

Az
ERSTE
NYÍLTVÉGŰ DOLLÁR DUETT ALAPOK ALAPJA

2023. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Dollár Duett Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Nyíltvégű Dollár Ingatlan Befektetési Alapok Alapjáról a MNB H-KE-III-330/2019. számú határozata alapján 2019. május 28-ai hatállyal **Erste Nyíltvégű Dollár Duett Alapok Alapjára** módosult.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Dollár Duett Alapok Alapja

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 (2016. augusztus 15-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 Tárgy +1 napon készül Tárgynapi eszközállomány

Eszközérték számításakor elérhető legfrissebb piaci árfolyam adatok

Tárgynapi 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	214 238 156.61	101.83%	212 061 478.43	100.79%
Banki egyenlegek	3 233 270.77	1.54%	2 536 393.33	1.21%
Pénzforgalmi számla egyenleg	3 233 270.77	1.54%	1 208 007.33	0.57%
Óvadékba adott pénzeszköz	0.00	0.00%	1 328 386.00	0.63%
Lekötött bankbetét	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Átruházható értékpapírok	206 224 636.72	98.02%	208 363 416.31	99.03%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	34 428 600.21	16.36%	1 144 289.43	0.54%
Diszkontkincstárjegyek	6 997 753.00	3.33%	1 144 289.43	0.54%
MNB kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Államkötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb kötvények	27 430 847.21	13.04%	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	171 796 036.51	81.65%	207 219 126.88	98.49%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	171 796 036.51	81.65%	207 219 126.88	98.49%
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	1 175 154.86	0.56%	-314 424.79	-0.15%
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	1 175 154.86	0.56%	-314 424.79	-0.15%
Opciók	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb eszközök	3 605 094.26	1.71%	1 476 093.58	0.70%
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb követelések	3 605 094.26	1.71%	1 476 093.58	0.70%
KÖTELEZETTSÉGEK	-3 842 006.06	-1.83%	-1 662 952.47	-0.79%
Hitelállomány	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Költségek	-123 827.43	-0.06%	-125 613.90	-0.06%
Különadó	-5 280.90	0.00%	-5 190.98	0.00%
Alapkezelői díj	-15 468.50	-0.01%	-18 101.20	-0.01%
Forgalmazói díj	-70 467.63	-0.03%	-68 095.00	-0.03%
Letétkezelői díj	-13 749.78	-0.01%	-13 791.39	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-711.29	0.00%	-1 794.80	0.00%
Felügyeleti díj	-18 002.67	-0.01%	-18 027.21	-0.01%
Könyvelési díj	-146.66	0.00%	-613.32	0.00%
Egyéb kötelezettség	-3 718 178.63	-1.77%	-1 537 338.57	-0.73%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	210 396 150.55	100.00%	210 398 525.96	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) *	170 647 540

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (USD) *	1.2329
--	--------

* 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	13.02%	0.00%	-13.02%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	3.32%	0.54%	-2.78%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	3.32%	0.54%	-2.78%
Egyéb átruházható értékpapírok	81.55%	98.33%	16.78%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	16.34%	0.54%	-15.80%

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 99,55%, 2023.06.30-án 101,27% 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 1,27%-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 1 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, 2023. augusztus 30.

Erste Alapkezelő Zrt.