



## **CIB FUTBALL TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP**

### **Féléves jelentés**

**CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2019**

# 1. Alapadatok

---

## 1.1. A CIB Futball Tőkevédett Származtatott Alap

Megnevezése:	CIB Futball 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, 2019/03/18-2022/03/18 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:	Henye István (Kamarai tagsági szám: MKVK-005674) KPMG Hungária Kft.
Székhelye:	H-1134 Budapest, Váci út 31.

## 2. A befektetési eszközállomány összetétele

Az Alap portfóliójában található eszközök és források tételei összetétele

Tárgynap (T. forgalmazás-elszámolási nap)	2018.12.28		2019.03.18		2019.06.28	
Saját tőke	-		5 081 321 611 HUF		5 947 525 593 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	-		10 002,8182		10 222,2952	
Darabszám	-		507 989 db		581 819 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezett ség	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	-	-	96,98%	85,56%	95,86%	87,34%
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						
Lejáratkor 100%-os árfolymvédelmet biztosító szintetikus betét	-	-	4 502 584 012 HUF	88,61%	4 565 000 430 HUF	76,7546%
Folyószámla (HUF)	-	-	579 890 000 HUF	11,41%	-	-
MÁK 2021/B	-	-	775 822 096 HUF	15,27%	636 567 600 HUF	10,7031%
Adidas AG, Electronic Arts Inc., Nike Inc., PepsiCo Inc. és Puma SE részvényekből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményét biztosító OTC opció	-	-	153 615 874 HUF	3,02%	246 182 488 HUF	4,1392%
<b>I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya</b>	-	-	154 768 275 HUF	2,9558%	6 863 097 HUF	0,1153%
I/1. Hitelállomány	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	-	-	154 768 275 HUF	2,9558%	6 863 097 HUF	0,1153%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
<b>II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya</b>	-	-	5 236 089 886 HUF	100,0000%	5 954 388 690 HUF	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	-	-	579 890 000 HUF	11,0749%	506 638 172 HUF	8,5087%
II/2. Egyéb követelés	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	-	-	4 502 584 012 HUF	85,9913%	4 565 000 430 HUF	76,6661%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	-	-	4 502 584 012 HUF	85,9913%	4 565 000 430 HUF	76,6661%
II/4. Átruházható értékpapírok	-	-	0 HUF	0,0000%	636 567 600 HUF	10,6907%
II/4.1. Állampapírok	-	-	0 HUF	0,0000%	636 567 600 HUF	10,6907%
II/4.1.1. Kötvények	-	-	0 HUF	0,0000%	636 567 600 HUF	10,6907%
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	-	-	153 615 874 HUF	2,9338%	246 182 488 HUF	4,1345%
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	-	-	153 615 874 HUF	2,9338%	246 182 488 HUF	4,1345%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	-	-	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	-	-	153 615 874 HUF	2,9338%	246 182 488 HUF	4,1345%
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	-	-	5 236 089 886 HUF	100,0000%	5 954 388 690 HUF	100,0000%
Nettó eszközérték	-	-	5 081 321 611 HUF	97,0442%	5 947 525 593 HUF	99,8847%

\* 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 ügyletek volumene, természete és kiterjedése, valamint az ügyletek 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, tőkeáttélt 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. március 18.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma		507 989 db		581 819 db
eladott befektetési jegyek darabszáma			78 908 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma			5 078 db	
tőkeszámla növekedése			794 544 883 HUF	
tőkeszámla csökkenése			51 752 812 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke		5 081 321 611 HUF		5 947 525 593 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték		10 002,8182		10 222,2952

#### 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	5 482 525 695 HUF	10 055,2522
2019/04/30	5 902 644 620 HUF	10 081,2365
2019/05/31	5 890 094 991 HUF	10 052,9692
2019/06/28	5 947 525 593 HUF	10 222,2952

## 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 Futball Tőkevédett Számaztatott Alap	-	-	-	-	-	7,91%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 kamatjövdelem származik, az időarányos kamat figyelembe van véve az Alap eszközértékének számításakor, hasonlóan a pénzből és a pénzzellegű 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 Szja. 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).