



Diófa Optimus II. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2019.

A **Diófa Optimus II. 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

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	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	4 228 193 554 Ft	72,48%	1 924 185 375 Ft	55,76%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 Ft	0,00%	284 997 007 Ft	8,26%
Jelzáloglevelek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Magyar és külföldi részvények	190 373 020 Ft	3,26%	342 063 611 Ft	9,91%
Kollektív befektetési értékpapírok	886 437 377 Ft	15,19%	595 709 663 Ft	17,26%
Átruházható értékpapírok	5 305 003 951 Ft	90,93%	3 146 955 656 Ft	91,19%
Banki egyenlegek	319 377 416 Ft	5,47%	93 822 243 Ft	2,72%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Aktív időbeli elhatárolások	846 734 Ft	0,01%	536 490 Ft	0,02%
Származékos ügyletek eredménye	938 734 Ft	0,02%	-462 673 Ft	-0,01%
Egyéb követelés	210 038 687 Ft	3,60%	211 353 736 Ft	6,12%
Összes eszköz	5 836 205 367 Ft	100,04%	3 452 205 452 Ft	100,04%
Kötelezettségek	-2 222 629 Ft	-0,04%	-1 322 883 Ft	-0,04%
Nettó eszközérték	5 833 982 738 Ft	100,00%	3 450 882 569 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)	5 363 498 069	3 107 961 386
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,087662	1,110323

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

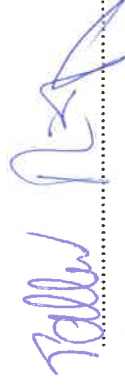
Kategória	2018.12.31		2019.06.30	
	Eszköztérték	Arány	Eszköztérték	Arány
Banki egyenlegek	319 377 416 Ft	5,47%	93 822 243 Ft	2,72%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	4 418 566 574 Ft	75,74%	2 551 245 993 Ft	73,93%
Más szabályozott piacon forgalmazott 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	886 437 377 Ft	15,19%	595 709 663 Ft	17,26%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	938 734 Ft	0,02%	-462 673 Ft	-0,01%
Egyéb követelés	210 038 687 Ft	3,60%	211 353 736 Ft	6,12%
Aktív időbeli elhatárolások	846 579 Ft	0,01%	536 490 Ft	0,02%
Összes eszköz	5 836 205 367 Ft	100,04%	3 452 205 452 Ft	100,04%
Kötelezettségek	-2 222 629 Ft	-0,04%	-1 322 883 Ft	-0,04%
Nettó eszköztérték	5 833 982 738 Ft	100,00%	3 450 882 569 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%	9,07%	8,81%	-0,26%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	72,47%	55,76%	-16,71%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	0,00%	8,26%	8,26%
Jelzáloglevelek	0,00%	50,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	3,26%	9,91%	6,65%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	15,20%	17,26%	2,07%
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, a kollektív befektetési értékpapírok és az egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok is megtalálhatóak a portfólió összetételében.

Budapest, 2019. augusztus 24.



Diófa Alapkezelő Zrt.