

A

**ERSTE MULTI ASSET ESG ACTIVE ALAPOK ALAPJA**

*2023. féléves jelentése*

## 1. A Erste Multi Asset ESG Active Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

### Az Alap neve

Az Alap neve Erste Globál Mix Megtakarítási Alapok Alapjáról a PSZÁF H-KE-III-447/2013. számú határozata alapján 2013. augusztus 05-ei hatállyal Erste Globál Aktív 50 Alapok Alapjára változott. Majd az MNB Pénzügyi Stabilitási Tanácsának H-KE-III-124/2014. számú határozata alapján YOU INVEST Dinamikus Alapok Alapjára módosult 2014. március 24-ei hatállyal. Az Alap neve az MNB H-KE-III-797/2021.számú határozata alapján 2022. február 14-ei hatállyal **Erste Multi Asset ESG Active Alapok Alapjára** változott.

### Az Alap rövidített elnevezése

Erste Multi Asset ESG Active Alapok Alapja

### Az Alap típusa, fajtája

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

### Az Alap futamideje

Az Alap futamideje az Alap nyilvántartásba vételétől (2011. március 02-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 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 (%)
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>1 275 621 716</b>	<b>100.13%</b>	<b>1 276 140 723</b>	<b>100.88%</b>
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>51 156 527</b>	<b>4.02%</b>	<b>25 629 433</b>	<b>2.03%</b>
Pénzforgalmi számla egyenleg	11 127 524	0.87%	25 629 433	2.03%
Óvadékba adott pénzeszköz	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	40 029 003	3.14%	0	0.00%
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>1 210 943 775</b>	<b>95.06%</b>	<b>1 213 075 535</b>	<b>95.90%</b>
<b>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	0	0.00%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	0	0.00%	0	0.00%
Állami garanciával rendelkező kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevelek	0	0.00%	0	0.00%
<b>Részvények</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>1 210 943 775</b>	<b>95.06%</b>	<b>1 213 075 535</b>	<b>95.90%</b>
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	1 210 943 775	95.06%	1 213 075 535	95.90%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
<b>Származtatott ügyletek</b>	<b>13 496 418</b>	<b>1.06%</b>	<b>37 407 889</b>	<b>2.96%</b>
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	13 496 418	1.06%	37 407 889	2.96%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>24 996</b>	<b>0.00%</b>	<b>27 866</b>	<b>0.00%</b>
Befektetési számla egyenleg	1	0.00%	2 870	0.00%
Egyéb követelések	24 995	0.00%	24 996	0.00%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-1 684 953</b>	<b>-0.13%</b>	<b>-11 159 847</b>	<b>-0.88%</b>
<b>Hitelállomány</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>
<b>Költségek</b>	<b>-1 684 953</b>	<b>-0.13%</b>	<b>-1 953 231</b>	<b>-0.15%</b>
Különadó	-162 816	-0.01%	-159 241	-0.01%
Alapkezelői díj	-194 102	-0.02%	-222 093	-0.02%
Forgalmazói díj	-884 241	-0.07%	-835 491	-0.06%
Letétkezelői díj	-86 267	-0.01%	-84 607	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-131 522	-0.01%	-330 635	-0.03%
Felügyeleti díj	-114 908	-0.01%	-111 164	-0.01%
Könyvelési díj	-111 097	-0.01%	-210 000	-0.02%
<b>Egyéb kötelezettség</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>-9 206 616</b>	<b>-0.73%</b>
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>1 273 936 763</b>	<b>100.00%</b>	<b>1 264 980 876</b>	<b>100.00%</b>

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)*	754 736 960

\* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

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

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft)*	1.6761
--	--------

\* 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	94.90%	95.07%	0.17%
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 99,07% 2023.06.30-án 97,20% 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 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 3-as 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.