

Féléves jelentés 2017

DIALÓG Octopus Származtatott Befektetési Alap

MNB lajstromszám: 1111-395
MNB engedélyszám: EN-III/TTE-339/2010
ISIN kód: HU0000709241 – A sorozat
ISIN kód: HU0000713375 – EUR sorozat

A Féléves jelentést a fent nevezett Alap kezelője a Dialóg Befektetési Alapkezelő Zrt., a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (továbbiakban: Kbtv.) 131. § és 132. § alapján készítette az Alap 2017. félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2017.01.01.- 2017.06.30.

Általános adatok:

| | |
|----------------------|--|
| Az Alap megnevezése: | DIALÓG Octopus Származtatott Deviza 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: 1037, Budapest, Iglice u. 3. fszt. 3.) – Liptákné Oláh Éva/001251 |
| 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 SPB Befektetési Zrt. székhelye (1051 Budapest, Vörösmarty tér 7-8. 3 em.) Raiffeisen Bank (1054 Budapest, Akadémia u. 6.) |

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

| Megnevezés | 2016.12.30. | | 2017.06.30. | |
|--------------------------|----------------------|------------------------|----------------------|------------------------|
| | Összeg / Érték (HUF) | A NEE százalékában (%) | Összeg / Érték (HUF) | A NEE százalékában (%) |
| Banki egyenlegek | 121 193 377 | 16,79 | 105 954 359 | 20,40 |
| Repo | | | | |
| Átruházható értékpapírok | 602 507 895 | 83,49 | 410 033 092 | 78,95 |
| Származékos ügyletek | | | | |
| Egyéb eszközök | | | 5 309 548 | 1,02 |
| Összes eszköz | 723 701 272 | 100,29 | 521 296 999 | 100,37 |
| Kötelezettségek | -2 081 528 | -0,29 | -1 916 028 | -0,37 |
| Nettó eszközérték | 721 619 744 | 100,00 | 519 380 969 | 100,00 |

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

| Befektetési jegy | | | | 2016.12.30. | 2017.06.30. |
|-----------------------------------|---------|--------|--------------|-------------|-------------|
| alap | sorozat | deviza | ISIN | | |
| Dialóg Octopus Származtatott Alap | A | HUF | HU0000709241 | 739 638 939 | 562 817 669 |
| Dialóg Octopus Származtatott Alap | B | EUR | HU0000713375 | 13 266 066 | 9 658 071 |

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

| Befektetési jegy | | | | 2016.12.30. | 2017.06.30. |
|-----------------------------------|---------|--------|--------------|-------------|-------------|
| alap | sorozat | deviza | ISIN | | |
| Dialóg Octopus Származtatott Alap | A | HUF | HU0000709241 | 0,9323 | 0,8835 |
| Dialóg Octopus Származtatott Alap | B | EUR | HU0000713375 | 0,007766 | 0,007413 |

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

| Megnevezés | 2016.12.30. | | 2017.06.30. | |
|---|----------------------|-----------------|----------------------|-----------------|
| | Összeg / Érték (HUF) | Százalékban (%) | Összeg / Érték (HUF) | Százalékban (%) |
| Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények | | | | |
| Részvény - Belföld - Biztosítók és Nyugdíjpénztárak | | | | |
| Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok | 84 895 160 | 14,09 | 74 512 080 | 18,17 |
| Részvény - GMU | 139 033 393 | 23,08 | 46 624 418 | 11,37 |
| Részvény - Egyéb külföld | 135 544 243 | 22,50 | 141 554 661 | 34,52 |
| GMU nem pénzügyi alapok | | | 27 609 889 | 6,73 |

| | | | | |
|---|-------------|--------|-------------|--------|
| befektetési jegyei | | | | |
| Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei | 26 960 742 | 4,47 | 38 983 881 | 9,51 |
| Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen | 386 433 538 | 64,14 | 329 284 929 | 80,31 |
| Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen | | | | |
| A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen | | | | |
| Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei | 25 348 750 | 4,21 | 25 633 925 | 6,25 |
| Egyéb átruházható értékpapírok | 25 348 750 | 4,21 | 25 633 925 | 6,25 |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás | 80 405 063 | 13,35 | 20 255 250 | 4,94 |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények | | | | |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok | 27 873 457 | 4,63 | 10 881 771 | 2,65 |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők | | | | |
| Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok | | | | |
| Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők | | | | |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld | 82 447 086 | 13,68 | 23 977 217 | 5,85 |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen | 190 725 607 | 31,66 | 55 114 238 | 13,44 |
| Értékpapírok összesen | 602 507 895 | 100,00 | 410 033 092 | 100,00 |

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

Budapest, 2017. augusztus 28.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.