény 2016/Y	9 511 126 429	23.25%
Államkötvény	2016/D MÁK	3 581 381	15.53%
Államkötvény	2017/A MÁK	93 204 080	0.62%
Államkötvény	2018/B MÁK	10 923 370 500	0.31%
Államkötvény	2019/A MÁK	458 011 600	0.01%
Államkötvény	REPHUN 2016/03/30	205 095 490	0.23%
Államkötvény	REPHUN 2019/03/25	709 658 146	26.71%
Vállalati kötvény	Magyar Export-Import Bank Kötvény	547 497 456	1.12%
Vállalati kötvény	MOL 2015/10/05	245 495 300	1.34%
Vállalati kötvény	MOL 2017/04/20	171 071 026	0.60%
Vállalati kötvény	MOL 2019/09/26	252 529 721	0.42%
EGT-állam által garantált, vagy olyan nemzetközi szervezet által kibocsátott, vagy garantált értékpapír, amelynek egy vagy több EGT állam is tagja	MFB 2016/05/31	6 350 064 201	0.62%
EGT-állam által garantált, vagy olyan nemzetközi szervezet által kibocsátott, vagy garantált értékpapír, amelynek egy vagy több EGT állam is tagja	MFB 2020/10/21	254 197 991	0.50%
Kincstárjegy	D140910	126 465 987	1.74%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB140702	3 699 507 900	9.05%
Az MNB, az Európai Központi Bank, vagy az Európai Unió más tagállamának jegybankja által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír	MNB140709	3 497 987 500	8.55%
Nettó eszközérték		40 900 721 904	

Az alaphoz nincsenek elkülönített eszközei. Az alap összetételében az MNB kötvények aránya valamelyest növekedett, míg az állami garanciával rendelkező kötvények aránya hasonló mértékben csökkent a félév végére.

Budapest, 2014. augusztus 27.

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



Erste Alapkezelő Zrt.