



## **CIB ÁZSIAI RÉSZVÉNY SZÁRMAZTATOTT ALAP**

### **Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2019**

## 1. Alapadatok

---

### 1.1. A CIB Ázsiai Részvény Származtatott Alap

|                     |   |
|---------------------|---|
| Megnevezése:        | CIB Ázsiai Részvény 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, 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)<br>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   | 4 484 311 187 HUF     |                | 4 399 492 042 HUF     |                |
| Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték  | 9 570,7161            |                | 9 504,7498            |                |
| Darabszám  | 468 545 db            |                | 462 873 db            |                |
| Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*  | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer |
| Tényleges  | 99,91%                | 97,61%         | 100,00%               | 80,46%         |
| 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   | 3 194 463 994 HUF     | 71,2364%       | 3 214 296 933 HUF     | 73,0606%       |
| Folyószámla (HUF)  | -                     | -              | 859 736 474 HUF       | 19,5417%       |
| MÁK 2019/A   | 850 984 800 HUF       | 18,9769%       | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| 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 | 4 257 990 HUF         | 0,0950%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya  | 17 708 013 HUF        | 0,3933%        | 15 674 850 HUF        | 0,3550%        |
| I/1. Hitelállomány   | 0 HUF                 | 0,0000%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| I/2. Egyéb kötelezettségek   | 17 708 013 HUF        | 0,3933%        | 15 674 850 HUF        | 0,3550%        |
| I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség   | 0 HUF                 | 0,0000%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya   | 4 502 019 200 HUF     | 100,0000%      | 4 415 166 892 HUF     | 100,0000%      |
| II/1. Folyószámla, készpénz  | 102 919 296 HUF       | 2,2861%        | 859 736 474 HUF       | 19,4723%       |
| II/2. Egyéb követelés  | 8 803 832 HUF         | 0,1956%        | 321 228 HUF           | 0,0073%        |
| II/3. Lekötött bankbetétek   | 3 194 463 994 HUF     | 70,9562%       | 3 214 296 933 HUF     | 72,8013%       |
| II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű   | 0 HUF                 | 0,0000%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű   | 3 194 463 994 HUF     | 70,9562%       | 3 214 296 933 HUF     | 72,8013%       |
| II/4. Átruházható értékpapírok   | 1 191 574 088 HUF     | 26,4675%       | 340 812 257 HUF       | 7,7191%        |
| II/4.1. Állampapírok   | 850 984 800 HUF       | 18,9023%       | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| II/4.1.1. Kötvények  | 850 984 800 HUF       | 18,9023%       | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| 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   | 340 589 288 HUF       | 7,5653%        | 340 812 257 HUF       | 7,7191%        |
| II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett  | 0 HUF                 | 0,0000%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| II/4.5.2. Tőzsdén kívüli   | 340 589 288 HUF       | 7,5653%        | 340 812 257 HUF       | 7,7191%        |
| II/5. Származékos ügyletek   | 4 257 990 HUF         | 0,0946%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| 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. Opciók ügyletek  | 4 257 990 HUF         | 0,0946%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| II/5.2.1. Tőzsdei opciók   | 0 HUF                 | 0,0000%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| II/5.2.2. OTC típusú opciók  | 4 257 990 HUF         | 0,0946%        | 0 HUF                 | 0,0000%        |
| 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   | 4 502 019 200 HUF     | 100,0000%      | 4 415 166 892 HUF     | 100,0000%      |
| Nettó eszközérték  | 4 484 311 187 HUF     | 99,6067%       | 4 399 492 042 HUF     | 99,6450%       |

\* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitettségét 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 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, 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<br>(2018. december 28.) | Tájékoztatási időszakban | Tájékoztatási időszak végén<br>(2019. június 28.) |
|--|---|--------------------------|---|
| forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma   | 468 545 db  |                          | 462 873 db  |
| eladott befektetési jegyek darabszáma            |   | 78 db                    |   |
| visszaváltott befektetési jegyek darabszáma      |   | 5 750 db                 |   |
| tőkeszámla növekedése                            |   | 746 765 HUF              |   |
| tőkeszámla csökkenése                            |   | 55 097 493 HUF           |   |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke       | 4 484 311 187 HUF   |                          | 4 399 492 042 HUF                                 |
| az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 9 570,7161  |                          | 9 504,7498  |

#### 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 | 4 484 311 187 HUF    | 9 570,7161                           |
| 2019/01/31 | 4 510 196 926 HUF    | 9 639,3150                           |
| 2019/02/28 | 4 485 052 611 HUF    | 9 600,6983                           |
| 2019/03/29 | 4 462 378 422 HUF    | 9 584,3108                           |
| 2019/04/30 | 4 451 902 942 HUF    | 9 574,1289                           |
| 2019/05/31 | 4 442 625 014 HUF    | 9 562,5872                           |
| 2019/06/28 | 4 399 492 042 HUF    | 9 504,7498                           |

## 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 | naptári évre számított |        |      |      |      |      |      |      |      |
|   |                   |        |      |      |      |                  | 2018                   | 2017   | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 |
| CIB Ázsiai Részvény Származtatott Alap    | -0,84%            | -2,14% | -    | -    | -    | -1,71%           | -3,51%                 | -2,88% | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    |

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 értékpapirokból, 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 kamatozó 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 kamatjövdelem adókulcsa a féléves jelentés készítésének időpontjában 15%. A Befektetési jegyek tartós befektetési számlára, illetve nyugdíj-előtakarékosági 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-előtakarékosági 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 kamatozó 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).