



**CIB** ALAPKEZELŐ

**CIB ÁZSIAI RÉSZVÉNY SZÁRMAZTATOTT ALAP**

**Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2018**

## 1. Alapadatok

---

### 1.1. A CIB Ázsiai Részvény Származtatott Alap

Megnevezése:	CIB Ázsiai Részvény Származtatott Alap (a továbbiakban: Alap)
Az Alap típusa:	nyilvános
Az Alap fajtája:	nyíltvégű, azaz a futamidő alatt az Alap befektetési jegyei a kezelési szabályzatban foglalt szabályok szerint megvásárolhatók, illetve visszaválthatók
Az Alap futamideje:	az Alap határozott futamidőre, 2016/07/04-2019/07/05 közötti időszakra jött létre
Besorolása:	speciális, származtatott, ABAK-irányelv alapján harmonizált befektetési alap

### 1.2. Az alapkezelő

Neve:	CIB Befektetési Alapkezelő Zrt. (a továbbiakban: Alapkezelő)
Székhelye:	H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.

### 1.3. A forgalmazó

Neve:	CIB Bank Zrt. (a továbbiakban: Forgalmazó)
Székhelye:	H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.

### 1.4. A letétkezelő

Neve:	CIB Bank Zrt. (a továbbiakban: Letétkezelő)
Székhelye:	H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.

### 1.5. Forgalmazási helyek

Neve:	CIB Bank Zrt. központja és fiókjai
Székhelye:	H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.

### 1.6. A könyvvizsgáló

Neve:	Boros Judit (Kamarai tagsági szám: MKVK-005374) KPMG Hungária Kft.
Székhelye:	H-1134 Budapest, Váci út 31.

## 2. A befektetési eszközállomány összetétele

### Az Alap portfóliójában található eszközök és források tételes összetétele

Tárgynap (T. forgalmazás-elszámolási nap)	2017.12.29		2018.06.29	
<b>Saját tőke</b>	4 763 369 471 HUF		4 549 214 608 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	9 918,3140		9 579,5930	
Darabszám	480 260 db		474 886 db	
<b>Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*</b>	<b>Kötelezettség módszer</b>	<b>Bruttó módszer</b>	<b>Kötelezettség módszer</b>	<b>Bruttó módszer</b>
Tényleges	97,79%	85,28%	100,00%	95,45%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
<b>Alap devizaneme</b>	HUF		HUF	
Devizakitettség fedezettségi szintje	0,00%		0,00%	
<b>Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya</b>				
Lejáratkori árfolyamvédelmet biztosító szintetikus betét	3 160 341 656 HUF	66,35%	3 159 052 870 HUF	69,44%
Folyószámla (HUF)	595 804 431 HUF	12,51%	-	-
MÁK 2019/A	903 096 000 HUF	18,96%	846 391 200 HUF	18,61%
HSBC Holdings PLC, Hyundai Motor Co, Lenovo Group Ltd, Samsung Electronics Co Ltd, PetroChina Co Ltd részvényekből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményétől függően hozamot biztosító OTC opció	105 503 530 HUF	2,21%	-	-
<b>I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya</b>	<b>23 680 285 HUF</b>	<b>0,49%</b>	<b>17 810 129 HUF</b>	<b>0,39%</b>
I/1. Hitelállomány	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
I/2. Egyéb kötelezettségek	23 680 285 HUF	0,49%	17 810 129 HUF	0,39%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
<b>II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya</b>	<b>4 787 049 756 HUF</b>	<b>100,00%</b>	<b>4 567 024 737 HUF</b>	<b>100,00%</b>
II/1. Folyószámla, készpénz	595 804 431 HUF	12,45%	206 972 125 HUF	4,53%
II/2. Egyéb követelés	22 304 139 HUF	0,47%	14 354 786 HUF	0,31%
II/3. Lekötött bankbetétek	3 160 341 656 HUF	66,02%	3 159 052 870 HUF	69,17%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	3 160 341 656 HUF	66,02%	3 159 052 870 HUF	69,17%
II/4. Átruházható értékpapírok	903 096 000 HUF	18,87%	1 186 644 956 HUF	25,98%
II/4.1. Állampapírok	903 096 000 HUF	18,87%	846 391 200 HUF	18,53%
II/4.1.1. Kötvények	903 096 000 HUF	18,87%	846 391 200 HUF	18,53%
II/4.1.2. Kincstárjegyek	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.2.3. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.3. Részvények	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.3.2. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.4. Jelzáloglevelek	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.5. Befektetési jegyek	0 HUF	0,00%	340 253 756 HUF	7,45%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,00%	340 253 756 HUF	7,45%
II/5. Származékos ügyletek	105 503 530 HUF	2,20%	0 HUF	0,00%
II/5.1. Határidos	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/5.1.1. Futures	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/5.1.2. Forward	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/5.2. Opciók ügyletek	105 503 530 HUF	2,20%	0 HUF	0,00%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	105 503 530 HUF	2,20%	0 HUF	0,00%
II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép.	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
II/7. Egyéb átruházható értékpapír	0 HUF	0,00%	0 HUF	0,00%
<b>Bruttó eszközérték</b>	<b>4 787 049 756 HUF</b>	<b>100,00%</b>	<b>4 567 024 737 HUF</b>	<b>100,00%</b>
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>4 763 369 471 HUF</b>	<b>99,51%</b>	<b>4 549 214 608 HUF</b>	<b>99,61%</b>

\* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitettségének számítását a *bruttó*, valamint a *kötelezettség módszerrel* számítja ki. A bruttó módszer az Alap teljes kitettségét adja meg, míg a kötelezettség módszer figyelembe veszi az Alapban lévő befektetési eszközök fedezeti és nettósítási hatásait is. Az Alapkezelő az Alap esetében alkalmazható tőkeáttétel (nettó összesített kockázati kitettség) legnagyobb mértékét az Alap típusa, befektetési stratégiája, a tőkeáttétel forrásai, az eszközök és a kötelezettségek aránya, a tőkeáttétel fedezeti biztosítékának mértéke, az Alap mögöttes piacain végrehajtott üzletkötések volumene, természete és kiterjedése, valamint az üzletkötések végrehajtási helyszíneit jelentő pénzügyi szolgáltatók, intézmények, partnerek által képviselt rendszerkockázat alapján állapítja meg. A tőkeáttétel mértéke a tájékoztatási időszakban a feltüntetett tényleges és a megengedett maximális értékek között ingadozott. Az Alapkezelő az Alap nevében kötött szerződések, teljesült megbízások, tőkeáttélt eredményező ügyletek vonatkozásában biztosítékokat nem nyújt, garanciákat nem vállal, valamint ezek újbóli felhasználására jogokat nem szerez és nem biztosít.

### 3. Az Alap forgalmi adatai

#### 3.1. A tájékoztatási időszakban az Alap befektetési jegyeinek forgalmi adatai

	Előző tájékoztatási időszak végén (2017. december 29.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2018. június 29.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	480 260 db		474 886 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		372 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		5 746 db	
tőkeszámla növekedése		3 623 341 HUF	
tőkeszámla csökkenése		56 068 041 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	4 763 369 471 HUF		4 549 214 608 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	9 918,3140		9 579,5930

#### 3.2. A tájékoztatási időszakban az Alap saját tőkéjének és az egy jegyre jutó nettó eszközértékének a változása havi bontásban

	az Alap saját tőkéje	az egy jegyre jutó nettó eszközérték
2016/12/30	4 986 767 812 HUF	10 211,3582
2017/01/31	5 069 554 758 HUF	10 387,5166
2017/02/28	4 961 641 124 HUF	10 176,9321
2017/03/31	5 155 417 469 HUF	10 577,9710
2017/04/28	5 051 454 111 HUF	10 352,5920
2017/05/31	4 928 454 630 HUF	10 119,5521
2017/06/30	4 812 847 443 HUF	9 903,5896
2017/07/31	4 814 561 790 HUF	9 906,7300
2017/08/31	4 758 429 174 HUF	9 799,0313
2017/09/29	4 759 093 434 HUF	9 852,8487
2017/10/31	4 780 306 909 HUF	9 919,3985
2017/11/30	4 785 439 966 HUF	9 943,1309
2017/12/29	4 763 369 471 HUF	9 918,3140
2018/01/31	4 801 390 769 HUF	10 021,2907
2018/02/28	4 690 462 051 HUF	9 790,8064
2018/03/29	4 650 677 855 HUF	9 735,5821
2018/04/27	4 612 038 143 HUF	9 671,1950
2018/05/31	4 616 734 630 HUF	9 695,4985
2018/06/29	4 549 214 608 HUF	9 579,5930



A CIB Gyógyszergyártók Származtatott Alapja, CIB Euró Gyógyszergyártók Származtatott Alapja, CIB Biztos Pont Tőkevédett Származtatott Alap, CIB Autógyártók Tőkevédett Származtatott Alapja, CIB Euró Autógyártók Tőkevédett Származtatott Alapja, CIB Luxusmárkák 2 Tőkevédett Származtatott Alapja, CIB Euró Luxusmárkák 2 Tőkevédett Származtatott Alapja, CIB Tiszta Amerika 2 Származtatott Alap, CIB Euró Tiszta Amerika 2 Származtatott Alap, CIB WebWilág 2 Származtatott Alap, CIB Euró WebWilág 2 Származtatott Alap, CIB Világmárkák Származtatott Alapja, CIB Euró Világmárkák Származtatott Alapja, CIB Szabadidő Származtatott Alap, CIB Stabil Európa 2 Származtatott Alap, CIB Ázsiai Részvény Származtatott Alap, CIB Euró Ázsiai Részvény Származtatott Alap, CIB Olajvállalatok Származtatott Alapja, CIB Dollár Olajvállalatok Származtatott Alapja, CIB Babatermékgyártók Származtatott Alapja, CIB Euró Babatermékgyártók Származtatott Alapja, CIB Édességek Származtatott Alapja, CIB Ipar 4.0 Tőkevédett Származtatott Alap esetében nem került sor referencia-index meghatározására.

Az Alap portfóliójában lévő elemek értékelésének forrásait és módszereit az Alap MNB által elfogadott kezelési szabályzata tartalmazza. Az Alap eszközértékének megállapítását az Alapkezelő végzi, az Alap kezelési szabályzatában meghatározottak szerint, piaci és kereskedés napi elszámolás elvén. Az Alap portfóliójában lévő kamatozó kötvény típusú értékpapirokból, valamint minden eszközből, amelyből kamatjövedelem származik, az időarányos kamat figyelembe vételre kerül az Alap eszközértékének számításakor, hasonlóan a pénzből és a pénzjellegű eszközökből származó hozamokhoz, illetve a realizált és nem realizált árfolyamnyereséghez. Az Alapkezelő kijelenti, hogy az Alap különböző időszakokra számított hozamai az osztalékon, kamaton és árfolyamnyereségen keletkező vissza nem igényelhető forrásadó levonása után, illetve a visszaigényelhető forrásadó figyelembe vételével számítja ki. Magánszemélyek a befektetési jegyek forgalmazónál történő visszaváltásakor hozamot realizálnak. A realizált hozam kamat jövedelemnek minősül, ami a kamatadó hatálya alá tartozik, hasonlóan a hitelintézeti betétben, takarékbetétben és folyószámlán elért kamathoz, illetve a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokon elért kamathoz és hozamhoz. Az adó alapja a visszaváltási ár és az értékpapír megszerzésére fordított érték, valamint az értékpapírok megszerzéséhez kapcsolódó járulékos költségek különbsége. Az adó mértéke a féléves jelentés készítésének időpontjában 15%. Jogi személyek és jogi személyiség nélküli társaságok esetében a befektetési jegyek árfolyamnyeresége és hozama az adóköteles árbevételüket növeli. Ez után a mindenkor érvényes adójogszabályok szerint kell az adót megfizetni. Az Alap Magyarországon nem adóalany, befektetése után forrásadót nem fizet, illetve nem igényelhet vissza. Az Alap teljesítményének bemutatásához szükséges számításokat az Alapkezelő összegyűjti és megőrzi. Az éves jelentésben szereplő hozamok a forgalmazási, számlavezetési költségek és kamatadó levonása előtti, illetve az alapok működési költségeinek, úgy mint alapkezelési díj, letétkezelési díj, könyvvizsgálói díj stb. felszámítása utáni nettó hozamként kerültek meghatározásra. Az éves jelentésben szereplő múltbeli hozamok nem jelentenek garanciát az Alap jövőbeni hozamára nézve. Az egyes alapok hozamadatai az adott alap kibocsátási pénznemében kerülnek megállapításra. Felhívjuk szíves figyelmét arra, hogy az egyes valuta- vagy devizanemek közötti átváltás befolyásolja az Alap által elért eredményt. A hozamok bemutatására a BAMOSZ (Befektetési Alapkezelők Magyarországi Szövetsége) vonatkozó mindenkor hatályos előírásaival összhangban kerül sor. Az 1 évnél hosszabb időszakok hozamait évesítve határozzuk meg (kamatos kamatszámítással, tört kitevővel, 365 napos bázison). Az Alap Tájékoztatója és kezelési szabályzata megtekinthető a [www.cibalap.hu](http://www.cibalap.hu) és a [www.cib.hu](http://www.cib.hu) honlapokon, valamint díjmentesen átvehető a forgalmazási helyeken.