

Az
ERSTE
NYÍLTVÉGŰ DOLLÁR DUETT ALAPOK ALAPJA

2024. 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.

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 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: 2023.12.29 (USD)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (USD)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	207 661 644.65	100.25%	205 904 250.87	102.17%
Banki egyenlegek	38 079.48	0.02%	4 337 145.01	2.15%
Pénzforgalmi számla egyenleg	38 079.48	0.02%	3 947 193.00	1.96%
Óvadék összege	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Lekötött bankbetét	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Átruházható értékpapírok	206 176 335.92	99.53%	197 576 622.57	98.04%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	229 689.54	0.11%	13 824 673.80	6.86%
Diszkontkincstárjegyek	229 689.54	0.11%	5 901 009.80	2.93%
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%
Hitelintézeti kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
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	0.00	0.00%	7 923 664.00	3.93%
Részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Hazai tőzsdei részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Hazai OTC részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Külföldi részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	205 946 646.38	99.42%	183 751 948.77	91.18%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	205 946 646.38	99.42%	183 751 948.77	91.18%
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	-3 272 127.29	-1.58%	3 979 332.15	1.97%
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	-3 272 127.29	-1.58%	3 979 332.15	1.97%
Opciók	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb eszközök	4 719 356.54	2.28%	11 151.14	0.01%
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb követelések	4 719 356.54	2.28%	11 151.14	0.01%
KÖTELEZETTSÉGEK	-508 313.39	-0.25%	-4 376 212.75	-2.17%
Hitelállomány	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Költségek	-118 262.43	-0.06%	-111 523.89	-0.06%
Alapkezelői díj	-17 287.15	-0.01%	-18 647.82	-0.01%
Forgalmazói díj	-65 032.60	-0.03%	-59 051.44	-0.03%
Letétkezelői díj	-13 171.16	-0.01%	-12 431.88	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-3 599.52	0.00%	-3 111.15	0.00%
Felügyeleti díj	-17 787.26	-0.01%	-17 176.73	-0.01%
Különadó	-178.93	0.00%	-542.70	0.00%
Könyvelési díj	-1 205.81	0.00%	-562.17	0.00%
Egyéb kötelezettség	-390 050.96	-0.19%	-4 264 688.86	-2.12%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	207 153 331.26	100.00%	201 528 038.12	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)*	156 339 335

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (USD)*	1.2890
--	--------

* 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	0.00%	0.00%	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.11%	6.71%	6.60%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.11%	6.71%	6.60%
Egyéb átruházható értékpapírok	99.18%	89.24%	-9.94%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.11%	6.71%	6.60%

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 kitétség 2023.12.29-én 101,86%, 2024.06.28-án 98,08% 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 kitétség 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 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 5 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, 2024. augusztus 22.

Erste Alapkezelő Zrt.