



CIB WEBWILÁG 2 SZÁRMAZTATOTT ALAP

Féléves jelentés

CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.

Forgalmazó, Letétkezelő:

CIB Bank Zrt.

2019

1. Alapadatok

1.1. A CIB WebWilág 2 Származtatott Alap

Megnevezése:	CIB WebWilág 2 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, 2015/08/17-2019/08/16 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:	Juhász Attila (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. forgalmazás-elszámolási nap)	2018.12.28		2019.06.28	
Saját tőke	3 220 511 137 HUF		3 154 563 930 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	9 850,6461		9 815,3767	
Darabszám	326 934 db		321 390 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	98,01%	97,22%	97,40%	87,41%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	HUF		HUF	
Devizakitétség 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	2 761 921 449 HUF	85,7603%	2 776 266 538 HUF	88,0079%
Apple Inc., Best Buy Co Inc., Expedia Inc, Facebook Inc., Google Inc., LinkedIn Corp, MercadoLibre Inc., Netflix Inc., TripAdvisor Inc. részvényekből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményétől függően hozamot biztosító OTC opció	63 955 349 HUF	1,9859%	82 139 016 HUF	2,6038%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	22 266 030 HUF	0,6866%	18 794 153 HUF	0,5922%
I/1. Hitelállomány	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	22 266 030 HUF	0,6866%	18 794 153 HUF	0,5922%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya	3 242 777 166 HUF	100,0000%	3 173 358 082 HUF	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	25 670 486 HUF	0,7916%	314 952 528 HUF	9,9249%
II/2. Egyéb követelés	31 640 HUF	0,0010%	0 HUF	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	2 761 921 449 HUF	85,1715%	2 776 266 538 HUF	87,4867%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	2 761 921 449 HUF	85,1715%	2 776 266 538 HUF	87,4867%
II/4. Átruházható értékpapírok	391 198 242 HUF	12,0637%	0 HUF	0,0000%
II/4.1. Állampapírok	180 834 270 HUF	5,5765%	0 HUF	0,0000%
II/4.1.1. Kötvények	180 834 270 HUF	5,5765%	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	210 363 972 HUF	6,4872%	0 HUF	0,0000%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli	210 363 972 HUF	6,4872%	0 HUF	0,0000%
II/5. Származékos ügyletek	63 955 349 HUF	1,9722%	82 139 016 HUF	2,5884%
II/5.1. Határidos	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	63 955 349 HUF	1,9722%	82 139 016 HUF	2,5884%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	63 955 349 HUF	1,9722%	82 139 016 HUF	2,5884%
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	3 242 777 166 HUF	100,0000%	3 173 358 082 HUF	100,0000%
Nettó eszközérték	3 220 511 137 HUF	99,3134%	3 154 563 930 HUF	99,4078%

* Az Alapkezelő az Alap tőkeáttétel szerinti kitétségét a *bruttó*, valamint a *kötelezettség módszerrel* számítja ki. A bruttó módszer az Alap teljes kitétségét 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 kitétség) 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, természetű 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, 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.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2019. június 28.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	326 934 db		321 390 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		608 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		6 152 db	
tőkeszámla növekedése		6 025 490 HUF	
tőkeszámla csökkenése		60 757 219 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	3 220 511 137 HUF		3 154 563 930 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	9 850,6461		9 815,3767

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	3 220 511 137 HUF	9 850,6461
2019/01/31	3 225 852 926 HUF	9 940,3212
2019/02/28	3 200 057 010 HUF	9 899,2369
2019/03/29	3 181 583 416 HUF	9 868,3737
2019/04/30	3 207 439 357 HUF	9 941,0171
2019/05/31	3 132 360 438 HUF	9 725,1696
2019/06/28	3 154 563 930 HUF	9 815,3767

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 WebVilág 2 Számaztatott Alap	-5,36%	-1,01%	-0,53%	-	-	-0,47%	-1,45%	-0,67%	0,80%	-	-	-	-	-	-

Az Alap által két tetszőlegesen választott időpont között elért, valamint tetszőlegesen választott időponttól 3, 6, 9 hónapos, illetve 1, 2, 3 éves időtávokra számított hozamadatak 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).