

## Féléves jelentés 2023

### 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 2023. félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2023.01.01.- 2023.06.30.

#### 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	2022.12.30		2023.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	97 183 367	16,08	104 082 643	57,57
Repo				
Átruházható értékpapírok	511 133 123	84,55	78 731 050	43,55
Származékos ügyletek				
Egyéb eszközök		0,00		0,00
Összes eszköz	608 316 490	100,63	182 813 693	101,12
Kötelezettségek	-3 779 681	-0,63	-2 018 850	-1,12
Nettó eszközérték	604 536 808	100,00	180 794 844	100,00

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

## II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2022.12.30	2023.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	652 535 448	202 987 062
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				2022.12.30	2023.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Sovereign PB Származtatott Alap	A	HUF	HU0000707732	0.921537	0.87569
Sovereign PB Származtatott Alap	E	EUR	HU0000726641	0.007999	0.008194

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

## IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2022.12.30		2023.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	27 402 400	5,36	20 558 900	26,11
Részvény - GMU	49 913 176	9,77		
Egyéb külföld nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	8 170 736	1,60		
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	85 486 312	16,72	20 558 900	26,11
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	28 153 265	5,51		

Egyéb átruházható értékpapírok	28 153 265	5,51		
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	287 204 342	56,19	58 172 150	73,89
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	110 289 204	21,58		
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	397 493 546	77,77	58 172 150	73,89
Értékpapírok összesen	511 133 123	100,00	78 731 050	100,00

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

Budapest, 2023. augusztus 31.

---

DIALÓG Alapkezelő Zrt.