



Diófa Optimus II. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2020.

A **Diófa Optimus II. Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2020 első félévére (2019.12.31-2020.06.30.; 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 2020 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.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	2019.12.31*		2020.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	400 009 600 Ft	16,75%	751 812 634 Ft	30,05%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	434 990 429 Ft	18,21%	456 682 865 Ft	18,25%
Jelzáloglevelek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Magyar és külföldi részvények	566 523 211 Ft	23,72%	28 807 440 Ft	1,15%
Kollektív befektetési értékpapírok	408 501 904 Ft	17,10%	951 355 172 Ft	38,03%
Átruházható értékpapírok	1 810 025 144 Ft	75,77%	2 188 658 111 Ft	87,48%
Banki egyenlegek	368 656 240 Ft	15,43%	179 504 739 Ft	7,17%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Aktív időbeli elhatárolások	1 070 101 Ft	0,04%	435 716 Ft	0,02%
Származékos ügyletek eredménye	2 587 772 Ft	0,11%	0 Ft	0,00%
Egyéb követelés	208 211 292 Ft	8,72%	156 695 972 Ft	6,26%
Összes eszköz	2 390 550 549 Ft	100,08%	2 525 294 538 Ft	100,94%
Kötelezettségek	-1 824 519 Ft	-0,08%	-23 404 567 Ft	-0,94%
Nettó eszközérték	2 388 726 030 Ft	100,00%	2 501 889 971 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

	2019.12.31	2020.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	2 108 640 924	2 108 640 924
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,132836	1,186495

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

Kategória	2019.12.31		2020.06.30	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Banki egyenlegek	368 656 240 Ft	15,43%	179 504 739 Ft	7,17%
Bankbetétek	0 Ft		0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	1 401 523 240 Ft	58,67%	1 761 312 011 Ft	70,40%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok			0 Ft	0,00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok			0 Ft	0,00%
Egyéb átruházható értékpapírok	408 501 904 Ft	17,10%	427 346 100 Ft	17,08%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok		0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	2 587 772 Ft	0,11%	0 Ft	0,00%
Egyéb követelés	208 211 292 Ft	8,72%	156 695 972 Ft	6,26%
Aktív időbeli elhatárolások	1 070 101 Ft	0,04%	435 716 Ft	0,02%
Összes eszköz	2 390 550 549 Ft	100,08%	2 525 294 538 Ft	100,94%
Kötelezettségek	-1 824 519 Ft	-0,08%	-23 404 567 Ft	-0,94%
Nettó eszközérték	2 388 726 030 Ft	100,00%	2 501 889 971 Ft	100,00%

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2019.12.31	2020.06.30	Változás
Betét és betétjellegű eszközök	0,00%	100,00%	24,23%	12,52%	-11,71%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	16,75%	30,05%	13,30%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	18,21%	18,25%	0,04%
Jelzáloglevelek	0,00%	50,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	1,60%	1,15%	-0,45%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	39,22%	38,03%	-1,19%
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, 2020. augusztus 24.

.....
Diófa Alapkezelő Zrt.