

Féléves jelentés 2020

Sovereign PB 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 2020. félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2020.01.01.- 2020.06.30.

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.) – Forgács Gabriella / 003228
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, 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	2019.12.31.		2020.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	668 106 952	45,06	269 521 567	20,14
Repo				
Átruházható értékpapírok	883 325 491	59,58	1 097 375 578	81,99
Származékos ügyletek		0,00		0,00
Egyéb eszközök	125 491	0,01		0,00
Összes eszköz	1 551 557 934	104,64	1 366 897 145	102,12
Kötelezettségek	-71 338 921	-4,81	-31 418 578	-2,35
Nettó eszközérték	1 482 701 655	100,00	1 338 488 831	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2019.12.31.	2020.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	1 333 494 663	1 304 422 237

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

jegy				2019.12.31.	2020.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	1.111892	1.026116

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2019.12.31.		2020.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld			21 580 657	1,97
Részvény - GMU			64 958 318	5,92
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	62 468 280	7,07	160 777 413	14,65
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	109 244 826	12,37	145 198 885	13,23
Részvény - Egyéb külföld	83 474 848	9,45	10 947 734	1,00
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	255 187 954	28,89	403 463 007	36,77
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				

összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	55 255 276	6,26	58 969 261	5,37
Egyéb átruházható értékpapírok	55 255 276	6,26	58 969 261	5,37
Részvény - GMU	59 541 724	6,74	55 735 432	5,08
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	132 332 630	14,98	120 706 049	11,00
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	56 140 311	6,36	48 420 415	4,41
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	37 225 010	4,21	39 449 733	3,59
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	30 267 470	3,43		
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok	257 375 116	29,14	370 631 682	33,77
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	572 882 261	64,86	634 943 310	57,86
Értékpapírok összesen	883 325 491	100,00	1 097 375 578	100,00

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

Budapest, 2020. augusztus 31.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.