

CIB Proftmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap

TEVÉKENYSÉGET LEZÁRÓ BESZÁMOLÓ

2023.05.19

CIB PROFTMIX 5 TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP
MÉRLEG



adatok eFt-ban

Megnevezés	2022.12.31	2023.05.19
A. BEFEKTETETT ESZKÖZÖK	-	-
I. Értékpapírok	-	-
1. Értékpapírok	-	-
2. Értékpapírok értékelési különbözete	-	-
a) kamatokból, osztalékból	-	-
b) egyéb	-	-
II. HOSSZÚ LEJÁRATÚ BANKBETÉTEK	-	-
1. Hosszú lejáratú bankbetétek	-	-
2. Hosszú lejáratú bankbetétek értékelési különbözete	-	-
B. FORGÓESZKÖZÖK	4.162.081	4.570.247
I. KÖVETELÉSEK	210	4.532.138
1. Követelések	210	4.532.138
2. Követelések értékvesztése (-)	-	-
3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	-	-
4. Forintkövetelések értékelési különbözete	-	-
II. ÉRTÉKPAPÍROK	-	-
1. Értékpapírok	-	-
2. Értékpapírok értékkülönbözete	-	-
a) kamatokból, osztalékból	-	-
b) egyéb	-	-
III. PÉNZESZKÖZÖK	4.161.871	38.109
1. Pénzeszközök	4.359.869	38.109
2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	- 197.998	-
C. AKTÍV IDŐBELI ELHATÁROLÁSOK	237.117	-
1. Aktív időbeli elhatárolás	237.117	-
2. Aktív időbeli elhatárolás értékvesztése (-)	-	-
D. Származékos ügyletek értékelési különbözete	200.472	-
ESZKÖZÖK ÖSSZESEN :	4.599.670	4.570.247

Megnevezés	2022.12.31	2023.05.19
E. SAJÁT TŐKE	4.369.723	4.268.500
I. Induló tőke	4.358.570	4.268.500
1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	5.052.600	5.059.670
2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	- 694.030	- 791.170
II. Tőkeváltozás	11.153	-
1. Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	2.999	512
2. Értékelési különbözet tartaléka	- 170.473	-
3. Előző évek eredménye	110.030	178.627
4. Tárgyévi eredménye	68.597	- 179.139
F. CÉLTARTALÉKOK	-	-
G. KÖTELEZETTSÉGEK	228.583	301.747
I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	-	-
II. Rövid lejáratú kötelezettségek	228.583	301.747
III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	-	-
H. PASSZÍV IDŐBELI ELHATÁROLÁSOK	1.364	-
FORRÁSOK ÖSSZESEN :	4.599.670	4.570.247

Budapest, 2023. május 26

CIB PROFTMIX 5 TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP
EREDMÉNYKIMUTATÁS



adatok eFt-ban

Megnevezés	2022	2023.01.01-2023.05.19
<i>I. Pénzügyi műveletek bevételei</i>	<i>117.451</i>	<i>157.657</i>
<i>II. Pénzügyi műveletek ráfordításai</i>	<i>-</i>	<i>-</i>
<i>III. Egyéb bevétel</i>	<i>6.679</i>	<i>3.127</i>
<i>IV. Működési költség</i>	<i>53.331</i>	<i>81.064</i>
<i>V. Egyéb ráfordítások</i>	<i>2.202</i>	<i>856</i>
<i>VI. Fizetett, fizetendő hozamok</i>	<i>-</i>	<i>258.003</i>
VII. Tárgyévi eredmény (I-II+III-IV-V-VI)	68.597	- 179.139

Budapest, 2023. május 26

CIB Proftmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap

KIEGÉSZÍTŐ MELLÉKLET

2023.05.19

I. Az Alap bemutatása

Az Alap teljes neve:	CIB Profitmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap
MNB engedély száma:	H-KE-III-311/2019.
MNB engedély kelte:	2019. május 14.
Az Alap kezelője:	Eurizon Asset Management Hungary Zrt. (2021. április 8-át megelőzően CIB Befektetési Alapkezelő Zrt.)
Székhelye:	1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.
Mérleg fordulónapja:	2023. május 19.
Mérlegkészítés időpontja:	2023. május 23.
Befektetési jegyek forgalmazója:	CIB Bank Zrt. 1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.
Letétkezelő:	CIB Bank Zrt. 1024 Budapest, Petrezselyem u. 2-8.
Könyvvizsgáló:	Kónya Zsolt Kamarai tagsági száma: MKVK-007383 Ernst & Young Kft.
Beszámolót aláíró személy:	Komm Tibor (Budapest) Eurizon Asset Management Hungary Zrt. vezérigazgatója

A beszámoló készítésének oka a CIB Profitmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap futamidejének 2023. május 19-i lejárat.

Beszámolási időszak 2023. január 01-től 2023. május 19-ig tart.

A tevékenységet lezáró beszámoló a 215/2000. (XII. 11.) számú "A befektetési alapok éves beszámoló készítési és könyvvezetési kötelezettségének sajátosságairól" szóló kormányrendelet és a 2000. évi C. törvény a számvitelről figyelembevételével készült.

A CIB Profitmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap (továbbiakban: az Alap) befektetési politikája az Alap tájékoztatójában kerül bemutatásra.

Az Eurizon Asset Management Slovakia, správ. spol., a.s., mint a CIB Befektetési Alapkezelő Zrt. egyedüli részvényese 2021. április 1-jén kelt 6/2021. (IV. 1.) sz. részvényesi határozatával az Alapkezelő cégnevének megváltoztatásáról döntött, amely alapján az Alapkezelő tevékenységét 2021. április 8-tól Eurizon Asset Management Hungary Zrt. név alatt folytatja.

II. A mérleghez kapcsolódó kiegészítések

1.1 Eszközök

1.1.1. Befektetett eszközök

Az Alap a Számviteli Törvény adta lehetőséget kihasználva a 215/2000. számú kormányrendelet 1. számú mellékletében az értékpapír alapokra előírt mérlegsémát a könnyebb áttekinthetőség érdekében kibővítette, a Befektetett eszközök között megjelenítette a Hosszúlejáratú bankbetétek mérlegsort, melyen az éven túli lejáratú bankbetétek összegét mutatja ki.

Az Alap sem a mérleg fordulónapján, sem 2022.12.31-én nem rendelkezett befektetett eszközökkel

1.1.2. Forgóeszközök

1.1.2.1. Követelések

Az Alapnak a mérleg fordulónapján követelésként 4.526.503 ezer Ft befektetőknek lejáratkor kifizetett előleg, valamint lejáratig még meg nem fizetett, jóváírandó kamat 5.635 ezer Ft került kimutatásra. (2022. december 31-én 210 ezer Ft befektetési jegy forgalmazási jutalék visszatérítésből).

1.1.2.2. Értékpapírok

Az Alap a megvásárolt, illetve értékesített értékpapírokat az üzletkötés napján veszi nyilvántartásba, illetve vezeti ki a nyilvántartásból. Az értékpapírok adásvétele során a bizományos felé fizetendő jutalékot költségként számolja el. Abban az esetben, ha az üzletkötés napja eltér a pénzügyi teljesítés napjától, akkor az ügyletekből adódó követeléseket, illetve kötelezettségeket bruttó módon, az egyéb követelések, illetve az egyéb kötelezettségek között mutatja ki a mérlegben.

Az értékpapírok a mérlegben piaci értéken kerülnek kimutatásra. A piaci érték a beszerzési érték és a 215/2000. (XII.11.) számú kormányrendeletben meghatározott értékelés szerinti értékkülönbözlet együttes összegeként kerül meghatározásra.

Az Alap saját portfóliójában lévő állampapírait az alábbiak szerint értékeli:

Az Alap T napon tulajdonában lévő állampapírait – a mérleg fordulónapi tőzsdenapi záróárfolyam és a fordulónapi felhalmozott kamat összegeként veszi számításba.

Tőzsdén nem jegyzett állampapírokat az ÁKK által mérleg fordulónapjára közzétett legjobb vételi és legjobb eladási árfolyam számtani átlaga és a fordulónapi felhalmozott kamat összegeként veszi számításba az Alap.

A 3 hónapnál rövidebb hátralévő futamidejű állampapírok és egyéb jegybankképes értékpapírok esetében, (amelyekre az elsődleges állampapír-forgalmazóknak már nincs árjegyzési kötelezettsége), és amelyekre az adott napon nem született tőzsdei kötés, ott az adott állampapír Államadósság Kezelő Központ által közzétett aktuális 3 hónapos referenciahozammal számított jelenértéke a meghatározó.

Az Alap sem a mérleg fordulónapján, sem 2022.12.31-én saját portfóliójában értékpapír állománnyal nem rendelkezik.

1.1.2.3. Pénzeszközök

Az Alap CIB Banknál vezetett folyószámlájának fordulónapi egyenlege 38.109 ezer Ft (2022. december 31-én folyószámlájának fordulónapi egyenlege 759.869 ezer Ft, éven belüli lejáratú szintetikus betétállomány összege 3.600.000 ezer Ft, az elszámolt értékelési különbözet összege 197.998 ezer Ft).

1.1.2.4. Aktív időbeli elhatárolások

Az Alap a mérleg fordulónapján nem képzett aktív időbeli elhatárolást. (2022. december 31-én 237.117 ezer Ft).

1.1.2.5. Származtatott ügyletek értékelési különbözete

E mérlegsoron az Alap a javára kötött, fordulónapon le nem zárt opciós ügyletet piaci értéken tartja nyilván. Az opció piaci ára az opció legjobb vételi és legjobb eladási árának számtani átlagaként kerül meghatározásra.

Az Alap a portfóliójában szereplő opciót számviteli politikájában rögzített módon a következőképpen számolja el könyveiben: az opció speciális jellegéből adódóan az opciós szerződésben a kötés napján meghatározott opciós prémiumot az Alap az opció bekerülési értékeként tartja nyilván, melynek értékét a pénzeszközökkel szemben számolja el a bekerülés/kötés napján. A bekerülési érték és a mindenkori piaci érték közötti különbözetet az Alap értékelési különbözet tartalékával szemben számolja el.

Az opció lejáratkor, illetve értékesítésekor az értékelési különbözet az értékelési tartalékkal szemben kivezetésre kerül, a bekerülési érték és a lejáratkor/értékesítésekor kapott tényleges ár közötti különbözet pedig árfolyameredményként kerül elszámolásra.

Az opció számviteli elszámolása az értékpapírokhoz hasonlóan történt az opció jellege miatt.

Az Alapnak mérlegfordulónapon nyitott származékos ügylete nincs.

Az Alap portfóliójában lévő opció adatai 2022.12.31-én:

Adatok ezer Ft-ban					
Opció	Szerződés szerinti érték	Értékelési különbözet	Piaci érték	Lejárat	Kibocsátó
BNP_Profitmix5_opció	172.947	27.525	200.472	2023.05.12	BNP
Összesen	172.947	27.525	200.472		

1.2. Források

1.2.1. Saját Tőke

Az Alap saját tőkéje két részből áll, az indulótőkéből és a tőkenövekményből.

Indulótőkeként az Alap a fordulónapon forgalomban lévő befektetési jegyek össznévértékét mutatja ki.

Az Alap befektetési jegyeinek alapcímlete 10.000 Ft.

Az Alap 2019. május 14-én kezdte meg működését, nyilvános ajánlattétel keretében lejegyzett 4.587.460 ezer Ft értékű befektetési jegy kibocsátásával.

Az Alap befektetési jegyeinek forgalmazása 2019. május 20-tól kezdődött.

A forgalmazási időszakban a befektetési jegyek eladásából és visszavételéből adódó, a befektetési jegyek névértékének és árfolyamának különbözetét tőkenövekményként számolja el az Alap. Tőkenövekmény részét képezi még a tárgyév eredménye és az Alap tulajdonában lévő befektetési eszközök fordulónapra kiszámolt értékelési különbözete, amely a befektetési eszközök beszerzési értéke és a fordulónapra érvényes piaci ár közötti nettó különbözet.

Az Alap nettó eszközérték jelentésével összhangban a megszűnési körülmények közötti saját tőke 4.268.500 ezer Ft, amely összeg a befektetők részére 2023. május 19-én előlegként kifizetésre került.

Adatok ezer Ft-ban

Időszak	Induló tőke kibocsátott befektetési jegy névértéke	Induló tőke visszavásárolt befektetési jegy névértéke	Tőkenövek- mény a forgalmazott befektetési jegyek értékkülönbö- zetéből	Tőkenövek- mény értékelési különbözetből	Tőkenövek- mény eredményből
Nyitó	5.052.600	-694.030	2.999	-170.473	178.627
Növekedés	7.070	-	-	170.473	-
Csökkenés	-	-97.140	-2.487	-	-
Időszak eredménye	-	-	-	-	-179.139
Záró	5.059.670	-791.170	512	-	-512

1.2.2. Céltartalékok

Az Alap nem képzett céltartalékokat.

1.2.3. Kötelezettségek

1.2.3.1. Hosszú lejáratú kötelezettségek

Az Alap sem a fordulónapon, sem 2022.12.31-én hosszú lejáratú kötelezettséget nem képzett.

1.2.3.2. Rövid lejáratú kötelezettségek

A fordulónapon az Alap igénybevett szolgáltatásokból eredő rövid lejáratú kötelezettségeinek összege 43.744 ezer Ft, fizetendő hozam 258.003 ezer Ft. (2022. december 31-én igénybevett szolgáltatásokból 23.547 ezer Ft, befektetési jegy forgalmazásból 4.284 ezer Ft, óvadékba adott pénz miatti kötelezettsége 200.752 ezer Ft.)

1.2.4. Passzív időbeli elhatárolások

Az Alap a mérleg fordulónapon nem képzett passzív időbeli elhatárolást. (2022. december 31-én 1.364 ezer Ft).

III. Az eredménykimutatáshoz kapcsolódó kiegészítések**1. Pénzügyi műveletek bevételei**

2023. évben az Alapnak befektetési tevékenységéből származó, - a tevékenység jellegéből adódóan - nagyrészt pénzügyi bevételei voltak. Az Alap az értékpapírok adás-vétele során keletkező árfolyamnyereség, illetve árfolyamvesztés elszámolásakor FIFO módszert alkalmaz. A kamatozó értékpapírok vételárában felhalmozott kamat a pénzügyi műveletek bevételeit csökkentő tételként, eladási árban felhalmozott kamat kamatbevételeként kerül elszámolásra. A pénzügyi műveletek bevételei az alábbiak szerint alakultak:

Adatok ezer Ft-ban		
Megnevezés	2022	2023
Opciók ügylet árfolyamnyeresége	-	103.840
Egyéb kapott kamatjellegű bevételek	117.451	53.817
Összesen	117.451	157.657

2. Pénzügyi műveletek ráfordításai

Sem tárgyévben, sem 2022.12.31-én pénzügyi műveletek ráfordítást nem számolt el.

3. Egyéb bevételek

Befektetési jegy forgalmazásából az Alapnak járó jutalékok 2023. évi összege 3.127 ezer Ft. (2022. évben 6.679 ezer Ft).

4. Működési költségek

Az Alap működési költségként csak a kibocsátási tájékoztatóban részletezett díjakat számolja el.

A működési költségek részletezését az alábbi tábla szemlélteti:

Adatok ezer Ft-ban		
Megnevezés	2022	2023
Alapkezelési alapidj	13.469	48.232
Forgalmazói díj	34.622	29.637
Felügyeleti díj	1.542	602
Könyvvizsgálói díj	1.383	1.698
Könyvelési díj	522	201
Letétkezelői díj	1.762	683
Bankköltség	31	11
Összesen	53.331	81.064

5. Egyéb ráfordítás

Az Alap tárgyévben 856 ezer Ft különadót számolt el egyéb ráfordításként. (2022. évben 2.202 ezer Ft).

6. Fizetett, fizetendő hozam

Az Alap tárgyévben 258.003 ezer Ft hozamot fizetett ki.

IV. Egyéb kiegészítések

Célkitűzések és befektetési politika

Az Alap céljaként szerepelt, hogy a telekommunikációban és az élelmiszeriparban világszinten vezető szerepet betöltő, közismert tőzsdei vállalatok, a *Deutsche Telekom AG*, a *Kellogg Company*, a *Nestlé S.A.*, a *Nokia Oyj* és a *Vodafone Group Plc.* részvényeiből egyenlő arányban összeállított kosár futamidő alatti a következő szabályok szerint számított teljesítményét a lejáratkor kifizesse. A hozamszámítás során az egyes részvények ténylegesen elért teljesítménye legfeljebb 45,00%-ig került figyelembevételre. Így optimális esetben az Alap a teljes futamidő alatt akár 45,00%-os maximális teljesítményt is biztosíthatott (365 napos bázison számított, maximális éves hozam=9,73%, maximális EHM*=9,73%) (100%-os részesedési arány mellett). A lehetséges maximális hozam elérése érdekében a javasolt befektetési időtartam megegyezett az Alap futamidejével. A részvények esetleges szélsőséges árfolyam-ingadozásának hatását az Alap azzal kívánta mérsékelni, hogy a hozamszámításnál a részvényeknek az Alap futamideje első három hetében a heti gyakorisággal megfigyelt árfolyamok átlagát alkalmazta kezdőértéknek, míg a záróértéket a részvények futamidő alatti évente egy alalommal megfigyelt árfolyamainak az átlaga jelentette. Az Alap befektetési politikája nem biztosította minimum hozam kifizetését.

A hozamlehetőséget nyújtó Opció mögöttes pénzügyi eszközeinek általános bemutatása

Az Alap hozamtermelő eszközét a *Deutsche Telekom AG*, a *Kellogg Company*, a *Nestlé S.A.*, a *Nokia Oyj* és a *Vodafone Group Plc.* részvényekből egyenlő arányban összeállított részvénykosár jelenti, amelynek teljesítményéből való részesedést a Kezelési szabályzat VI. fejezetének 31. pontjában szereplő opciós ügylet biztosította.

→ *Deutsche Telekom AG*: a világ egyik legnagyobb infokommunikációs és távközlési szolgáltatója, amely elsősorban az európai, illetve az amerikai kontinens több mint 50 országában közel 225 millió üzleti és lakossági előfizetőknek nyújt mobil, illetve vezetékes hang, adat, internet, távközlési, televíziós és informatikai szolgáltatásokat. A vállalat valamennyi termékét és szolgáltatását egységes márkanév alatt értékesíti. A németországi Bonn városban székhellyel rendelkező vállalat története 1861-ig nyúlik vissza, alkalmazottainak száma meghaladja a 215 ezer főt. A vállalat a 30 legnagyobb német vállalatot magában foglaló DAX tőzsdei részvényindex eleme, részvényeivel valamennyi németországi és az amerikai OTCQX tőzsdén kereskednek.

→ *Kellogg Company*: a világ egyik jelentős élelmiszeripari vállalata, amely elsősorban müzlik, kekszek, snack, crisps kukoricapehely, burgonyaszírom és egyéb reggeliző termékek gyártásáról vált ismertté. A vállalat rengeteg népszerű és kedvelt gyártói márka, így többek között a All-Bran, Apple Jacks, Corn Pops, Cracklin' Oat Bran, Crispix, Crunchmania, Eggo, Froot Loops™, Frosted Mini-Wheats, Fruit Flavored Snacks, Happy Inside, Honey Smacks, Kellogg's Raisin Bran, Kellogg's Frosted Flakes, Kellogg's Limited Edition, Kellogg's, Nutri-Grain, Krave, Moe's Southwest Grill Breakfast Bowls, Mueslix, Pop-Tarts, Rice Krispies, Smart Start, Special tulajdonosa. Az 1898-ban alapított, Battle Creek-ben (Michigan, Egyesült Államok) székhellyel rendelkező vállalat megközelítőleg 33 ezer alkalmazottat foglalkoztat, termékeit a világ 21 országában található gyártóüzemeiben állítja elő és világ 180 országában kínálja a fogyasztók számára. A vállalat értékesítésében jelentős szerepet tölt be a Wal-Mart Stores. A vállalat részvényeivel - melyek az S&P 500 Index és S&P 500 Packaged Foods & Meats Index kosarának elemei - a New York Stock Exchange tőzsdén kereskednek.

→ *Nestlé S.A.*: a világ legnagyobb élelmiszeripari vállalata, tevékenységének központjában az édességek mellett elsősorban az állateledetek, ásványvizek, reggelizőpelyhek, kávé és kakaó, csecsemőtáplálási, konyhai és professzionális vendéglátóipari termékek gyártása szerepel. A vállalat kínálatában található termékek számos közismert márkanév, így többek között a Mövenpick, Häagen-Dazs, After Eight, Smarties, Kit Kat, Darling, Friskies, Nesquik, Nescafé, Nespresso, Ricoré, Cerelac, Maggi alatt kerülnek a fogyasztókhoz. A Svájcban található Vevey székhellyel rendelkező, 1867-ben alapított vállalat világszerte közel 450 gyártó üzemében 280 ezer alkalmazottat foglalkoztat, termékeit 130 országban értékesíti, részvényeivel többek között a Swiss Stock Exchange-en lehet kereskedni. Részvényei számos vezető tőzsdeindex, többek között a Swiss Market Index, FTSE, MSCI, és a Dow Jones indexcsaládok kosarának elemei.

→ *Nokia Oyj*: a mobilkommunikációs eszközök és kommunikációs hálózatok és berendezések vezető szállítója, 130 országban van jelen, termékeit és szolgáltatásait több mint 400 millióan használják. Az 1865-ben végén eredetileg fűrészmalomként alapított vállalat története során papírgyárként, elektronikai üzemként, kábel- és gumibroncsgyárakként, illetve energiaszolgáltatóként is működött, tevékenységét az 1990-es évektől a mobil távközlésre összpontosította. A hagyományos mobiltelefonpiac összeomlását követően sikeresen újjászervezte működést, napjainkban fő tevékenységi köre a hagyományos, illetve az okos hálózatok fejlesztésére, az ötödik generációs késleltetés nélküli, folyamatosan rendelkezésre álló kapcsolatokra, adatátviteli megoldások fejlesztésére összpontosul, amely mellett a mesterséges

intelligencia és a kognitív tudományok területén is alapkutatásokat folytat. A finnországi Espoo városában található központtal rendelkező vállalat 100 ezer munkavállalót foglalkoztat, részvényeivel számos piacon, így a Nasdaq Helsinki Stock Exchange a New York Stock Exchange és a Euronext Paris Stock Exchange tőzsdéken kereskednek, a Dow Jones, Nasdaq, S&P, STOXX indexcsaládok számos tagjának elemei.

→ **Vodafone Group Plc:** a világ egyik vezető kommunikációs szolgáltatójaként Európában, Közel-Keleten, Amerikában, Afrikában és Ázsiában is jelen van, magánszemélyek és vállalkozások számára nyújt vezetékes és vezeték nélküli távközlési, mobilfizetési, kereskedelmi televíziós szolgáltatásokat, valamint kommunikációs hálózatokat tervez, fejleszt, épít és működtet, emellett telekommunikációs, híradás- és számítástechnikai termékek nagy- és kiskereskedelmi tevékenységét is végzi. A több mint 100 ezer alkalmazottat foglalkoztató vállalat székhelye az Egyesült Királyságban fekvő Newbury városában található, története 1983-ig vezethető vissza, termékeit és szolgáltatásait a világ 144 országában több mint 500 millió ügyfelének értékesíti. A vállalat a **FTSE 100 Index tagja**, valamint a London Stock Exchange részvénytőzsdén jegyzett 100 legnagyobb piaci kapitalizációval rendelkező részvénytársaság közé sorolható, részvényeivel a London Stock Exchange és Nasdaq tőzsdéken lehet kereskedni.

*A betéti kamat és az értékpapírok hozama számításáról és közzétételéről szóló 82/2010. (III. 25.) Korm. rendelet szerint számított egységesített értékpapír hozam mutató.

Az Alapra jellemző kockázat-hozam profil

Az Alapra jellemző kockázati profilnak, valamint az ezzel összhangban álló pénzügyi célnak megfelelően, az Alap a kockázatkedvelő, közepes szintű hozamvárománnyal és legalább az Alap futamidejével megegyező befektetési időhorizonttal rendelkező Befektetők számára olyan forint alapú befektetést nyújtott, amelyre a befektetési jegyek árfolyamának kiszámítható ingadozása jellemző.

Az Alap hozamfizetésére vonatkozó adatok

→ A futamidő elején alkalmazott átlagolás

Az Alap futamidő alatt elért teljesítményének megállapítása során a részvénykosárban szereplő részvények kezdő értékének a futamidő elején heti gyakorisággal a 2019/05/20, 2019/05/27 és 2019/06/03 napokon megfigyelt tőzsdei napvégi záróárak átlagát tekintjük. Ez a hozamszámítási módszer csökkentheti a hozamkifizetés feltételének megállapítása során a részvények esetleges rövid ideig tartó szélsőséges elmozdulásainak a hozamkifizetésre gyakorolt hatását.

→ A futamidő alatt alkalmazott átlagolás

Az Alap futamidő alatt megfigyelt nominális teljesítményének megállapítása során a részvénykosárban szereplő részvények záró értékének a futamidő alatt éves gyakorisággal, 2020/04/30, 2020/05/08, 2020/05/15, 2021/04/30, 2021/05/07, 2021/05/14, 2022/04/29, 2022/05/06, 2022/05/13, 2023/04/28, 2023/05/05 és 2023/05/12 napokon megfigyelt tőzsdei napvégi záróárak átlagát tekintjük. Ez a hozamszámítási módszer csökkentheti a hozam megállapítása során a részvények esetleges rövid ideig tartó szélsőséges elmozdulásainak a hozamra gyakorolt hatását. Így a részvények teljesítménye kiegyenlítettebben vehet részt a hozamkifizetésre vonatkozó feltételének teljesítésében.

CIB PROFITMIX 5 TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP

Kiegészítő melléklet 2023.05.19-ével végződő gazdasági időszakra

Az Alap lejáratkori teljesítménye a fentiek alapján a Befektetési jegyek névértékére vetítve az alábbiak szerint alakult:

Az Alap hozamát termelő eszközkosárban található részvények árfolyama az egyes megfigyelési pontokon:

Részvények	2019/05/20	2019/05/27	2019/05/28	2019/06/03	Futamidő indulásakor számolt átlag	2020/04/30	2020/05/08	2020/05/11	2020/05/15	1. év végén számolt átlag	2021/04/30	2021/05/07	2021/05/14	2. év végén számolt átlag	2022/04/29	2022/05/06	2022/05/13	3. év végén számolt átlag	2023/04/28	2023/05/05	2023/05/12	4. év végén számolt átlag
Deutsche Telekom	15,286	15,216		15,224	15,2420	13,325	13,660		13,640	13,5417	16,000	16,534	16,812	16,4487	17,570	17,302	18,322	17,7313	21,880	21,410	21,660	21,6500
Kellogg	56,440	54,560	53,800	54,9333	65,500	63,680	64,070	64,4167	62,420	66,950	66,540	65,3033	68,500	72,730	73,010	71,4133	69,770	70,350	70,810	70,3100		
Nestlé	99,550	99,470	101,440	100,1533	101,900	105,000	103,880	103,5933	108,880	109,120	108,840	108,9467	126,000	123,360	122,540	123,9667	114,520	116,460	114,980	115,3200		
Nokia	4,492	4,5505	4,457	4,4997	3,324	3,2945	3,187	3,2685	3,943	4,267	4,047	4,0852	4,871	4,768	4,699	4,7788	3,842	3,763	3,763	3,7890		
Vodafone	126,400	127,120	129,960	127,8267	112,140	113,000	120,980	115,3733	136,800	141,820	140,720	139,7800	121,540	120,420	117,820	119,9267	95,900	95,020	89,860	93,5933		

Az Alap hozamát termelő részvények és az ezekből egyenlő arányban összeállított részvénykosár által elért hozam a futamidő egyes éveiben, illetve végén:

Rész- vények	Egyes részvények						Részvénykosár hozama		4. év végén kifizetésre kerülő hozam
	képlet szerint megfigyelt hozama					kosársúlya	képlet szerinti	100% részesedési rátával	
	1. év végén	2. év végén	3. év végén	4. év végén	futamidő alatt számolt átlag				
Deutsche Telekom	-11,1556%	7,9167%	16,3321%	42,0417%	13,7837%	20,00%	6,0444%	6,0444%	6,0444%
Kellogg	17,2633%	18,8774%	30,0000%	27,9915%	23,5331%	20,00%			
Nestlé	3,4347%	8,7799%	23,7769%	15,1434%	12,7837%	20,00%			
Nokia	-27,3613%	-9,2118%	6,2042%	-15,7938%	-11,5407%	20,00%			
Vodafone	-9,7424%	9,3512%	-6,1802%	-26,7811%	-8,3381%	20,00%			

Az Alap Kezelési szabályzatának, VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint teljes, 4 éves futamidő alatt az Alap hozamát termelő *Deutsche Telekom AG*, a *Kellogg Company*, a *Nestlé S.A.*, a *Nokia Oyj* és a *Vodafone Group Plc.* részvényeiből egyenlő arányban összeállított kosár az egyes megfigyelési pontokon +13,7837%, +23,5331%, +12,7837%, -11,5407%, és -8,3381% hozamot ért el, amelyekből számolt átlag +6,0444%-os teljesítményt és a 100%-os részesedési arálynak megfelelően ezzel megegyező mértékű lejáratkor kifizethető hozamot eredményezett.

Ahol:

☑ részvényⁱ⁼¹⁻⁵:

- *Deutsche Telekom AG* (ISIN code: DE0005557508, Bloomberg code: DTE:GY Equity)
- *Kellogg Company* (ISIN code: US4878361082, Bloomberg code: K:UN Equity)
- *Nestlé S.A.* (ISIN code: CH0038863350, Bloomberg code: NESN SE Equity)
- *Nokia Oyj* (ISIN code: FI0009000681, Bloomberg code: NOKIA:FH Equity)
- *Vodafone Group Plc.* (ISIN code: GB00BH4HKS39, Bloomberg code: VOD:LN Equity)

☑ részvény₀ = a Kezelési szabályzat 1.10. pont szerinti futamidő indulásakor heti gyakorisággal, 2019/05/20, 2019/05/27 illetve 2019/05/28 (*Kellogg Company* és *Vodafone Group Plc* részvények esetében) és 2019/06/03 napokon megfigyelt napvégi záróárak egyszerű számtani átlaggal számolt értéke.

☑ részvény_{t=1-4}:

- részvény_{t=1} = a Kezelési szabályzat 1.10. pont szerinti futamidő első évének végén heti gyakorisággal 2020/04/30, 2020/05/08, illetve 2020/05/11 és 2020/05/15 napokon megfigyelt napvégi záróárak egyszerű számtani átlaggal számolt értéke.
- részvény_{t=2} = a Kezelési szabályzat 1.10. pont szerinti futamidő második évének végén heti gyakorisággal, 2021/04/30, 2021/05/07 és 2021/05/14 napokon megfigyelt napvégi záróárak egyszerű számtani átlaggal számolt értéke.
- részvény_{t=3} = a Kezelési szabályzat 1.10. pont szerinti futamidő harmadik évének végén heti gyakorisággal, 2022/04/29, 2022/05/06 és 2022/05/13 napokon megfigyelt napvégi záróárak egyszerű számtani átlaggal számolt értéke.
- részvény_{t=4} = a Kezelési szabályzat 1.10. pont szerinti futamidő negyedik évének végén heti gyakorisággal, 2023/04/28, 2023/05/05 és 2023/05/12 napokon megfigyelt napvégi záróárak egyszerű számtani átlaggal számolt értéke.

Az Alapnak a részvénykosár teljesítményétől függő hozamából az Alap kezelési szabályzatának, VI. fejezet 31. pontja szerint rögzített részesedési arány szerint történik a kifizetés, ennek mértéke 100%-ban került meghatározásra:

https://net.cib.hu/system/files/server?file=/Sajtoszoba/CIB.Profitmix.5.Alap_sikeres.jegyzes_reszesedesi.rata_20190521.pdf&type=related.

Az Alap a befektetési jegyek számlavezető helyein az ügyfelek értékpapírszámlájához kapcsolódó pénzszámlákra 2023/05/19-én 100%-os tőkevédelem visszafizetést teljesített Befektetési jegyenként 10.000 HUF összegben, valamint az Alap a Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint a futamidő végén történt kifizetéssel összesen +6,0444%-os (éves hozam: 1,48%, EHM=1,48%) hozamot ért el, melynek kifizetését követően 2023/05/19-én lezárta működését.

Az Alap a megszűnési jelentésben szereplő számviteli információk 2014. évi XVI. törvényben kötelezően előírt könyvvizsgálattal az Ernst & Young Kft -t bízta meg.

A könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy Szarvas Hajnalka (Budaörs), MKVK tagsági száma: 005105.

Az Alap 2023. évben az igazgatóság és a felügyelő bizottság tagjainak tevékenységükért járandóságot nem fizetett, kölcsön nem került folyósításra.

Az Alap a fordulónapon függő- és jövőbeni követelésként ki nem használt hitelkeretet nem tart nyilván.

Az Alap 2023. évben határidős, swap, értékpapír kölcsönzési, illetve óvadéki REPO ügyleteket nem számolt el.

Nincs az alap javára kapott, illetve terhére adott fedezet, biztosíték, óvadék, garancia- és kezességvállalás.

Az Alap 2023. május 19-én-án lejárt, befektetési jegyei visszaváltásra kerültek, ezért üzleti jelentés nem készül.

Az Alap befektetési jegyei után ígéretet tett a tőke megóvására, melynek lejáratkori értéke 4.268.500 ezer Ft, lejáratkori hozammal növelt összeg 4.526.503 ezer Ft került kifizetésre. Az ígéret megvalósulását az Alap befektetési politikája biztosítja.

Az Alap Cash flow kimutatását az 1. számú melléklet tartalmazza. Az Alap 2023. évi utolsó, letétkezelő által közzétett, 2023.05.19-re vonatkozó Portfólió jelentése a 2. számú mellékletben található. A beszámoló adatai a Portfólió jelentésben szereplő adatoktól a 2023. május 19-i lejáratkori kifizetéssel térnek el

Az Alap tevékenységet lezáró beszámolója, mint az Alapra vonatkozó hivatalos közlemény megtekinthető a forgalmazási helyeken, az alapkezelő székhelyén és a www.eurizon.hu oldalon.

Budapest, 2023. május 26.

Komm Tibor, Elnök-vezérigazgató, Eurizon Asset Management Hungary Zrt. által elektronikusan aláírva.

CIB PROFITMIX 5 TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP

Kiegészítő melléklet 2023.05.19-ével végződő gazdasági időszakra

1. számú melléklet**CIB Profitmix 5 Tőkevédett Származtatott Alap**

Cash flow-kimutatás

Adatok ezer Ft-ban

Sorszám	A tétel megnevezése	2022	2023
a	b	d	d
I.	Szokásos tevékenységből származó pénzeszköz-változás	3.589.517	-4.520.137
1.	Tárgyévi eredmény (befolyt bérleti díjak, kapott hozamok nélkül)	16.755	-470.072
2.	Elszámolt amortizáció +	-	0
3.	Elszámolt értékvesztés és visszaírás	-	0
4.	Elszámolt értékelési különbözet *	-	0
5.	Céltartalék képzés és felhasználás különbözete	-	0
6.	Ingatlan befektetések értékesítésének eredménye	-	0
7.	Értékpapír befektetések értékesítésének, beváltásának eredménye	-	0
8.	Befektetett eszközök állományváltozása	3.600.000	0
9.	Forgóeszközök állományváltozása	271	-4.358.981
10.	Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása	221.904	73.164
11.	Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása	-183.917	0
12.	Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása	-65.608	237.117
13.	Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása	113	-1.364
II.	Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás	51.843	290.934
14.	Ingatlanok beszerzése -	-	0
15.	Ingatlanok eladása +	-	0
16.	Befolyt bérleti díjak +	-	0
17.	Értékpapírok beszerzése -	-	0
18.	Értékpapírok eladása, beváltása +	-	0
19.	Kapott hozamok +	51.843	290.934
III.	Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás	-189.840	-92.557
20.	Befektetési jegy kibocsátás +	36.960	7.070
21.	Befektetési jegy kibocsátás során kapott apport -	-	0
22.	Befektetési jegy visszavásárlása -	-229.710	-97.140
23.	Befektetési jegyek után fizetett hozamok -	2.910	-2.487
24.	Hitel, illetve kölcsön felvétele +	-	0
25.	Hitel, illetve kölcsön törlesztése -	-	0
26.	Hitel, illetve kölcsön után fizetett kamat -	-	0
IV.	IV. Pénzeszközök változása	3.451.520	-4.321.760

* Az Elszámolt értékelési különbözet sor nem tartalmazza a hosszú lejáratú bankbetétek, származtatott ügyletek és értékpapírok értékelési különbözetét

CIB PROFITMIX 5 TŐKEVÉDETT SZÁRMAZTATOTT ALAP

Kiegészítő melléklet 2023.05.19-ével végződő gazdasági időszakra

2. számú melléklet

Portfólió jelentés értékpapíralapra				
Adatok MAGYAR FORINT devizában				
Alap neve, lajstromszáma:	CIB Profitmix 5 Alap, 1111-782			
Letétkezelő neve:	CIB Bank Zrt.			
NEÉ számítás típusa:	T+1 napon számolt			
	Tárgynap (T nap):	2023.05.19		
	Saját tőke:	4.526.503.080,00		
	Egy jegyre jutó NEÉ:	10.604,4350		
	Darabszám:	426.850		
			Érték	%
I. Kötelezettségek			-43.697.783,00	100,00
I/1. Hitelállomány (összes)			0,00	0,00
I/2. Egyéb kötelezettségek (összes)			-43.697.783,00	100,00
Alapkezelői díj			-35.369.443,00	80,94
Felügyeleti díj			-211.827,00	0,48
Forgalmazói díj			-4.516.653,00	10,34
Könyvelési díj			-70.334,00	0,16
Könyvvizsgálói díj			-1.363.980,00	3,12
Különadó			-302.609,00	0,69
Letétkezelői díj			-242.091,00	0,55
Sikerdíj			0,00	0,00
Egyéb nem költség alapú kötelezettségek (összes)			-1.620.846,00	3,71
I/3. Céltartalékok (összes)			0,00	0,00
I/4. Passzív időbeli elhatárolások (összes)			0,00	0,00
II. Eszközök			4.570.200.863,00	100,00
II/1. Folyószámla, készpénz (összes)			4.570.200.863,00	100,00
II/2. Egyéb követelés (összes)			0,00	0,00
II/3. Lekötött bankbetétek			0,00	0,00
II/3.1. Max 3 hó lekötésű (összes)			0,00	0,00
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes)			0,00	0,00
II/4. Értékpapírok			0,00	0,00
II/4.1. Állampapírok (összes)			0,00	0,00
II/4.1.1. Kötvények (összes)			0,00	0,00
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes)			0,00	0,00
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes ép. (összes)			0,00	0,00
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes)			0,00	0,00
II/4.2. Gazdálkodó és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.			0,00	0,00
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes)			0,00	0,00
II/4.2.2. Külföldi kötvények (összes)			0,00	0,00
II/4.2.3. Tőzsdén kívüli (összes)			0,00	0,00
II/4.3. Részvények			0,00	0,00
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes)			0,00	0,00
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes)			0,00	0,00
II/4.3.3. Tőzsdén kívüli (összes)			0,00	0,00
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes)			0,00	0,00

2. számú melléklet (folytatás)

II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes)			0,00	0,00
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes)			0,00	0,00
II/4.5. Befektetési jegyek (összes)			0,00	0,00
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes)			0,00	0,00
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes)			0,00	0,00
II/4.6. Kárpótlási jegy (összes)			0,00	0,00
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes)			0,00	0,00
II/6. Származékos ügyletek			0,00	0,00
II/6.1. Határidős			0,00	0,00
II/6.1.1. Futures (összes)			0,00	0,00
II/6.1.2. Forward (összes)			0,00	0,00
II/6.2. Opció			0,00	0,00
II/6.2.1. Tőzsdei opció (összes)			0,00	0,00
II/6.2.2. OTC ill. OTC típusú (összes)			0,00	0,00
Eszközök összesen:			4.570.200.863,00	100,00

3. számú melléklet

Pénzügyi mutatók	2022	2023
Összes kötelezettség / Összes eszköz	4,97%	6,06%
Saját tőke / Összes forrás	95,00%	93,40%
Tárgyévi eredmény / Saját tőke	1,57%	-
Tárgyévi eredmény / Összes bevétel	55,26%	-
Pénzeszköz / Saját tőke	95,24%	0,89%