

Éves jelentés 2012

DIALÓG Árupiaci Származtatott Befektetési Alap

PSZÁF lajstromszám: 1111-493
PSZÁF engedélyszám: H-KE-III-296/2012
ISIN kód: HU0000711551

Általános adatok:

Az Alap megnevezése:	DIALÓG Árupiaci Származtatott Befektetési Alap
Az Alap típusa:	Magyarországon, nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott nyíltvégű, értékpapír befektetési alap
Az Alap futamideje:	A nyilvántartásba vételtől határozatlan ideig tart
Besorolása:	Nemzetközi, Származtatott ügyletekbe fektető befektetési alap
Alapkezelő:	DIALÓG Alapkezelő Zrt. (1037 Budapest, Montevideo u. 3/B.)
Letétkezelő:	Unicredit Bank Hungary Zrt. (1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)
Könyvvizsgáló:	Trusted Adviser Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft. (székhelye: 2096, Üröm, Pillangó u. 12) – Szovics Zsolt /005784
Vezető Forgalmazó:	Unicredit Bank Hungary Zrt. (1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)
Alforgalmazó:	Concorde Értékpapír Zrt. (1123 Budapest, Alkotás utca 50.) Erste Befektetési Zrt. székhelye (1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.) ERSTE Bank Hungary Nyrt. fiókhálózatába tartozó fiókok, amelyeket az Erste Befektetési Zrt. Üzletszabályzatának mellékletét képező mindenkori ügynöklistája tartalmaz Erste Befektetési Zrt. internetes kereskedési rendszerei (Hozamplaza, Netbroker, Portfolió Online Tőzsde), kivéve, amennyiben az Erste Befektetési Zrt. a közzétételi helyein (www.erstebroker.hu) nem rendelkezik eltérően

I. VAGYONKIMUTATÁS

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak összetétele a tárgyidőszak elején és végén, valamint az adott eszköz összes eszközön belüli aránya:

Megnevezés	2012.12.28.		2013.06.28.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	37 249 125	18,06	31 965 885	16,70
Repo				
Átruházható értékpapírok	185 103 862	89,77	175 505 426	91,70
Származékos ügyletek	-15 321 261	-7,43	-10 062 907	-5,26
Egyéb eszközök		0,00		0,00
Összes eszköz	207 031 726	100,41	197 408 404	103,15
Kötelezettségek	-835 150	-0,41	-6 025 654	-3,15
Nettó eszközérték	206 196 576	100,00	191 382 750	100,00

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2012.12.28.	2013.06.28.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Dialóg Árupiaci Származtatott Alap	A	HUF	HU0000711551	221 235 450	214 934 395

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2012.12.28.	2013.06.28.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Dialóg Árupiaci Származtatott Alap	A	HUF	HU0000711551	0.932	0.8904

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2012.12.28.		2013.06.28.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen				
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	185 103 862	100,00	110 597 401	63,02
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények			64 908 025	36,98
Hitelviszonyt megtestesítő	185 103 862	100,00	175 505 426	100,00

értékpapírok összesen				
Értékpapírok összesen	185 103 862	100,00	175 505 426	100,00

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

Az Alap az elmúlt fél évben a befektetési politika szerint 90 %-ban biztonságos értékpapírokba (63% DKJ, 37% MNB kötvény) fektette vagyonát. Az árupiaci szektort –az iparágnak megfelelően– származtatott ügyletekkel reprezentálta.

Budapest, 2013. augusztus 30.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.