

Az
ERSTE ARANY ALAPOK ALAPJA

2023. 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 Tárgynap: 2022.12.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2023.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	4 530 291 280.00	100.11%	3 259 450 743.00	100.25%
Banki egyenlegek	130 324 270.00	2.88%	14 221 359.00	0.44%
Pénzforgalmi számla egyenleg	130 324 270.00	2.88%	14 221 359.00	0.44%
Óvadékba adott pénzeszköz	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Lekötött bankbetét	4 387 294 653.00	96.95%	0.00	0.00%
Átruházható értékpapírok	0.00	0.00%	3 218 575 908.00	98.99%
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%
Egyéb kötvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Jelzáloglevelek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Részcények	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	4 387 294 653.00	96.95%	0.00	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	0.00	0.00%	3 218 575 908.00	98.99%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	4 387 294 653.00	96.95%	0.00	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0.00	0.00%	3 218 575 908.00	98.99%
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	12 672 357.00	0.28%	0.00	0.00%
Egyéb eszközök	0.00	0.00%	26 653 476.00	0.82%
Befektetési számla egyenleg	12 672 357.00	0.28%	26 041 434.00	0.80%
Egyéb követelések	-5 112 710.00	-0.11%	612 042.00	0.02%
KÖTELEZETTSÉGEK	0.00	0.00%	-8 193 843.00	-0.25%
Hitelállomány	-3 818 664.00	-0.08%	0.00	0.00%
Költségek	-508 176.00	-0.01%	-3 416 143.00	-0.11%
Különadó	-635 568.00	-0.01%	-417 420.00	-0.01%
Alapkezelői díj	-1 739 374.00	-0.04%	-494 549.00	-0.02%
Forgalmazói díj	-284 280.00	-0.01%	-1 455 580.00	-0.04%
Letétkezelői díj	-131 522.00	0.00%	-216 566.00	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-358 647.00	-0.01%	-330 635.00	-0.01%
Felügyeleti díj	0.00	0.00%	-291 393.00	-0.01%
Könyvelési díj	-161 097.00	0.00%	-210 000.00	-0.01%
Egyéb kötelezettség	-1 294 046.00	-0.03%	-4 777 700.00	-0.15%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	4 525 178 570	100.00%	3 251 256 900.00	100.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF sorozat	3 215 391 335		2 751 123 763.00	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK DPM EUR sorozat	568 126 429		236 020 867.00	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK DPM USD sorozat	689 118 879		213 068 722.00	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK DPM HUF sorozat	52 541 926		51 043 548.00	

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) "HUF" sorozat*	2 135 699 865
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023.06.30-án (db) "DPM EUR" sorozat*	574 439
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023.06.30-án (db) "DPM USD" sorozat*	586 054
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023.06.30-án (db) "DPM HUF" sorozat*	44 076 672

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (HUF) "HUF" sorozat*	1.2882
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (EUR) "DPM EUR" sorozat*	1.1071
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (USD) "DPM USD" sorozat*	1.0618
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (HUF) "DPM HUF" sorozat*	1.1581

* 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	96.84%	98.76%	1.92%
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	0.00%	0.00%	0.00%
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.

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 100,08%, 2023.06.30-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:

2023.06.30-án nettó összesített kockázati kitettség 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 SRI mutató szerint 4-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, 2023. augusztus 30.

Erste Alapkezelő Zrt.