

Az Eurizon Bankszektor Tőkevédett Származtatott Részalap lejárata

Az Eurizon Asset Management Hungary Zrt. (székhely: H-1024 Budapest, Petrezselyem utca 2-8., cg.: 01-10-044283, tevékenységi engedély száma: III/100 036-4/2002.) (a továbbiakban: Alapkezelő) ezúton tájékoztatja Tisztelt Befektetőit, hogy az Eurizon Bankszektor Tőkevédett Származtatott Részalap (a továbbiakban: Részalap) 2022/07/25-án indult futamidejének végére ért 2024/10/31 napon. Az Alapkezelő a Részalap Tájékoztatójával és Kezelési szabályzatával összhangban, illetve a 2014. évi XVI. törvény a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról (a továbbiakban: Kbtv.) 79. § (2) bekezdése alapján a Részalap portfóliójának pozitív záró egyenlege terhére a Befektetők számára előleg formájában részki fizetést teljesített. Ezt követően az Alapkezelő a Kbtv. 78. § (1) értelmében az elkészült megszűnési jelentést benyújtja a Magyar Nemzeti Bankhoz és kezdeményezi a Részalap törlését a Magyar Nemzeti Bank nyilvántartásából, amelyről a Kbtv. 139. § (1) bekezdés I) pontja alapján tájékoztatja a Tisztelt Befektetőket. A befektetési alapok éves beszámoló készítési és könyvvezetési kötelezettségének sajátosságairól szóló 215/2000. (XII. 11.) Korm. rendelet 10/A. § értelmében az Alapkezelő ezúton tájékoztatja Tisztelt Befektetőit, hogy elkészült a Részalap tevékenységet lezáró beszámolója 2024/07/26-ra vonatkozóan.

Célkitűzések és befektetési politika

2022/07/25-2022/09/30 közötti tőkefelhalmozási időszakban

A Részalap a 2022/10/01-2024/10/31 közötti befektetési időszak befektetési céljainak megvalósítása érdekében saját tőkét halmozott fel a Befektetési jegyek kiszámítható árfolyam-alakulása és a kockázatok maximális kerülése mellett.

2022/10/01-2024/10/31 közötti befektetési időszakban

A Részalap céljaként szerepelt, hogy a vezető európai bankok és pénzügyi vállalatok részvényeit tartalmazó EURO STOXX Banks Index (Bloomberg code: SX7E Index, ISIN: EU0009658426) következő szabályok szerint kiszámított teljesítményét a lejáratkor kifizesse. A Részalap a részvényindexnek a befektetési időszak alatt félévente megfigyelt értékeiből számított átlaga és a részvényindex induló értékeinek átlaga közötti pozitív teljesítményt fizette ki legfeljebb 35% \times 1,4=49%-ig a lejáratkor (140%-os részesedési aránnyal, a teljes futamidőre és a 2022/09/30-án érvényes befektetési jegy árfolyamra számítva) (365 napos bázison számított, maximális éves hozam=19,19%, maximális EHM*=19,19%). A Részalap a lejáratkor teljes tőkevédelemre tett ígéretet, azaz arra, hogy a Befektetési jegyek árfolyama a lejáratkor mindenképp elérje a 2022/09/30-án érvényes árfolyam 100%-át. (140%-os részesedési aránnyal és a teljes futamidőre számítva). A részvényindex esetleges szélsőséges ingadozásának hatását a Részalap azzal kívánta mérsékelni, hogy a hozamszámításnál a befektetési időszak első három hetében hetente egyszer megfigyelt értékeinek átlagát alkalmazta Részvényindex Átlag Induló Értéknek.

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

A hozamlehetőséget nyújtó Opció mögöttes pénzügyi eszközének általános bemutatása

A Részalap hozamlehetőségét a Kezelési szabályzat VI. fejezetének 31. pontjában szereplő Opciók pénzügyi eszköz nyújtotta, melynek mögöttes eszköze a EURO STOXX Banks Index (Bloomberg code: SX7E Index, ISIN: EU0009658426). A részvényindex azokat a legnagyobb európai bank és pénzügyi szektorban tevékenykedő vállalatokat tartalmazza, amelyek a részvényindex adminisztrátora által vizsgált szempontoknak megfelelnek. A részvényindex számítása 1998/06/15-én indult 100 kezdőértékkel. A referenciamutató-kezelő az 1997-ben alapított STOXX Ltd., amely jelenleg a Deutsche Börse Group vállalatcsoport tagjaként több mint 10 ezer különböző részvény-, kötvény-, strukturált és tematikus típusú index, pl. a EURO STOXX 50®, STOXX® Europe 50, and STOXX® Europe 600 indexcsaládok számítását végzi. A részvényindex kosarában az egyes részvények közközhányaddal korrigált piaci tőkeérték súlyozással vesznek részt. A részvényindex ún. árindex, amely az osztalékfizetéseket nem, csak a részvények árfolyam-mozgását veszi figyelembe. A részvényindex kosarának felülvizsgálatára negyedévente kerül sor. A részvényindex mindenkor aktuális értékével, kosarának összetételével, iparági és földrajzi megoszlásával, számításának módszertanával kapcsolatos további információk elérhetők többek között a <https://www.stoxx.com/index-details?symbol=sx7e> weboldalon angol nyelven. A EURO STOXX Banks Indexet szolgáltató STOXX Ltd. olyan referenciamutató-kezelő, amely szerepel az Európai Parlament és a Tanács 2016. június 8-i a pénzügyi eszközökben és pénzügyi ügyletekben referenciamutatóként vagy a befektetési alapok teljesítményének méréséhez használt indexekről, valamint a 2008/48/EK és a 2014/17/EU irányelv, továbbá az 596/2014/EU rendelet módosításáról szóló (EU) 2016/1011 Rendelete 36. cikkében említett nyilvántartásban.

A Részalapra jellemző kockázat-hozam profil

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

A Részalap hozamfizetésére vonatkozó adatok

→ A futamidő elején alkalmazott átlagolás

A Részalap futamidő alatt elért teljesítményének megállapítása során a részvényindex kezdő árfolyamának a befektetési időszak elején heti gyakorisággal - a 2022/10/03, 2022/10/10 és 2022/10/17 napokon - megfigyelt tőzsdei záró értékek egyszerű számtani átlaggal számolt értékét tekintettük. Ez a hozamszámítási módszer csökkentheti a hozamkifizetés feltételének megállapítása során a részvényindex esetleges rövid ideig tartó szélsőséges elmozdulásainak a hozamkifizetésre gyakorolt hatását.

→ A futamidő alatt alkalmazott átlagolás

A Részalap futamidő alatt megfigyelt nominális teljesítményének megállapítása során a részvényindex záró értékének a befektetési időszak alatt féléves gyakorisággal - a 2023/04/21, 2023/10/27, 2024/04/26 és 2024/10/25 napokon - megfigyelt tőzsdei záróértékek átlagát tekintettük.

A Részalap lejáratkori teljesítménye a fentiek alapján a Befektetési jegyek névértékére vetítve az alábbiak szerint alakult:

2022/07/25-2022/09/30 közötti tőkefelhalmozási időszakban

A Részalap a Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint a Befektetési jegyeknek a tőkefelhalmozási időszak végén, illetve elején érvényes árfolyamából számítva 1,0174/1,0000-1=**+1,7400%**-os nominális hozamot ért el.

2022/10/01-2024/10/31 közötti befektetési időszakban

A Részalap Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint ebben az időszakban a Részalap hozamát termelő EURO STOXX Banks Index (Bloomberg code: SX7E Index, ISIN: EU0009658426) **+49,00%**-os (35,00%x1,4) hozamot ért el.

$$\text{Lejáratkor} \\ \text{kifizetésre} \\ \text{kerülő} \\ \text{hozam}} = \text{Befektetési} \\ \text{jegy} \\ \text{2022/09/30-} \\ \text{án érvényes} \\ \text{árfolyam}} \times \text{részese} \\ \text{dési} \\ \text{arány}} \times \left\{ \text{MAX} \left[0,00\% ; \text{MIN} \left[35,00\% ; \text{Részvény-} \right. \right. \right. \right. \\ \left. \left. \left. \left. \text{index} \right. \right. \right. \right. \\ \left. \left. \left. \left. \text{teljesítmény} \right. \right. \right. \right. \left. \right\}$$

$$\text{A futamidő} \\ \text{egésze} \\ \text{alatt} \\ \text{teljesített} \\ \text{összes} \\ \text{kifizetés}} = \text{Lejáratkor} \\ \text{kifizetésre} \\ \text{kerülő} \\ \text{hozam}} + \text{Befektetési} \\ \text{jegy} \\ \text{2022/09/30-án} \\ \text{érvényes} \\ \text{árfolyam}}$$

Ahol:

- 2022/09/30-án érvényes Befektetési jegy árfolyam: 1,0174
- Részvényindex: EURO STOXX Banks Index (Bloomberg code: SX7E Index, ISIN: EU0009658426)
- Részvényindex teljesítmény:

$$\text{részvény-} \\ \text{index} \\ \text{teljesítmény}} = \frac{\text{Részvényindex Átlag} \\ \text{Záró Érték}}{\text{Részvényindex Átlag} \\ \text{Induló Érték}} - 1$$

- Részvényindex Átlag Induló Érték:

$$\text{Részvény-} \\ \text{index} \\ \text{Átlag} \\ \text{Induló Érték}} = \frac{1}{3} \sum_{k=1}^3 \left(\text{részvény-} \right. \\ \left. \text{index} \right. \\ \left. \text{érték}_{0,k} \right)$$

0,k: ahol k=1-3: 2022/10/03, 2022/10/10, 2022/10/17, melyek a befektetési időszak elején történő index érték megfigyelés időpontjait jelölik.

- Részvényindex Átlag Záró Érték:

$$\text{Részvény-} \\ \text{index} \\ \text{átlag} \\ \text{záró érték}} = \frac{1}{4} \sum_{k=1}^4 \left(\text{Részvény-} \right. \\ \left. \text{index} \right. \\ \left. \text{érték}_{1,k} \right)$$

1,k: ahol k=1-4: 2023/04/21, 2023/10/27, 2024/04/26, 2024/10/25, melyek a futamidő alatt történő index érték megfigyelés időpontjait jelölik.

- Részvényindex tőzsdei záróértékek: a Bloomberg L.P. informatikai rendszer adatbázisában a részvényindex ticker symbol-jában szerepelő exchange code által jelölt tőzsdén megfigyelt tőzsdei záróértékek. A megfigyelési időpontok a módosított munkanap szabály szerint módosulhatnak.

A Részalapnak a részvények teljesítményétől függő hozamából a Részalap kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontja szerint rögzített részese dési arány szerint történik a kifizetés, ennek mértéke 140%-ban került meghatározásra: <https://eurizon.hu/shared/documents/cib-bankszektor-reszalap-pf-cp-kozvetetel-20221005.pdf>.

A befektetési időszak alatt elért **+49,00%**-os nominális hozam a tőkefelhalmozási időszak utolsó napján, 2022/09/30-án érvényes 1,0174 Befektetési jegy árfolyamra került felszámításra. Így a

Székhely Eurizon Asset Management Hungary Zrt. / Eurizon Asset Management Hungary Ltd.

H-1024 Budapest Nyilvántartó cégbíróság: Fővárosi Törvényszék Cégbírósága Cégjegyzékszám: Cg. 01-10-044283 Adószám: 11969347-2-41 Tevékenységi engedély száma: PSZÁF III/100.036-4/2002.

Petrezselyem utca 2-8.
Telefon: (06 1) 423 24 00
Fax: (06 1) 489 66 64

Részalap a teljes futamidő alatt $(1+1,74\%) \times (1+49,00\%) - 1 = 51,5926\%$ -os hozamot ért el (éves hozam: 20,10%, EHM=20,10%). Ennek megfelelően a Részalap a befektetési jegyek számlavezető helyein az ügyfelek értékpapírszámlájához kapcsolódó pénzeszámlákra Befektetési jegyenként 2024/10/31-én összesen 1,5159 HUF összegben visszafizetést teljesített, melynek kifizetését követően lezárta működését.

Budapest, 2024. november 08.
Eurizon Asset Management Hungary Zrt.

Székhely

H-1024 Budapest
Petrezselyem utca 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.