



TAKARÉK FHB APOLLO SZÁRMAZTATOTT RÉSZVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves Jelentés

2016.

A **Takarék FHB Apollo Származtatott Részvény 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)	2016. január 5.
Lajstromszáma	1111-664
Típusa	nyilvános, nyíltvégű határozatlan futamidejű értékpapír befektetési alap
Kockázati szint	magas
Javasolt minimális befektetési időtáv	3-5 év
Referencia index	45% S&P500 index + 45% Euro Stoxx 50 index + 10% RMAX index

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-93/2009.
Felügyeleti engedély kelte	2009. május 25.
Alapkezelő honlapja	www.diofaalapkezelo.hu

Letétkezelő és Forgalmazó

Neve	Magyar Takarékszövetkezeti 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	2016.01.13*		2016.06.30*	
	Eszközérték	Arány	Eszközérték	Arány
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok			22 983 E Ft	3,62%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok				0,00%
Jelzáloglevelek				0,00%
Részvények, ETF-ek	99 267 E Ft	50,17%	548 672 E Ft	
Átruházható értékpapírok	99 267 E Ft	50,17%	571 655 E Ft	90,10%
Banki egyenlegek	200 000 E Ft	101,08%	63 292 E Ft	9,98%
Bankbetétek				
Származékos ügyletek eredménye			-1 917 E Ft	-0,30%
Egyéb eszköz	102 149 E Ft	51,63%	3 127 E Ft	0,49%
Összes eszköz	401 416 E Ft	202,88%	636 157 E Ft	100,27%
Kötelezettségek	-203 562 E Ft	-102,88%	-1 715 E Ft	-0,27%
Nettó eszközérték	197 854 E Ft	100,00%	634 442 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

	2016.01.13	2016.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	200 000 000	625 978 086
Egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft)	0,989269	1,009357

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

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

Kategória	2016.01.13 Eszközérték	Arány	2016.06.30 Eszközérték	Arány
Banki egyenlegek	200 000 E Ft	101,08%	63 292 E Ft	9,98%
Bankbetétek				
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	99 267 E Ft	50,17%	571 655 E Ft	90,10%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				
Egyéb átruházható értékpapírok			-1 917 E Ft	-0,30%
Származékos ügyletek eredménye			3 127 E Ft	0,49%
Egyéb eszköz	102 149 E Ft	51,63%		
Magyar és külföldi részvények				
Összes eszköz	401 416 E Ft	202,88%	636 157 E Ft	100,27%
Kötelezettségek	-203 562 E Ft	-102,88%	-1 715 E Ft	-0,27%
Nettó eszközeérték	197 854 E Ft	100,00%	634 442 E Ft	100,00%

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

Kategória	Minimális arány	Maximális arány	2016.01.13	2016.06.30	Változás
Betét és betétjellegű eszközök	0,00%	50,00%	49,83%	9,52%	-40,30%
Állampapírok, állami garancia mellett kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok, nemzetközi pénzügyi intézmény által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	100,00%		3,64%	3,64%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0,00%	20,00%			
Jelzáloglevelek	0,00%	20,00%			
Részvények, ETF-ek	50,00%	100,00%	50,17%	86,84%	36,67%
Összesen			100,00%	100,00%	

Az Alap az indulása után folyamatosan töltötte fel a részvények súlyát, félév végére ez az eszközosztály 86,84%-ot tett ki az Alapban. Kis arányban hazai kibocsátású állampapír is szerepel az Alap portfóliójában.

Budapest, 2016. augusztus 29.



Diófa Alapkezelő Zrt.