



CIB EURÓ ÁZSIAI RÉSZVÉNY SZÁRMAZTATOTT ALAP

Féléves jelentés

CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.

Forgalmazó, Letétkezelő:

CIB Bank Zrt.

2017

1. Alapadatok

1.1. A CIB Euró Ázsiai Részvény Származtatott Alap

| | |
|---------------------|---|
| Megnevezése: | CIB Euró Ázsiai Részvény Származtatott Alap (a továbbiakban: Alap) |
| Az Alap típusa: | nyilvános, azaz nyilvános forgalombahozatal útján létrehozott |
| Az Alap fajtája: | nyíltvégű, azaz a futamidő alatt bármikor visszaváltható |
| 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

| Tárgnap (T nap) | 2016.12.30 | | 2017.06.30 | |
|--|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
| Saját tőke | 10,117,846.39 EUR | | 9,789,477.20 EUR | |
| Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 0.01012731 | | 0.00978833 | |
| Darabszám | 999,065,728 db | | 1,000,117,373 db | |
| Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke* | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer |
| Tényleges | 95.31% | 82.16% | 98.32% | 86.53% |
| Maximális | 120.00% | 120.00% | 120.00% | 120.00% |
| Alap devizaneme | EUR | | EUR | |
| Devizakitettség fedezettségi szintje | 0.00% | | 0.00% | |
| Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya | | | | |
| Lejáratkori árfolyamvédelmet biztosító szintetikus betét | 6,831,044.19 EUR | 67.51% | 7,861,001.90 EUR | 80.30% |
| Folyószámla (EUR) | 1,330,708.59 EUR | 13.15% | 1,154,133.47 EUR | 11.79% |
| REPHUN 6 01/11/19 EUR | 1,415,763.60 EUR | 13.99% | - | - |
| HSBC Holdings PLC, Hyundai Motor Co, Lenovo Group Ltd, Samsung Electronics Co Ltd, PetroChina Co Ltd részvényekből kialakított befektetési eszközösár teljesítményétől függően hozamot biztosító OTC opció | 474,641.04 EUR | 4.69% | 164,146.69 EUR | 1.68% |
| I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya | 11,117.97 EUR | 0.11% | 10,990.18 EUR | 0.11% |
| I/1. Hitelállomány | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| I/2. Egyéb kötelezettségek | 11,117.97 EUR | 0.11% | 10,990.18 EUR | 0.11% |
| I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya | 10,128,964.36 EUR | 100.00% | 9,800,467.38 EUR | 100.00% |
| II/1. Folyószámla, készpénz | 1,330,708.59 EUR | 13.14% | 1,154,133.47 EUR | 11.78% |
| II/2. Egyéb követelés | 76,806.94 EUR | 0.76% | 61,562.82 EUR | 0.63% |
| II/3. Lekötött bankbetétek | 6,831,044.19 EUR | 67.44% | 7,861,001.90 EUR | 80.21% |
| II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű | 6,831,044.19 EUR | 67.44% | 7,861,001.90 EUR | 80.21% |
| II/4. Átruházható értékpapírok | 1,415,763.60 EUR | 13.98% | 559,622.50 EUR | 5.71% |
| II/4.1. Állampapírok | 1,415,763.60 EUR | 13.98% | 559,622.50 EUR | 5.71% |
| II/4.1.1. Kötvények | 1,415,763.60 EUR | 13.98% | 559,622.50 EUR | 5.71% |
| II/4.1.2. Kincstárjegyek | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.2.3. Tőzsdén kívüli | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.3. Részvények | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.3.2. Tőzsdén kívüli | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.4. Jelzáloglevelek | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.4.2. Tőzsdén kívüli | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.5. Befektetési jegyek | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/4.5.2. Tőzsdén kívüli | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/5. Származékos ügyletek | 474,641.04 EUR | 4.69% | 164,146.69 EUR | 1.67% |
| II/5.1. Határidős | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/5.1.1. Futures | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/5.1.2. Forward | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/5.2. Opció ügyletek | 474,641.04 EUR | 4.69% | 164,146.69 EUR | 1.67% |
| II/5.2.1. Tőzsdei opciók | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/5.2.2. OTC típusú opciók | 474,641.04 EUR | 4.69% | 164,146.69 EUR | 1.67% |
| II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép. | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| II/7. Egyéb átruházható értékpapír | 0.00 EUR | 0.00% | 0.00 EUR | 0.00% |
| Bruttó eszközérték | 10,128,964.36 EUR | 100.00% | 9,800,467.38 EUR | 100.00% |
| Nettó eszközérték | 10,117,846.39 EUR | 99.89% | 9,789,477.20 EUR | 99.89% |

* 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 ügyletek volumene, természete és kiterjedése, valamint az ügyletek 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 (2016. december 30.) | Tájékoztatási időszakban | Tájékoztatási időszak végén (2017. június 30.) |
|--|---|--------------------------|---|
| forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma | 999,065,728 db | | 1,000,117,373 db |
| eladott befektetési jegyek darabszáma | | 5,285,445 db | |
| visszaváltott befektetési jegyek darabszáma | | 4,233,800 db | |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke | 10,117,846.39 EUR | | 9,789,477.20 EUR |
| az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 0.01012731 | | 0.00978833 |

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 |
|------------|----------------------|--------------------------------------|
| 2013/12/30 | - | - |
| 2014/12/30 | - | - |
| 2015/12/30 | - | - |
| 2016/12/30 | 10,117,846.39 EUR | 0.01012731 |
| 2017/01/31 | 10,305,683.11 EUR | 0.01032566 |
| 2017/02/28 | 10,104,266.75 EUR | 0.01012547 |
| 2017/03/31 | 10,475,022.55 EUR | 0.01048377 |
| 2017/04/28 | 10,252,799.45 EUR | 0.01026254 |
| 2017/05/31 | 9,976,676.06 EUR | 0.01000598 |
| 2017/06/30 | 9,789,477.20 EUR | 0.00978833 |

A CIB Hozamvédeett Betét Alap, CIB Euró Pénzpiaci Alap, CIB Dollár Megtakarítási Alap, CIB Euró Talentum Total Return Alapok Alapja, CIB Talentum Total Return Alapok Alapja, CIB Luxusmárkák 2 Tőkevédeett Származtatott Alapja, CIB Gyógyszergyártók Származtatott Alapja, CIB Euró Gyógyszergyártók Származtatott Alapja, CIB WebVilág 2 Származtatott Alap, CIB Euró WebVilág 2 Származtatott Alap, CIB Biztos Pont Tőkevédeett Származtatott Alap, CIB Autógyártók Tőkevédeett Származtatott Alapja, CIB Euró Autógyártók Tőkevédeett Származtatott Alapja, CIB Világmárkák Származtatott Alapja, CIB Euró Világmárkák Származtatott Alapja, CIB Szabadidő Származtatott Alap, CIB Stabil Európa 2 Származtatott Alap, CIB Dollár Olajvállalatok Származtatott Alapja, CIB Ázsiai Részvény Származtatott Alap, CIB Euró Ázsiai Részvény Származtatott Alap, CIB Tiszta Amerika 2 Származtatott Alap, CIB Euró Tiszta Amerika 2 Származtatott Alap, CIB Babatermékgyártók Származtatott Alapja, CIB Euró Babatermékgyártók Származtatott Alapja, CIB Edességek Származtatott Alapja 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 a Letétkezelő végzi, az Alap kezelési szabályzatában Az Alap portfóliójában lévő elemek 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 kamatjövedelem származik, az időarányos kamat figyelembe van véve 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 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 hozamot realizálnak. A realizált hozam kamat jövedelemnek minősül, ami a kamatadó hatálya alá tartozik, hasonlóan a hitelintézeti betéten, takarékbetéten 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 az éves jelentés készítésének időpontjában 15%. A 2006. augusztus 31-e előtt vásárolt befektetési jegyek mentesülnek a kamatadó hatálya alól. Jogi személyek és jogi személyiség nélküli társaságok esetében a befektetési jegyek árfolyamnyeresége és hozama az adóköteles árbevételüket növeli. Ez után a mindenkor érvényes társasági adó jogszabályok 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 és a www.cib.hu honlapokon, valamint díjmentesen átvehető a forgalmazási helyeken.