

Az
ERSTE
NYÍLTVÉGŰ DOLLÁR BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP

2023. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Dollár Bázis Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Nyíltvégű Dollár Pénzpiaci Befektetési Alapról a MNB H-KE-III-568/2018. számú határozata alapján 2019. január 14-ei hatállyal **Erste Nyíltvégű Dollár Bázis Befektetési Alap**ra módosult.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Dollár Bázis 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 (2007. november 09-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 T-1 napon készül Tárgynap – 1 napi eszközállomány
Eszközérték számításakor elérhető legfrissebb piaci árfolyam adatok
Tárgynap – 2 napi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

2. Vagyonkimutatás, a befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele

| Megnevezés | Záró eszközérték Tárgynap: 2022.12.30 (USD) | Az eszközök teljes portf. arányában (%) | Záró eszközérték Tárgynap: 2023.06.30 (USD) | Az eszközök teljes portf. arányában (%) |
|--|---|--|---|--|
| ÖSSZES ESZKÖZ | 103 744 843.98 | 101.10% | 147 217 994.15 | 104.94% |
| Banki egyenlegek | 33 909 280.12 | 33.04% | 24 601 554.30 | 17.54% |
| Pénzforgalmi számla egyenleg | 2 849 781.90 | 2.78% | 22 800 954.30 | 16.25% |
| Óvadékba adott pénzeszköz | 1 035 776.00 | 0.00% | 1 800 600.00 | 1.28% |
| Lekötött bankbetét | 30 023 722.22 | 29.26% | 0.00 | 0.00% |
| Átruházható értékpapírok | 70 677 779.04 | 68.87% | 120 049 206.53 | 85.58% |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 70 677 779.04 | 68.87% | 120 049 206.53 | 85.58% |
| Diszkontkincstárjegyek | 23 189 335.48 | 22.60% | 47 191 297.50 | 33.64% |
| MNB kötvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Államkötvények | 34 046 971.50 | 33.17% | 45 430 591.00 | 32.38% |
| Állami garanciával rendelkező kötvények | 13 441 472.06 | 13.10% | 27 427 318.03 | 19.55% |
| Egyéb kötvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Jelzáloglevelek | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Résztvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Hazai tőzsdei részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Hazai OTC részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Külföldi részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Kollektív befektetési értékpapírok | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Zártvégű alap befektetési jegye | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Származtatott ügyletek | -1 877 991.18 | -1.83% | -1 717 043.07 | -1.22% |
| Futures ügyletek | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Forward ügyletek | -1 877 991.18 | -1.83% | -1 717 043.07 | -1.22% |
| Opciók | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Egyéb származtatott ügyletek | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Egyéb eszközök | 1 035 776.00 | 1.01% | 4 284 276.39 | 3.05% |
| Befektetési számla egyenleg | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Egyéb követelések | 1 035 776.00 | 1.01% | 4 284 276.39 | 3.05% |
| KÖTELEZETTSÉGEK | -1 124 231.20 | -1.10% | -6 934 624.07 | -4.94% |
| Hitelállomány | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Költségek | -88 455.20 | -0.09% | -106 823.16 | -0.08% |
| Alapkezelői díj | -11 119.59 | -0.01% | -15 261.82 | -0.01% |
| Forgalmazói díj | -50 655.90 | -0.05% | -57 413.53 | -0.04% |
| Letétkezelői díj | -6 589.39 | -0.01% | -7 752.04 | -0.01% |
| Könyvvizsgálói díj | -548.83 | 0.00% | -1 386.89 | 0.00% |
| Felügyeleti díj | -7 963.59 | -0.01% | -10 027.12 | -0.01% |
| Különadó | -11 283.81 | -0.01% | -14 363.80 | -0.01% |
| Könyvelési díj | -294.09 | 0.00% | -617.96 | 0.00% |
| Egyéb kötelezettség | -1 035 776.00 | -1.01% | -6 827 800.91 | -4.87% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK | 102 620 612.78 | 100.00% | 140 283 370.08 | 100.00% |

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) * | 117 200 471 |

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

| | |
|--|--------|
| Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (USD) * | 1.1970 |
|--|--------|

* 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 | 45.39% | 45.99% | 0.59% |
| Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok | 22.21% | 31.94% | 9.73% |
| A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok | 32.53% | 44.91% | 12.38% |
| Egyéb átruházható értékpapírok | 0.00% | 0.00% | 0.00% |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 67.60% | 77.92% | 10.32% |

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 2022.12.30-án 101,92%, 2023.06.30-án 101,57% 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:

2023.06.30-án nettó összesített kockázati kitettség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 1,57%-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 jellegűknél 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 1-es 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 hónapon 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.