

Féléves jelentés 2013

DIALÓG EURO Származtatott Befektetési Alap

PSZÁF lajstromszám: 1111-380
PSZÁF engedélyszám: EN-III/TTE-142/2010
ISIN kód: HU0000708714

Általános adatok:

Az Alap megnevezése:	DIALÓG EURO 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: 2096, Üröm, Pillangó u. 12) – Szovics Zsolt /005784
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.) Hungária Értékpapír Zrt. székhelye (2700 Cegléd Rákóczi út 30.)

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

Megnevezés	2012.12.28.		2013.06.28.	
	Összeg / Érték (EUR)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (EUR)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	597 229	18,46	759 354	13,31
Repo				
Átruházható értékpapírok	2 813 258	86,93	5 038 441	88,32
Származékos ügyletek	2 864	0,09	-2 339	-0,04
Egyéb eszközök		0,00		0,00
Összes eszköz	3 413 350	105,48	5 795 456	101,59
Kötelezettségek	-173 891	-5,37	-90 956	-1,59
Nettó eszközérték	3 236 101	100,00	5 704 499	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2012.12.28.	2013.06.28.
alap	soro zat	deviz a	ISIN		
Dialóg EURÓ Származtatott Deviza Alap	A	EUR	HU0000708714	291 667 601	490 429 842

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2012.12.28.	2013.06.28.
alap	soro zat	deviza	ISIN		
Dialóg EURÓ Származtatott Deviza Alap	A	EUR	HU0000708714	0.011095	0.011632

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2012.12.28.		2013.06.28.	
	Összeg / Érték (EUR)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (EUR)	Százalékban (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen				
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	1 677 460	59,63	2 019 619	40,08
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	477 427	16,97	1 115 383	22,14
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld	410 373	14,59	794 422	15,77

- Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők				
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	247 997	8,82	329 187	6,53
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok			779 830	15,48
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	2 813 258	100,00	5 038 441	100,00
Értékpapírok összesen	2 813 258	100,00	5 038 441	100,00

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

A befektetési politika szerint fordulónapon az eszközök között a legnagyobb eszközcsoport a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok – a kötvények aránya változatlanul 88 %-ot tesz ki. Ezen belül is az államkötvényekben és állami garanciás kötvényekben 62 % van, míg a vállalati kötvények aránya 38 % körül van. A bankbetétek aránya az összportfolióban kismértékben lecsökkent 18,46 %-ról 13,31 %-ra.

Budapest, 2013. augusztus 30.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.