



CIB BABATERMÉKGYÁRTÓK SZÁRMAZTATOTT ALAPJA

Féléves jelentés

CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.

Forgalmazó, Letétkezelő:

CIB Bank Zrt.

2019

1. Alapadatok

1.1. A CIB Babatermékgyártók Származtatottja Alap

| | |
|---------------------|---|
| Megnevezése: | CIB Babatermékgyártók Származtatott Alapja (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, 2017/04/03-2020/04/03 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: | Henye István (Kamarai tagsági szám: MKVK-005674) 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) | 2018.12.28 | | 2019.06.28 | |
|--|--------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
| Saját tőke | 3 987 936 901 HUF | | 4 009 606 309 HUF | |
| Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 9 663,2046 | | 9 937,6575 | |
| Darabszám | 412 693 db | | 403 476 db | |
| Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke* | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer |
| Tényleges | 99,31% | 77,98% | 96,17% | 77,94% |
| Maximális | 120,00% | 120,00% | 120,00% | 120,00% |
| Alap devizaneme | HUF | | HUF | |
| Devizakitettségi fedezettségi szintje | 0,00% | | 0,00% | |
| Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya | | | | |
| Lejáratkori 95%-os árfolymvédelmet biztosító szintetikus betét | 2 767 471 515 HUF | 69,0210% | 2 787 736 108 HUF | 69,5264% |
| Folyószámla (HUF) | 850 728 179 HUF | 21,2172% | 731 317 446 HUF | 18,2391% |
| Hasbro Inc, Johnson & Johnson, Kimberly-Clark Corp, Procter & Gamble Co/The és Walt Disney Co/The részvényekből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményét biztosító OTC opció | 27 405 010 HUF | 0,6835% | 153 386 250 HUF | 3,8255% |
| I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya | 13 428 801 HUF | 0,3356% | 12 860 930 HUF | 0,3197% |
| I/1. Hitelállomány | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| I/2. Egyéb kötelezettségek | 13 428 801 HUF | 0,3356% | 12 860 930 HUF | 0,3197% |
| I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya | 4 001 365 702 HUF | 100,0000% | 4 022 467 239 HUF | 100,0000% |
| II/1. Folyószámla, készpénz | 850 728 179 HUF | 21,2609% | 731 317 446 HUF | 18,1808% |
| II/2. Egyéb követelés | 15 171 710 HUF | 0,3792% | 9 215 178 HUF | 0,2291% |
| II/3. Lékötött bankbetétek | 2 767 471 515 HUF | 69,1632% | 2 787 736 108 HUF | 69,3041% |
| II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű | 2 767 471 515 HUF | 69,1632% | 2 787 736 108 HUF | 69,3041% |
| II/4. Átruházható értékpapírok | 340 589 288 HUF | 8,5118% | 340 812 257 HUF | 8,4727% |
| II/4.1. Állampapírok | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.1.1. Kötvények | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.1.2. Kincstárjegyek | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.2.3. Tőzsdén kívüli | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.3. Részvények | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.3.2. Tőzsdén kívüli | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.4. Jelzáloglevelek | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.4.2. Tőzsdén kívüli | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.5. Befektetési jegyek | 340 589 288 HUF | 8,5118% | 340 812 257 HUF | 8,4727% |
| II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.5.2. Tőzsdén kívüli | 340 589 288 HUF | 8,5118% | 340 812 257 HUF | 8,4727% |
| II/5. Származékos ügyletek | 27 405 010 HUF | 0,6849% | 153 386 250 HUF | 3,8132% |
| II/5.1. Határidős | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.1.1. Futures | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.1.2. Forward | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.2. Opció ügyletek | 27 405 010 HUF | 0,6849% | 153 386 250 HUF | 3,8132% |
| II/5.2.1. Tőzsdei opciók | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.2.2. OTC típusú opciók | 27 405 010 HUF | 0,6849% | 153 386 250 HUF | 3,8132% |
| II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép. | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/7. Egyéb átruházható értékpapír | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| Bruttó eszközérték | 4 001 365 702 HUF | 100,0000% | 4 022 467 239 HUF | 100,0000% |
| Nettó eszközérték | 3 987 936 901 HUF | 99,6644% | 4 009 606 309 HUF | 99,6803% |

* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitétségét a *bruttó*, valamint a *kötelezettség módszerrel* számítja ki. A bruttó módszer az Alap teljes kitétségét 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 kitétség) legnagyobb mértékét az Alap típusa, befektetési stratégiája, a tőkeáttétel forrásai, az eszközök és a kötelezettségek aránya, a tőkeáttételes pozíció biztosítékának mértéke, az Alap mögöttes piacain végrehajtott ügyletek volumene, természete és kiterjedése, valamint az ügyletek végrehajtási helyszíneit jelentő pénzügyi szolgáltatások, 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 (2018. december 28.) | Tájékoztatási időszakban | Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.) |
|--|---|--------------------------|---|
| forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma | 412 693 db | | 403 476 db |
| eladott befektetési jegyek darabszáma | | 710 db | |
| visszaváltott befektetési jegyek darabszáma | | 9 927 db | |
| tőkeszámla növekedése | | 6 938 144 HUF | |
| tőkeszámla csökkenése | | 97 450 216 HUF | |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke | 3 987 936 901 HUF | | 4 009 606 309 HUF |
| az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 9 663,2046 | | 9 937,6575 |

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 |
|------------|----------------------|--------------------------------------|
| 2018/12/28 | 3 987 936 901 HUF | 9 663,2046 |
| 2019/01/31 | 3 971 872 127 HUF | 9 659,1986 |
| 2019/02/28 | 3 977 604 641 HUF | 9 697,6430 |
| 2019/03/29 | 3 983 741 338 HUF | 9 721,3267 |
| 2019/04/30 | 4 028 797 206 HUF | 9 857,0598 |
| 2019/05/31 | 3 976 929 864 HUF | 9 784,6933 |
| 2019/06/28 | 4 009 606 309 HUF | 9 937,6575 |

4. Az Alap hozamadatai

| az alap által 2019/06/28-ig elért hozamok | évesített hozamok | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-------------------|--------|------|------|------|----------------------|------------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| | 1 év | 2 év | 3 év | 4 év | 5 év | indulás- tól mért | naplári évre számított | | | | | | | | |
| | | | | | | | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 |
| CIB Babatermékgyártók Számaztatott Alapja | 3,03% | -0,43% | - | - | - | -0,31% | -2,55% | - | - | - | - | - | - | - | - |

Az Alap által két tetszőlegesen választott időpont között elért, valamint tetszőlegesen választott időponttól 3, 6, 9 hónapos, illetve 1, 2, 3 éves időtávokra számított hozamadatak megtekinthetők a www.cib.hu és a www.cibalap.hu oldalakon. Az Alap múltbeli teljesítménye nem jelent garanciát a jövőbeni hozamra! Az Alap portfóliójában lévő eszközök értékelésének forrásait és módszereit az Alap MNB által elfogadott kezelési szabályzata tartalmazza. Az Alap eszközértékének megállapítását a Letétkezelő végzi, az Alap kezelési szabályzatában meghatározottak szerint, piaci és kereskedés napi elszámolás elvén. Az Alap portfóliójában lévő kamatozó kötvény típusú értékpapírokból, valamint minden eszközből, amelyből kamatjövdelem származik, az időarányos kamat figyelembe van véve az Alap eszközértékének számításakor, hasonlóan a pénzből és a pénzzellegű eszközökből származó hozamokhoz, illetve a realizált és nem realizált árfolyamnyereséghez. Az Alapkezelő kijelenti, hogy az Alap különböző időszakokra számított hozamait 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 realizálnak hozamot. A realizált hozam kamat jövedelemnek minősül, ami a kamatadó hatálya alá tartozik, hasonlóan a hitelintézeti betétben, takarékbetétben és folyószámlán elért kamathoz, illetve a nyilvánosan forgalomba hozott 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 Sza. törvény alkalmazásában a kamatjövdelem adókulcsa a féléves jelentés készítésének időpontjában 15%. A Befektetési jegyek tartós befektetési számlára, illetve nyugdíj-előtakarékossági számlára helyezhetők. Az értékpapír számlán elhelyezett Befektetési jegyek árfolyamnyeresége, illetve hozama után a kifizetőnek minősülő Forgalmazó adót von le. A tartós befektetési számlán, illetve nyugdíj-előtakarékossági számlán elhelyezett Befektetési jegyek árfolyamnyeresége, illetve hozama után a Forgalmazó adót nem von le. 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 Alapot a 2006. évi LIX. számú, az államháztartás egyensúlyát javító különadóról és járadékról szóló törvény 2015. január 1-től hatályos módosítása értelmében különadó-fizetési kötelezettség terheli. Az Alap teljesítményének bemutatásához szükséges számításokat az Alapkezelő összegyűjti és megőrzi. A féléves 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 Alap hozamadatai az Alap kibocsátási pénznemében kerülnek megállapításra. 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).