



**CIB ALAPKEZELŐ**

**CIB EURÓ AUTÓGYÁRTÓK TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT  
ALAPJA**

**Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:  
CIB Bank Zrt.**

**2020**

# 1. Alapadatok

---

## 1.1. A CIB Euró Autógyártók Tőkevédett Származtatott Alapja

Megnevezése:	CIB Euró Autógyártók Tőkevédett Származtatott Alapja (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, 2015/06/15-2020/11/20 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:	Juhász Attila Sándor (Kamarai tagsági szám: MKVK-006065) 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)	2019.12.30		2020.06.30	
Saját tőke	8.774.685,01 EUR		8.632.954,64 EUR	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,01002942		0,01002996	
Darabszám	874.894.746 db		860.717.142 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	99,67%	92,90%	99,62%	80,46%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	EUR		EUR	
Devizakitettség fedezettségi szintje	0,00%		0,00%	
Alap teljes portfóliójában belüli 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya				
Lejáratkori tőkevédelmet biztosító szintetikus betét	8.174.228,60 EUR	93,1569%	6.968.499,90 EUR	80,7198%
Folyószámla	-	-	1.654.769,41 EUR	19,1681%
Fiat Chrysler Automobiles NV valamint a vállalatcsoport részvényesi struktúrájában bekövetkezett változásnak megfelelően 2016/01/04 időponttól a Ferrari NV, General Motors Co., Honda Motor Co. Ltd., Hyundai Motor Co., Kia Motors Corp., Nissan Motor Co. Ltd., Mitsubishi Motors Corp., Renault SA, Tesla Motors Inc, Volkswagen AG részvényekből kialakított befektetési eszközosár teljesítményétől függően hozamot biztosító OTC opció	28.678,12 EUR	0,3268%	32.529,44 EUR	0,3768%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	22.703,77 EUR	0,2581%	22.844,11 EUR	0,2639%
I/1. Hitelállomány	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	22.703,77 EUR	0,2581%	22.844,11 EUR	0,2639%
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	8.797.388,7800 EUR	100,0000%	8.655.798,7488 EUR	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	594.482,06 EUR	6,7575%	1.654.769,41 EUR	19,1175%
II/2. Egyéb követelés	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	8.174.228,60 EUR	92,9165%	6.968.499,90 EUR	80,5067%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	8.174.228,60 EUR	92,9165%	6.968.499,90 EUR	80,5067%
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	28.678,12 EUR	0,3260%	32.529,44 EUR	0,3758%
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	28.678,12 EUR	0,3260%	32.529,44 EUR	0,3758%
II/5.2.1. Tőzsdői opciók	0,00 EUR	0,0000%	0,00 EUR	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	28.678,12 EUR	0,3260%	32.529,44 EUR	0,3758%
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	8.797.388,78 EUR	100,0000%	8.655.798,75 EUR	100,0000%
Nettó eszközérték	8.774.685,01 EUR	99,7419%	8.632.954,64 EUR	99,7361%

\* 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 tájékoztatói időszakban a feltüntetett tényleges és a megengedett maximális értékek között ingadozott. Az Alapkezelő az Alap nevében kötött szerződések, teljesült megbízások, tőkeáttételel 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	874.894.746 db		860.717.142 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		0 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		14.177.604 db	
tőkeszámla növekedése		0,00 EUR	
tőkeszámla csökkenése		142.267,63 EUR	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	8.774.685,01 EUR		8.632.954,64 EUR
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	0,01002942		0,01002996

#### 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	8.774.685,01 EUR	0,01002942
2020/01/31	8.777.700,20 EUR	0,01003286
2020/02/28	8.768.988,07 EUR	0,01003606
2020/03/31	8.753.546,39 EUR	0,01003765
2020/04/30	8.688.925,47 EUR	0,01003365
2020/05/31	8.683.304,17 EUR	0,01002952
2020/06/30	8.632.954,64 EUR	0,01002996

## 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	2019
CIB Euró Autógyártók Származtatott Alapja	-0,23%	0,16%	0,18%	0,18%	0,22%	0,13%	-	-	-	-	-	-	-0,23%	0,06%	0,11%	0,13%

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 Sza. 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 járulékról 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 kitevével, 365 napos bázison).