



**CIB ALAPKEZELŐ**

**CIB EURÓ FUTBALL SZÁRMAZTATOTT ALAP**

## **Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2020**

# 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:	Mitták Zoltán (Kamarai tagsági szám: MKVK-007298) 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)	2019.12.30		2020.06.30	
Saját tőke	4.281.709,97 EUR		4.054.828,17 EUR	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,01052311		0,01013709	
Darabszám	406.886.201 db		399.999.173 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	91,68%	72,71%	94,82%	77,11%
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 árfolyamvédelmet biztosító szintetikus betét	3.125.687,94 EUR	77,0856%	3.136.875,33 EUR	77,3615%
Folyószámla (EUR)	812.238,15 EUR	20,0314%	717.971,45 EUR	17,7066%
Adidas AG, Electronic Arts Inc., Nike Inc. és PepsiCo Inc. részvényekből kialakított befektetési eszközosár teljesítményét biztosító OTC opció	356.094,94 EUR	8,7820%	210.084,37 EUR	5,1811%
<b>I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya</b>	<b>12.311,06 EUR</b>	<b>0,2867%</b>	<b>10.102,98 EUR</b>	<b>0,2485%</b>
I/1. Hitelállomány	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	12.311,06 EUR	0,2867%	10.102,98 EUR	0,2485%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
<b>II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya</b>	<b>4.294.021,03 EUR</b>	<b>100,0000%</b>	<b>4.064.931,15 EUR</b>	<b>100,0000%</b>
II/1. Folyószámla, készpénz	812.238,15 EUR	18,9156%	717.971,45 EUR	17,6626%
II/2. Egyéb követelés	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	3.125.687,94 EUR	72,7916%	3.136.875,33 EUR	77,1692%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	3.125.687,94 EUR	72,7916%	3.136.875,33 EUR	77,1692%
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	356.094,94 EUR	8,2928%	210.084,37 EUR	5,1682%
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	356.094,94 EUR	8,2928%	210.084,37 EUR	5,1682%
II/5.2.1. Tőzsdői opciók	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	356.094,94 EUR	8,2928%	210.084,37 EUR	5,1682%
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	4.294.021,03 EUR	100,0000%	4.064.931,15 EUR	100,0000%
Nettó eszközérték	4.281.709,97 EUR	99,7133%	4.054.828,17 EUR	99,7515%

\* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitétséget a bruttó, valamint a kötelezettség módszerrel számítja ki. A bruttó módszer az Alap teljes kitétséget 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, tőkeáttétellel 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 (2019. december 30.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2020. június 30.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	406.886.201 db		399.999.173 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		1.044.999 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		7.932.027 db	
tőkeszámla növekedése		10.929,36 EUR	
tőkeszámla csökkenése		78.635,51 EUR	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	4.281.709,97 EUR		4.054.828,17 EUR
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,01052311		0,01013709

#### 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
2019/12/30	4.281.709,97 EUR	0,01052311
2020/01/31	4.313.835,39 EUR	0,01058643
2020/02/28	4.214.929,11 EUR	0,01034661
2020/03/31	3.937.582,79 EUR	0,00983205
2020/04/30	3.985.429,99 EUR	0,00996010
2020/05/31	4.036.108,62 EUR	0,01009054
2020/06/30	4.054.828,17 EUR	0,01013709

## 4. Az Alap hozamadatai

az alap által 2020/06/30-ig elért hozamok	évesített hozamok														
	1 év	2 év	3 év	4 év	5 év	indulás-tól mért	naptári évre számított								
							2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018
CIB Euró Futball Alap	-0,23%	-	-	-	-	1,09%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 jóváhagyott 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, valamint az Alap Kezelési szabályzatában meghatározott szabályok szerinti hozamkifizetések alkalmával 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 az éves 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. 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 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).