

Az
ERSTE
STOCK HUNGARY INDEXKÖVETŐ BEFEKTETÉSI ALAP

2026. féléves jelentése

1. Az Erste Stock Hungary Indexkövető 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. 2025. január 6. napjától az Alap új neve **Erste Stock Hungary Indexkövető Befektetési Alap**.

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.

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 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: 2025.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2026.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	30 746 614 320	100.22%	43 544 255 268	100.51%
Banki egyenlegek	8 790	0.00%	530 973 063	1.23%
Pénzforgalmi számla egyenleg	8 790	0.00%	50 973 063	0.12%
Óvadék összege	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	480 000 000	1.11%
Átruházható értékpapírok	30 674 961 979	99.98%	42 621 482 917	98.38%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	1 999 338 000	4.61%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	0	0.00%	1 999 338 000	4.61%
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%
Részesvények	28 386 133 250	92.52%	40 622 144 917	93.76%
Hazai tőzsdei részesvények	28 386 133 250	92.52%	40 622 144 917	93.76%
Hazai OTC részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	2 288 828 729	7.46%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	2 288 828 729	7.46%	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	43 516 174	0.14%	708 759	0.00%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	43 516 174	0.14%	708 759	0.00%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	28 127 377	0.09%	391 090 529	0.90%
Befektetési számla egyenleg	200 000	0.00%	200 000	0.00%
Egyéb követelések	27 927 377	0.09%	390 890 529	0.90%
KÖTELEZETTSÉGEK	-66 245 105	-0.22%	-219 170 014	-0.51%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-29 050 580	-0.09%	-43 558 322	-0.10%
Alapkezelői díj	-5 499 080	-0.02%	-8 208 614	-0.02%
Forgalmazói díj	-14 867 883	-0.05%	-19 153 432	-0.04%
Letétkezelői díj	-2 040 847	-0.01%	-2 732 760	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-386 688	0.00%	-767 020	0.00%
Felügyeleti díj	-2 565 108	-0.01%	-6 423 924	-0.01%
Különadó	-3 538 574	-0.01%	-4 850 963	-0.01%
Könyvelési díj	-152 400	0.00%	-304 800	0.00%
Research díj	0	0.00%	-1 116 809	0.00%
Egyéb kötelezettség	-37 194 525	-0.12%	-175 611 692	-0.41%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	30 680 369 215	100.00%	43 325 085 254	100.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap A sorozat	30 612 191 766		43 240 841 098	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste Stock Hungary Indexkövető Részvény Befektetési Alap D sorozat	68 177 449		84 244 156	

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: 2026.01.01 - 2026.06.30	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2026.06.30-án (db) Erste Stock Hungary Indexkövető Befektetési Alap A sorozat*	5 280 228 498
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2026.06.30-án (db) Erste Stock Hungary Indexkövető Befektetési Alap D sorozat*	20 599 705

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2026.06.30-án (HUF) Erste Stock Hungary Indexkövető Befektetési Alap A sorozat*	8.189200
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2026.06.30-án (HUF) Erste Stock Hungary Indexkövető Befektetési Alap D sorozat*	4.089600

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2025.12.31	2026.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	92.32%	93.29%	0.97%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.00%	4.59%	4.59%
Egyéb átruházható értékpapírok	7.44%	4.59%	-2.85%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00%	4.59%	4.59%

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 kitettsége nem haladhatja meg az Alap nettó eszközértékének a kétszeresét. A származtatott ügyletek figyelembevételével számított, a befektetési eszközökben meglévő nettó összesített kockázati kitettség 2025.12.31-én 99,98%, 2026.06.30-án 100,10% 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:

2026.06.30-án nettó összesített kockázati kitettség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,10%-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 4-es kockázat/nyereség profilú besorolást kapott. Az úgynevezett PRIIPs rendelet (EU 2017/653) új kockázati mutató számítást 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, 2026. augusztus 27.

Erste Alapkezelő Zrt.