

Féléves jelentés 2019

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 2019. félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2019.01.01.- 2019.06.30.

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, 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	2018.12.28		2019.06.28	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	232 407 621	12,36	209 161 442	13,76
Repo				
Átruházható értékpapírok	1 671 276 473	88,86	1 320 719 390	86,89
Származékos ügyletek		0,00		0,00
Egyéb eszközök	921 369	0,05	86 899 274	5,72
Összes eszköz	1 904 605 463	101,26	1 616 780 106	106,36
Kötelezettségek	-23 753 186	-1,26	-107 137 779	-7,05
Nettó eszközérték	1 880 852 277	100,00	1 520 067 268	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2018.12.28	2019.06.28
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	1 862 287 436	1 462 329 829

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

jegy				2018.12.28	2019.06.28
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	1.009969	1.039483

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2018.12.28		2019.06.28	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok			19 893 000	1,51
Részvény - GMÜ	135 526 191	8,11	133 724 582	10,13
Részvény - Egyéb külföld	179 074 972	10,71	267 633 314	20,26
GMÜ nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	105 034 745	6,28	66 406 585	5,03
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	95 306 086	5,70	101 550 078	7,69
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	514 941 993	30,81	589 207 559	44,61
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható				

értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei			54 354 720	4,12
Egyéb átruházható értékpapírok			54 354 720	4,12
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	530 049 831	31,72	56 087 375	4,25
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	35 902 961	2,15	36 916 023	2,80
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	73 561 568	4,40		
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	58 204 700	3,48	58 114 927	4,40
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	228 229 439	13,66	229 577 979	17,38
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok	174 456 895	10,44	142 014 805	10,75
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	55 929 086	3,35	154 446 001	11,69
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	1 156 334 480	69,19	677 157 111	51,27
Értékpapírok összesen	1 671 276 473	100,00	1 320 719 390	100,00

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

Budapest, 2019. augusztus 30.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.