

Az Eurizon Egészségipari 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 Egészségipari Származtatott Részalap (a továbbiakban: Részalap) 2021/02/22-én indult futamidejének végére ért 2024/04/12 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 törlesztését 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 2023/02/09-re vonatkozóan, valamint az éves jelentése és éves beszámolója a 2023. december 31-re végződő évre vonatkozóan.

A Részalap célkitűzései és befektetési politikája

2021/02/22-2021/04/09 közötti tőkefelhalmozási időszakban

A Részalap a 2021/04/10-2024/04/12 közötti befektetési időszak befektetési céljainak megvalósítása érdekében a saját tőkét halmozott fel a Befektetési jegyek kiszámítható árfolyam-alakulása és a kockázatok maximális kerülése mellett.

2021/04/10-2024/04/12 közötti befektetési időszakban

A Részalap céljaként szerepelt, hogy a STOXX Europe 600 Health Care Price EUR Index (Bloomberg code: SXDP, ISIN code: EU0009658723) a következő szabályok szerint kiszámított teljesítményét a lejáratkor kifizesse. A hozamszámítás során a részvényindex ezen időszak alatti teljesítményét a Részalap félévente rögzítette, ezen teljesítményeket átlagolta és amennyiben az átlagteljesítmény pozitív, akkor azt a lejáratkor legfeljebb 34%-ig kifizette. Emellett a Részalap további +6,00%-os hozamot fizetett, annak köszönhetően, hogy a futamidő végén a Részvényindex záróértéke magasabb volt a Részvényindex Átlag Induló Értékhez képest. A Részalap a részvényindex által elérhető hozamlehetőséget úgy tudta nyújtani, hogy a lejáratkori teljes tőkevédelem helyett arra tett ígéretet, hogy a Befektetési jegyek lejáratkor mindenképp elérik 2021/04/09-én érvényes árfolyam 94%-át. Ebből következett, hogy lejáratkor a Befektetési jegyek a 2021/04/09-én érvényes árfolyamukhoz viszonyítva legfeljebb -6,00%-os árfolyamvesztést tartalmaztak. **A részvényindex legfeljebb 40,00%-os (34,00%+6,00%) teljesítményét, valamint a Befektetési jegyek lejáratkori -6,00%-os árfolyamvesztését összegezve a Részalapon, mint befektetésen legfeljebb 34,00%+6,00%-6,00%=34,00%-os maximális hozam elérése volt lehetséges (365 napos bázison számított, maximális éves hozam=9,78%, maximális EHM*=9,78%) (100,00%-os részesedési arány esetén, a forgalomba hozott befektetési jegyek névértékére 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 Részalap referenciamutatóként alkalmazható indexet nem követett. A Részalap Opciók pénzügyi eszköz teljesítményen alapuló, a Kezelési Szabályzatának 31. pontjában meghatározott képlet szerint számított kifizetést ígért, amely cél eléréséhez szükséges befektetési politikát a futamidő elején meghatározott és amelyet a futamidő alatt változatlan formában követett és hajtott végre, ezért a Bizottság 583/2010/EU rendelete 7. cikk (1) bekezdése d) pontja értelmében passzívan kezelt befektetési alapnak minősült.

A hozamlehetőséget nyújtó Opció mögöttes pénzügyi eszközeinek általános bemutatása

A Részalap hozamlehetőségét Kezelési szabályzat VI. fejezetének 31. pontjában szereplő Opciók pénzügyi eszköz nyújtotta, melynek mögöttes eszköze a STOXX Europe 600 Health Care EUR Index (Bloomberg code: SXDP, ISIN code: EU0009658723). A részvényindex kosara a STOXX Ltd., mint az index adminisztrátora által a STOXX® Europe 600 Index kosarában található az egészségügyben tevékenykedő, orvostechnikai eszköz és felszerelés gyártó, egészségügyi intézmény fenntartó, szolgáltató, biotechnológiai és gyógyszeripari vállalatok közül azokat tartalmazta, amelyek a részvényindex adminisztrátor által vizsgált szempontoknak megfeleltek. A részvényindex számítása 1991/12/31-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 közléshányaddal korrigált piaci tőkeérték súlyozással vettek részt. A részvényindex ún. árindex, amely az osztalékfizetéseket nem, csak a részvények árfolyam-mozgását vette figyelembe. A részvényindex kosarában felülvizsgálatára negyedévente került 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=SXDP> weboldalon angol nyelven. A STOXX Europe 600 Health Care EUR 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 betéti kamat és az értékpapírok hozama számításáról és közzétételéről szóló 82/2010. (III. 25.) Korm. rendelet szerint számított egységesített értékpapír hozam mutató.

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

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 futamidő elején alkalmazott átlagolás

A Részalap futamidő alatt elért teljesítményének megállapítása során a részvények kezdő árfolyamának a futamidő elején heti gyakorisággal a 2021/04/12, 2021/04/19 és 2021/04/26 napokon megfigyelt tőzsdei záróárak egyszerű számtani átlaggal számolt értékét tekintettük. 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

A Részalap futamidő alatt megfigyelt nominális teljesítményének megállapítása során a részvények záró árfolyamának a futamidő alatt féléves gyakorisággal, 2021/10/08, 2022/04/08, 2022/10/07, 2023/04/11, 2023/10/06 és 2024/04/05 napokon megfigyelt tőzsdei záróárak átlagát tekintettük.

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

| STOXX Europe 600 Health Care Price EUR Index | 2021/04/12 | 2021/04/19 | 2021/04/26 | Futamidő indulásakor számolt átlag | 2021/10/08 | 2022/04/08 | 2022/10/07 | 2023/04/11 | 2023/10/06 | 2024/04/05 | Félévente rögzített hozamok átlaga | Részvényindex hozama | 2024/04/05-én érvényes részvényindex értéke magasabb az indulásakor számolt átlaghoz képest? | Hozamkifizetés feltétele teljesül? | Lejáratkor kifizetésre kerülő plusz hozam | Lejáratkor kifizetésre kerülő hozam 100% részesedési rátával |
|--|------------|------------|------------|------------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------------------------------|----------------------|--|------------------------------------|---|--|
| érték | 894,93 | 911,98 | 909,66 | 905,52 | 1.000,18 | 1.137,45 | 944,69 | 1.058,72 | 1.056,33 | 1.109,39 | | | igen | igen | 6,00% | 22,0794679% |
| hozam | | | | | +10,45% | +25,61% | +4,33% | +16,92% | +16,65% | +22,51% | +16,08% | +16,08% | | | | |

A Részalap Kezelési szabályzatának, VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint teljes, 3 éves futamidő alatt a Részalap hozamát termelő *STOXX Europe 600 Health Care Price EUR Index* részvényindex +10,45%, +25,61%, +4,33%, +16,92%, +16,65%, +22,51% félévente rögzített hozamot ért el, amelyből számolt átlag +22,0794679%-os teljesítményt jelentett.

Ahol:

- ☑ Befektetési jegy névérték = 10.000 HUF
- ☑ Részvényindex: STOXX Europe 600 Health Care Price EUR Index (Bloomberg code: SXDP, ISIN code: EU0009658723)
- ☑ Részvényindex teljesítmény:

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

- ☑ Részvényindex Átlag Induló Érték:

$$\text{Részvényindex Átlag Induló Érték} = \frac{1}{3} \sum_{k=1}^3 \left(\text{részvényindex érték}_{0,k} \right)$$

0,k: ahol k=1-3: 2021/04/12, 2021/04/19, 2021/04/26, melyek a befektetési időszak elején történő index érték megfigyelés időpontjait jelölik.

- ☑ Részvényindex Átlag Záró Érték:

$$\text{Részvényindex Átlag Záró Érték} = \frac{1}{6} \sum_{k=1}^6 \left(\text{részvényindex érték}_{1,k} \right)$$

1,k: ahol k=1-6: 2021/10/08, 2022/04/08, 2022/10/07, 2023/04/11, 2023/10/06, 2024/04/05, melyek a futamidő alatt történő index érték megfigyelés időpontjait jelölik.

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

A Részalapnak a részvénykosár 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-egeszsegipari-reszalap-pf-pcp-kozvetetel-20210414.pdf>.

A Részalap a befektetési jegyek számlavezető helyein az ügyfelek értékpapírszámlájához kapcsolódó pénzeszámlákra 2024/04/12-én 94%-os árfolyamvédett visszafizetést teljesített Befektetési jegyenként 9.400 HUF összegben, valamint a Részalap a Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint a futamidő végén történt kifizetéssel összesen +22,0794679%-

6,00%=16,0794679%-os (éves hozam: 4,87%, EHM=4,87%) hozamot ért el, melynek kifizetését követően 2024/04/12-én lezárta működését.

Budapest, 2024. április 19.

Eurizon Asset Management Hungary Zrt.