



Az
ERSTE ARANY ALAPOK ALAPJA

2021. féléves jelentése

1. Az Erste Arany Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve a MNB H-KE-III-144/2020. számú határozatával 2020. április 03-tól Erste DPM Arany Alapok Alapjáról **Erste Arany Alapok Alapjára** módosult.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Arany 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 (2020. január 21.) határozatlan ideig terjed.

Az Alap által kibocsátott befektetési jegy sorozatok:

- „HUF” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000723572
- „DPM EUR” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000723580
- „DPM USD” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000723598
- „DPM HUF” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000725528

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
Tárgynapi árfolyam adatok
Tárgynapi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

2. Vagyonkimutatás, a befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele

Megnevezés	Záró eszközérték Tárgnap: 2020.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgnap: 2021.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	2 224 289 834.00	100.20%	2 401 030 948.00	100.34%
Banki egyenlegek	20 192 846.00	0.91%	30 089 829.00	1.26%
Pénzforgalmi számla egyenleg	20 192 846.00	0.91%	30 089 829.00	1.26%
Lekötött bankbetét	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Átruházható értékpapírok	2 203 972 491.00	99.28%	2 326 264 232.00	97.21%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Diszkontkincstárjegyek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
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%	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	2 203 972 491.00	99.28%	2 326 264 232.00	97.21%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	2 203 972 491.00	99.28%	2 326 264 232.00	97.21%
Zártvégű alap befektetési jegye	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Opciók	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb eszközök	124 497.00	0.01%	44 676 887.00	1.87%
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	44 565 130.00	1.86%
Egyéb követelések	124 497.00	0.01%	111 757.00	0.01%
KÖTELEZETTSÉGEK	-4 371 390.00	-0.20%	-8 075 544.00	-0.34%
Hitelállomány	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Költségek	-2 549 059.00	-0.11%	-2 541 671.00	-0.11%
Különadó	-245 350.00	-0.01%	-294 233.00	-0.01%
Alapkezelői díj	-202 940.00	-0.01%	-212 995.00	-0.01%
Forgalmazói díj	-1 149 992.00	-0.05%	-1 206 971.00	-0.05%
Letétkezelői díj	-143 094.00	-0.01%	-157 183.00	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-635 000.00	-0.03%	-314 890.00	-0.01%
Felügyeleti díj	-172 683.00	-0.01%	-205 399.00	-0.01%
Könyvelési díj	0.00	0.00%	-150 000.00	-0.01%
Egyéb kötelezettség	-1 822 331.00	-0.08%	-5 533 873.00	-0.23%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	2 219 918 444.00	100.00%	2 392 955 404.00	100.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF sorozat	2 088 691 981		2 136 441 927.00	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK DPM EUR sorozat	33 047 570		106 369 161.00	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK DPM USD sorozat	61 245 524		107 246 613.00	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK DPM HUF sorozat	36 933 369		42 897 703.00	

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Tárgyidőszak: 2021.01.01 - 2021.06.30	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2021.06.30-án (db) "HUF" sorozat*	2 023 521 214
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2021.06.30-án (db) "DPM EUR" sorozat*	319 235
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2021.06.30-án (db) "DPM USD" sorozat*	363 744
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2021.06.30-án (db) "DPM HUF" sorozat*	45 911 613

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2021.06.30-án (HUF) "HUF" sorozat*	1.0558
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2021.06.30-án (EUR) "DPM EUR" sorozat*	0.9469
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2021.06.30-án (USD) "DPM USD" sorozat*	0.9959
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2021.06.30-án (HUF) "DPM HUF" sorozat*	0.9344

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

5. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	Kategóriák aránya az összes eszközre vetítve		
	2020.12.31	2021.06.30	Változás
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	99.09%	96.89%	-2.20%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%

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.

Az Alapnak nincsenek elkülönített eszközei.

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 2020.12.31-én 100,19%, 2021.06.30-án 100,11% 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:

2021.06.30-án nettó összesített kockázati kitétség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,11%-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 jellegüknel 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 SRRI mutató szerint 5-ös kockázat/nyereség profilú besorolást kapott az iShares Gold Trust ETF 5 évre visszatekintő heti hozamainak szóródása alapján. 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 stresszteszteket 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, 2021. augusztus 31.

Erste Alapkezelő Zrt.