

Az
ERSTE
MULTI ASSET BASE ALAPOK ALAPJA

2023. féléves jelentése

1. Az Erste Multi Asset Base Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Globál Aktív Megtakarítási Alapok Alapjáról a PSZÁF H-KE-III-446/2013. számú határozata alapján 2013. augusztus 05-ei hatállyal Erste Globál Aktív 30 Alapok Alapjára változott. Majd az MNB Pénzügyi Stabilitási Tanácsának H-KE-III-127/2014. számú határozata alapján YOU INVEST Kiegyensúlyozott Alapok Alapjára módosult 2014. március 24-ei hatállyal. Az Alap neve az MNB H-KE-III-802/2021.számú határozata alapján 2022. február 14-ei hatállyal **Erste Multi Asset Base Alapok Alapjára** változott.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Multi Asset Base 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 (%)
ÖSSZES ESZKÖZ	3 390 592 945	100.82%	3 331 914 517	100.65%
Banki egyenlegek	35 013 075	1.04%	12 443 644	0.38%
Pénzforgalmi számla egyenleg	12 663 075	0.38%	12 443 644	0.38%
Óvadékba adott pénzeszköz	22 350 000	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	3 338 015 444	99.25%	3 254 108 141	98.30%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	113 465 700	3.37%	13 786 980	0.42%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	13 786 980	0.42%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	113 465 700	3.37%	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%
Részcények	0	0.00%	0	0.00%
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%
Kollektív befektetési értékpapírok	3 224 549 744	95.88%	3 240 321 161	97.88%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	1 266 931 748	37.67%	1 435 899 965	43.38%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	1 957 617 996	58.21%	1 804 421 196	54.51%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	-4 849 996	-0.14%	63 489 369	1.92%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	-4 849 996	-0.14%	63 489 369	1.92%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	22 414 422	0.67%	1 873 363	0.06%
Befektetési számla egyenleg	1	0.00%	808 944	0.02%
Egyéb követelések	22 414 421	0.67%	1 064 419	0.03%
KÖTELEZETTSÉGEK	-27 494 889	-0.82%	-21 541 290	-0.65%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-3 218 785	-0.10%	-3 320 779	-0.10%
Különadó	-303 692	-0.01%	-255 478	-0.01%
Alapkezelői díj	-377 961	-0.01%	-425 913	-0.01%
Forgalmazói díj	-1 721 821	-0.05%	-1 602 243	-0.05%
Letétkezelői díj	-223 977	-0.01%	-216 337	-0.01%
Könyvvizsgálói díj	-131 522	0.00%	-330 635	-0.01%
Felügyeleti díj	-298 715	-0.01%	-280 173	-0.01%
Könyvelési díj	-161 097	0.00%	-210 000	0.00%
Egyéb kötelezettség	-24 276 104	-0.72%	-18 220 511	-0.55%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	3 363 098 056	100.00%	3 310 373 227	100.00%

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)	1 976 139 995

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft)	1.6752
---	--------

* 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	2.76%	2.73%	-0.03%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	3.37%	0.41%	-2.95%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0.00%	0.41%	0.41%
Egyéb átruházható értékpapírok	92.95%	94.52%	1.57%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	3.37%	0.41%	-2.95%

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 100,29% 2023.06.30-án 99,52% 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 2-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 3 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.