

Az
ERSTE
DPM MEGATREND ALAPOK ALAPJA

2024. féléves jelentése

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

Az Alap neve

Az Alap neve Erste Európai Részvény Alapok Alapjáról a PSZÁF H-KE-III-259/2012. számú határozata alapján 2012. augusztus 26-ai hatállyal Erste Európai Részvény Befektetési Alapjára módosult, majd 2013. december 30-ai hatállyal ismét változott a Magyar Nemzeti Bank H-KE-III-808/2013. számú határozata alapján Erste Európai Részvény Alapok Alapjára.

Az Alap neve az MNB H-KE-III-563/2019. számú határozata alapján 2019. december 2-ával **Erste DPM Megatrend Alapok Alapjára** módosult.

Az Alap rövidített elnevezése

Erste DPM Megatrend 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 (2010. március 25-től) határozatlan ideig terjed.

Az Alap által kibocsátott befektetési jegy sorozatok:

„HUF” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000708649

„EUR” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000723432

„USD” sorozat – ISIN azonosítója: HU0000723440

Alapkezelő

Erste Alapkezelő Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Cégjegyzékszáma: 01-10-044157

Letétkezelő

ERSTE Bank Hungary Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Cégjegyzékszáma: 01-10-041054

Forgalmazó

Erste Befektetési Zrt.

Székhelye: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.

Cégjegyzékszáma: 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	3 805 571 835	101.24%	2 778 715 739	100.11%
Banki egyenlegek	28 121 971	0.75%	26 439 637	0.95%
Pénzforgalmi számla egyenleg	28 121 971	0.75%	26 439 637	0.95%
Óvadék összege	0	0.00%	0	0.00%
Lekötött bankbetét	0	0.00%	0	0.00%
Átruházható értékpapírok	3 776 842 995	100.47%	2 727 586 422	98.27%
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%
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	3 776 842 995	100.47%	2 727 586 422	98.27%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Hazai	0	0.00%	0	0.00%
Nyíltvégű alap befektetési jegye - Külföldi	3 776 842 995	100.47%	2 727 586 422	98.27%
Zártvégű alap befektetési jegye	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Futures ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Forward ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Opciók	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb származtatott ügyletek	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb eszközök	606 869	0.02%	24 689 680	0.89%
Befektetési számla egyenleg	0	0.00%	24 418 680	0.88%
Egyéb követelések	606 869	0.02%	271 000	0.01%
KÖTELEZETTSÉGEK	-46 559 235	-1.24%	-2 993 723	-0.11%
Hitelállomány	0	0.00%	0	0.00%
Költségek	-2 710 955	-0.07%	-2 030 549	-0.07%
Alapkezelői díj	-897 508	-0.02%	-628 418	-0.02%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0	0.00%
Letétkezelői díj	-208 494	-0.01%	-146 198	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-663 097	-0.02%	-503 107	-0.02%
Felügyeleti díj	-303 739	-0.01%	-223 754	-0.01%
Különadó	-430 375	-0.01%	-321 405	-0.01%
Könyvelési díj	-207 742	0.00%	-207 667	-0.01%
Egyéb kötelezettség	-43 848 280	-1.17%	-963 174	-0.03%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	3 759 012 600	100.00%	2 775 722 016	100.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste DPM Megatrend Alapok Alapja HUF sorozat	782 240 888		649 293 074	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste DPM Megatrend Alapok Alapja EUR sorozat	1 835 550 840		1 345 751 877	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK HUF-ban Erste DPM Megatrend Alapok Alapja USD sorozat	1 141 220 872		780 677 065	

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) Erste DPM Megatrend Alapok Alapja HUF sorozat*	206 854 014
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2024.06.28án (db) Erste DPM Megatrend Alapok Alapja EUR sorozat*	2 566 971
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2024.06.28án (db) Erste DPM Megatrend Alapok Alapja USD sorozat*	1 681 388

* tárgyidőszakban közzétett utolsó nettó eszközérték

4. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (HUF) Erste DPM Megatrend Alapok Alapja HUF sorozat*	3.1389
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (EUR) Erste DPM Megatrend Alapok Alapja EUR sorozat*	1.3267
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték 2024.06.28án (USD) Erste DPM Megatrend Alapok Alapja USD sorozat*	1.2569

* 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	52.21%	64.87%	12.66%
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	47.03%	33.29%	-13.74%
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 kitettsége nem haladhatja meg az Alap nettó eszközértékének a kétszeresét. A származtatott ügyletek figyelembevételével számított, a befektetési eszközökben meglévő nettó összesített kockázati kitettség 2023.12.29-én 100,47%, 2024.06.28-án 100,07% 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 kitettség alapján a tőkeáttétel teljes összege a nettó eszközérték 0,07%-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 számítást vezetett be (SRI), amely felváltja a korábbi SRRI-t. 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 6 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.