



Az
ERSTE ALPOK
NYÍLTVÉGŰ TŐKEVÉDETT PÉNZPIACI
BEFEKTETÉSI ALAP

2016. féléves jelentése

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

Az Alap neve

Az alap Magyar Posta Nyíltvégű Pénzpiaci Alap néven indult, mely a PSZÁF E-III-110.232-3/2009. számú határozata alapján 2009. május 20-ai hatállyal Magyar Posta Nyíltvégű Tőkevédett Pénzpiaci Befektetési Alapra változott. Az Alap jelenlegi neve 2013. február 1-től Alpok Nyíltvégű Tőkevédett Pénzpiaci Alapra módosult a Felügyelet H-KE-III-36/2013. számú határozata szerint. Az Alap jelenlegi neve 2013. október 7-től **Erste Alpok Nyíltvégű Tőkevédett Pénzpiaci Befektetési Alap**, melyet a Felügyelet H-KE-III-561/2013. számú határozatával engedélyezett.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Alpok Tőkevédett Pénzpiaci Alap

Az Alap típusa, fajtája

Az Alap nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott, nyíltvégű befektetési alap.

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (2004. november 16-tól) 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

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: 2015.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2016.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	6 938 673 719	104.64%	3 519 097 438	100.11%
Banki egyenlegek	4 281 722 261	64.57%	2 102 464 830	59.81%
Pénzforgalmi számla egyenleg	129 400 944	1.95%	433 246 186	12.32%
Lekötött bankbetét	4 152 321 317	62.62%	1 669 218 644	47.49%
Átruházható értékpapírok	2 656 379 760	40.06%	1 426 266 030	40.57%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	2 639 477 096	39.80%	1 426 266 030	40.57%
Diszkontkincstárjegyek	2 201 364 210	33.20%	1 081 322 490	30.76%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	100 886	0.00%	344 943 540	9.81%
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	438 012 000	6.61%	0	0.00%
Külföldi kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Résztvények	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	16 902 664	0.25%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	16 902 664	0.25%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	570 793	0.01%	-9 812 498	-0.28%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	570 793	0.01%	-9 812 498	-0.28%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	905	0.00%	179 076	0.01%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	905	0.00%	179 076	0.01%
KÖTELEZETTSÉGEK	-307 378 644	-4.64%	-3 766 073	-0.11%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-8 013 844	-0.12%	-3 758 073	-0.11%
Különadó	-846 743	-0.01%	-484 641	-0.01%
Alapkezelői díj	-854 963	-0.01%	-333 183	-0.01%
Forgalmazói díj	-4 844 792	-0.07%	-1 888 036	-0.05%
Letétkezelői díj	-398 983	-0.01%	-207 314	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-635 634	-0.01%	-600 585	-0.02%
Felügyeleti díj	-432 729	-0.01%	-244 314	-0.01%
Közzétételi költség	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötelezettség	-299 364 800	-4.51%	-8 000	0.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	6 631 295 075	100.00%	3 515 331 365	100.00%
Befektetési jegyek darabszáma	3 848 993 909		2 036 345 041	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték	1.7229		1.7263	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2016.06.30-án*	2 036 345 041
--	---------------

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2016.06.30-án (Ft) *	1.7263
---	--------

* 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	6.31%	9.75%	3.44%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	31.73%	30.68%	-1.05%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	27.41%	30.68%	3.26%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.24%	0.00%	-0.24%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	38.04%	40.43%	2.39%

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei. Az Alap összetételében a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok aránya növekedett, mely az államkötvények arányának emelkedéséből ered, mely meghaladta a jelzálog kötvények és diszkont kincstárjegyek arányának csökkenését. A félév végére csökkent a nyíltvégű alapok befektetési jegyeinek aránya is. A hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összetételének változását tükrözi a tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok és a más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok arányának változása.

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 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.

Erste Alapkezelő Zrt.
1138 Budapest, Népfürdő u. 24. 2/E

Budapest, 2016. augusztus 26.



Erste Alapkezelő Zrt.