

Az
ERSTE
ESG STOCK COST AVERAGING ALAPOK ALAPJA

2023. féléves jelentése

1. Az Erste ESG Stock Cost Averaging Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste ESG Stock Cost Averaging Alapok Alapja

Az Alap rövidített elnevezése

Erste ESG Stock Cost Averaging Alapok Alapja

Az Alap típusa, fajtája

Az Alap Magyarországon nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott, nyíltvégű befektetési alap.

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje a nyilvántartásba vételtől (2021. január 21.) 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
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	11 621 337 229.00	102.35%	7 302 289 849.00	101.32%
Banki egyenlegek	122 475 163.00	1.08%	24 419 386.00	0.34%
Pénzforgalmi számla egyenleg	84 893 702.00	0.75%	24 419 386.00	0.34%
Óvadékba adott pénzeszköz	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Lekötött bankbetét	37 581 461.00	0.33%	0.00	0.00%
Átruházható értékpapírok	11 030 768 722.00	97.14%	7 236 035 745.00	100.40%
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%
Részvények	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	11 030 768 722.00	97.14%	7 236 035 745.00	100.40%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	11 030 768 722.00	97.14%	7 236 035 745.00	100.40%
Zártvégű alap befektetési jegye	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Származtatott ügyletek	235 929 345.00	2.08%	0.00	0.00%
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	235 929 345.00	2.08%	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	232 163 999.00	2.04%	41 834 718.00	0.58%
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	41 834 718.00	0.58%
Egyéb követelések	232 163 999.00	2.04%	0.00	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-266 283 519.00	-2.35%	-95 229 209.00	-1.32%
Hitelállomány	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Költségek	-12 290 283.00	-0.11%	-10 195 693.00	-0.14%
Különadó	-865 468.00	-0.01%	-986 676.00	-0.01%
Alapkezelői díj	-1 771 045.00	-0.02%	-1 557 965.00	-0.02%
Forgalmazói díj	-8 068 095.00	-0.07%	-5 860 917.00	-0.08%
Letétkezelői díj	-655 943.00	-0.01%	-494 592.00	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-157 828.00	0.00%	-396 762.00	-0.01%
Felügyeleti díj	-610 807.00	-0.01%	-688 781.00	-0.01%
Könyvelési díj	-161 097.00	0.00%	-210 000.00	0.00%
Egyéb kötelezettség	-253 993 236.00	-2.24%	-85 033 516.00	-1.18%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	11 355 053 710.00	100.00%	7 207 060 640.00	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)*	6 492 558 953

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft)*	1.1100
--	--------

* 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	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	96.84%	99.09%	2.25%
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 kitétsége nem haladhatja meg az Alap nettó eszközértékének a kétszeresét. A származtatott ügyletek figyelembevételével számított, a befektetési eszközökben meglévő nettó összesített kockázati kitétsége 2022.12.30-án 98,20%, 2023.06.30-án 100,40% 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 kitétsége alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,40%-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 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 befektetései 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, 2023. augusztus 30.

Erste Alapkezelő Zrt.