

**AEGON ATTICUS ALFA SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP**

2012. I. FÉLÉVES JELENTÉS

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. Törvény (a továbbiakban: Batv.) 106. § és 107. §, alapján készítette az Alap 2012. I. félévi működésének bemutatása céljából.

Az Alap általános működésével kapcsolatos további adatokat az Alap befektetési jegyeinek nyilvános forgalomba hozatalához készült PSZÁF által jóváhagyott tájékoztató tartalmazza, mely megtalálható az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelőnél, az Alap befektetési jegyeinek főforgalmazójánál, az Alap befektetési jegyeinek forgalmazási helyein, valamint az Alapkezelő honlapján (www.aegonalapkezelo.hu).

Budapest, 2012. augusztus 27.

Kocsis Bálint
vezérigazgató

Kadocsa Péter
vezérigazgató

Jelen dokumentum sajátkezű aláírásképet biztonsági okból nem tartalmaz. Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással és egyéb felelős személy aláírásával ellátott papír alapú dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL

Az Alap elnevezése:

AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap

Az Alap rövid neve:

AEGON Atticus Alfa Alap

Az Alap lajstromszáma:

1111-171

Az Alap fajtája

nyíltvégű

Az Alap típusa

nyilvános

A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa

| | |
|---|--------------|
| AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap „A” | HU0000703970 |
| AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap „B” | HU0000708318 |

Hozamfizetés

Az Alapok a tőkenövekmény terhére hozamot nem fizetnek, a teljes tőkenövekmény újra befektetésre kerül az Alapok befektetési politikájának megfelelően. A Befektetők a tőkenövekményt a tulajdonukban álló Befektetési jegyek vételi és visszavásárlási árának különbözeteként, mint árfolyamnyereséget realizálhatják.

A Befektetők köre

A Befektetési jegyeket egyaránt megvásárolhatják devizabelföldi es devizakülföldi természetes személyek, jogi személyek es jogi személyiség nélküli gazdasági társaságok.

| | |
|--------------------------|--|
| Alapkezelő adatai | AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. 1091 Budapest, Üllői út 1. Telefon : (06-1) 476-20-42 |
|--------------------------|--|

| | |
|---------------------------|--|
| Letétkezelő adatai | UniCredit Bank Hungary Zrt. 1054 Budapest, Szabadság tér 5-6. |
|---------------------------|--|

| | |
|---------------------------------|---|
| Vezető forgalmazó adatai | AEGON Magyarország Befektetési Jegy Forgalmazó Zrt. 1085 Budapest, Kálvin tér 12-13. |
|---------------------------------|---|

| | |
|-----------------------------|---|
| Könyvvizsgáló adatai | Deák Zsuzsanna Bejegyzett könyvvizsgáló – 005763 Ernst & Young Kft. 1132 Budapest, Váci út 20. |
|-----------------------------|---|

I. VAGYONKIMUTATÁS

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak összetétele a tárgyidőszak elején és végén, valamint az adott eszköz összes eszközön belüli aránya:

| Megnevezés | 2011. december 30. | | 2012. június 29. | |
|--------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------|------------------------|
| | Összeg / Érték (Ft) | A NEÉ százalékában (%) | Összeg / Érték (Ft) | A NEÉ százalékában (%) |
| Banki egyenlegek | 1,194,413,890 | 8.29% | 933,249,110 | 9.56% |
| Repo | 32,923,176 | 0.23% | 223,785,058 | 2.29% |
| Átruházható értékpapírok | 13,618,004,244 | 94.46% | 8,591,514,121 | 88.02% |
| Származékos ügyletek | - 99,510,075 | -0.69% | 158,971,227 | 1.63% |
| Egyéb eszközök | 578,766,705 | 4.01% | 173,601,821 | 1.78% |
| Összes eszköz | 15,324,597,940 | 106.30% | 10,081,121,336 | 103.28% |
| Kötelezettségek | - 908,183,131 | -6.30% | - 320,072,951 | -3.28% |
| Nettó eszközérték | 14,416,414,808 | 100.00% | 9,761,048,385 | 100.00% |

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

| Befektetési jegy | | 2011. december 30. | 2012. június 29. |
|---|--------------|--------------------|------------------|
| Sorozat | ISIN | | |
| AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF) | HU0000703970 | 5,579,359,959 | 3,587,429,562 |
| AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN) | HU0000708318 | 38,649,895 | 26,137,190 |

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

| Befektetési jegy | | 2011. december 30. | 2012. június 29. |
|---|--------------|--------------------|------------------|
| Sorozat | ISIN | | |
| AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF) | HU0000703970 | 1.784976 | 1.849571 |
| AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN) | HU0000708318 | 1.635616 | 1.768614 |

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

| Megnevezés | 2011. december 30. | | 2012. június 29. | |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|--------------------|
| | Összeg / Érték (Ft) | Százalékban (%) | Összeg / Érték (Ft) | Százalékban (%) |
| Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok | 411,906,350 | 3.02% | 1,197,847,630 | 13.94% |
| Részvény - GMU | - | 0.00% | 40,507,592 | 0.47% |
| Részvény - Egyéb külföld | 302,960,523 | 2.22% | - | 0.00% |
| GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei | 2,108,795,594 | 15.49% | - | 0.00% |
| Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen | 2,823,662,467 | 20.73% | 1,238,355,222 | 14.41% |
| Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen | - | 0.00% | - | 0.00% |
| A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen | - | 0.00% | - | 0.00% |
| Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei | 20,783,385 | 0.15% | 18,618,398 | 0.22% |
| GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei | 1,577,324,504 | 11.58% | 1,408,586,486 | 16.40% |
| Egyéb átruházható értékpapírok | 1,598,107,889 | 11.74% | 1,427,204,884 | 16.61% |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás | 4,190,308,154 | 30.77% | 3,398,935,981 | 39.56% |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. k | - | 0.00% | 648,900,756 | 7.55% |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pü. | 3,978,972,357 | 29.22% | 1,595,739,469 | 18.57% |
| Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pü. | 1,026,953,378 | 7.54% | 282,377,809 | 3.29% |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen | 9,196,233,888 | 67.53% | 5,925,954,016 | 68.97% |
| Értékpapírok összesen | 13,618,004,244 | 100.00% | 8,591,514,121 | 100.00% |

Az Alap befektetési politikájával összhangban a portfólióban részvények, hazai diszkont kincstárjegyek, illetve rövid és hosszú lejáratú forintban és devizában kibocsátott államkötvények, vállalati kötvények, átváltható kötvények és származtatott termékek vannak. Az Alap összetételében 2012 első félévében történt változásokat a különböző piaci lehetőségek kiaknázásának célja indokolta.