



**CIB EURÓ FUTBALL SZÁRMAZTATOTT ALAP**

## **Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2019**

# 1. Alapadatok

---

## 1.1. A CIB Euró Futball Származtatott Alap

Megnevezése:	CIB Euró Futball 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, 2019/03/18-2022/03/18 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		2019.03.18		2019.06.28	
Saját tőke	-		3 482 025,26 EUR		4 003 963,75 EUR	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	-		0,00999600		0,00968151	
Darabszám	-		348 325 954 db		394 059 763 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	-	-	96,59%	85,58%	95,34%	77,87%
Maximális	-	-	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	EUR		EUR		EUR	
Devizakitetttség 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	-	-	3 099 702,81 EUR	89,0201%	3 126 960,18 EUR	78,0966%
Folyószámla (EUR)	-	-	383 259,54 EUR	11,0068%	699 766,83 EUR	17,4769%
Adidas AG, Electronic Arts Inc., Nike Inc., PepsiCo Inc. és Puma SE részvényekből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményét biztosító OTC opció	-	-	118 779,17 EUR	3,4112%	28 266,43 EUR	0,7060%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	-	-	119 716,26 EUR	3,3238%	9 159,74 EUR	0,2282%
I/1. Hitelállomány	-	-	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	-	-	119 716,26 EUR	3,3238%	9 159,74 EUR	0,2282%
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	-	-	3 601 741,52 EUR	100,0000%	4 013 123,49 EUR	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	-	-	383 259,54 EUR	10,6410%	699 766,83 EUR	17,4370%
II/2. Egyéb követelés	-	-	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	-	-	3 099 702,81 EUR	86,0612%	3 126 960,18 EUR	77,9184%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	-	-	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	-	-	3 099 702,81 EUR	86,0612%	3 126 960,18 EUR	77,9184%
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/4.2.2. 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	-	-	118 779,17 EUR	3,2978%	186 396,48 EUR	4,6447%
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	-	-	118 779,17 EUR	3,2978%	186 396,48 EUR	4,6447%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	-	-	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	-	-	118 779,17 EUR	3,2978%	28 266,43 EUR	0,7043%
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	-	-	3 601 741,52 EUR	100,0000%	4 013 123,49 EUR	100,0000%
Nettó eszközérték	-	-	3 482 025,26 EUR	96,6762%	4 003 963,75 EUR	99,7718%

\* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitétttségét a *bruttó*, valamint a *kötelezettség módszerrel* számítja ki. A bruttó módszer az Alap teljes kitétttségét 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 kitétttség) 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 szolgáltatók, intézmények, partnerek által képviselt rendszerkockázat alapján állapítja meg. A tőkeáttétel mértéke a tájékoztatói időszakban a feltüntetett tényleges és a megengedett maximális értékek között ingadozott. Az Alapkezelő az Alap nevében kötött szerződések, teljesült megbízások, tőkeáttétel 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.)	Az Alap futamidejének első napján (2019. március 18.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma		348 325 954 db		394 059 763 db
eladott befektetési jegyek darabszáma			45 873 809 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma			140 000 db	
tőkeszámla növekedése			458 809,24 EUR	
tőkeszámla csökkenése			1 400,74 EUR	
a portfólió összesített nettó eszközértéke		3 482 025,26 EUR		4 003 963,75 EUR
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték		0,009996		0,01016080

#### 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	-	-
2019/01/31	-	-
2019/02/28	-	-
2019/03/29	3 668 810,44 EUR	0,00997388
2019/04/30	3 951 806,26 EUR	0,01004834
2019/05/31	3 929 500,27 EUR	0,00997184
2019/06/28	4 003 963,75 EUR	0,01016080

## 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 Futball Számaztatott Alap	-	-	-	-	-	5,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Az Alap által két tetszőlegesen választott időpont között elért, valamint tetszőlegesen választott időponttól 3, 6, 9 hónapos, illetve 1, 2, 3 éves időtávokra számított hozam adatok megtekinthetők a [www.cib.hu](http://www.cib.hu) és a [www.cibalap.hu](http://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).