

Az
ERSTE
MULTI ASSET DIVERSIFIED ALAPOK ALAPJA

2024. féléves jelentése

1. Az Erste Multi Asset Diversified Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Multi Asset Diversified Alapok Alapja

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Multi Asset Diversified 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 (2019. június 20-tól) határozatlan ideig terjed.

Alapkezelő

Erste Alapkezelő Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Céjjegyzékszám: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Céjjegyzékszám: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Céjjegyzékszám: 01-10-041373

Nettó eszközérték számítás típusa

Tárgynapi eszközérték Tárgy +1 napon készül

Tárgynapi eszközállomány

T napi 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 (HUF)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (HUF)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	12 204 668 693	100.33%	21 888 906 543	100.42%
Banki egyenlegek	19 739 244	0.16%	890 501 767	4.09%
Pénzforgalmi számla egyenleg	19 739 244	0.16%	672 602 767	3.09%
Óvadék összege	0	0.00%	217 899 000	1.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	12 064 535 804	99.18%	21 065 511 482	96.64%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	34 271 125	0.28%	529 680 100	2.43%
Diszkontkincstárjegyek	34 271 125	0.28%	529 680 100	2.43%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	0	0.00%	0	0.00%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Hitelintézeti kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Vállalati kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi kötvények	0	0.00%	0	0.00%
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	12 030 264 679	98.89%	20 535 831 382	94.21%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	2 819 323 070	23.18%	5 496 600 747	25.22%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	9 210 941 609	75.72%	15 039 230 635	69.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	111 206 732	0.91%	-144 343 372	-0.66%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	111 206 732	0.91%	-144 343 372	-0.66%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	9 186 913	0.08%	77 236 666	0.35%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	395	0.00%
Egyéb követelések	9 186 913	0.08%	77 236 271	0.35%
KÖTELEZETTSÉGEK	-39 872 909	-0.33%	-91 565 665	-0.42%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-13 435 282	-0.11%	-20 723 284	-0.10%
Alapkezelői díj	-1 986 835	-0.02%	-3 727 648	-0.02%
Forgalmazói díj	-7 474 286	-0.06%	-11 804 218	-0.05%
Letétkezelői díj	-756 890	-0.01%	-1 242 549	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-928 335	-0.01%	-704 350	0.00%
Felügyeleti díj	-991 846	-0.01%	-1 498 566	-0.01%
Különadó	-1 089 348	-0.01%	-1 538 286	-0.01%
Könyvelési díj	-207 742	0.00%	-207 667	0.00%
Egyéb kötelezettség	-26 437 627	-0.22%	-70 842 381	-0.33%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	12 164 795 784	100.00%	21 797 340 878	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)*	15 376 781 393

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (HUF)*	1.4175
--	--------

* 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	9.38%	9.27%	-0.11%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.28%	2.42%	2.14%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.28%	4.26%	3.98%
Egyéb átruházható értékpapírok	89.17%	84.54%	-4.64%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.28%	2.42%	2.14%

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 2023.12.29-én 99,20%, 2024.06.28-án 100,76% 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:

2024.06.28-án nettó összesített kockázati kitettség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,76%-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 3-as 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.