

Az
ERSTE
MULTI ASSET DIVERSIFIED ALAPOK ALAPJA

2023. féléves jelentése

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

Az Alap neve

Erste Multi Asset Diversified Alapok Alapja

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Multi Asset Diversified Alapok Alapja

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 (2019. június 20-tól) 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

T napi 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	12 997 695 616	100.24%	11 969 929 247	104.10%
Banki egyenlegek	91 719 934	0.71%	2 181 648	0.02%
Pénzforgalmi számla egyenleg	91 719 934	0.71%	2 181 648	0.02%
Óvadékba adott pénzeszköz	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	12 849 710 876	99.10%	11 358 224 118	98.78%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	139 725 638	1.08%	91 215 593	0.79%
Diszkontkincstárjegyek	0	0.00%	32 169 620	0.28%
MNB kötvények	0	0.00%	0	0.00%
Államkötvények	139 725 638	1.08%	59 045 973	0.51%
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%
Részvények	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	12 709 985 238	98.03%	11 267 008 525	97.99%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	2 814 510 297	21.71%	2 241 296 193	19.49%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	9 895 474 941	70.05%	9 025 712 332	78.50%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	54 867 777	0.42%	276 880 940	2.41%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	54 867 777	0.42%	276 880 940	2.41%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	1 397 029	0.01%	332 642 541	2.89%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	1 164 160	0.01%
Egyéb követelések	1 397 029	0.01%	331 478 381	2.88%
KÖTELEZETTSÉGEK	-31 659 292	-0.24%	-471 499 280	-4.10%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-14 664 677	-0.11%	-13 149 488	-0.11%
Különadó	-1 380 129	-0.01%	-1 173 409	-0.01%
Alapkezelői díj	-1 961 112	-0.02%	-1 999 474	-0.02%
Forgalmazói díj	-8 933 956	-0.06%	-7 521 831	-0.07%
Letétkezelői díj	-871 605	-0.01%	-761 704	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-184 132	0.00%	-462 889	0.00%
Felügyeleti díj	-1 172 646	-0.01%	-1 020 181	-0.01%
Könyvelési díj	-161 097	0.00%	-210 000	0.00%
Egyéb kötelezettség	-16 994 615	-0.13%	-458 349 792	-3.99%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	12 966 036 324	100.00%	11 498 429 967	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) *	9 403 920 705

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft) *	1.2227
---	--------

* 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	11.08%	10.14%	-0.93%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0.59%	0.28%	-0.32%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	1.33%	0.28%	-1.05%
Egyéb átruházható értékpapírok	87.18%	87.16%	-0.01%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1.07%	0.78%	-0.29%

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 kitettsége nem haladhatja meg az Alap nettó eszközértékének a kétszeresét. A származtatott ügyletek figyelembevételével számított, a befektetési eszközökben meglévő nettó összesített kockázati kitettség 2022.12.30-án 99,81%, 2023.06.30-án 98,78% 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 kitettség 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 számítást 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.