



**EURIZON**  
ASSET MANAGEMENT

## **CIB 5 ELEM TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP**

### **Féléves jelentés**

**Eurizon Asset Management Hungary Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2021**

**Székhely**  
H-1027 Budapest  
Medve utca 4 -14.  
Telefon: (06 1) 423 24 00  
Fax: (06 1) 489 66 64

**Eurizon Asset Management Hungary Zrt. / Eurizon Asset Management Hungary Ltd.**  
Nyilvántartó cégbíróság: Fővárosi Törvényszék Cégbírósága Cégjegyzékszám: Cg. 01-10-044283  
Adószám: 11969347-2-41 Tevékenységi engedély száma: PSZÁF III/100.036-4/2002.

Company of **INTESA**  **SANPAOLO**

# 1. Alapadatok

---

## 1.1. A CIB 5 Elem Tőkevédett Származtatott Alap

<b>Megnevezése:</b>	<b>CIB 5 Elem Tőkevédett Származtatott Alap (a továbbiakban: Alap)</b>
<b>Az Alap típusa:</b>	<b>nyilvános</b>
<b>Az Alap fajtája:</b>	<b>nyíltvégű, azaz a futamidő alatt az Alap befektetési jegyei a kezelési szabályzatban foglalt szabályok szerint megvásárolhatók, illetve visszaválthatók</b>
<b>Az Alap futamideje:</b>	<b>az Alap határozott futamidőre, 2019/01/22-2022/01/21 közötti időszakra jött létre</b>
<b>Besorolása:</b>	<b>speciális, tőkevédett, ABAK-irányelv alapján harmonizált befektetési alap</b>

## 1.2. Az alapkezelő

<b>Neve:</b>	<b>Eurizon Asset Management Hungary Zrt. (2021/04/08-át megelőzően: CIB Befektetési Alapkezelő) (a továbbiakban: Alapkezelő)</b>
<b>Székhelye:</b>	<b>H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.</b>

## 1.3. A forgalmazó

<b>Neve:</b>	<b>CIB Bank Zrt. (a továbbiakban: Forgalmazó)</b>
<b>Székhelye:</b>	<b>H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.</b>

## 1.4. A letétkezelő

<b>Neve:</b>	<b>CIB Bank Zrt. (a továbbiakban: Letétkezelő)</b>
<b>Székhelye:</b>	<b>H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.</b>

## 1.5. Forgalmazási helyek

<b>Neve:</b>	<b>CIB Bank Zrt. központja és fiókjai</b>
<b>Székhelye:</b>	<b>H-1027 Budapest, Medve u. 4-14.</b>

## 1.6. A könyvvizsgáló

<b>Neve:</b>	<b>Kónya Zsolt (Kamarai tagsági szám: MKVK-007383) Ernst &amp; Young Könyvvizsgáló Kft.</b>
<b>Székhelye:</b>	<b>H-1132 Budapest, Váci út 20.</b>

## 2. A befektetési eszközállomány összetétele

### Az Alap portfóliójában található eszközök és források tételei összetétele

Tárgynap (T. forgalmazás-elszámolási nap)	2020.12.30		2021.06.30	
Saját tőke	6.924.489.007 HUF		7.036.828.292 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	10.219,1245		10.422,5529	
Darabszám	677.601 db		675.154 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	96,42%	70,69%	91,91%	64,27%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	HUF		HUF	
Devizakitettségi fedezettségi szintje	0,00%		0,00%	
Alap teljes portfóliójában belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya				
Lejáratkori 95%-os árfolymvédelmet biztosító szintetikus betét	4.980.105.246 HUF	71,9202%	4.990.857.310 HUF	70,9248%
Folyószámla (HUF)	1.782.677.583 HUF	25,7445%	1.944.705.218 HUF	27,6361%
BASF AG, BYD Co. Ltd., SAMSUNG SDI Co. Ltd., SQM S.A. és Tesla Inc. részvényekből kialakított befektetési eszközosár teljesítményét biztosító OTC opció	207.340.443 HUF	2,9943%	339.160.970 HUF	4,8198%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	46.503.115 HUF	0,6671%	237.895.207 HUF	3,2702%
I/1. Hitelállomány	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	46.503.115 HUF	0,6671%	237.895.207 HUF	3,2702%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belül aránya	6.970.992.122 HUF	100,0000%	7.274.723.498 HUF	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	1.782.677.583 HUF	25,5728%	1.944.705.218 HUF	26,7324%
II/2. Egyéb követelés	868.850 HUF	0,0125%	0 HUF	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	4.980.105.246 HUF	71,4404%	4.990.857.310 HUF	68,6055%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	4.980.105.246 HUF	71,4404%	4.990.857.310 HUF	68,6055%
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/4.2.2. 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	207.340.443 HUF	2,9743%	339.160.970 HUF	4,6622%
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	207.340.443 HUF	2,9743%	339.160.970 HUF	4,6622%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	207.340.443 HUF	2,9743%	339.160.970 HUF	4,6622%
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	6.970.992.122 HUF	100,0000%	7.274.723.498 HUF	100,0000%
Nettó eszközérték	6.924.489.007 HUF	99,3329%	7.036.828.292 HUF	96,7298%

\* 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 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 érték 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.

**Székhely**  
H-1027 Budapest  
Medve utca 4 -14.  
Telefon: (06 1) 423 24 00  
Fax: (06 1) 489 66 64

**Eurizon Asset Management Hungary Zrt. / Eurizon Asset Management Hungary Ltd.**  
Nyilvántartó cégbíróság: Fővárosi Törvényszék Cégbírósága Cégjegyzékszám: Cg. 01-10-044283  
Adószám: 11969347-2-41 Tevékenységi engedély száma: PSZÁF III/100.036-4/2002.

### 3. Az Alap forgalmi adatai

#### 3.1. A tájékoztatási időszakban az Alap befektetési jegyeinek forgalmi adatai

	Előző tájékoztatási időszak végén (2020. december 30.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2021. június 30.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	677.601 db		675.154 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		9.857 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		12.304 db	
tőkeszámla növekedése		101.665.842 HUF	
tőkeszámla csökkenése		127.204.123 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	6.924.489.007 HUF		7.036.828.292 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	10.219,1245		10.422,5529

#### 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
2020/12/30	6.924.489.007 HUF	10.219,1245
2021/01/29	6.935.890.281 HUF	10.214,8304
2021/02/26	6.961.915.688 HUF	10.256,6185
2021/03/31	7.011.012.799 HUF	10.354,0741
2021/04/30	7.052.817.960 HUF	10.413,5833
2021/05/31	6.999.665.870 HUF	10.359,0712
2021/06/30	7.036.828.292 HUF	10.422,5529

**Székhely**  
H-1027 Budapest  
Medve utca 4 -14.  
Telefon: (06 1) 423 24 00  
Fax: (06 1) 489 66 64

**Eurizon Asset Management Hungary Zrt. / Eurizon Asset Management Hungary Ltd.**  
Nyilvántartó cégbíróság: Fővárosi Törvényszék Cégbírósága Cégjegyzékszám: Cg. 01-10-044283  
Adószám: 11969347-2-41 Tevékenységi engedély száma: PSZÁF III/100.036-4/2002.

## 4. Az Alap hozamadatai

az Részalap által 2021/06/30-ig elért hozamok	nominális		évesített hozamok																	
	3 hónap	6 hónap	1 év	2 év	3 év	4 év	5 év	indulás- tól mért	naptári évre számított											
									2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020		
CIB 5 Elem Tőkevédett Származtatott Alap	-	-	5,10%	2,72%	-	-	-	1,70%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5,10%

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 [www.eurizoncapital.com/hu](http://www.eurizoncapital.com/hu) oldalon. 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 Szja. törvény alkalmazásában a kamatjövedelem 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).

**Székhely**  
H-1027 Budapest  
Medve utca 4 -14.  
Telefon: (06 1) 423 24 00  
Fax: (06 1) 489 66 64

**Eurizon Asset Management Hungary Zrt. / Eurizon Asset Management Hungary Ltd.**  
Nyilvántartó cégbíróság: Fővárosi Törvényszék Cégbírósága Cégjegyzékszám: Cg. 01-10-044283  
Adószám: 11969347-2-41 Tevékenységi engedély száma: PSZÁF III/100.036-4/2002.