

Az

ERSTE

NYÍLTVÉGŰ EURO BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP

2024. 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 Alapra** 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.
Céjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

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

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.
Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.
Céjegyzékszám: 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: 2023.12.29 (EUR)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (EUR)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	780 863 465.10	100.24%	766 519 067.54	100.23%
Banki egyenlegek	17 569 540.88	2.26%	22 786 858.87	2.98%
Pénzforgalmi számla egyenleg	7 687.32	0.00%	2 811.16	0.00%
Óvadék összege	0.00	0.00%	680 000.00	0.09%
Lekötött bankbetét	17 561 853.56	2.25%	22 104 047.71	2.89%
Átruházható értékpapírok	763 211 123.57	97.98%	743 018 044.90	97.16%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	577 607 898.55	74.15%	480 775 719.26	62.87%
Diszkontkincstárjegyek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
MNB kötvények	0.00	0.00%	44 075 195.93	5.76%
Államkötvények	37 611 666.51	4.83%	6 400 273.02	0.84%
Állami garanciával rendelkező kötvények	91 825 133.34	11.79%	71 542 537.25	9.35%
Hitelintézeti kötvények	44 462 569.20	5.71%	38 896 238.56	5.09%
Vállalati kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Jelzáloglevelek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Külföldi kötvények	403 708 529.50	51.83%	319 861 474.50	41.83%
Részvények	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	185 603 225.02	23.83%	262 242 325.64	34.29%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	185 603 225.02	23.83%	262 242 325.64	34.29%
Zártvégű alap befektetési jegye	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Származtatott ügyletek	-997 199.35	-0.13%	714 163.77	0.09%
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	-997 199.35	-0.13%	714 163.77	0.09%
Opciók	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb eszközök	1 080 000.00	0.14%	0.00	0.00%
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb követelések	1 080 000.00	0.14%	0.00	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-1 896 763.32	-0.24%	-1 758 083.98	-0.23%
Hitelállomány	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Költségek	-678 296.77	-0.09%	-685 362.32	-0.09%
Alapkezelői díj	-97 873.14	-0.01%	-111 344.21	-0.01%
Forgalmazói díj	-368 189.43	-0.05%	-352 589.99	-0.05%
Letétkezelői díj	-49 713.34	-0.01%	-49 486.31	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-2 764.87	0.00%	-4 170.49	0.00%
Felügyeleti díj	-65 646.20	-0.01%	-68 644.83	-0.01%
Különadó	-93 015.77	-0.01%	-98 602.86	-0.01%
Könyvelési díj	-1 094.02	0.00%	-523.63	0.00%
Egyéb kötelezettség	-1 218 466.55	-0.16%	-1 072 721.66	-0.14%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	778 966 701.78	100.00%	764 760 983.56	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: 2024.01.01 - 2024.06.30	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2024.06.28án (db)*	667 059 394

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (EUR)*	1.1465
--	--------

* 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	72.10%	66.41%	-5.70%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	13.92%	6.60%	-7.32%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	59.49%	48.81%	-10.69%
Egyéb átruházható értékpapírok	14.01%	23.75%	9.74%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	75.79%	62.60%	-13.19%

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 kitétségek 2023.12.29-én 100,37%, 2024.06.28-án 100,05% 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 kitétségek alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,05%-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 befektetései 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.