



## **CIB DOLLÁR OLAJVÁLLALATOK SZÁRMAZTATOTT ALAPJA**

### **Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2018**

# 1. Alapadatok

---

## 1.1. A CIB Dollár Olajvállalatok Származtatott Alapja

Megnevezése:	CIB Dollár Olajvállalatok 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, 2016/10/24-2018/10/26 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:	Nagy Zsuzsanna (Kamarai tagsági szám: MKVK-005421) 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>	6 959 618,46 USD		7 623 113,84 USD	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,0100301		0,0109054	
Darabszám	693 871 648 db		699 024 549 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	89,46%	77,33%	82,50%	46,83%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
<b>Alap devizaneme</b>	USD		USD	
Devizakitettség fedezettségi szintje	USD		USD	
USD	0,00%		0,00%	
<b>Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya</b>				
Lejáratkori árfolyamvédelmet biztosító szintetikus betét	3 534 247,48 USD	50,78%	3 569 081,22 USD	46,82%
REPHUN 02/19/18 USD	1 833 238,80 USD	26,34%	-	-
BP plc, Chevron Corporation, Eni SpA, Exxon Mobil Corporation, Repsol SA részvényekből kialakított befektetési eszközösár teljesítményétől függően hozamot biztosító OTC opció	733 868,19 USD	10,54%	1 334 037,55 USD	17,50%
<b>I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya</b>	<b>20 189,23 USD</b>	<b>0,29%</b>	<b>8 955,10 USD</b>	<b>0,12%</b>
I/1. Hitelállomány	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
I/2. Egyéb kötelezettségek	20 189,23 USD	0,29%	8 955,10 USD	0,12%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
<b>II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya</b>	<b>6 979 807,69 USD</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 632 068,94 USD</b>	<b>100,00%</b>
II/1. Folyószámla, készpénz	844 484,75 USD	12,10%	2 719 009,14 USD	35,63%
II/2. Egyéb követelés	33 968,47 USD	0,49%	9 941,03 USD	0,13%
II/3. Lekötött bankbetétek	3 534 247,48 USD	50,64%	3 569 081,22 USD	46,76%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	3 534 247,48 USD	50,64%	3 569 081,22 USD	46,76%
II/4. Átruházható értékpapírok	1 833 238,80 USD	26,26%	0,00 USD	0,00%
II/4.1. Állampapírok	1 833 238,80 USD	26,26%	0,00 USD	0,00%
II/4.1.1. Kötvények	1 833 238,80 USD	26,26%	0,00 USD	0,00%
II/4.1.2. Kincstárjegyek	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.2.3. Tőzsdén kívüli	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.3. Részvények	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.3.2. Tőzsdén kívüli	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.4. Jelzáloglevelek	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.5. Befektetési jegyek	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/5. Származékos ügyletek	733 868,19 USD	10,51%	1 334 037,55 USD	17,48%
II/5.1. Határidős	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/5.1.1. Futures	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/5.1.2. Forward	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/5.2. Opció ügyletek	733 868,19 USD	10,51%	1 334 037,55 USD	17,48%
II/5.2.1. Tőzsdői opciók	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	733 868,19 USD	10,51%	1 334 037,55 USD	17,48%
II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép.	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
II/7. Egyéb átruházható értékpapír	0,00 USD	0,00%	0,00 USD	0,00%
<b>Bruttó eszközérték</b>	<b>6 979 807,69 USD</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 632 068,94 USD</b>	<b>100,00%</b>
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>6 959 618,46 USD</b>	<b>99,71%</b>	<b>7 623 113,84 USD</b>	<b>99,88%</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, tőkeáttételt 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	693 871 648 db		699 024 549 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		14 629 718 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		9 476 817 db	
tőkeszámla növekedése		149 896,98 USD	
tőkeszámla csökkenése		98 967,99 USD	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	6 959 618,46 EUR		7 623 113,84 USD
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,01003012		0,01090536

#### 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	6 561 535,14 USD	0,01030255
2017/01/31	6 424 179,06 USD	0,01001374
2017/02/28	6 388 196,66 USD	0,00993037
2017/03/31	6 448 319,10 USD	0,00994011
2017/04/28	6 310 805,98 USD	0,00975731
2017/05/31	6 323 891,33 USD	0,00979091
2017/06/30	6 294 415,24 USD	0,00956645
2017/07/31	6 505 672,51 USD	0,00958165
2017/08/31	6 532 890,74 USD	0,00952136
2017/09/29	6 761 407,74 USD	0,00985294
2017/10/31	6 846 785,44 USD	0,00995573
2017/11/30	6 790 448,29 USD	0,00985217
2017/12/29	6 959 618,46 USD	0,01003012
2018/01/31	7 038 472,22 USD	0,01014280
2018/02/28	6 684 483,21 USD	0,00960497
2018/03/29	6 674 504,37 USD	0,00955589
2018/04/27	7 162 864,06 USD	0,01030084
2018/05/31	7 307 660,34 USD	0,01057023
2018/06/29	7 623 113,84 USD	0,01090536



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 WebWílág 2 Származtatott Alap, CIB Euró WebWílág 2 Származtatott Alap, CIB Világmarkák Származtatott Alapja, CIB Euró Világmarkák 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 értékpapírokból, 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.