

Féléves jelentés 2013

DIALÓG Octopus Származtatott Befektetési Alap

PSZÁF lajstromszám: 1111-395
PSZÁF engedélyszám: EN-III/TTE-339/2010
ISIN kód: HU0000709241

Általános adatok:

Az Alap megnevezése:	DIALÓG Octopus Származtatott Deviza 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 (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	262 619 932	19,67	195 232 341	15,43
Repo				
Átruházható értékpapírok	1 146 372 364	85,86	1 094 085 850	86,50
Származékos ügyletek	-27 033 546	-2,02	-14 725 055	-1,16
Egyéb eszközök		0,00	508 520	0,04
Összes eszköz	1 381 958 750	103,50	1 275 101 656	100,81
Kötelezettségek	-46 788 643	-3,50	-10 206 047	-0,81
Nettó eszközérték	1 335 170 107	100,00	1 264 895 609	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	sorozat	deviza	ISIN		
Dialóg Octopus Származtatott Alap	A	HUF	HU0000709241	1 266 362 381	1 149 453 046

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	sorozat	deviza	ISIN		
Dialóg Octopus Származtatott Alap	A	HUF	HU0000709241	1.0543	1.1004

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 (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények			8 697 855	0,79
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	140 741 315	12,28	165 401 540	15,12
Részvény - GMU	154 889 622	13,51	117 774 034	10,76
Részvény - Egyéb külföld	137 752 592	12,02	57 315 658	5,24
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	433 383 529	37,80	349 189 087	31,92
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				

összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	443 713 735	38,71	252 899 266	23,12
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	157 093 072	13,70	316 073 114	28,89
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	112 182 028	9,79	48 231 349	4,41
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok			124 311 259	11,36
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld			3 381 776	0,31
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	712 988 835	62,20	744 896 764	68,08
Értékpapírok összesen	1 146 372 364	100,00	1 094 085 850	100,00

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

A befektetési politika szerint fordulónapon az eszközök között a bankbetétek aránya tovább csökkent 19,7%-ról 15,43 %-ra. Az átruházható értékpapírok aránya továbbra is 85 % felett van. Ezen eszközosztályon belül a hazai részvények aránya kissé megnőtt (15 %-ra), míg a külföldi részvények aránya lecsökkent 15 %-ra. A kötvények között 10 % felé emelkedett a nem hazai kibocsátású kötvények aránya. A negatív eredménytartalom a tőkeáttételes GFT pozíciókon erőteljesen lecsökkent 2013 első félévében.

Budapest, 2013. augusztus 30.

DIALÓG Alapkezelő Zrt.