

## Féléves jelentés 2022

### 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 2022. félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2022.01.01.- 2022.06.30.

#### 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	2021.12.31		2022.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	183 629 160	22,18	121 913 172	16,85
Repo				
Átruházható értékpapírok	648 272 092	78,29	605 460 284	83,68
Származékos ügyletek				
Egyéb eszközök	391 664	0,05	135 474	0,02
Összes eszköz	832 292 916	100,51	727 508 930	100,54
Kötelezettségek	-4 219 446	-0,51	-3 940 132	-0,54
Nettó eszközérték	828 073 470	100,00	723 568 798	100,00

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

## II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2021.12.31	2022.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	849 952 124	776 530 148
Sovereign PB Származtatott Alap	E	EUR	HU0000726641	1 000 000	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				2021.12.31	2022.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	0.97029	0.927645
Sovereign PB Származtatott Alap	E	EUR	HU0000726641	0.009141	0.008127

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

## IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2021.12.31		2022.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	18 675 000	2,88	9 895 850	1,63
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	42 480	0,01	18 450 800	3,05
Részvény - GMÜ	65 552 702	10,11	71 829 604	11,86
Részvény - Egyéb külföld	110 858 769	17,10	135 764 409	22,42
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	169 247 210	26,11	155 046 852	25,61
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	364 376 161	56,21	390 987 515	64,58

Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	61 564 255	9,50	66 247 411	10,94
Egyéb átruházható értékpapírok	61 564 255	9,50	66 247 411	10,94
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	6 461 921	1,00	7 081 156	1,17
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	65 793 290	10,15		
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok	38 019 251	5,86		
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	112 057 215	17,29	141 144 203	23,31
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	222 331 676	34,30	148 225 359	24,48
<b>Értékpapírok összesen</b>	<b>648 272 092</b>	<b>100,00</b>	<b>605 460 284</b>	<b>100,00</b>

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

Budapest, 2022. augusztus 30.

---

DIALÓG Alapkezelő Zrt.