



Diófa Optimus II. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2018.

A **Diófa Optimus II. Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2018 első félévére (2017.12.31-2018.06.30.; a továbbiakban: tárgyidőszak) vonatkozó jelentése a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény (Kbftv.) 131.§ és 132. § valamint az ezen bekezdésben hivatkozott 6. melléklet I–IV. szakaszában megfogalmazott kötelező tartalmi elemek szerint készült az Alap 2018 első félévi működésének bemutatása érdekében.

I. ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Nyilvántartásba vétel dátuma(MNB)	2015.08.11.
Lajstromszáma	1121-68
Típusa	nyilvános, zártkörű sorozattal, nyíltvégű határozatlan futamidejű értékpapír befektetési alap
Kockázati szint	mérsékelt
Javasolt minimális befektetési időtáv	1 év
Referencia index	100% RMAX Index +1%

„A” sorozat

ISIN azonosító	HU0000715115
Folyamatos forgalmazás kezdete	2015. június 29.
Típusa	nyilvános
Befektetési jegyek visszaváltása	T+15

„I” sorozat

ISIN azonosító	HU0000714035
Folyamatos forgalmazás kezdete	2014. augusztus 12.
Típusa	zártkörű
Befektetési jegyek visszaváltása	T+1

Alapkezelő

Neve	Diófa Alapkezelő Zrt.
Székhelye	1013 Budapest, Krisztina tér 2.
Cégjegyzékszám	01-10-046307
Tevékenységi kör	befektetési alapkezelés, portfóliókezelés
Felügyeleti engedély száma	EN-III./M-393/2009.
Felügyeleti engedély kelte	2009. május 25.
Alapkezelő honlapja	www.diofaalapkezelo.hu

Letétkezelő és Forgalmazó

Neve	ERSTE BANK HUNGARY ZRT.
Székhelye	1138 Budapest, Népfürdő utca. 24-26.

Az alap könyvvizsgálója

Cégnév	Trusted Adviser Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft.
Székhely	1037 Budapest, Iglice utca 3. fszt. 3.
Cégjegyzékszám	01-09-279282
MKVK nyilvántartási szám	002588

II. VAGYONKIMUTATÁS

Kategória	2017.12.31*		2018.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1 967 058 696 Ft	33,74%	4 517 645 620 Ft	76,46%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Jelzáloglevelek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Magyar és külföldi részvények	334 305 030 Ft	5,73%	187 309 260 Ft	3,17%
Kollektív befektetési értékpapírok	972 116 460 Ft	16,67%	968 223 064 Ft	16,39%
Átruházható értékpapírok	3 273 480 186 Ft	56,14%	5 673 177 944 Ft	96,01%
Banki egyenlegek	310 145 459 Ft	5,32%	103 799 679 Ft	1,76%
Bankbetétek	2 275 000 000 Ft	39,02%	0 Ft	0,00%
Aktív időbeli elhatárolások	952 407 Ft	0,00%	932 233 Ft	
Származékos ügyletek eredménye	-31 552 662 Ft	-0,54%	-7 196 325 Ft	-0,12%
Egyéb követelés	4 675 000 Ft	0,08%	214 411 718 Ft	3,63%
Összes eszköz	5 832 700 390 Ft	100,04%	5 985 125 249 Ft	101,29%
Kötelezettségek	-2 262 645 Ft	-0,04%	-76 380 845 Ft	-1,29%
Nettó eszközérték	5 830 437 745 Ft	100,00%	5 908 744 404 Ft	100,00%

* A számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatok alapján.

III. A FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA ÉS AZ EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

	2017.12.29	2018.06.29
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	5 048 693 596	5 363 498 069
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,154830	1,101650

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

IV.1. A számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatok alapján

Kategória	2017.12.31		2018.06.30	
	Eszköztérték	Arány	Eszköztérték	Arány
Banki egyenlegek	310 145 459 Ft	5,32%	103 799 679 Ft	1,76%
Bankbetétek	2 275 000 000 Ft		0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	3 273 480 186 Ft	56,14%	5 673 177 944 Ft	96,01%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Egyéb átruházható értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	-31 552 662 Ft	-0,54%	-7 196 325 Ft	-0,12%
Egyéb követelés	4 675 000 Ft	0,08%	214 411 718 Ft	3,63%
Aktív időbeli elhatárolások	952 407 Ft	0,02%	932 233 Ft	0,02%
Összes eszköz	5 832 700 390 Ft	127,62%	5 985 125 249 Ft	101,29%
Kötelezettségek	-2 262 645 Ft	-27,62%	-76 380 845 Ft	-1,29%
Nettó eszköztérték	5 830 437 745 Ft	100,00%	5 908 744 404 Ft	100,00%

IV.2. Az Alapkezelő és a letétkezelő által számolt nettó eszközérték kimutatás alapján

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2017.12.29	2018.06.29	Változás
Betét és betétfellegű eszközök	0,00%	100,00%	43,86%	3,99%	-39,87%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzeti központi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	33,74%	54,12%	20,38%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Jelzáloglevelek	0,00%	50,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	5,73%	25,51%	19,77%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	16,67%	16,39%	-0,29%
Összesen			100,00%	100,00%	

Az alap portfóliójában félév során továbbra is a hazai állampapírok és az állami garanciával rendelkező egyéb kötvények szerepelnek a legmagasabb arányban. Emellett a magyar és külföldi részvények és a kollektív befektetési értékpapírok is megtalálhatóak a portfólió összetételében.

Budapest, 2018. augusztus 14.

[Handwritten signature]

Diófa Alapkezelő Zrt.