

Az
ERSTE
NYÍLTVÉGŰ DOLLÁR BÁZIS BEFEKTETÉSI ALAP

2024. féléves jelentése

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

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Nyíltvégű Dollár Pénzpiaci Befektetési Alapról a MNB H-KE-III-568/2018. számú határozata alapján 2019. január 14-ei hatállyal **Erste Nyíltvégű Dollár Bázis Befektetési Alap**ra módosult.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Dollár Bázis Alap

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 (2007. november 09-től) 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 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 (USD)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)	Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (USD)	Az eszközök teljes portf. arányában (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	170 765 065.93	101.82%	164 215 368.92	100.21%
Banki egyenlegek	2 537 050.51	1.51%	204 655.96	0.12%
Pénzforgalmi számla egyenleg	4 690.40	0.00%	94 830.96	0.06%
Óvadék összege	0.00	0.00%	109 825.00	0.07%
Lekötött bankbetét	2 532 360.11	1.51%	0.00	0.00%
Átruházható értékpapírok	168 362 734.55	100.38%	163 428 901.66	99.73%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	118 250 088.09	70.51%	101 679 384.29	62.05%
Diszkontkincstárjegyek	1 225 217.07	0.73%	201 124.81	0.12%
MNB kötvények	0.00	0.00%	8 075 585.72	4.93%
Államkötvények	52 147 600.50	31.09%	945 857.28	0.58%
Állami garanciával rendelkező kötvények	23 404 419.02	13.95%	15 425 122.87	9.41%
Hitelintézeti kötvények	0.00	0.00%	7 314 873.61	4.46%
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	41 472 851.50	24.73%	69 716 820.00	42.54%
Részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Hazai tőzsdei részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Hazai OTC részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Külföldi részesvények	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Kollektív befektetési értékpapírok	50 112 646.46	29.88%	61 749 517.37	37.68%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	50 112 646.46	29.88%	61 749 517.37	37.68%
Zártvégű alap befektetési jegye	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Származtatott ügyletek	-1 350 965.13	-0.81%	581 811.30	0.36%
Futures ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Forward ügyletek	-1 350 965.13	-0.81%	581 811.30	0.36%
Opciók	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb eszközök	1 216 246.00	0.73%	0.00	0.00%
Befektetési számla egyenleg	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Egyéb követelések	1 216 246.00	0.73%	0.00	0.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-3 047 144.64	-1.82%	-347 646.50	-0.21%
Hitelállomány	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Költségek	-143 959.48	-0.09%	-153 601.29	-0.09%
Alapkezelői díj	-20 340.25	-0.01%	-24 549.70	-0.01%
Forgalmazói díj	-76 518.07	-0.05%	-77 740.71	-0.05%
Letétkezelői díj	-10 331.55	-0.01%	-10 910.98	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-2 781.45	0.00%	-3 111.15	0.00%
Felügyeleti díj	-13 558.80	-0.01%	-15 075.02	-0.01%
Különadó	-19 211.81	-0.01%	-21 654.07	-0.01%
Könyvelési díj	-1 217.55	0.00%	-559.66	0.00%
Egyéb kötelezettség	-2 903 185.16	-1.73%	-194 045.21	-0.12%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	167 717 921.29	100.00%	163 867 722.42	100.00%

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)*	130 973 767

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (USD)*	1.2511
--	--------

* 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	63.96%	29.73%	-34.23%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	4.14%	38.44%	34.29%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	12.78%	48.44%	35.66%
Egyéb átruházható értékpapírok	21.52%	31.41%	9.89%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	62.74%	61.91%	-0.83%

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 kitétség 2023.12.29-én 101,89%, 2024.06.28-án 99,74% 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 kitétség alapján az Alapban nem volt tőkeáttétel. 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). 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 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, 2024. augusztus 22.

Erste Alapkezelő Zrt.