



Diófa Optimus I. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2017.

A **Díófa Optimus I. 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

Díófa Optimus I. Befektetési Alap alapadatai

Nyilvántartásba vétel dátuma(MNB)	2012. június 21.
Lajstromszáma	1121-55
Típusa	nyilvános, zártkörű sorozattal, nyíltvégű határozatlan futamidejű értékpapír befektetési alap
Kockázati szint	közepes
Javasolt minimális befektetési időtáv	1 év
Referencia index	100% RMAX Index +1%

„A” sorozat

ISIN azonosító	HU0000715107
Folyamatos forgalmazás kezdete	2015. augusztus 10.
Típusa	nyilvános
Befektetési jegyek visszaváltása	T+15 nap

„I” sorozat

ISIN azonosító	HU0000711544
Folyamatos forgalmazás kezdete	2012. június 21.
Típusa	zártkörű
Befektetési jegyek visszaváltása	T+1 nap

Alapkezelő

Neve	Díófa Alapkezelő Zrt.
Székhelye	1013 Budapest, Krisztina tér 2.
Cégjegyzékszám	01-10-046307
Tevékenységi kör	befektetési alapkezelés, portfóliókezelés
Felügyeletei engedély száma	EN-III./M-93/2009.
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	0005784

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	6 612 159 E Ft	69,59%	5 377 232 Ft	71,01%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 E Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Jelzáloglevelek	951 036 E Ft	10,00%	1 347 484 E Ft	17,80%
Magyar és külföldi részvények	0 E Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Kollektív befektetési értékpapírok	0 E Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Átruházható értékpapírok	7 563 195 E Ft	79,58%	6 724 716 E Ft	88,81%
Banki egyenlegek	1 828 132 E Ft	19,24%	102 856 E Ft	1,36%
Bankbetétek	0 E Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	477 E Ft	0,01%	0 Ft	0,00%
Egyéb eszköz	114 571 E Ft	1,21%	747 911 E Ft	9,88%
Összes eszköz	9 506 375 E Ft	100,04%	7 575 483 E Ft	100,05%
Kötelezettségek	-4 259 E Ft	-0,04%	-3 493 E Ft	-0,05%
Nettó eszközérték	9 502 116 E Ft	100,00%	7 571 990 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)	6 800 570 274	5 309 462 829
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,397194	1,426130

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

Kategória	2016.12.31		2017.06.30	
	Eszköztérték	Arány	Eszköztérték	Arány
Banki egyenlegek	1 828 131 654 Ft	19,24%	102 856 056 Ft	1,36%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	7 563 195 117 Ft	79,58%	6 724 716 302 Ft	88,81%
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	477 383 Ft	0,01%	0 Ft	0,00%
Egyéb eszköz	114 571 326 Ft	1,21%	747 911 117 Ft	9,88%
Összes eszköz	9 506 375 480 Ft	100,04%	7 575 483 475 Ft	100,05%
Kötelezettségek	-4 259 555 Ft	-0,04%	-3 493 037 Ft	-0,05%
Nettó eszköztérték	9 502 115 925 Ft	100,00%	7 571 990 438 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%	20,41%	11,19%	-9,22%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	69,59%	71,01%	1,43%
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%	25,00%	10,00%	17,80%	7,80%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Összesen			100,00%	100,00%	

A portfólió összetételében továbbra is a hazai állampapírok és az állami garanciával rendelkező egyéb kötvények találhatók a legmagasabb arányban. A betét jellegű eszközök aránya csökkent, míg az állampapírok és a jelzáloglevelek súlya növekedett az előző félévhez képest.

Budapest, 2017. augusztus 28.



Diófa Alapkezelő Zrt.