



CIB EURÓ 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 nap)	2018.12.28		2019.06.28	
Saját tőke	4 174 455,20 EUR		4 258 313,76 EUR	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,00968151		0,00996000	
Darabszám	431 178 271 db		427 526 776 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	99,32%	72,76%	96,24%	71,41%
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 95%-os árfolymvédelmet biztosító szintetikus betét	3 030 148,44 EUR	72,5879%	3 038 605,92 EUR	71,3570%
Folyószámla (EUR)	1 108 911,26 EUR	26,5642%	1 057 086,67 EUR	24,8241%
Hasbro Inc, Johnson & Johnson, Kimberly-Clark Corp, Procter & Gamble Co/The és Walt Disney Co/The részvényekből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményét biztosító OTC opció	28 266,43 EUR	0,6771%	160 176,46 EUR	3,7615%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	9 644,41 EUR	0,2305%	7 721,03 EUR	0,1810%
I/1. Hitelállomány	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	9 644,41 EUR	0,2305%	7 721,03 EUR	0,1810%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya	4 184 099,61 EUR	100,0000%	4 266 034,79 EUR	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	1 108 911,26 EUR	26,5030%	1 057 086,67 EUR	24,7791%
II/2. Egyéb követelés	16 773,48 EUR	0,4009%	10 165,74 EUR	0,2383%
II/3. Lekötött bankbetétek	3 030 148,44 EUR	72,4206%	3 038 605,92 EUR	71,2279%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	3 030 148,44 EUR	72,4206%	3 038 605,92 EUR	71,2279%
II/4. Átruházható értékpapírok	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.1. Állampapírok	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.1.1. Kötvények	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.1.2. Kincstárjegyek	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.2.3. Tőzsdén kívüli	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.3. Részvények	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.3.2. Tőzsdén kívüli	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.4. Jelzáloglevelek	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.5. Befektetési jegyek	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5. Származékos ügyletek	28 266,43 EUR	0,6756%	160 176,46 EUR	3,7547%
II/5.1. Határidős	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.1.1. Futures	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.1.2. Forward	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.2. Opció ügyletek	28 266,43 EUR	0,6756%	160 176,46 EUR	3,7547%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	28 266,43 EUR	0,6756%	160 176,46 EUR	3,7547%
II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép.	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/7. Egyéb átruházható értékpapír	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
Bruttó eszközérték	4 184 099,61 EUR	100,0000%	4 266 034,79 EUR	100,0000%
Nettó eszközérték	4 174 455,20 EUR	99,7695%	4 258 313,76 EUR	99,8190%

* 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 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 (2018. december 28.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	431 178 271 db		427 526 776 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		2 228 412 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		5 879 907 db	
tőkeszámla növekedése		21 862,72 EUR	
tőkeszámla csökkenése		57 542,74 EUR	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	4 174 455,20 EUR		4 258 313,76 EUR
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,00968151		0,00996034

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	4 174 455,20 EUR	0,00968151
2019/01/31	4 167 633,47 EUR	0,00967504
2019/02/28	4 185 291,13 EUR	0,00971603
2019/03/29	4 197 788,46 EUR	0,00973110
2019/04/30	4 227 062,60 EUR	0,00986781
2019/05/31	4 191 575,59 EUR	0,00980188
2019/06/28	4 258 313,76 EUR	0,00996034

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 Euró Babatermékgyártók Számaztatott Alapja	2,55%	-0,09%	-	-	-	-0,16%	-1,77%	-	-	-	-	-	-	-	-

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 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 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 Szja. törvény alkalmazásában a kamatjövedelem adókulcsa a féléves jelentés készítésének időpontjában 15%. A Befektetési jegyek tartós befektetési számlára helyezhetők. Az értékpapír számlán elhelyezett Befektetési jegyek árfolyamnyeresége, illetve hozama után a kifizetőnek minősülő Forgalmazó adót von le. A tartós befektetési 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. Felhívjuk a figyelmet arra, hogy az EURHUF árfolyam ingadozása kedvezően és hátrányosan is befolyásolhatja az Alap által elért forintban számított 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).