

Az
ERSTE
NYÍLTVÉGŰ DOLLÁR BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP

2026. 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.

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 T-1 napon készül Tárgynap – 1 napi eszközállomány

Eszközérték számításakor elérhető legfrissebb piaci árfolyam adatok

Tárgynap – 2 napi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

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

Megnevezés	Záró eszközérték Tárgynap: 2025.12.31 (USD)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2026.06.30 (USD)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	279 189 963	100.09%	259 247 152	100.71%
Banki egyenlegek	12 797	0.00%	2 048 128	0.80%
Pénzforgalmi számla egyenleg	12 797	0.00%	475 159	0.18%
Óvadék összege	0	0.00%	1 572 969	0.61%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	280 217 242	100.46%	255 190 342	99.14%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	209 816 124	75.22%	188 757 539	73.33%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	2 737 558	0.98%	6 430 811	2.50%
Államkötvények	26 778 697	9.60%	19 803 407	7.69%
Állami garanciával rendelkező kötvények	53 235 844	19.09%	46 561 697	18.09%
Hitelintézeti kötvények	12 749 298	4.57%	9 000 658	3.50%
Vállalati kötvények	10 496 103	3.76%	12 862 017	5.00%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi kötvények	103 818 625	37.22%	94 098 950	36.56%
Részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai tőzsdei részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai OTC részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részesvények	0	0.00%	0	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	70 401 118	25.24%	66 432 803	25.81%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	70 401 118	25.24%	66 432 803	25.81%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	-1 681 459	-0.60%	2 008 426	0.78%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-1 681 459	-0.60%	2 008 426	0.78%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	641 383	0.23%	256	0.00%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	641 383	0.23%	256	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-254 347	-0.09%	-1 831 381	-0.71%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-254 058	-0.09%	-256 077	-0.10%
Alapkezelői díj	-47 216	-0.02%	-47 676	-0.02%
Forgalmazói díj	-127 657	-0.05%	-111 244	-0.04%
Letétkezelői díj	-18 653	-0.01%	-16 951	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-2 121	0.00%	-3 573	0.00%
Felügyeleti díj	-24 170	-0.01%	-44 451	-0.02%
Különadó	-33 777	-0.01%	-30 896	-0.01%
Könyvelési díj	-464	0.00%	-980	0.00%
Research díj	0	0.00%	-306	0.00%
Egyéb kötelezettség	-288	0.00%	-1 575 304	-0.61%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	278 935 616	100.00%	257 415 771	100.00%

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)*	190 775 325

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2026.06.30-án (USD)*	1.349300
---	----------

* 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	77.95%	74.13%	-3.82%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	38.70%	36.78%	-1.92%
Egyéb átruházható értékpapírok	22.18%	24.29%	2.11%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	75.01%	72.68%	-2.33%

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 100,69%, 2026.06.30-án 99,32% 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 az Alapban nem volt tőkeáttétel. 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 számítást vezetett be (SRI), amely felváltja a korábbi SRRI-t. 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, 2026. augusztus 27.

Erste Alapkezelő Zrt.