



TAKARÉK FHB ABSZOLÚT HOZAMÚ BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves Jelentés

2016.

A **Takarék FHB Abszolút Hozamú Befektetési Alap** (a továbbiakban: Alap) 2016 első félévére (2015.12.31.-2016.06.30.; 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 2016 első félévi működésének bemutatása érdekében.

I. ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Nyilvántartásba vétel dátuma(MNB)	2009.07.08
Lajstromszáma	1111-339
Befektetési jegyek ISIN azonosítója	HU0000707997
Típusa	nyilvános, nyíltvégű határozatlan futamidejű abszolút hozamú értékpapír befektetési alap
Kockázati szint	mérsékelt
Javasolt minimális befektetési időtáv	1 év
Referencia index	100% RMAX

Alapkezelő

Neve	Diófa Alapkezelő Zrt.
Székhelye	1013 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.diofaalapkezeslo.hu

Letétkezelő és Forgalmazó

Neve	TAKARÉK BANK ZRT.
Székhelye	1122 Budapest, Pethényi köz 10.

Az alap könyvvizsgálója

Cégnév	Trusted Adviser Könyvvizsgáló és Tanácsadó kft.
Székhely	2096 Üröm, Pillangó u. 12.
Cégjegyzékszám	13-09-132805

II. VAGYONKIMUTATÁS

Kategória	2015.12.31*		2016.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	332 339 E Ft	36,85%	63 740 E Ft	8,11%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	68 654 E Ft	7,61%	236 885 E Ft	30,13%
Jelzáloglevelek	49 834 E Ft	5,53%	44 634 E Ft	5,68%
Magyar és külföldi részvények	8 782 E Ft	0,97%	31 452 E Ft	4,00%
Kollektív befektetési értékpapírok	111 055 E Ft	12,31%	81 184 E Ft	10,33%
Átruházható értékpapírok	570 664 E Ft	63,28%	457 895 E Ft	58,24%
Banki egyenlegek	216 240 E Ft	23,98%	322 774 E Ft	41,05%
Bankbetétek	120 000 E Ft	13,31%		
Származékos ügyletek eredménye	-3 082 E Ft	-0,34%	-3 135 E Ft	-0,40%
Egyéb eszköz	5 E Ft	0,00%	10 760 E Ft	1,37%
Összes eszköz	903 828 E Ft	100,22%	788 294 E Ft	100,26%
Kötelezettségek	-2 000 E Ft	-0,22%	-2 057 E Ft	-0,26%
Nettó eszközérték	901 827 E Ft	100,00%	786 237 E 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

	2015.12.31	2016.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	668 596 421	579 290 967
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	1,348840	1,357064

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

Kategória	2015.12.31		2016.06.30	
	Eszköztérték	Arány	Eszköztérték	Arány
Banki egyenlegek	216 240 154 Ft	23,98%	322 773 643 Ft	41,05%
Bankbetétek	120 000 000 Ft	13,31%		
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	460 665 736 Ft	51,08%	345 258 855 Ft	43,91%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok				
A közelműltben forgalomba hozott átruházható értékpapírok				
Egyéb átruházható értékpapírok	109 997 991 Ft	12,20%	81 184 109 Ft	10,33%
Származékos ügyletek eredménye	-3 081 618 Ft	-0,34%	-3 135 237 Ft	-0,40%
Egyéb eszköz	5 333 Ft	0,00%	10 759 994 Ft	1,37%
Magyar és külföldi részvények			31 452 498 Ft	4,00%
Összes eszköz	903 827 596 Ft	100,22%	788 293 862 Ft	100,26%
Kötelezettségek	-2 000 145 Ft	-0,22%	-2 056 871 Ft	-0,26%
Nettó eszköztérték	901 827 451 Ft	100,00%	786 236 991 Ft	100,00%

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2015.12.31	2016.06.30	Változás
Pénzpiaci eszközök	0,00%	100,00%	36,72%	41,75%	5,03%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	36,85%	30,00%	-6,86%
Állampapír fedezete mellett kötött repó megállapodás	0,00%	100,00%			
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%	7,61%	8,50%	0,88%
Jelzáloglevelek	0,00%	15,00%	5,53%	5,68%	0,15%
Magyar és külföldi részvények	-90,00%	90,00%	0,97%	3,75%	2,78%
Kollektív befektetési értékpapírok	0,00%	80,00%	12,31%	10,33%	-1,99%
Deviza	0,00%	50,00%			
Összesen			100,00%	100,00%	

Az Alap stratégiájában jelentős változás nem történt a félév során. Az Alap eszközeinek jelentős részét pénzügyi eszközökben, állampapírokban és egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokban tartotta. Az Alap ezen kívül kis arányban hazai és külföldi egyedi részvényeket, illetve ingatlan befektetési jegyeket is tartott.

Budapest, 2016. augusztus 29.



Diófa Alapkezelő Zrt.