



CIB ALTERNATÍV ENERGIA SZÁRMAZTATOTT ALAP

Féléves jelentés

CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.

Forgalmazó, Letétkezelő:

CIB Bank Zrt.

2019

1. Alapadatok

1.1. A CIB Alternatív Energia Származtatott Alap

Megnevezése:	CIB Alternatív Energia 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, 2018/11/19-2020/11/20 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)	2018.12.28		2019.06.28	
Saját tőke	3 822 468 225 HUF		4 098 903 526 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	9 849,9198		9 642,3009	
Darabszám	388 071 db		425 096 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	97,99%	77,58%	99,68%	79,08%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	HUF		HUF	
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	2 014 050 540 HUF	52,6898%	2 038 120 340 HUF	49,7235%
Folyószámla (HUF)	780 296 851 HUF	20,4134%	844 092 376 HUF	20,5931%
MÁK 2020/A	780 547 264 HUF	20,4200%	1 189 234 760 HUF	29,0135%
E.ON SE, az Electricite de France SA, a First Solar Inc., a Tesla Inc. és a Vestas Wind Systems A/S részvényekből kialakított befektetési eszközosár teljesítményét biztosító OTC opció	76 872 994 HUF	2,0111%	13 287 681 HUF	0,3242%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	4 229 285 HUF	0,1105%	8 390 294 HUF	0,2043%
I/1. Hitelállomány	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	4 229 285 HUF	0,1105%	8 390 294 HUF	0,2043%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya	3 826 697 510 HUF	100,0000%	4 107 293 820 HUF	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	780 296 851 HUF	20,3909%	844 092 376 HUF	20,5511%
II/2. Egyéb követelés	174 929 861 HUF	4,5713%	22 558 663 HUF	0,5492%
II/3. Lekötött bankbetétek	2 014 050 540 HUF	52,6316%	2 038 120 340 HUF	49,6220%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	2 014 050 540 HUF	52,6316%	2 038 120 340 HUF	49,6220%
II/4. Átruházható értékpapírok	780 547 264 HUF	20,3974%	1 189 234 760 HUF	28,9542%
II/4.1. Állampapírok	780 547 264 HUF	20,3974%	1 189 234 760 HUF	28,9542%
II/4.1.1. Kötvények	780 547 264 HUF	20,3974%	1 189 234 760 HUF	28,9542%
II/4.1.2. Kincstárjegyek	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.2.3. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.3. Részvények	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.3.2. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.4. Jelzáloglevelek	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.5. Befektetési jegyek	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5. Származékos ügyletek	76 872 994 HUF	2,0089%	13 287 681 HUF	0,3235%
II/5.1. Határidős	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.1.1. Futures	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.1.2. Forward	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2. Opciósi ügyletek	76 872 994 HUF	2,0089%	13 287 681 HUF	0,3235%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	76 872 994 HUF	2,0089%	13 287 681 HUF	0,3235%
II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép.	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/7. Egyéb átruházható értékpapír	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
Bruttó eszközérték	3 826 697 510 HUF	100,0000%	4 107 293 820 HUF	100,0000%
Nettó eszközérték	3 822 468 225 HUF	99,8895%	4 098 903 526 HUF	99,7957%

* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitettséget a bruttó, valamint a kötelezettség módszerrel számítja ki. A bruttó módszer az Alap teljes kitettséget 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 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, 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.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	388 071 db		425 096 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		42 429 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		5 404 db	
tőkeszámla növekedése		419 418 378 HUF	
tőkeszámla csökkenése		53 387 398 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	3 822 468 225 HUF		4 098 903 526 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	9 849,9198		9 642,3009

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	3 822 468 225 HUF	9 849,9198
2019/01/31	4 274 627 513 HUF	10 045,7740
2019/02/28	4 224 117 371 HUF	9 962,2120
2019/03/29	4 176 506 660 HUF	9 834,7340
2019/04/30	4 146 961 946 HUF	9 753,7937
2019/05/31	4 103 376 158 HUF	9 639,9417
2019/06/28	4 098 903 526 HUF	9 642,3009

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 Alternatív Energia Számaztatott Alap	-	-	-	-	-	-5,82%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 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 kamatjövdelem 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 Sza. törvény alkalmazásában a kamatjövdelem adókulcsa a féléves jelentés készítésének időpontjában 15%. A Befektetési jegyek tartós befektetési számlára, illetve nyugdíj-előtakarékossági számlára helyezhetők. Az értékpapír számlán elhelyezett Befektetési jegyek árfolyamnyeresége, illetve hozama után a kifizetőnek minősülő Forgalmazó adót von le. A tartós befektetési számlán, illetve nyugdíj-előtakarékossági 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. 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).