



EURIZON

ASSET MANAGEMENT

CIB OLAJVÁLLALATOK 2 SZÁRMAZTATOTT ALAPJA

Féléves jelentés

Eurizon Asset Management Hungary Zrt.

Forgalmazó, Letétkezelő:

CIB Bank Zrt.

2022

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 Olajvállalatok 2 Származtatott Alapja

| | |
|---------------------|---|
| Megnevezése: | CIB Olajvállalatok 2 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, 2019/11/18-2022/11/18 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-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: | Kónya Zsolt (Kamarai tagsági szám: MKVK-007383) 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) | 2021.12.30 | | 2022.06.30 | |
|---|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
| Saját tőke | 3 381 727 297 HUF | | 3 344 413 736 HUF | |
| Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 9 361,7011 | | 9 454,5206 | |
| Darabszám | 361 230 db | | 353 737 db | |
| Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke* | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer |
| Tényleges | 99,45% | 63,66% | 99,45% | 64,96% |
| Maximális | 120,00% | 120,00% | 120,00% | 120,00% |
| Alap devizaneme | HUF | | HUF | |
| Devizakitetés fedezettségi szintje | 0,00% | | 0,00% | |
| Alap teljes portfóliójában belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya | | | | |
| Lejáratkori 95%-os árfolyamvédelmet biztosító szintetikus betét | 2 158 377 892 HUF | 64,5368% | 2 185 538 234 HUF | 65,3489% |
| Folyószámla (HUF) | 1 213 221 650 HUF | 36,2761% | 1 153 629 525 HUF | 34,4942% |
| BP p.l.c., China Petroleum & Chemical Corporation, Engie SA, az Eni S.p.A és TOTAL SA részvényekből kialakított befektetési eszközosár teljesítményét biztosító OTC opció | 18 443 100 HUF | 0,5515% | 18 443 100 HUF | 0,5515% |
| I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya | 8 315 345 HUF | 0,2486% | 16 619 074 HUF | 0,4969% |
| I/1. Hitelállomány | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| I/2. Egyéb kötelezettségek | 8 315 345 HUF | 0,2453% | 16 619 074 HUF | 0,4945% |
| I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya | 3 390 042 642 HUF | 100,0000% | 3 361 032 810 HUF | 100,0000% |
| II/1. Folyószámla, készpénz | 1 213 221 650 HUF | 35,7878% | 1 153 629 525 HUF | 34,3237% |
| II/2. Egyéb követelés | 0 HUF | 0,0000% | 3 421 951 HUF | 0,1018% |
| II/3. Lekötött bankbetétek | 2 158 377 892 HUF | 63,6682% | 2 185 538 234 HUF | 65,0258% |
| II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű | 2 158 377 892 HUF | 63,6682% | 2 185 538 234 HUF | 65,0258% |
| 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 | 18 443 100 HUF | 0,5440% | 18 443 100 HUF | 0,5487% |
| 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 | 18 443 100 HUF | 0,5440% | 18 443 100 HUF | 0,5487% |
| II/5.2.1. Tőzsdei opciók | 0 HUF | 0,0000% | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.2.2. OTC típusú opciók | 18 443 100 HUF | 0,5440% | 18 443 100 HUF | 0,5487% |
| 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 | 3 390 042 642 HUF | 100,0000% | 3 361 032 810 HUF | 100,0000% |
| Nettó eszközérték | 3 381 727 297 HUF | 99,7547% | 3 344 413 736 HUF | 99,5055% |

* 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.

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 (2021. december 30.) | Tájékoztatási időszakban | Tájékoztatási időszak végén (2022. június 30.) |
|--|---|--------------------------|---|
| forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma | 361 230 db | | 353 737 db |
| eladott befektetési jegyek darabszáma | | 1 791 db | |
| visszaváltott befektetési jegyek darabszáma | | 9 284 db | |
| tőkeszámla növekedése | | 16 867 115 HUF | |
| tőkeszámla csökkenése | | 87 182 593 HUF | |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke | 3 381 727 297 HUF | | 3 344 413 736 HUF |
| az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | 9 361,7011 | | 9 454,5206 |

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 |
|------------|----------------------|--------------------------------------|
| 2021/12/30 | 3 381 727 297 HUF | 9 361,7011 |
| 2022/01/31 | 3 378 380 553 HUF | 9 381,0028 |
| 2022/02/28 | 3 364 779 150 HUF | 9 385,3756 |
| 2022/03/31 | 3 334 878 429 HUF | 9 369,4257 |
| 2022/04/29 | 3 334 906 239 HUF | 9 399,2915 |
| 2022/05/30 | 3 350 826 218 HUF | 9 442,3251 |
| 2022/06/30 | 3 344 413 736 HUF | 9 454,5206 |

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

| a Részalap által 2022/06/30-ig elért hozamok | nominális | | évesített hozamok | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------|---------|-------------------|------|----------------------|------------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|---|--------|--------|
| | 3 hónap | 6 hónap | 1 év | 5 év | indulás- tól mért | naptári évre számított | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | | | |
| CIB Olajvállalatok 2 Származtatott Alapja | - | - | -0,32% | - | -2,13% | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | -3,64% | -2,14% |

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 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 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 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 az éves 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. 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 időszak hozamait évesítve határozzuk meg (kamatosszámítással, 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.