

Az  
**ERSTE**  
**NYÍLTVÉGŰ BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP**

*2024. 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: 2023.12.29 (HUF)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (HUF)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>273 684 260 583</b>	<b>100.31%</b>	<b>295 804 935 737</b>	<b>100.19%</b>
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>288 928 108</b>	<b>0.11%</b>	<b>82 560 409 306</b>	<b>27.96%</b>
Pénzforgalmi számla egyenleg	56 648 524	0.02%	76 734 941	0.03%
Óvadék összege	27 124 900	0.01%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	205 154 684	0.08%	82 483 674 365	27.94%
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>272 785 644 627</b>	<b>99.98%</b>	<b>214 252 501 879</b>	<b>72.57%</b>
<b>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>229 640 926 138</b>	<b>84.17%</b>	<b>167 551 726 159</b>	<b>56.75%</b>
Diszkontkincstárjegyek	45 396 751 200	16.64%	48 652 250 000	16.48%
MNB kötvények	0	0.00%	25 969 918 000	8.80%
Államkötvények	77 549 023 000	28.42%	23 663 412 500	8.02%
Állami garanciával rendelkező kötvények	76 907 014 258	28.19%	49 890 907 777	16.90%
Hitelintézeti kötvények	15 995 444 629	5.86%	14 369 931 015	4.87%
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	13 792 693 051	5.06%	5 005 306 867	1.70%
<b>Részcégek</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>
Hazai tőzsdei részvények	0	0.00%	0	0.00%
Hazai OTC részvények	0	0.00%	0	0.00%
Külföldi részvények	0	0.00%	0	0.00%
<b>Kollektív befektetési értékpapírok</b>	<b>43 144 718 489</b>	<b>15.81%</b>	<b>46 700 775 720</b>	<b>15.82%</b>
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	43 144 718 489	15.81%	46 700 775 720	15.82%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
<b>Származtatott ügyletek</b>	<b>609 687 848</b>	<b>0.22%</b>	<b>-1 007 975 448</b>	<b>-0.34%</b>
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	609 687 848	0.22%	-1 007 975 448	-0.34%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb követelések	0	0.00%	0	0.00%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-856 532 349</b>	<b>-0.31%</b>	<b>-573 641 243</b>	<b>-0.19%</b>
<b>Hitelállomány</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>
<b>Költségek</b>	<b>-322 014 678</b>	<b>-0.12%</b>	<b>-342 247 713</b>	<b>-0.12%</b>
Alapkezelői díj	-53 046 678	-0.02%	-63 868 804	-0.02%
Forgalmazói díj	-199 556 552	-0.07%	-202 251 214	-0.07%
Letétkezelői díj	-14 145 781	-0.01%	-14 902 721	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-2 121 909	0.00%	-1 610 506	0.00%
Felügyeleti díj	-21 815 326	-0.01%	-24 382 817	-0.01%
Különadó	-30 910 690	-0.01%	-35 023 984	-0.01%
Könyvelési díj	-417 742	0.00%	-207 667	0.00%
<b>Egyéb kötelezettség</b>	<b>-534 517 671</b>	<b>-0.20%</b>	<b>-231 393 530</b>	<b>-0.08%</b>
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>272 827 728 234</b>	<b>100.00%</b>	<b>295 231 294 494</b>	<b>100.00%</b>

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)*	102 330 001 830

\* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

### 4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (HUF)*	2.88509
--	---------

\* 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	34.87%	23.10%	-11.77%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	48.96%	32.84%	-16.12%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	48.51%	42.90%	-5.62%
Egyéb átruházható értékpapírok	15.72%	15.55%	-0.17%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	83.83%	55.94%	-27.89%

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 kitétségi arány 2023.12.29-én 100,06%, 2024.06.28-án 100,51% 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:**

2024.06.28-án nettó összesített kockázati kitétségi arány alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,51%-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 1-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-t. 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 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 befektetései 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.