

Féléves jelentés 2017

Sovereign PB Származtatott Befektetési Alap **(régiben DIALÓG Deviza Származtatott Befektetési Alap)**

MNB lajstromszám: 1111-319
MNB engedélyszám: E-III/110.757/2009
ISIN kód: HU0000707732

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.

Tárgyidőszak: 2017.01.01.- 2017.06.30.

Általános adatok:

Az Alap megnevezése:	Sovereign PB 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: 1037, Budapest, Iglice u. 3. fszt. 3.) – Liptákné Oláh Éva/001251
Befektetési tanácsadó:	SPB Befektetési Zrt. (1051 Budapest, Vörösmarty tér 7-8. 3 em.)
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, Portfólió 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	35 301 794	6,47	43 085 513	3,98
Repo				
Átruházható értékpapírok	514 412 276	94,28	1 043 919 396	96,38
Származékos ügyletek	-193 400	-0,04		
Egyéb eszközök				
Összes eszköz	549 520 670	101,35	1 087 004 909	100,36
Kötelezettségek	-3 910 824	-0,72	-3 889 237	-0,36
Nettó eszközérték	545 609 846	100,00	1 083 115 672	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		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	561 683 311	1 110 979 356

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		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	0.9714	0.9749

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 (%)
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld			20 737 807	1,99
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények			5 250 000	0,50
Részvény - GMU	39 745 666	7,73		
Részvény - Egyéb külföld	58 073 823	11,29	130 113 127	12,46
GMU nem pénzügyi alapok befektetési			152 319 128	14,59

jegyei				
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	40 780 652	7,93	50 096 188	4,80
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	138 600 141	26,94	358 516 250	34,34
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	156 875 458	30,50	218 891 636	20,97
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	20 715 430	4,03	36 011 089	3,45
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	0	0,00	73 190 144	7,01
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	73 879	0,01	66 820 828	6,40
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	18 511 407	3,60	71 918 696	6,89
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	151 748 431	29,50	119 900 202	11,49
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok	27 887 531	5,42	98 670 551	9,45
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	375 812 135	73,06	685 403 146	65,66
Értékpapírok összesen	514 412 276	100,00	1 043 919 396	100,00

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

Budapest, 2017. augusztus 28.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.