

Az
ERSTE
MEGATREND COST AVERAGING ALAPOK ALAPJA

2023. féléves jelentése

1. Az Erste Megatrend Cost Averaging Alapok Alapja (továbbiakban: Alap) rövid bemutatása

Az Alap neve

Erste Megatrend Cost Averaging Alapok Alapja

Az Alap rövidített elnevezése

Erste Megatrend Cost Averaging Alapok Alapja

Az Alap típusa, fajtája

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

Az Alap futamideje

Az Alap futamideje a nyilvántartásba vételtől (2020. november 05.) 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 | 2 664 110 997.00 | 104.39% | 1 987 228 413.00 | 101.51% |
| Banki egyenlegek | 20 048 495.00 | 0.79% | 27 049 510.00 | 1.38% |
| Pénzforgalmi számla egyenleg | 20 048 495.00 | 0.79% | 27 049 510.00 | 1.38% |
| Óvadékba adott pénzeszköz | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Lekötött bankbetét | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Átruházható értékpapírok | 2 442 034 681.00 | 95.69% | 1 958 794 008.00 | 100.06% |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Diszkontkincstárjegyek | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| MNB kötvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Államkötvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Állami garanciával rendelkező 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% |
| Részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Hazai tőzsdei részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Hazai OTC részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Külföldi részvények | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Kollektív befektetési értékpapírok | 2 442 034 681.00 | 95.69% | 1 958 794 008.00 | 100.06% |
| Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai | 0.00 | 0.00% | 302 059 000.00 | 15.43% |
| Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi | 2 442 034 681.00 | 95.69% | 1 656 735 008.00 | 84.63% |
| Zártvégű alap befektetési jegye | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Származtatott ügyletek | 97 950 322.00 | 3.84% | 0.00 | 0.00% |
| Futures ügyletek | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Forward ügyletek | 97 950 322.00 | 3.84% | 0.00 | 0.00% |
| Opciók | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Egyéb származtatott ügyletek | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Egyéb eszközök | 104 077 499.00 | 4.08% | 1 384 895.00 | 0.07% |
| Befektetési számla egyenleg | 0.00 | 0.00% | 1 384 895.00 | 0.07% |
| Egyéb követelések | 104 077 499.00 | 4.08% | 0.00 | 0.00% |
| KÖTELEZETTSÉGEK | -112 071 419.00 | -4.39% | -29 546 401.00 | -1.51% |
| Hitelállomány | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| Költségek | -3 645 231.00 | -0.14% | -3 082 535.00 | -0.16% |
| Különadó | -271 042.00 | -0.01% | -214 487.00 | -0.01% |
| Alapkezelői díj | -480 372.00 | -0.02% | -422 584.00 | -0.02% |
| Forgalmazói díj | -2 188 364.00 | -0.09% | -1 589 722.00 | -0.08% |
| Letétkezelői díj | -177 916.00 | -0.01% | -134 154.00 | -0.01% |
| Könyvvizsgálói díj | -131 522.00 | -0.01% | -330 635.00 | -0.02% |
| Felügyeleti díj | -234 918.00 | -0.01% | -180 953.00 | -0.01% |
| Könyvelési díj | -161 097.00 | -0.01% | -210 000.00 | -0.01% |
| Egyéb kötelezettség | -108 426 188.00 | -4.25% | -26 463 866.00 | -1.35% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK | 2 552 039 578.00 | 100.00% | 1 957 682 012.00 | 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)* | 1 881 037 824 |

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

| | |
|--|--------|
| Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2023.06.30-án (Ft)* | 1.0407 |
|--|--------|

* 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 | 95.37% | 98.57% | 3.20% |
| 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 kitétség 2022.12.30-án 133,58%, 2023.06.30-án 100,16% volt.

A biztosíték vagy a tőkeáttételi megállapodás értelmében nyújtott garanciák újbóli felhasználási joga:

Az Alap a kapott biztosítékokat nem használja fel. Az adott biztosítékokat 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 kitétség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,16%-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 4-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 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 befektetései likviditási profilja megfeleljen az Alap kötelezettségeinek. Az Alapkezelő rendszeresen stresszteszteket 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.