



CIB ALAPKEZELŐ

CIB PROFITMIX 5 TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP

Féléves jelentés

CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.

Forgalmazó, Letétkezelő:

CIB Bank Zrt.

2019

1. Alapadatok

1.1. A CIB Profitmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap

Megnevezése:	CIB Profitmix 5 Tőkevédett 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, 2019/05/20-2023/05/19 közötti időszakra jött létre
Besorolása:	speciális, tőkevédett, 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		2019.05.20		2019.06.28	
Saját tőke	-		4 589 294 591 HUF		4 884 896 427 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	-		10 003,9991		10 012,0238	
Darabszám	-		458 746 db		487 903 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	-	-	96,23%	83,43%	97,63%	83,19%
Maximális	-	-	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	HUF		HUF		HUF	
Devizakitettség fedezettségi szintje	-		0,00%		0,00%	
Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya						
Lejáratkori 100%-os árfolymvédelmet biztosító szintetikus betét	-	-	4 003 132 860 HUF	87,2276%	4 066 984 720 HUF	83,2563%
Folyószámla (HUF)	-	-	587 462 448 HUF	12,8007%	705 380 538 HUF	14,4400%
Deutsche Telekom AG, Kellogg Company, Nestlé S.A., Nokia Oyj, Vodafone Group Plc. részvényekből kialakított befektetési eszközösár teljesítményétől függően hozamot biztosító OTC opció	-	-	172 947 242 HUF	3,7685%	115 603 992 HUF	2,3666%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	-	-	174 247 959 HUF	3,6579%	3 565 064 HUF	0,0729%
I/1. Hitelállomány	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	-	-	174 247 959 HUF	3,6579%	3 565 064 HUF	0,0729%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya	-	-	4 763 542 550 HUF	100,0000%	4 888 461 491 HUF	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	-	-	587 462 448 HUF	12,3325%	705 380 538 HUF	14,4295%
II/2. Egyéb követelés	-	-	0 HUF	0,0000%	492 241 HUF	0,0101%
II/3. Lekötött bankbetétek	-	-	4 003 132 860 HUF	84,0369%	4 066 984 720 HUF	83,1956%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	-	-	4 003 132 860 HUF	84,0369%	4 066 984 720 HUF	83,1956%
II/4. Átruházható értékpapírok	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.1. Állampapírok	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.1.1. Kötvények	-	-	0 HUF	0,0000%	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	-	-	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	-	-	172 947 242 HUF	3,6306%	115 603 992 HUF	2,3648%
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. Opció ügyletek	-	-	172 947 242 HUF	3,6306%	115 603 992 HUF	2,3648%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	-	-	172 947 242 HUF	3,6306%	115 603 992 HUF	2,3648%
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	-	-	4 763 542 550 HUF	100,0000%	4 888 461 491 HUF	100,0000%
Nettó eszközérték	-	-	4 589 294 591 HUF	96,3421%	4 884 896 427 HUF	99,9271%

* 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, 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. május 20.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma		458 746 db		487 903 db
eladott befektetési jegyek darabszáma			31 746 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma			2 589 db	
tőkeszámla növekedése			318 729 778 HUF	
tőkeszámla csökkenése			26 088 234 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke		4 589 294 591 HUF		4 884 896 427 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték		10 003,9991		10 012,0238

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	-	-
2019/04/30	-	-
2019/05/31	4 751 297 958 HUF	10 016,8827
2019/06/28	4 884 896 427 HUF	10 012,0238

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 Profitmix 5 Tőkevédett Számaztatott Alap	-	-	-	-	-	9,65%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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).