

Féléves jelentés 2021

Sovereign PB Származtatott Befektetési Alap

MNB lajstromszám: 1111-319
MNB engedélyszám: E-III/110.757/2009
ISIN kód: HU0000707732- HUF sorozat
ISIN kód: HU0000726641 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: Kbftv.) 131. § és 132. § alapján készítette az Alap 2021. félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2021.01.01.- 2021.06.30.

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: 1082 Budapest, Baross utca 66-68, 3. emelet) – 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 55-61.) 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 (1133 Budapest, Váci út 116-118.)

Az „EUR sorozat” forgalmazása kizárólag az SPB Befektetési Zrt.-nél történik

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

Megnevezés	2020.12.31		2021.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	120 289 759	9,69	418 392 060	46,37
Repo				
Átruházható értékpapírok	1 127 056 277	90,75	500 098 944	55,42
Származékos ügyletek				
Egyéb eszközök		0,00	36 596 157	4,06
Összes eszköz	1 247 346 036	100,43	955 087 161	105,85
Kötelezettségek	-5 360 802	-0,43	-52 777 896	-5,85
Nettó eszközérték	1 241 985 234	100,00	902 309 263	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2020.12.31	2021.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	1 154 901 619	962 530 194
Sovereign PB Származtatott Alap	E	EUR	HU0000726641		1 000 000

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2020.12.31	2021.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	1.075403	0.934064
Sovereign PB Származtatott Alap	E	EUR	HU0000726641		0.00922

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2020.12.31		2021.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	29 956 046	2,66		
Részvény - GMU	79 009 385	7,01	16 455 196	3,29
Részvény - Egyéb külföld	14 347 620	1,27	16 218 255	3,24
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	110 516 818	9,81		
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	172 590 718	15,31	122 250 263	24,45
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	406 420 587	36,06	154 923 715	30,98
Más szabályozott piacon				

forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	67 598 708	6,00	61 702 709	12,34
Egyéb átruházható értékpapírok	67 598 708	6,00	61 702 709	12,34
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	277 244 875	24,60	103 659 676	20,73
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	47 064 446	4,18	47 016 520	9,40
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	39 347 270	3,49		
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	34 604 289	3,07	96 423 869	19,28
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok	254 776 103	22,61	36 372 454	7,27
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	653 036 982	57,94	283 472 520	56,68
Értékpapírok összesen	1 127 056 277	100,00	500 098 944	100,00

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

Budapest, 2021. augusztus 27.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.