

Az
ERSTE
STOCK HUNGARY INDEXKÖVETŐ RÉSZVÉNY
BEFEKTETÉSI ALAP

2024. 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: 2023.12.29 (HUF)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (HUF)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	9 901 769 792	100.15%	11 478 026 759	100.15%
Banki egyenlegek	1 438 053	0.01%	25 874 196	0.23%
Pénzforgalmi számla egyenleg	1 438 053	0.01%	25 874 196	0.23%
Óvadék összege	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	9 897 395 559	100.10%	11 311 192 339	98.70%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	48 958 750	0.50%	48 952 100	0.43%
Diszkontkincstárjegyek	48 958 750	0.50%	48 952 100	0.43%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	0	0.00%	0	0.00%
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	9 756 373 680	98.68%	10 828 548 764	94.49%
Hazai tőzsdei részvények	9 756 373 680	98.68%	10 828 548 764	94.49%
Hazai OTC részvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részvények	0	0.00%	0	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	92 063 129	0.93%	433 691 475	3.78%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	92 063 129	0.93%	433 691 475	3.78%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	-580 057	-0.01%	2 066 967	0.02%
Futures ügyletek	0	0.00%	6 502 500	0.06%
Forward ügyletek	-580 057	-0.01%	-4 435 533	-0.04%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	3 516 237	0.04%	138 893 257	1.21%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	200 000	0.00%
Egyéb követelések	3 516 237	0.04%	138 693 257	1.21%
KÖTELEZETTSÉGEK	-14 599 242	-0.15%	-17 543 231	-0.15%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-9 513 766	-0.10%	-10 232 763	-0.09%
Alapkezelői díj	-1 280 387	-0.01%	-1 606 777	-0.01%
Forgalmazói díj	-4 816 695	-0.05%	-5 088 126	-0.04%
Letétkezelői díj	-609 848	-0.01%	-668 218	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-795 716	-0.01%	-603 729	-0.01%
Felügyeleti díj	-779 108	-0.01%	-865 136	-0.01%
Különadó	-1 024 270	-0.01%	-1 193 110	-0.01%
Könyvelési díj	-207 742	0.00%	-207 667	0.00%
Egyéb kötelezettség	-5 085 476	-0.05%	-7 310 468	-0.06%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	9 887 170 550	100.00%	11 460 483 528	100.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap A sorozat	9 861 993 668		11 430 919 570	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap D sorozat	25 176 882		29 563 958	

A táblázatban szereplő információk az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján kerültek meghatározásra.

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei.

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Tárgyidőszak: 2024.01.01 - 2024.06.30	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2024.06.28án (db) Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap A sorozat*	2 724 599 132
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2024.06.28án (db) Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap D sorozat*	14 334 302

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (HUF) Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap A sorozat*	4.1955
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (HUF) Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap D sorozat*	2.0625

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2023.12.31	2024.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	98.53%	94.34%	-4.19%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.49%	0.43%	-0.07%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.49%	0.43%	-0.07%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.93%	3.78%	2.85%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.49%	0.43%	-0.07%

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 2023.12.29-én 100,10%, 2024.06.28-án 104,72% volt.

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

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

Az Alap által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege:

2024.06.28-án nettó összesített kockázati kitétség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 4,72%-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 jellegüknél 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, 2024. augusztus 22.

Erste Alapkezelő Zrt.