



TAKARÉK FHB ABSZOLÚT HOZAMÚ BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves Jelentés
2015.

A **Takarék FHB Abszolút Hozamú Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2015 első félévére (2014.12.31.-2015.06.30.; 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 2015 első félévi működésének bemutatása érdekében.

I. Általános információk

Takarék FHB Abszolút Hozamú Befektetési Alap alapadatai

Nyilvántartásba vétel dátuma (MNB)	2009. július 8.
Lajstromszáma	1111-339
Befektetési jegyek ISIN azonosítója	HU0000707997
Típusa	nyilvános, nyíltvégű határozatlan futamidejű értékpapír befektetési alap
Befektetési kategória	abszolút hozamú alap
Javasolt minimális befektetési időtáv	1 év
Referencia index	100% RMAX

Alapkezelő

Neve	Diófa Alapkezelő Zrt.
Székhelye	1062 Budapest, Andrássy út 105.
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	Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.
Székhelye	1122 Budapest, Pethényi köz 10.

II. Vagyongkimutatás

Kategória	2014.12.31*		2015.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok és államilag teljes körűen garantált, egyéb kötvények	155 582 589 Ft	32,11%	107 481 657 Ft	12,37%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok			428 697 638 Ft	49,35%
Jelzáloglevelek				
Részcégek, ETF-ek	216 300 Ft	0,04%	122 371 114 Ft	14,09%
Befektetési jegyek			106 791 326 Ft	12,29%
Átruházható értékpapírok	155 798 889 Ft	32,15%	765 341 735 Ft	88,11%
Banki egyenlegek	82 919 768 Ft	17,11%	143 145 635 Ft	16,48%
Bankbetétek	250 000 000 Ft	51,59%	80 000 000 Ft	9,21%
Származékos ügyletek eredménye			-10 620 289 Ft	-1,22%
Egyéb eszköz	128 125 Ft		30 711 Ft	0,00%
Összes eszköz	488 846 782 Ft	100,88%	977 897 792 Ft	112,58%
Kötelezettségek	-4 248 617 Ft	-0,88%	-109 290 246 Ft	-12,58%
Nettó eszközérték	484 598 165 Ft	100,00%	868 607 546 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

	2014.12.31*	2015.06.30*
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	356 743 214	635 710 263
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,358422	1,365974

* Az Alapkezelő és a Letétkezelő által számolt nettó eszközérték kimutatás alapján, amely kis mértékben eltér a számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatoktól, az eltérő elszámolási naptól adódóan.

IV. A befektetési alap összetétele

	2014.12.31*		2015.06.30*	
Kategória	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Banki egyenlegek	82 919 768 Ft	17,11%	143 145 635 Ft	16,48%
Bankbetétek	250 000 000 Ft	51,59%	80 000 000 Ft	9,21%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	155 798 889 Ft	32,15%	658 550 409 Ft	75,82%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				
Egyéb átruházható értékpapírok			106 791 326 Ft	12,29%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok				
Származékos ügyletek eredménye			-10 620 289 Ft	-1,22%
Egyéb eszköz	128 125 Ft		30 711 Ft	0,00%
Összes eszköz	488 846 782 Ft	100,88%	977 897 792 Ft	112,58%
Kötelezettségek	-4 248 617 Ft	-0,88%	-109 290 246 Ft	-12,58%
Nettó eszközérték	484 598 165 Ft	100,00%	868 607 546 Ft	100,00%

* A számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatok alapján.

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2014.12.31*	2015.06.30*	Változás
Pénz	0,00%	30,00%	16,24%	2,65%	-13,59%
Bankbetétek	0,00%	70,00%	51,61%	9,22%	-42,39%
Állampapírok és államilag teljes körűen garantált, egyéb kötvények	0,00%	100,00%	32,15%	47,22%	15,07%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	50,00%		14,52%	14,52%
Jelzáloglevelek	0,00%	25,00%			
Részcvények, ETF-ek	0,00%	90,00%		14,09%	14,09%
Befektetési jegyek	0,00%	20,00%		12,30%	12,30%
Összesen			100%	100%	0%

* Az Alapkezelő és a Letétkezelő által számolt nettó eszközérték kimutatás alapján, amely kis mértékben eltér számviteli törvény rendelkezései szerint kimutatott adatoktól, az eltérő elszámolási naptól adódóan.

A Takaréknál FHB Abszolút Hozamú Befektetési Alap neve 2015. június 26. előtt Takaréknál Invest Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap volt, melybe 2015. június 25-én olvadt be az FHB Abszolút Hozamú Befektetési Alap. A félév végére jelentős portfólió összetétel változás zajlott le az Alapban: a rövid lejáratú bankbetétek és folyószámlapénz terhére növeltük az állampapírokat, a hitelintézeti és vállalati kötvényeket, a hazai és külföldi részvényeket, valamint az ingatlan befektetési alapok befektetési jegyeinek súlyát. A magasabb kockázatú pozíciókat aktívan menedzseltük a félév során.

Budapest, 2015. augusztus 24.

.....
Diófa Alapkezelő Zrt.