

Az
ERSTE
STOCK HUNGARY INDEXKÖVETŐ RÉSZVÉNY
BEFEKTETÉSI ALAP

2023. féléves jelentése

1. Az Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve 2009. április 25-től Erste Dinamikus Alapok Alapjáról Erste Nyíltvégű Hazai Indexkövető Részvény Befektetési Alapra módosult, mely 2013. október 21-vel a PSZÁF H-KE-III-666/2013. számú határozata alapján **Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alapra** változott.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Stock Hungary Indexkövető 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 (2006. április 26-tól) határozatlan ideig terjed.

Az Alap által kibocsátott befektetési jegy sorozatok:

„A” sorozat - Befektetési jegy ISIN azonosítója: HU0000704200

devizaneme: forint

„D” sorozat - Befektetési jegy ISIN azonosítója: HU0000723457

devizaneme: forint

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: 2022.12.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2023.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	6 849 187 107	100.14%	6 449 169 459	100.48%
Banki egyenlegek	64 001 817	0.94%	102 791 877	1.60%
Pénzforgalmi számla egyenleg	64 001 817	0.94%	102 791 877	1.60%
Óvadékba adott pénzeszköz	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	6 734 425 290	98.46%	6 101 055 798	95.06%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1 619 200	0.02%	68 565 840	1.07%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	68 565 840	1.07%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	1 619 200	0.02%	0	0.00%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	0	0.00%	0	0.00%
Részvények	6 732 806 090	98.44%	5 874 472 038	91.53%
Hazai tőzsdei részvények	6 732 806 090	98.44%	5 874 472 038	91.53%
Hazai OTC részvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részvények	0	0.00%	0	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	0	0.00%	158 017 920	2.46%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	158 017 920	2.46%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	0	0.00%	-1 260 422	-0.02%
Futures ügyletek	0	0.00%	-2 312 000	-0.04%
Forward ügyletek	0	0.00%	1 051 578	0.02%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	50 760 000	0.74%	246 582 206	3.84%
Befektetési számla egyenleg	200 000	0.00%	200 000	0.00%
Értékpapír kölcsönadás	50 550 000	0.74%	189 850 000	2.96%
Egyéb követelések	10 000	0.00%	56 532 206	0.88%
KÖTELEZETTSÉGEK	-9 370 690	-0.14%	-30 795 748	-0.48%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-6 636 915	-0.10%	-6 349 364	-0.10%
Különadó	-785 895	-0.01%	-739 453	-0.01%
Alapkezelői díj	-821 857	-0.01%	-856 445	-0.01%
Forgalmazói díj	-3 744 013	-0.05%	-3 221 865	-0.05%
Letétkezelői díj	-461 577	-0.01%	-408 488	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-157 828	0.00%	-396 762	-0.01%
Felügyeleti díj	-554 648	-0.01%	-516 351	-0.01%
Könyvelési díj	-111 097	0.00%	-210 000	0.00%
Egyéb kötelezettség	-2 733 775	-0.04%	-24 446 384	-0.38%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	6 839 816 417	100.00%	6 418 373 711	100.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK "A" sorozat	6 811 236 178		6 390 391 913	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK "D" sorozat	28 580 239		27 981 798	

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei.

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Tárgyidőszak: 2023.01.01 - 2023.06.30	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023.06.30-án (db) "A" sorozat *	2 183 770 031
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023.06.30-án (db) "D" sorozat *	19 604 065

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték alapján

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft) "A" sorozat *	2.9263
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft) "D" sorozat *	1.4273

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2022.12.31	2023.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	98.25%	91.06%	-7.20%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.00%	1.06%	1.06%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.00%	1.06%	1.06%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.00%	2.45%	2.45%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00%	1.06%	1.06%

A fenti táblában a tárgyidőszak utolsó napi eszköz állományának értékét - a tárgyidőszak utolsó piaci árfolyam adatai alapján meghatározva – viszonyítjuk az összes eszköz adatához.

Az értékpapírokat a kategóriákban megjelenő tulajdonságok szerint közöljük, így az egyes kategóriák között átfedés lehetséges.

6. Az ABA nevében alkalmazható tőkeáttétellel kapcsolatos információk bemutatása

Az Alap nevében alkalmazható tőkeáttétel mértékében bekövetkező változások:

Az Alap - származtatott ügyletek figyelembevételével számított - teljes nettósított kockázati kitétsége nem haladhatja meg az Alap nettó eszközértékének a kétszeresét. A származtatott ügyletek figyelembevételével számított, a befektetési eszközökben meglévő nettó összesített kockázati kitétség 2022.12.30-án 103,85%, 2023.06.30-án 104,08% volt.

A biztosíték vagy a tőkeáttételi megállapodás értelmében nyújtott garanciák újbóli felhasználási joga:

Az Alap a kapott biztosítékokat nem használja fel. Az adott biztosítékokat a partner intézmény az egyedi szerződésekben meghatározott feltételek mellett használhatja fel.

Az Alap által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege:

2023.06.30-án nettó összesített kockázati kitétség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 4,08%-át teszi ki. Az Alap a fordulónapon készpénz vagy értékpapír kölcsönt nem vett igénybe.

7. Az Alternatív Befektetési Alap (ABA) illikvid eszközeinek, likviditás kezelésének és kockázatkezelésének bemutatása

a) Az ABA eszközei között a záró napon nem szerepeltek olyan eszközök, amelyekre nem likvid jellegüknel fogva különleges szabályok vonatkoztak volna.

b) Az ABA az adott időszakban likviditáskezelésével kapcsolatos új megállapodást nem kötött.

c) Az ABA kockázati profilja a múltbeli hozamok szórásán alapuló SRI mutató szerint 5-ös kockázat/nyereség profilú besorolást kapott. Az úgynevezett PRIIPs rendelet (EU 2017/653) új kockázati mutató számítását vezetett be (SRI), amely felváltja a korábbi (SRRI). Az SRI (summary risk indicator) egyetlen összesített kockázati mutatóként kívánja megjeleníteni a legjelentősebb kockázatokat: piaci kockázat, hitelkockázat és a likviditási kockázat. Az SRI 1-től 7-ig terjedő skálán vesz fel értékeket. Ez az Alap adott esetben nem megfelelő olyan befektetők számára, akik 6 éven belül ki akarják venni az Alapból a pénzüket.

Az Alapkezelő nyomon követi és méri az ABA-val kapcsolatban fennálló potenciális kockázatokat, úgy, mint piaci kockázat, partner kockázat és likviditási kockázat. Az Alapkezelő rendszeresen ellenőrzi az Alap likviditását, továbbá azt is, hogy a befektetési stratégia összhangban van-e a visszaváltási politikával. A portfólióba vásárolt eszközök kiválasztása során azok likviditási profilja is meghatározásra kerül, amit folyamatos felülvizsgálat követ, hogy az Alap befektetéseinek likviditási profilja megfeleljen az Alap kötelezettségeinek. Az Alapkezelő rendszeresen stressztesztet végez, mind rendes, mind rendkívüli likviditási feltételek mellett, amivel nyomon tudja követni alapjainak likviditási kockázatát.

Amennyiben a likviditást veszélyeztető rendkívüli helyzet áll elő, úgy a kockázatkezelés haladéktalanul döntési javaslatot terjeszt az Alapkezelő döntésre jogosult vezető tisztségviselői elé.

Budapest, 2023. augusztus 30.

Erste Alapkezelő Zrt.