



Diófa Optimus II. Befektetési Alap

Féléves Jelentés

2022.

A **Diófa Optimus II. Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2022 első félévére (2021.12.31-2022.06.30.; 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 2022 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	1134 Budapest, Kassák Lajos utca 19-25.
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	1082 Budapest, Baross utca 66-68. 3.em.11.
Cégjegyzékszám	01-09-279282
MKVK nyilvántartási szám	002588

Az e pénzügyi termék alapjául szolgáló befektetések nem veszik figyelembe a környezeti szempontból fenntartható gazdasági tevékenységekre vonatkozó uniós kritériumokat.

II. VAGYONKIMUTATÁS

Kategória	2021.12.31*		2022.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	566 153 950 Ft	25,35%	124 583 265 Ft	91,10%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	186 364 381 Ft	8,34%	0 Ft	0,00%
Jelzáloglevelek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Magyar és külföldi részvények	182 600 000 Ft	8,18%	0 Ft	0,00%
Befektetési jegyek és kollektív befektetési értékpapírok	840 515 389 Ft	37,63%	0 Ft	0,00%
Átruházható értékpapírok	1 775 633 720 Ft	79,50%	124 583 265 Ft	91,10%
Banki egyenlegek	288 189 820 Ft	12,90%	77 475 477 Ft	56,65%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	-403 518 Ft	-0,02%	0 Ft	0,00%
Egyéb követelés	170 909 648 Ft	7,65%	-2 706 Ft	0,00%
Egyéb eszköz	165 654 Ft	0,01%	0 Ft	0,00%
Összes eszköz	2 234 495 324 Ft	100,05%	202 056 036 Ft	147,75%
Kötelezettségek	-1 049 953 Ft	-0,05%	-65 302 146 Ft	-47,75%
Nettó eszközérték	2 233 445 371 Ft	100,00%	136 753 890 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

	2021.12.31*	2022.06.30*
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	1 730 914 684	136 748 839
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,291009	1,222889

* Az Alapkezelő és a Letétkezelő által az év utolsó forgalmazási napjára, illetve a féléves záráskor számolt nettó eszközérték kimutatás alapján készül, amely kis mértékben eltér a számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatoktól, mert az alapok nem alkalmaznak elhatárolásokat sem a már ismert, sem a tervezett követelések és kötelezettségek optimális időarányos kimutatására.

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

Kategória	2021.12.31*		2022.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Banki egyenlegek	288 189 820 Ft	12,91%	77 475 477 Ft	56,65%
Bankbetétek	0 Ft	0,00%	0 Ft	0,00%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	935 118 331 Ft	41,87%	124 583 265 Ft	91,10%
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	840 515 389 Ft	37,63%	0 Ft	0,00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok			0 Ft	0,00%
Származékos ügyletek eredménye	-403 518 Ft	-0,02%	0 Ft	0,00%
Egyéb követelés	170 909 648 Ft	7,65%	-2 706 Ft	0,00%
Egyéb eszköz	165 654 Ft	0,01%	0 Ft	0,00%
Összes eszköz	2 234 495 324 Ft	100,05%	202 056 036 Ft	147,75%
Kötelezettségek	-1 049 953 Ft	-0,05%	-65 302 146 Ft	-47,75%
Nettó eszközérték	2 233 445 371 Ft	100,00%	136 753 890 Ft	100,00%

* A számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatok alapján.

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2021.12.31*	2022.06.30*	Változás
Betét és betétjellegű eszközök	0,00%	100,00%	20,52%	8,90%	-11,62%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	25,35%	91,10%	65,75%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	8,34%	16,78%	-8,34%
Jelzáloglevelek	0,00%	50,00%	0,00%		0,00%
Magyar és külföldi részvények	0,00%	50,00%	8,18%	1,51%	-8,18%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	37,63%	55,88%	-37,63%
Származtatott ügyletek	-200,00%	200,00%	-0,02%	0,00%	0,02%
Összesen			100,00%	100,00%	

Alapkezelő és a letétkezelő által számolt nettó eszközérték kimutatás alapján.

Az alap portfóliójában félév során hazai állampapírok és az állami garanciával rendelkező egyéb kötvények szerepelnek a legmagasabb arányban.

Keltezés: Budapest, 2022. augusztus 29.

Diófa Alapkezelő Zrt.