



# Diófa Optimus I. Befektetési Alap

## Féléves Jelentés

### 2018.

A **Díófa Optimus I. Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2018 első félévére (2017.12.31-2018.06.30.; 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 2018 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<br>határozatlan futamidejű értékpapír befektetési<br>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         | <a href="http://www.diofaalapkezelő.hu">www.diofaalapkezelő.hu</a> |

#### **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 | 6 507 025 804 Ft        | 84,09%         | 6 907 339 271 Ft        | 98,68%         |
| Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok                                                                                                                                      | 500 051 500 Ft          | 6,46%          | 0 Ft                    | 0,00%          |
| Jelzáloglevelek                                                                                                                                                                    | 0 Ft                    | 10,00%         | 0 Ft                    | 0,00%          |
| Magyar és külföldi részvények                                                                                                                                                      | 0 Ft                    | 0,00%          | 0 Ft                    | 0,00%          |
| Kollektív befektetési értékpapírok                                                                                                                                                 | 0 Ft                    | 0,00%          | 0 Ft                    | 0,00%          |
| <b>Átruházható értékpapírok</b>                                                                                                                                                    | <b>7 007 077 304 Ft</b> | <b>79,58%</b>  | <b>6 907 339 271 Ft</b> | <b>98,68%</b>  |
| Banki egyenlegek                                                                                                                                                                   | 109 277 651 Ft          | 1,41%          | 34 313 075 Ft           | 0,49%          |
| Aktív időbeli elhatárolás                                                                                                                                                          | 4 514 Ft                | 0,00%          | 0 Ft                    | 0,00%          |
| Bankbetétek                                                                                                                                                                        | 625 000 000 Ft          | 8,08%          | 0 Ft                    | 0,00%          |
| Származékos ügyletek eredménye                                                                                                                                                     | 0 Ft                    | 0,00%          | -2 793 100 Ft           | -0,04%         |
| Egyéb eszköz                                                                                                                                                                       | 0 Ft                    | 0,00%          | 64 024 424 Ft           | 0,91%          |
| <b>Összes eszköz</b>                                                                                                                                                               | <b>7 741 359 469 Ft</b> | <b>100,04%</b> | <b>7 002 883 670 Ft</b> | <b>100,04%</b> |
| Kötelezettségek                                                                                                                                                                    | -3 413 231 Ft           | -0,04%         | -3 106 085 Ft           | -0,04%         |
| <b>Nettó eszközérték</b>                                                                                                                                                           | <b>7 737 946 238 Ft</b> | <b>100,00%</b> | <b>6 999 777 585 Ft</b> | <b>100,00%</b> |

\* 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)    | 5 309 462 829 | 4 897 831 411 |
| Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft) | 1,457362      | 1,429115      |

#### IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

| Kategória                                                     | 2017.12.31*<br>Eszköztérték | Arány          | 2018.06.30*<br>Eszköztérték | Arány          |
|---------------------------------------------------------------|-----------------------------|----------------|-----------------------------|----------------|
| Banki egyenlegek                                              | 109 277 651 Ft              | 1,41%          | 34 313 075 Ft               | 0,49%          |
| Bankbetétek                                                   | 625 000 000 Ft              |                | 0 Ft                        | 0,00%          |
| A törzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok      | 6 507 025 804 Ft            | 79,58%         | 6 907 339 271 Ft            | 98,68%         |
| 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                       | 500 051 500 Ft              | 0,00%          | 0 Ft                        | 0,00%          |
| Származékos ügyletek eredménye                                | 0 Ft                        | 0,00%          | -2 793 100 Ft               | -0,04%         |
| Aktív időbeli elhatárolások                                   | 4 514 Ft                    | 0,00%          | 0 Ft                        | 0,00%          |
| Egyéb eszköz                                                  | 0 Ft                        | 0,00%          | 64 024 424 Ft               | 0,91%          |
| <b>Összes eszköz</b>                                          | <b>7 741 359 469 Ft</b>     | <b>100,04%</b> | <b>7 002 883 670 Ft</b>     | <b>100,04%</b> |
| Kötelezettségek                                               | -3 413 231 Ft               | -0,04%         | -3 106 085 Ft               | -0,04%         |
| <b>Nettó eszköztérték</b>                                     | <b>7 737 946 238 Ft</b>     | <b>100,00%</b> | <b>6 999 777 585 Ft</b>     | <b>100,00%</b> |

## 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 betétjellegű eszközök                                                                                                                                                           | 0,00%           | 100,00%         | 9,45%          | 1,32%          | -8,13%   |
| Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzeti központi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 0,00%           | 100,00%         | 90,55%         | 98,68%         | 8,13%    |
| 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%          | 0,00%          | 0,00%          | 0,00%    |
| 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%    |
| <b>Összesen</b>                                                                                                                                                                          |                 |                 | <b>100,00%</b> | <b>100,00%</b> |          |

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 súlya növekedett az előző félévhez képest.

Budapest, 2018. augusztus 14.



Diófa Alapkezelő Zrt.