



Diófa Optimus II. Befektetési Alap

Féléves Jelentés 2017.

A **Díófa Optimus II. Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2017 első félévére (2016.12.31-2017.06.30.; a továbbiakban: tárgydőszak) 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 2016 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	Díófa 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.diofaalapkezelő.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
A könyvvizsgálatért személyében is felelős személy adatai	Szovics Zsolt
MKVK tagszám	005784

II. VAGYONKIMUTATÁS

Kategória	2016.12.31*		2017.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1 375 095 E Ft	41,82%	1 834 434 E Ft	33,46%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 E Ft	0,00%	0 E Ft	0,00%
Jelzáloglevelek	178 830 E Ft	5,44%	188 073 E Ft	3,43%
Magyar és külföldi részvények	307 888 E Ft	9,36%	1 575 931 E Ft	28,74%
Befektetési jegyek és kollektív befektetési értékpapírok	114 197 E Ft	3,47%	1 456 132 E Ft	26,56%
Átruházható értékpapírok	1 976 010 E Ft	60,09%	5 054 570 E Ft	92,19%
Banki egyenlegek	2 115 725 E Ft	64,35%	322 048 E Ft	5,87%
Bankbetétek	0 E Ft	0,00%	0 E Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	9 475 E Ft	0,29%	17 002 E Ft	0,31%
Egyéb követelés	94 877 E Ft	2,89%	291 420 E Ft	5,32%
Egyéb eszköz	111 E Ft	0,00%	929 E Ft	0,02%
Összes eszköz	4 196 198 E Ft	127,62%	5 685 969 E Ft	103,70%
Kötelezettségek	-907 993 E Ft	-27,62%	-203 070 E Ft	-3,70%
Nettó eszközérték	3 288 205 E Ft	100,00%	5 482 899 E 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

	2016.12.30	2017.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	3 107 961 386	347 729 103
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,057985	1,084845

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

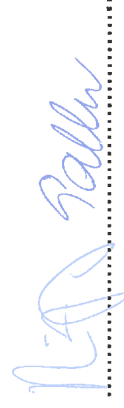
Kategória	2016.12.31		2017.06.30	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Banki egyenlegek	2 115 725 146 Ft	64,35%	322 048 038 Ft	5,87%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	1 976 009 517 Ft	60,09%	4 127 764 630 Ft	75,28%
Más szabályozott piacon forgalmazott 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%	926 805 580 Ft	16,90%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	9 474 723 Ft	0,29%	17 001 820 Ft	0,31%
Egyéb eszköz	111 420 Ft	0,00%	928 484 Ft	0,02%
Egyéb követelés	94 877 440 Ft	2,89%	291 420 068 Ft	5,32%
Összes eszköz	4 196 198 246 Ft	127,62%	5 685 968 620 Ft	103,70%
Kötelezettségek	-907 992 901 Ft	-27,62%	-203 069 238 Ft	-3,70%
Nettó eszközérték	3 288 205 345 Ft	100,00%	5 482 899 382 Ft	100,00%

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2016.12.30	2017.06.30	Változás
Betét és betétjellegű eszközök	0,00%	100,00%	39,91%	7,81%	-32,09%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzeti központi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	41,82%	33,46%	-8,36%
Állampapír fedezete mellett kötött repó megállapodás	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Jelzáloglevelek	0,00%	50,00%	5,44%	3,43%	-2,01%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	9,36%	28,74%	19,38%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	3,47%	26,56%	23,08%
Összesen			100,00%	100,00%	

A portfólió összetételében továbbra is a hazai állampapírok és az állami garanciával rendelkező egyéb kötvények szerepelnek a legmagasabb arányban, melyeknek súlya a jelzáloglevelekéhez hasonlóan csökkent a félév során, a vállalati kötvények, a részvények és a befektetési jegyek javára.

Budapest, 2017. augusztus 28.



Diófa Alapkezelő Zrt.