

Az Eurizon Proximitix 2025 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 Proximitix 2025 Tőkevédett Származtatott Részalap (a továbbiakban: Részalap) 2022/01/17-én indult futamidejének végére ért 2025/03/21 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 részkiifizetést 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 könyvvizelési 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 2025/03/21-re vonatkozóan, valamint az éves jelentése és éves beszámolója a 2024. december 31-re végződő évre vonatkozóan.

Célkitűzések és befektetési politika

2022/01/17-2022/03/18 közötti tőkefelhalmozási időszakban

A Részalap a 2022/03/19-2025/03/21 közötti befektetési időszak befektetési céljainak megvalósítása érdekében saját tőkét halmozott fel a Befektetési jegyek kiszámítható árfolyam-alakulása és a kockázatok maximális kerülése mellett.

2022/03/19-2025/03/21 közötti befektetési időszakban

A Részalap céljaként szerepelt, hogy a STOXX Europe ESG Environmental Leaders Select 30 EUR Index (Bloomberg code: SEENVSEP, ISIN code: CH0321940618) 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 40%-ig a lejáratkor.

A Részalap a lejáratkor teljes tőkevédelemre tett ígéretet, azaz a Befektetési jegyek a lejáratkor mindenképp elérik a 2022/03/18-án érvényes árfolyam 100%-át. A Részalapon legfeljebb 40,00%-os maximális hozam elérése volt lehetséges (365 napos bázison számított, maximális éves hozam=11,18%, maximális EHM*=11,18%) (100%-os részesedési arány esetén a teljes futamidőre számítva és amennyiben a 2022/03/18-án érvényes befektetési jegy árfolyam eléri a befektetési jegy névértékét). A legkedvezőtlenebb esetben, azaz amennyiben az index teljesítménye miatt a futamidő végén hozamkifizetés nem történik, a Részalapnak a lejárati időpontjában érvényes teljesítménye 0,00% lett volna. 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 Opció pénzügyi eszköz nyújtja, melynek mögöttes eszköze a STOXX Europe ESG Environmental Leaders Select 30 EUR Index (Bloomberg code: SEENVSEP, ISIN code: CH0321940618). A részvényindex kosara a STOXX Ltd., mint az index adminisztrátora által a STOXX Global ESG Environmental Leaders Index kosarában található vállalatok közül azokat tartalmazza, amelyek a részvényindex adminisztrátor által vizsgált osztalékfizetésre, illetve a részvényárfolyamok ingadozására vonatkozó szempontoknak megfelelnek. A STOXX Global ESG Environmental Leaders Index azoknak a tőzsdéi vállalatoknak a részvényeit tartalmazza, amelyek a részvényindex adminisztrátora által vizsgált ESG szempontoknak megfelelnek, úgy mint elkötelezettség környezetvédelmi célok elérésére, globális felmelegedésért felelős, üvegházhatást erősítő gázok kibocsátásának csökkentésére, hatékony hulladékgyártáskor, energiateljesítmény optimalizálására. A részvényindex számítása 2004/06/21-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 középhányaddal 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=SEENVSEP> weboldalon angol nyelven. A STOXX Europe ESG Environmental Leaders Select 30 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 STOXX Europe ESG Environmental Leaders Select 30 EUR 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 hozamvárákozással 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 2022/03/21, 2022/03/28 és 2022/04/04 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 2022/09/16, 2023/03/17, 2023/09/15, 2024/03/14, 2024/09/13 és 2025/03/14 napokon - megfigyelt tőzsdei záróértékek átlagát tekintettük.

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

2022/01/17-2022/03/18 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 1,00052/1,0000-1=**+0,5200%**-os nominális hozamot ért el.

2022/03/19-2025/03/21 közötti befektetési időszakban

A Részalap Kezelési szabályzatának VI. fejezet 31. pontjában rögzített szabályok szerint ebben az időszakban a Részalap hozamát termelő STOXX Europe ESG Environmental Leaders Select 30 EUR Index (Bloomberg code: SEENVSEP, ISIN code: CH0321940618), **a 120%-os részesedési aránnyal számítva, +0,65%**-os hozamot ért el.

$$\begin{aligned} \text{Lejáratkori teljesítmény} &= \text{Befektetési jegy} \times \text{részese-} \\ &= \text{2022/03/18-án érvényes} \times \text{arány} \times \left\{ \text{MAX} \left[0,00\% ; \text{MIN} \left[40,00\% ; \text{részvény-} \right. \right. \right. \\ & \left. \left. \left. \text{index teljesítmény} \right] \right] \right\} \\ \text{A futamidő egésze alatt teljesített összes kifizetés} &= \text{Lejáratkori kifizetésre kerülő hozam} + \text{Befektetési jegy 2022/03/18-án érvényes árfolyam} \end{aligned}$$

Ahol:

- 2022/03/18-án érvényes Befektetési jegy árfolyam: 1,0052
- Részvényindex: STOXX Europe ESG Environmental Leaders Select 30 EUR Index (Bloomberg code: SEENVSEP, ISIN code: CH0321940618)
- Részvényindex teljesítmény:

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

- 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: 2022/03/21, 2022/03/28, 2022/04/04, 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: 2022/09/16, 2023/03/17, 2023/09/15, 2024/03/14, 2024/09/13, 2025/03/14, 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 szereplő 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 részesedési arány szerint történik a kifizetés, ennek mértéke 120%-ban került meghatározásra: <https://eurizon.hu/shared/documents/cibesgreszalap-pfcp-kozvetetel-20220321.pdf>.

A befektetési időszak alatt elért **+0,65%**-os nominális hozam a tőkefelhalmozási időszak utolsó napján, 2022/03/18-án érvényes 1,0052 Befektetési jegy árfolyamra került felszámításra. Így a Részalap a teljes futamidő alatt **(1+0,52%)x(1+0,65%)-1=1,1734%**-os hozamot ért el (éves hozam: 0,37%, EHM=0,37%). Ennek megfelelően a Részalap a befektetési jegyek számlavezető helyein az ügyfelek értékpapírszámlájához kapcsolódó pénzszámlákra Befektetési jegyenként 2025/03/21-én összesen 1,0117 HUF összegben visszafizetést teljesített, melynek kifizetését követően lezárta működését.

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