

A

ERSTE MULTI ASSET ESG ACTIVE ALAPOK ALAPJA

2024. 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.
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: 2023.12.29 (HUF) | Az eszközök teljes portf. arányában (%) | Záró eszközérték Tárgynap: 2024.06.28 (HUF) | Az eszközök teljes portf. arányában (%) |
|--|---|--|---|--|
| ÖSSZES ESZKÖZ | 1 276 426 795 | 100.77% | 1 845 079 257 | 100.14% |
| Banki egyenlegek | 35 201 750 | 2.78% | 178 096 102 | 9.67% |
| Pénzforgalmi számla egyenleg | 35 201 750 | 2.78% | 178 096 102 | 9.67% |
| Óvadék összege | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Lekötött bankbetét | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Átruházható értékpapírok | 1 225 341 819 | 96.74% | 1 671 870 616 | 90.74% |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| 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% |
| Hitelintézeti kötvények | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| 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 | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| 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 | 1 225 341 819 | 96.74% | 1 671 870 616 | 90.74% |
| Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi | 1 225 341 819 | 96.74% | 1 671 870 616 | 90.74% |
| Zártvégű alap befektetési jegye | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Származtatott ügyletek | 15 853 226 | 1.25% | -17 654 365 | -0.96% |
| Futures ügyletek | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Forward ügyletek | 15 853 226 | 1.25% | -17 654 365 | -0.96% |
| Opciók | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Egyéb származtatott ügyletek | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Egyéb eszközök | 30 000 | 0.00% | 12 766 904 | 0.69% |
| Befektetési számla egyenleg | 1 | 0.00% | 1 | 0.00% |
| Egyéb követelések | 29 999 | 0.00% | 12 766 903 | 0.69% |
| KÖTELEZETTSÉGEK | -9 768 426 | -0.77% | -2 632 238 | -0.14% |
| Hitelállomány | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Költségek | -2 188 763 | -0.17% | -2 409 534 | -0.13% |
| Alapkezelői díj | -207 335 | -0.02% | -308 124 | -0.02% |
| Forgalmazói díj | -779 975 | -0.06% | -975 725 | -0.05% |
| Letétkezelői díj | -78 985 | 0.00% | -102 708 | 0.00% |
| Könyvvizsgálói díj | -663 097 | -0.05% | -503 107 | -0.03% |
| Felügyeleti díj | -104 111 | -0.01% | -128 140 | -0.01% |
| Különadó | -147 518 | -0.01% | -184 063 | -0.01% |
| Könyvelési díj | -207 742 | -0.02% | -207 667 | -0.01% |
| Egyéb kötelezettség | -7 579 663 | -0.60% | -222 704 | -0.01% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK | 1 266 658 369 | 100.00% | 1 842 447 019 | 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)* | 952 743 910 |

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

| | |
|--|--------|
| Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (HUF)* | 1.9338 |
|--|--------|

* 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 | 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 | 95.97% | 90.58% | -5.39% |
| 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 kitétségi arány 2023.12.29-én 98,92% 2024.06.28-án 101,09% 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 1,09%-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 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, 2024. augusztus 22.

Erste Alapkezelő Zrt.