



**EURIZON**  
ASSET MANAGEMENT

**EURIZON EURÓPAI RÉSZVÉNYEK SZÁRMAZTATOTT  
ALAPJA**

**Féléves jelentés**

**Eurizon Asset Management Hungary Zrt.**

**Forgalmazó, Letétkezelő:**

**CIB Bank Zrt.**

**2023**

**Székhely**  
H-1024 Budapest  
Petrezselyem u. 2-8.  
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. Az CIB Európai Részvények Származtatott Alapja

Megnevezése:	CIB Európai Részvények 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, 2020/10/05-2023/10/06 közötti időszakra jött létre
Besorolása:	speciális, származtatott, ABAK-irányelv alapján harmonizált befektetési alap

## 1.2. Az alapkezelő

Neve:	Eurizon Asset Management Hungary Zrt. (2021/04/08-át megelőzően: CIB Befektetési Alapkezelő) (a továbbiakban: Alapkezelő)
Székhelye:	H-1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.

## 1.3. A forgalmazó

Neve:	CIB Bank Zrt. (a továbbiakban: Forgalmazó)
Székhelye:	H-1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.

## 1.4. A letétkezelő

Neve:	CIB Bank Zrt. (a továbbiakban: Letétkezelő)
Székhelye:	H-1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.

## 1.5. Forgalmazási helyek

Neve:	CIB Bank Zrt. központja és fiókjai
Székhelye:	H-1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.

## 1.6. A könyvvizsgáló

Neve:	Barabás Csaba (Kamarai tagsági szám: MKVK-005787) Ernst & Young Könyvvizsgáló Kft.
Székhelye:	H-1132 Budapest, Váci út 20.

## 2. A befektetési eszközállomány összetétele

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

Tárgynap (T. forgalmazás-elszámolási nap)	2022.12.30		2023.06.30	
Saját tőke	1.696.399.541 HUF		1.732.260.177 HUF	
Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	10.626.2069		11.291.4087	
Darabszám	159.643 db		153.414 db	
Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke*	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer	Kötelezettség módszer	Bruttó módszer
Tényleges	56,25%	13,04%	564,34%	13,03%
Maximális	120,00%	120,00%	120,00%	120,00%
Alap devizaneme	HUF		HUF	
Devizakitettség fedezettségi szintje	0,00%		0,00%	
Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya				
Lejáratkori tőkevédelmet biztosító szintetikus betét	1.024.393.491 HUF	60,3863%	1.106.373.521 HUF	63,8688%
Folyószámla	741.601.703 HUF	43,7162%	715.722.670 HUF	41,3173%
EURO STOXX Select Dividend 30 részvényindexből kialakított befektetési eszközkosár teljesítményét biztosító OTC opció	338.337.208 HUF	19,9444%	357.315.504 HUF	20,6271%
I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya	408.377.773 HUF	19,4024%	447.151.518 HUF	20,5171%
I/1. Hitelállomány	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
I/2. Egyéb kötelezettségek	408.377.773 HUF	19,4024%	447.151.518 HUF	20,5171%
I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya	2.104.777.314 HUF	100,0000%	2.179.411.695 HUF	100,0000%
II/1. Folyószámla, készpénz	741.601.703 HUF	35,2342%	715.722.670 HUF	32,8402%
II/2. Egyéb követelés	444.912 HUF	0,0211%	0 HUF	0,0000%
II/3. Lekötött bankbetétek	1.024.393.491 HUF	48,6699%	1.106.373.521 HUF	50,7648%
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű	1.024.393.491 HUF	48,6699%	1.106.373.521 HUF	50,7648%
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	338.337.208 HUF	16,0747%	357.315.504 HUF	16,3950%
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. Opciók ügyletek	338.337.208 HUF	16,0747%	357.315.504 HUF	16,3950%
II/5.2.1. Tőzsdei opciók	0 HUF	0,0000%	0 HUF	0,0000%
II/5.2.2. OTC típusú opciók	338.337.208 HUF	16,0747%	357.315.504 HUF	16,3950%
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	2.104.777.314 HUF	100,0000%	2.179.411.695 HUF	100,0000%
Nettó eszközérték	1.696.399.541 HUF	80,5976%	1.732.260.177 HUF	79,4829%

\* 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 rendszercockázat 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, tőkeáttéttel eredményező ügyletek vonatkozásában biztosítékokat nem nyújt, garanciákat nem vállal, valamint ezek újbóli felhasználására jogokat nem szerez és nem biztosít.

**Székhely**  
H-1024 Budapest  
Petrezselyem u. 2-8.  
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**

### 3. Az Alap forgalmi adatai

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

	Előző tájékoztatási időszak végén (2022. december 30.)	Tájékoztatási időszakban	Tájékoztatási időszak végén (2023. június 30.)
forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma	159.643 db		153.414 db
eladott befektetési jegyek darabszáma		1.596 db	
visszaváltott befektetési jegyek darabszáma		7.825 db	
tőkeszámla növekedése		17.706.991 HUF	
tőkeszámla csökkenése		86.331.804 HUF	
a portfólió összesített nettó eszközértéke	1.696.399.541 HUF		1.732.260.177 HUF
az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték	10.626,2069		11.291,4087

#### 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
2022/12/30	1.696.399.541 HUF	10.626,2069
2023/01/31	1.747.949.399 HUF	11.047,5183
2023/02/28	1.745.359.086 HUF	11.123,7386
2023/03/31	1.680.273.943 HUF	10.791,9481
2023/04/28	1.704.808.821 HUF	10.989,6204
2023/05/31	1.713.757.581 HUF	11.126,1286
2023/06/30	1.732.260.177 HUF	11.291,4087

**Székhely**  
H-1024 Budapest  
Petrezselyem u. 2-8.  
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

a Részalapok által 2023/06/30-ig elért hozamok	évesített hozamok												
	1 év	5 év	indulás-tól mért	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
CIB Európai Részvények Származtatott Alapja	9,68%	-	4,54%	-	-	-	-	-	-	-	-	7,92%	-7,15%

Az Alap futamideje 2020. október 5-től indult, így a 2020. illetve az azt megelőző naptári évekre az Alap nem rendelkezik hozamadattal ahhoz, hogy a Befektetők számára a múltbéli teljesítményről hasznos tájékoztatás lenne adható. 2020. október 5-ét követően 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.eurizoncapital.com/hu](http://www.eurizoncapital.com/hu) oldalon. Az Alap múltbéli 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 értékpapirokból, 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 és a szociális hozzájárulási adó hatálya alá tartozik, hasonlóan a hitelintézeti betéten, takarékkbetéten 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 az éves jelentés készítésének időpontjában 15%. A szociális hozzájárulási adó mértéke a féléves jelentés készítésének időpontjában 13%. 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. Az éves 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-1024 Budapest  
Petrezselyem u. 2-8.  
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.