



Diófa Optimus II. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2021.

A **Diófa Optimus II. Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2021 első félévére (2020.12.31-2021.06.30.; 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 2021 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	2020.12.31*		2021.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	525 000 503 Ft	20,00%	472 867 680 Ft	17,61%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	461 516 452 Ft	17,58%	450 700 771 Ft	16,78%
Jelzáloglevelek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Magyar és külföldi részvények	44 964 000 Ft	1,72%	40 617 480 Ft	1,51%
Kollektív befektetési értékpapírok	1 349 199 939 Ft	51,41%	1 500 819 698 Ft	55,89%
Átruházható értékpapírok	2 380 680 894 Ft	90,71%	2 465 005 629 Ft	91,79%
Banki egyenlegek	100 202 721 Ft	3,82%	37 082 746 Ft	1,38%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Aktív időbeli elhatárolások	-35 573 013 Ft	-1,36%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	192 405 947 Ft	7,33%	-10 383 982 Ft	-0,39%
Egyéb követelés	467 219 Ft	0,02%	194 690 529 Ft	7,25%
Összes eszköz	2 638 183 768 Ft	100,52%	2 686 394 922 Ft	100,04%
Kötelezettségek	-13 577 835 Ft	-0,52%	-1 030 217 Ft	-0,04%
Nettó eszközérték	2 624 605 933 Ft	100,00%	2 685 364 705 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

	2020.12.31	2021.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	2 108 640 924	2 108 640 924
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,244707	1,273747

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

Kategória	2020.12.31		2021.06.30	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Banki egyenlegek	100 202 721 Ft	3,82%	37 082 746 Ft	1,38%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	1 622 079 202 Ft	61,80%	1 618 765 349 Ft	60,27%
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	758 601 692 Ft	28,90%	846 240 280 Ft	31,51%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok			0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	-35 573 013 Ft	-1,36%	-10 383 982 Ft	-0,39%
Egyéb követelés	192 405 947 Ft	7,33%	194 690 529 Ft	7,25%
Aktív időbeli elhatárolások	467 219 Ft	0,02%	509 512 Ft	0,02%
Összes eszköz	2 638 183 768 Ft	100,52%	2 686 904 434 Ft	100,04%
Kötelezettségek	-13 577 835 Ft	-0,52%	-1 030 217 Ft	-0,04%
Nettó eszközérték	2 624 605 933 Ft	100,00%	2 685 874 217 Ft	100,00%

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2020.12.31	2021.06.30	Változás
Betét és betétjellegű eszközök	0,00%	100,00%	9,29%	8,22%	-1,07%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	20,01%	17,61%	-2,40%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	17,58%	16,78%	-0,80%
Jelzáloglevelek	0,00%	50,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	1,71%	1,51%	-0,20%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	51,41%	55,88%	4,47%
Összesen			100,00%	100,00%	

Az alap portfóliójában félév során továbbra is a kollektív befektetési értékpapírok, illetve hazai állampapírok és az állami garanciával rendelkező egyéb kötvények szerepelnek a legmagasabb arányban. Emellett a magyar és külföldi részvények, és az egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok is megtalálhatóak a portfólió összetételében.

Budapest, 2021. augusztus 24.

.....
 Diófa Alapkezelő Zrt.