



Az
ERSTE
NYÍLTVÉGŰ BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP

2021. féléves jelentése

1. Az Erste Nyíltvégű Bázis Befektetési Alap (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Nyíltvégű Pénzpiaci Befektetési Alapról a PSZÁF E-III-110.164-13/2009. számú határozata alapján 2009. május 20-ai hatállyal Erste Nyíltvégű Tőkevédett Pénzpiaci Befektetési Alapra módosult. Majd a Magyar Nemzeti Bank Pénzügyi Stabilitási Tanácsa H-KE-III-660/2016. számú határozata alapján 2016. november 2-ai hatállyal kikerült az Alap nevéből a „Tőkevédett” jelző. Az Alap elnevezése 2019. január 14-ei hatállyal **Erste Nyíltvégű Bázis Befektetési Alapra** változott.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Bázis Alap

Az Alap típusa, fajtája

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

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (2001. január 10-től) határozatlan ideig terjed.

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 T-1 napon készül Tárgynap – 1 napi eszközállomány
Eszközérték számításakor elérhető legfrissebb piaci árfolyam adatok
Tárgynap – 2 napi befektetési jegy forgalmi adatok felhasználásával

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

Megnevezés	Záró eszközérték Tárgynap: 2020.12.31 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2021.06.30 (Ft)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	35 881 704 492	100.05%	19 459 993 572	100.07%
Banki egyenlegek	20 425 498 397	56.95%	5 174 421 870	26.61%
Pénzforgalmi számla egyenleg	2 878 910 826	8.03%	2 174 001 870	11.18%
Óvadékba adott pénzeszköz	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	17 546 587 571	48.93%	3 000 420 000	15.43%
Átruházható értékpapírok	15 474 005 839	43.15%	14 280 982 839	73.44%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	15 474 005 839	43.15%	14 280 982 839	73.44%
Diszkontkincstárjegyek	7 366 355 343	20.54%	4 840 804 000	24.89%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	3 796 379 750	10.59%	1 590 052 500	8.19%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Hitelintézeti kötvények	3 127 955 984	8.72%	6 204 015 907	31.90%
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	1 183 314 762	3.30%	1 646 110 432	8.46%
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	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	0	0.00%	0	0.00%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	-17 800 141	-0.05%	4 588 480	0.02%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-17 800 141	-0.05%	4 588 480	0.02%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	397	0.00%	383	0.00%
Befektetési számla egyenleg	397	0.00%	383	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	0	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-18 039 693	-0.05%	-13 826 408	-0.07%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-17 638 433	-0.05%	-10 114 155	-0.05%
Különadó	-4 857 902	-0.01%	-2 939 844	-0.02%
Alapkezelői díj	-884 935	0.00%	-475 478	0.00%
Forgalmazói díj	-5 014 633	-0.01%	-2 694 373	-0.01%
Letétkezelői díj	-2 064 849	-0.01%	-1 109 448	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-1 397 000	0.00%	-692 759	0.00%
Felügyeleti díj	-3 419 114	-0.01%	-2 052 253	-0.01%
Könyvelési díj	0	0.00%	-150 000	0.00%
Egyéb kötelezettség	-401 260	0.00%	-3 712 253	-0.02%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	35 863 664 799	100.00%	19 446 167 164	100.00%

3. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Tárgyidőszak: 2021.01.01 - 2021.06.30	
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2021.06.30-án (db) *	8 644 235 382

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2021.06.30-án (Ft) *	2.249611
---	----------

* 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	11.46%	40.29%	28.83%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	31.44%	25.30%	-6.14%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	26.68%	32.59%	5.91%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.00%	0.00%	0.00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	42.91%	65.59%	22.68%

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 nincs elkülönített eszköze.

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. Az Alap származtatott ügyletei között 2020.06.30-án kizárólag deviza forward pozíciót tartott. A származtatott ügyletek figyelembevételével számított, a befektetési eszközökben meglévő nettó összesített kockázati kitétség 2020.12.31-én 100,10%, 2021.06.30-án 100,03% 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 0,03%-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 SRRI mutató szerint 1-es kockázat/nyereség profilú besorolást kapott az RMAX index elmúlt 5 évre visszatekintő heti hozamok szóródása alapján. Ez az Alap adott esetben nem megfelelő olyan befektetők számára, akik 6 hónapon 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, 2021. augusztus 31.

Erste Alapkezelő Zrt.