



Diófa Optimus I. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2019.

A Diófa Optimus I. Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) 2019 első félévére (2018.12.31-2019.06.30.; 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 2019 első félévi működésének bemutatása érdekében.

I. ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Diófa 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	Diófa Alapkezelő Zrt.
Székhelye	1013 Budapest, Krisztina tér 2.
Cégjegyzékszám	01-10-046307
Tevékenységi kör	befektetési alapkezelés, portfóliókezelés
Felügyeleti 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

II. VAGYONKIMUTATÁS

Kategória	2018.12.31*		2019.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	4 992 355 310 Ft	75,57%	3 674 060 420 Ft	68,11%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1 057 777 402 Ft	16,01%	1 054 078 244 Ft	19,54%
Jelzáloglevelek	466 218 000 Ft	7,06%	493 949 790 Ft	9,16%
Magyar és külföldi részvények	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Kollektív befektetési értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Átruházható értékpapírok	6 516 350 712 Ft	98,63%	5 222 088 454 Ft	96,81%
Banki egyenlegek	49 351 943 Ft	0,75%	57 510 740 Ft	1,07%
Aktív időbeli elhatárolás	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	-9 919 656 Ft	-0,15%	-1 855 598 Ft	-0,03%
Egyéb eszköz	53 661 585 Ft	0,81%	119 031 164 Ft	2,21%
Összes eszköz	6 609 444 584 Ft	100,04%	5 396 774 760 Ft	100,05%
Kötelezettségek	-2 859 514 Ft	-0,04%	-2 704 064 Ft	-0,05%
Nettó eszközérték	6 606 585 070 Ft	100,00%	5 394 070 696 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

	2018.12.28	2019.06.28
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	4 547 831 411	3 708 163 443
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,452520	1,454581

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

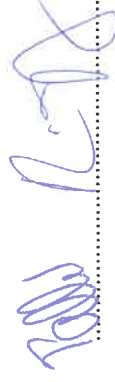
Kategória	2018.12.31*		2019.06.30*	
	Eszközték	Arány	Eszközték	Arány
Banki egyenlegek	49 351 943 Ft	0,75%	34 313 075 Ft	1,07%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	5 458 573 310 Ft	82,62%	4 168 010 210 Ft	77,27%
Más szabályozott piacon forgalmazott 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	1 057 777 402 Ft	16,01%	1 054 078 244 Ft	19,54%
Származékos ügyletek eredménye	-9 919 656 Ft	-0,15%	-1 855 598 Ft	-0,03%
Aktív időbeli elhatárolások	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Egyéb eszköz	53 661 585 Ft	0,81%	119 031 164 Ft	2,21%
Összes eszköz	6 609 444 584 Ft	100,04%	5 396 774 760 Ft	100,05%
Kötelezettségek	-2 859 514 Ft	-0,04%	-2 704 064 Ft	-0,05%
Nettó eszközték	6 606 585 070 Ft	100,00%	5 394 070 696 Ft	100,00%

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2018.12.28	2019.06.28	Változás
Betét és betétjellegű eszközök	0,00%	100,00%	2,37%	3,22%	0,85%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzeti központi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	74,80%	68,09%	-6,71%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	15,85%	19,53%	3,69%
Jelzáloglevelek	0,00%	25,00%	6,98%	9,15%	2,17%
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. Az egyéb kötvények és jelzáloglevelek aránya kis mértékben bővült a hazai állampapírok és az állami garanciával rendelkező egyéb kötvények kárára.

Budapest, 2019. augusztus 24.



Diófa Alapkezelő Zrt.