

Az Eurizon 30 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 30 Tőkevédett Származtatott Részalap (a továbbiakban: Részalap) 2025. november 28-án lejárt. Az Alapkezelő a Részalap Tájékoztatójával és Kezelési szabályzatával összhangban, továbbá a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény (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) bekezdésének l) pontja alapján tájékoztatja a Tisztelt Befektetőket. A befektetési alapok éves beszámoló készítési és könyvvizelési kötelezettségének sajátosságairól szóló 215/2000. (XII. 11.) Korm. rendelet 10/A. § alapján az Alapkezelő ezúton tájékoztatja Tisztelt Befektetőit, hogy elkészült a Részalap tevékenységet lezáró beszámolója.

Célkitűzések és befektetési politika

A 2022/11/02-2022/11/15 közötti tőkefelhalmozási időszakban

A Részalap a 2022/11/16-2025/11/28 közötti befektetési időszak befektetési céljainak megvalósítása érdekében saját tőkét halmozott fel a Befektetési jegyek kiszámítható árfolyam-alakulása és a kockázatok maximális kerülése mellett.

A 2022/11/16-2025/11/28 közötti befektetési időszakban

A Részalap céljaként szerepelt, hogy a világszerte közzismert vállalatok részvényeit tartalmazó STOXX Global Select Dividend 100 Indexnek (Bloomberg code: SDGP Index, ISIN: US26063V1180) a befektetési időszak első hónapjában 3 alkalommal megfigyelt értékeiből számított átlaga és befektetési időszak alatt havonta egy-egy alkalommal megfigyelt értékeiből számított átlaga közötti pozitív teljesítményt a lejáratkor legfeljebb 20%-ig kifizesse. A Részalap hozamvédelemre tett ígéretet, azaz a részvényindex teljesítményétől függetlenül a Részalap befektetési politikája a Befektetési jegyek tőkefelhalmozási időszakban érvényes legmagasabb árfolyama után minimum 30%-os hozam lejáratkor történő kifizetését is biztosította. A Részalap a lejáratkor teljes tőkevédelemre tett ígéretet, azaz a Befektetési jegyek árfolyama a lejáratkor mindenképp eléri a tőkefelhalmozási időszakban érvényes legmagasabb árfolyam 100%-át, amely nem lehetett alacsonyabb a Befektetési jegyek névértékénél. A Részalap maximálisan elérhető hozama 30%+10%=40% lehetett (maximális éves hozam, maximális EHM* =14,29%) (50%-os részesedési arány esetén a teljes futamidőre és a Befektetési jegy névértékére számítva). A részvényindex esetleges szélsőséges ingadozásának hatását a Részalap azzal kívánta mérsékelni, hogy a hozamszámításnál a befektetési időszak első hónapjában 3, valamint a befektetési időszak alatt havonta egy-egy alkalommal megfigyelt értékeinek átlagát alkalmazta Részvényindex Átlag Induló Értéknek, valamint Részvényindex Átlag Záró 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 a védett hozam feletti további hozamlehetőségét a Kezelési szabályzat VI. fejezetének 31. pontjában szereplő Opció pénzügyi eszköz nyújtotta, melynek mögöttes eszköze a STOXX Global Select Dividend 100 Index (BBG: SDGP IND, ISIN: US26063V1180). A részvényindex kosara világszerte azokat a 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-, struktúrált 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 kosarában a felülvizsgálatára évente kerül sor. A részvényindex mindenkor aktuális értékével, kosarában összetételével, iparági és földrajzi megoszlásával, számításának módszertanával kapcsolatos további információk elérhetők többek között a <https://www.stoxx.com/index-details?symbol=SDGP> weboldalon angol nyelven. A STOXX Global Select Dividend 100 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 STOXX Global Select Dividend 100 Index esetleges megszűnése vagy lényeges megváltozása esetén az Alapkezelő jogosult egyoldalúan, a Felügyelet engedélyével a hozamszámítás során alkalmazandó új index és amennyiben indokolt, korrekciós tényező, illetve a célnak megfelelő új index hiányában helyettesítő hozamszámítási módszer alkalmazásáról dönteni, figyelembe véve azt, hogy az Index megszűnése vagy lényeges megváltozása esetén a Részalap hozamát termelő Opció ügyletben milyen módon módosul a kifizetés feltétele.

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 2022/11/16, 2022/11/21 és 2022/11/28 napokon - megfigyelt tőzsdei záró értékek egyszerű számtani átlaggal számolt értékét tekintettük (Részvényindex Átlag Induló Érték). 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 havonta egy-egy alkalommal megfigyelt tőzsdei záróértékek átlagát tekintettük (Részvényindex Átlag Záró Érték).

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

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

2022/11/02-2022/11/15 közötti tőkefelhalmozási időszakban

A Részalap a Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint a Befektetési jegyeknek a tőkefelhalmozási időszak végén, valamint elején érvényes árfolyamából számítva 1,0035/1,0000-1=+0,3500%-os nominális hozamot ért el.

2022/11/16-2025/11/28 közötti befektetési időszakban

A Részalap Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint ebben az időszakban a Részalap hozamát STOXX Global Select Dividend 100 Index (BBG: SDGP IND, ISIN: US26063V1180), a 50%-os részesedési aránnyal számítva, + 0,8448%-os hozamot ért el.

STOXX Global Select Dividend 100 Index	2022/11/16	2022/11/21	2022/11/28	Futamidő indulásakor számolt átlag	2022/12/16	2023/01/13	2023/02/17	2023/03/17	2023/04/14	2023/05/19	2023/06/16	2023/07/14	2023/08/18	2023/09/15	2023/10/13	2023/11/17	2023/12/15
érték	2.869,03	2.885,23	2.887,01	2.880,42	2.843,53	2.950,90	2.996,68	2.766,33	2.817,83	2.690,23	2.678,18	2.628,73	2.608,20	2.726,31	2.632,23	2.612,28	2.767,85
hozam					-1,28%	+2,45%	+4,04%	-3,96%	-2,17%	-6,60%	-7,02%	-8,74%	-9,45%	-5,35%	-8,62%	-9,31%	-3,91%
STOXX Global Select Dividend 100 Index	2022/11/16	2022/11/21	2022/11/28	Futamidő indulásakor számolt átlag	2024/01/12	2024/02/16	2024/03/15	2024/04/19	2024/05/17	2024/06/14	2024/07/12	2024/08/16	2024/09/13	2024/10/18	2024/11/15	2024/12/13	
érték	2.869,03	2.885,23	2.887,01	2.880,42	2.795,48	2.781,09	2.791,10	2.834,71	2.998,30	2.880,97	2.960,72	2.905,14	2.923,35	3.070,99	3.071,48	3.083,42	
hozam					-2,95%	-3,45%	-3,10%	-1,59%	+4,09%	+0,02%	+2,79%	+0,86%	+1,49%	+6,62%	+6,63%	+7,05%	
STOXX Global Select Dividend 100 Index	2022/11/16	2022/11/21	2022/11/28	Futamidő indulásakor számolt átlag	2025/01/17	2025/02/14	2025/03/14	2025/04/22	2025/05/16	2025/06/13	2025/07/18	2025/08/15	2025/09/19	2025/10/17	2025/11/21		
érték	2.869,03	2.885,23	2.887,01	2.880,42	3.089,68	3.123,55	3.073,29	2.880,26	3.139,65	3.100,66	3.141,93	3.246,44	3.253,74	3.250,23	3.331,73		
hozam					+7,26%	+8,44%	+6,70%	-0,01%	+9,00%	+7,65%	+9,08%	+12,71%	+12,96%	+12,84%	+15,67%		

STOXX Global Select Dividend 100 Index	2022/11/16	2022/11/21	2022/11/28	Futamidő indulásakor számolt átlag	Havonta rögzített hozamok átlaga	Részvény-index hozama	A Részalap minimálisan biztosított hozam	Lejáratkor kifizetésre kerülő hozam 50% részesedési rátával
érték	2.869,03	2.885,23	2.887,01	2.880,42				
hozam					1,689518246%	1,689518246%	30,00%	30,84475912%

A hozamfizetés képlete:

$$\text{Lejáratkor kifizetésre kerülő hozam} = \text{A tőkefelhalmozási időszakban érvényes legmagasabb Befektetési} \times \left\{ 30,00\% + \text{részesedési arány} \times \text{MAX} \left[0,00\% ; \text{MIN} \left[20,00\% ; \text{Részvény-index átlagteljesítmény} \right] \right] \right\}$$

$$\text{A futamidő egésze alatt teljesített összes kifizetés Befektetési jegyenként} = \text{Lejáratkor kifizetésre kerülő hozam} + \text{A tőkefelhalmozási időszakban érvényes legmagasabb Befektetési jegy árfolyam}$$

Ahol:

- ✓ 2022/11/15-én érvényes Befektetési jegy árfolyam: 1,0035
- ✓ Részvényindex: STOXX Global Select Dividend 100 Index (BBG: SDGP IND, ISIN: US26063V1180).
- ✓ Részvényindex teljesítmény:

$$\text{Részvény-index átlagteljesítmény} = \frac{\text{Részvényindex átlag záró érték} - \text{Részvényindex átlag induló érték}}{\text{Részvényindex átlag induló érték}} - 1$$

- ✓ Részvényindex Átlag Induló Érték:

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

0,k: ahol k=1-3: 2022/11/16, 2022/11/21, 2022/11/28, melyek a befektetési időszak elején történő index érték megfigyelés időpontjait jelölik.

- ✓ Részvényindex Átlag Záró Érték:

$$\text{Részvény-} \\ \text{index átlag} \\ \text{záró érték} = \frac{1}{36} \sum_{k=1}^{36} \left(\text{Részvény-} \\ \text{index} \\ \text{érték}_{1,k} \right)$$

1,k: ahol k=1-36:, melyek a befektetési időszak alatt történő index érték megfigyelés időpontjait jelölik az alábbiak szerint:

- a befektetési időszak 1. évében: 2022/12/16, 2023/01/13, 2023/02/17, 2023/03/17, 2023/04/14, 2023/05/19, 2023/06/16, 2023/07/14, 2023/08/18, 2023/09/15, 2023/10/13, 2023/11/17, 2023/12/15,
- a befektetési időszak 2. évében: 2024/01/12, 2024/02/16, 2024/03/15, 2024/04/19, 2024/05/17, 2024/06/14, 2024/07/12, 2024/08/16, 2024/09/13, 2024/10/18, 2024/11/15, 2024/12/13,
- a befektetési időszak 3. évében: 2025/01/17, 2025/02/14, 2025/03/14, 2025/04/22, 2025/05/16, 2025/06/13, 2025/07/18, 2025/08/15, 2025/09/19, 2025/10/17, 2025/11/21.

- ☑ Részvényindex tőzsdei záróértékek: a Bloomberg L.P. informatikai rendszer adatbázisában a részvényindex ticker symbol-jában szereplő exchange code által jelölt tőzsdén megfigyelt tőzsdei záróértékek.

A Részalapnak a részvények teljesítményétől függő hozamából a Részalap kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontja szerint rögzített részesedési arány szerint történik a kifizetés, ennek mértéke 100%-ban került meghatározásra: <https://eurizon.hu/shared/documents/cib-30-reszalap-pfcp-kozzetétel-20221117.pdf>.

A befektetési időszak alatt elért +30,84475912%-os hozam a tőkefelhalmozási időszak utolsó napján, 2022/11/15-én érvényes 1,0035 Befektetési jegy árfolyamra került felszámításra. Így a Részalap a teljes futamidő alatt $(1+0,35\%) \times (1+30,84475912\%) - 1 = 31,30271578\%$ -os hozamot ért el (éves hozam: 9,39%, EHM=9,39%). Ennek megfelelően a Részalap az ügyfelek értékpapírszámláihoz kapcsolódó pénzeszközökre 2025/11/28-án Befektetési jegyenként összesen 1,3130 HUF összegben visszafizetést teljesített, melynek kifizetését követően lezárta működését.