



EURIZON
ASSET MANAGEMENT

**EURIZON EURÓPAI CSILLAGOK TŐKEVÉDETT
SZÁRMAZTATOTT RÉSZALAPJA**

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 Eurizon Európai Csillagok Tőkevédett Származtatott Részalapja

| | |
|------------------------|---|
| Megnevezése: | Eurizon Európai Csillagok Tőkevédett Származtatott Részalapja, az Eurizon Származtatott Esernyőalap részalapja (a továbbiakban: Részalap, A Részalap neve 2023.05.08-át megelőzően CIB Európai Csillagok Tőkevédett Származtatott Részalapja) |
| A Részalap típusa: | nyilvános |
| A Részalap fajtája: | nyíltvégű, azaz a futamidő alatt a Részalap befektetési jegyei a kezelési szabályzatban foglalt szabályok szerint megvásárolhatók, illetve visszaválthatók |
| A Részalap futamideje: | a Részalap határozott futamidőre, 2023/03/01-2026/04/24 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

A Részalap portfóliójában található eszközök és források tételes összetétele

| Tárgynap (T. forgalmazás-elszámolási nap) | 2021.12.30 | | 2023.03.01 | | 2023.06.30 | |
|--|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
| Saját tőke | - | | 179.850.401 HUF | | 3.426.299.414 HUF | |
| Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | - | | 1,0000 | | 1,0656 | |
| Darabszám | - | | 179.850.401 db | | 3.215.371.487 db | |
| Tőkeáttétel bruttó, valamint kötelezettség módszerrel számított teljes mértéke* | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer | Kötelezettség módszer | Bruttó módszer |
| Tényleges | - | - | - | - | 96,34% | 85,38% |
| Maximális | - | - | - | - | 120,00% | 120,00% |
| Alap devizaneme | HUF | | HUF | | HUF | |
| Devizakitettség fedezettségi szintje | - | | - | | 0,00% | |
| Alap teljes portfólióján belül 10% feletti részarányban szereplő eszközök felsorolása, értéke illetve részaránya | | | | | | |
| Lejáratkori tőkevédelmet biztosító szintetikus betét | - | - | - | - | 1.614.596.040 HUF | 47,1236% |
| EURO STOXX Select Dividend 30 részvényindexből kialakított befektetési eszközosár teljesítményét biztosító OTC opció | - | - | - | - | 125.240.000 HUF | 3,6553% |
| MÁK 2026/E | - | - | - | - | 1.327.647.200 HUF | 38,7487% |
| I. Kötelezettségek felsorolása, értéke ill. eszközökhöz viszonyított aránya | - | - | 0 HUF | - | 17.802.025 HUF | 0,5169% |
| I/1. Hitelállomány | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| I/2. Egyéb kötelezettségek | - | - | 0 HUF | - | 17.802.025 HUF | 0,5169% |
| I/3. Származékos ügyletekből eredő kötelezettség | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II. Eszközök felsorolása, értéke ill. az összes eszközökön belüli aránya | - | - | 179.850.401 HUF | - | 3.444.101.439 HUF | 100,0000% |
| II/1. Folyószámla, készpénz | - | - | 0 HUF | - | 375.931.926 HUF | 10,9152% |
| II/2. Egyéb követelés | - | - | 179.850.401 HUF | - | 686.273 HUF | 0,0199% |
| II/3. Lekötött bankbetétek | - | - | 0 HUF | - | 1.614.596.040 HUF | 46,8800% |
| II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű | - | - | 0 HUF | - | 1.614.596.040 HUF | 46,8800% |
| II/4. Átruházható értékpapírok | - | - | 0 HUF | - | 1.327.647.200 HUF | 38,5484% |
| II/4.1. Állampapírok | - | - | 0 HUF | - | 1.327.647.200 HUF | 38,5484% |
| II/4.1.1. Kötvények | - | - | 0 HUF | - | 1.327.647.200 HUF | 38,5484% |
| II/4.1.2. Kincstárjegyek | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.1.3. Egyéb jegybankképes értékpapírok | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.2. Vállalati, egyéb hitelviszonyt jelentő értékpapírok | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.2.2. Tőzsdén kívüli | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.3. Részvények | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.3.2. Tőzsdén kívüli | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.4. Jelzáloglevelek | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.4.2. Tőzsdén kívüli | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.5. Befektetési jegyek | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/4.5.2. Tőzsdén kívüli | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5. Származékos ügyletek | - | - | 0 HUF | - | 125.240.000 HUF | 3,6364% |
| II/5.1. Határidős | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.1.1. Futures | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.1.2. Forward | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.2. Opció ügyletek | - | - | 0 HUF | - | 125.240.000 HUF | 3,6364% |
| II/5.2.1. Tőzsdei opciók | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/5.2.2. OTC típusú opciók | - | - | 0 HUF | - | 125.240.000 HUF | 3,6364% |
| II/6. Közelmúltban forgalomba hozott átruházható ép. | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| II/7. Egyéb átruházható értékpapír | - | - | 0 HUF | - | 0 HUF | 0,0000% |
| Bruttó eszközérték | - | - | 179.850.401 HUF | - | 3.444.101.439 HUF | 100,0000% |
| Nettó eszközérték | - | - | 179.850.401 HUF | - | 3.426.299.414 HUF | 99,4831% |

* Az Alapkezelő a Részalap tőkeáttétel szerinti kitettségét a bruttó, valamint a kötelezettség módszerrel számítja ki. A bruttó módszer a Részalap teljes kitettségét adja meg, míg a kötelezettség módszer figyelembe veszi a Részalapban lévő befektetési eszközök fedezeti és nettósítási hatásait is. Az Alapkezelő a Részalap esetében alkalmazható tőkeáttétel (nettó összesített kockázati kitettség) legnagyobb mértékét a Részalap típusa, befektetési stratégiája, a tőkeáttétel forrásai, az eszközök és a kötelezettségek aránya, a tőkeáttételes pozíció biztosítékának mértéke, a Részalap 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 a Részalap 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-1024 Budapest
Petreszelyem 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.

3. A Részalap forgalmi adatai

3.1. A tájékoztatási időszakban a Részalap befektetési jegyeinek forgalmi adatai

| | Előző tájékoztatási időszak végén (2022. december 30.) | A Részalap futamidejének első napján (2022. március 1.) | Tájékoztatási időszakban | Tájékoztatási időszak végén (2023. június 30.) |
|--|---|--|--------------------------|---|
| forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma | | 179.850.401 db | | 3.215.371.487 db |
| eladott befektetési jegyek darabszáma | | | 3.073.014.048 db | |
| visszaváltott befektetési jegyek darabszáma | | | 37.492.962 db | |
| tőkeszámla növekedése | | | 3.081.891.384 HUF | |
| tőkeszámla csökkenése | | | 38.517.796 HUF | |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke | | 179.850.401 HUF | | 3.426.299.414 HUF |
| az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték | | 1,0000 | | 1,0656 |

3.2. A tájékoztatási időszakban a Részalap saját tőkéjének és az egy jegyre jutó nettó eszközértékének a változása havi bontásban

| | a Részalap saját tőkéje | az egy jegyre jutó nettó eszközérték |
|------------|-------------------------|--------------------------------------|
| 2022/12/30 | - | - |
| 2023/01/31 | - | - |
| 2023/02/28 | - | - |
| 2023/03/31 | 3.128.979.949 HUF | 1,0065 |
| 2023/04/28 | 3.288.295.879 HUF | 1,0343 |
| 2023/05/31 | 3.310.063.111 HUF | 1,0348 |
| 2023/06/30 | 3.426.299.414 HUF | 1,0656 |

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. A Részalap 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 |
| | | | | | | | | | | | | | |
| Eurizon Európai Csillagok Tőkevédett Származtatott Részalapja | - | - | 6,56% | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

A Részalap futamideje 2023. március 1-től indult, így a 2023. illetve az azt megelőző naptári évekre a Részalap nem rendelkezik hozamadattal ahhoz, hogy a Befektetők számára a múltbéli teljesítményről hasznos tájékoztatás lenne adható. 2023. március 1-ét követően a Részalap 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. A Részalap múltbéli teljesítménye nem jelent garanciát a jövőbeni hozamra! A Részalap portfóliójában lévő eszközök értékelésének forrásait és módszereit a Részalap MNB által elfogadott kezelési szabályzata tartalmazza. A Részalap eszközértékének megállapítását a Letétkezelő végzi, a Részalap kezelési szabályzatában meghatározottak szerint, piaci és kereskedés napi elszámolás elvén. A Részalap portfóliójában lévő kamatozó kötvény típusú értékpapirokból, valamint minden eszközből, amelyből kamatjövedelem származik, az időarányos kamat figyelembe van véve a Részalap eszközértékének számításakor, hasonlóan a pénzből és a pénzjellegű eszközökből származó hozamokhoz, illetve a realizált és nem realizált árfolyamnyereséghez. Az Alapkezelő kijelenti, hogy a Részalap 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 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 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-előtakarékosági 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-előtakarékosági 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. A Részalapot 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. A Részalap 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. A Részalap hozamadatai a Részalap 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.