

*Az*

**ERSTE**

**NYÍLTVÉGŰ EURO BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP**

*2023. féléves jelentése*

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

### Az Alap neve

Az Alap neve Erste Nyíltvégű Euro Pénzpiaci Befektetési Alapról a MNB H-KE-III-528/2018. számú határozata alapján 2019. január 14-ei hatállyal **Erste Nyíltvégű Euro Bázis Befektetési Alap**ra módosult.

### Az Alap rövidített elnevezése

Erste Euro 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.  
Céggjegyzékszám: 01-10-044157

### Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.  
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.  
Céggjegyzékszám: 01-10-041054

### Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.  
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.  
Céggjegyzékszám: 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 (EUR)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2023.06.30 (EUR)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>190 808 282.77</b>	<b>101.00%</b>	<b>632 645 317.65</b>	<b>122.23%</b>
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>86 384 549.13</b>	<b>45.73%</b>	<b>190 897 149.08</b>	<b>36.88%</b>
Pénzforgalmi számla egyenleg	3 563 882.46	1.89%	165 600 399.08	31.99%
Óvadékba adott pénzeszköz	1 300 000.00	0.00%	5 280 000.00	1.02%
Lekötött bankbetét	81 520 666.67	43.15%	20 016 750.00	3.87%
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>103 283 803.83</b>	<b>54.67%</b>	<b>354 490 216.04</b>	<b>68.49%</b>
<b>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>103 283 803.83</b>	<b>54.67%</b>	<b>354 490 216.04</b>	<b>68.49%</b>
Diszkontkincstárjegyek	40 324 165.24	21.35%	252 341 718.00	48.75%
MNB kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Államkötvények	5 184 705.00	2.74%	10 922 236.25	2.11%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0.00	0.00%	69 245 849.86	13.38%
Egyéb kötvények	57 774 933.59	30.58%	21 980 411.93	4.25%
Jelzáloglevelek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
<b>Résztvények</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>
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%
<b>Kollektív befektetési értékpapírok</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>
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%
<b>Származtatott ügyletek</b>	<b>-690 070.19</b>	<b>-0.37%</b>	<b>-5 655 910.71</b>	<b>-1.09%</b>
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	-690 070.19	-0.37%	-5 655 910.71	-1.09%
Opciók	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>1 830 000.00</b>	<b>0.97%</b>	<b>92 913 863.24</b>	<b>17.95%</b>
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	87 633 863.24	16.93%
Egyéb követelések	1 830 000.00	0.97%	5 280 000.00	1.02%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-1 896 143.26</b>	<b>-1.00%</b>	<b>-115 038 195.37</b>	<b>-22.23%</b>
<b>Hitelállomány</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>
<b>Költségek</b>	<b>-66 141.01</b>	<b>-0.04%</b>	<b>-261 827.68</b>	<b>-0.05%</b>
Alapkezelői díj	-4 674.72	0.00%	-34 215.80	-0.01%
Forgalmazói díj	-21 295.93	-0.01%	-128 716.59	-0.02%
Letétkezelői díj	-10 388.26	-0.01%	-26 069.18	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-579.19	0.00%	-1 378.62	0.00%
Felügyeleti díj	-11 968.48	-0.01%	-29 139.34	-0.01%
Különadó	-16 958.44	-0.01%	-41 741.99	-0.01%
Könyvelési díj	-275.99	0.00%	-566.16	0.00%
<b>Egyéb kötelezettség</b>	<b>-1 830 002.25</b>	<b>-0.97%</b>	<b>-114 776 367.69</b>	<b>-22.17%</b>
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>188 912 139.51</b>	<b>100.00%</b>	<b>517 607 122.28</b>	<b>100.00%</b>

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) *	466 006 647

\* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

### 4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (EUR) *	1.1107
--	--------

\* 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	45.18%	36.38%	-8.81%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	9.49%	29.87%	20.38%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	36.77%	60.03%	23.26%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.00%	12.53%	12.53%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	54.68%	66.25%	11.57%

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 100,77%, 2023.06.30-án 101,26% 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 kitettség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 1,26%-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.