

**AEGON ATTICUS ALFA SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP**

2012. ÉVES 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. évi 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, 2013. április 26.

Kocsis Bálint
vezérigazgató

Kadocsa Péter
elnök-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 és devizakülföldi természetes személyek, jogi személyek és 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.
---------------------------------	---

A megbízott könyvvizsgáló társaság adatai	Ernst & Young Kft. 1132 Budapest, Váci út 20. Céggjegyzékszám: 01-09-267553 Nyilvántartásba vételi szám: 001165
--	--

Az Ernst & Young munkatársának adatai	Mészáros Péter Kamarai tagsági szám: 005805 Lakcím: 1222 Budapest, Kötélgártó u. 4.
--	---

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. december 28.	
	Összeg / Érték (Ft)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (Ft)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	1,194,413,890	8.29%	329,745,628	2.95%
Repo	32,923,176	0.23%	9,612,300	0.09%
Átruházható értékpapírok	13,618,004,244	94.46%	11,201,209,652	100.08%
Származékos ügyletek	- 99,510,075	-0.69%	- 142,493,169	-1.27%
Egyéb eszközök	578,766,705	4.01%	69,016,165	0.62%
Összes eszköz	15,324,597,940	106.30%	11,467,090,576	102.46%
Kötelezettségek	- 908,186,894	-6.30%	- 275,045,474	-2.46%
Nettó eszközérték	14,416,411,045	100.00%	11,192,045,102	100.00%

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy		2011. december 30.	2012. december 28.
Sorozat	ISIN		
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF)	HU0000703970	5,579,359,959	3,307,227,425
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN)	HU0000708318	38,649,895	33,140,731

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy		2011. december 30.	2012. december 28.
Sorozat	ISIN		
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF)	HU0000703970	1.784976	2.053530
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN)	HU0000708318	1.635616	1.857117

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2011. december 30.		2012. december 28.	
	Összeg / Érték (Ft)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (Ft)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézménye	411,906,350	3.02%	- 83,000,000	-0.74%
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	-	0.00%	1,429,993,170	12.77%
Részvény - Egyéb külföld	302,960,523	2.22%	818,253,344	7.31%
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	2,108,795,594	15.49%	403,346,250	3.60%
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	2,823,662,467	20.73%	2,568,592,764	22.93%
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%	162,563,727	1.45%
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1,577,324,504	11.58%	1,565,717,326	13.98%
Egyéb átruházható értékpapírok	1,598,107,889	11.74%	1,728,281,054	15.43%
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	4,190,308,154	30.77%	4,581,175,571	40.90%
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. k	-	0.00%	619,798,298	5.53%
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pü.	3,978,972,357	29.22%	1,139,213,061	10.17%
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügy			276,540,379	2.47%
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pü.	1,026,953,378	7.54%	287,608,526	2.57%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	9,196,233,888	67.53%	6,904,335,834	61.64%
Értékpapírok összesen	13,618,004,244	100.00%	11,201,209,652	100.00%

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

V. BEFEKTETÉSI ALAP ESZKÖZEINEK ALAKULÁSA

Befektetésből származó jövedelem:

adatok eFt-ban	
Pénzügyi műveletek bevételei	2012
Pénzintézettől kapott kamatok	1 102
Diszkont kincstárjegyek árfolyamnyeresége	78 227
Deviza árf. változással kapcsolatos nyereség	72 495
Részvények árfolyamnyeresége	1 248 719
Kötvények árfolyamnyeresége	883 578
Repo ügyletek kamata	7 245
Értékpapírok felhalmozott kamata	-24 840
Kamatkozó papírok kapott kamata	196 097
Kapott osztalék	72 800
Származékos ügyletek nyeresége	1 873 813
Összesen:	4 409 236

Az Alap 2012-es éves beszámolójában szereplő számviteli adatok alapján készült.

adatok eFt-ban	
Pénzügyi műveletek ráfordításai	2012
Diszkont papírok árfolyamvesztesége	1 036
Kötvények árfolyamvesztesége	443 693
Részvények árfolyamvesztesége	1 241 727
Fizetett kamat	5
Értékpapír kölcsönzés díja	8 275
Opció díj	3 384
Származékos ügyletek vesztesége	739 557
Összesen:	2 437 677

Az Alap 2012-es éves beszámolójában szereplő számviteli adatok alapján készült.

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alapnál 2012-ben Egyéb ráfordításként 766 eFt adókorrekciót, valamint kerekítési különbözeteket könyveltünk el. Egyéb bevételként szintén kerekítési különbözeteket, és 982 eFt adókorrekciót, illetve 34e Ft büntető jutalékot számoltunk el, melyet az OTP és a Concorde fizetett a befektetési jegyek forgalmazása után.

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

	adatok eFt-ban
Működési költségek	2012
Alapkezelői díj	172 971
Letétkezelői díj	12 655
Könyvvizsgálói díj	4 195
Közzétételi díjak	126
Megbízási díj	69 546
KELER díj	627
PSZÁF díj	2 819
Bankköltség	323
Fizetendő sikerdíj	166 532
Főforgalmazói jutalék	6 820
Forgalmazói jutalék	53 545
Tranzakciós díjak	2 371
Összesen:	492 530

Az Alap 2012-es éves beszámolójában szereplő számviteli adatok alapján készült.

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

	adatok eFt-ban	
Tőkenövekmény:	2011	2012
visszavásárolt bef.jegyek bevonási értékkülönbözete	2 172 922	65 625
értékelési különözetéből	565 051	590 387
előző évek eredményből	4 048 863	3 576 625
üzleti év eredményéből	-472 238	1 479 280
Összesen:	6 314 598	5 711 916

Az Alap 2012-es éves beszámolójában szereplő számviteli adatok alapján készült.

Felosztott és újrabefektetett jövedelemmel az alap nem rendelkezett 2012-ben.

VI. A NETTÓ ESZKÖZÉRTÉKNEK ÉS AZ EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉNEK A VÁLTOZÁSA

Alap neve / Fund	ISIN	1 jegyre jutó eszközérték / Unit price	Nettó eszközérték / Netto Asset Value	Értéknap / Value date
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF)	HU0000703970	1.733247	11,492,974,777 Ft	31/12/2009
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN)	HU0000708318	1.699318	1,082.47 zł	31/12/2009
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF)	HU0000703970	1.835063	11,509,306,056 Ft	31/12/2010
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN)	HU0000708318	1.684139	6,854,894 zł	31/12/2010
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF)	HU0000703970	1.784976	9,959,023,622 Ft	30/12/2011
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN)	HU0000708318	1.635616	63,216,386.66 zł	30/12/2011
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap A (HUF)	HU0000703970	2.053530	6,791,490,734 Ft	28/12/2012
AEGON Atticus Alfa Befektetési Alap B (PLN)	HU0000708318	1.857117	61,546,215 zł	28/12/2012

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

VII. SZÁRMAZTATOTT ÜGYLETEK

Ügylet típusa	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó határidős ár	Értékelési különbözete	dev	Hó végi állomány
USDHUF forward Eladás	21/03/2012	2,100,000	248.66	224.70	50,311,590	HUF	2012/ január
USDHUF forward Eladás	21/03/2012	2,500,000	251.81	224.70	67,769,750	HUF	2012/ január
USDHUF forward Eladás	21/03/2012	2,000,000	252.35	224.70	55,295,800	HUF	2012/ január
EURHUF forward Eladás	13/02/2012	19,229,000	315.28	294.34	402,691,795	HUF	2012/ január
EURHUF forward Eladás	21/03/2012	110,000	311.45	296.38	1,657,579	HUF	2012/ január
USDHUF forward Eladás	21/03/2012	1,200,000	242.22	224.70	21,021,480	HUF	2012/ január
USDHUF forward Eladás	21/03/2012	1,000,000	240.17	224.70	15,467,900	HUF	2012/ január
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	20,000,000	70.12	71.29	23,334,000	HUF	2012/ január
					637,549,894		2012/ január Összesen
USDHUF forward Eladás	21/03/2012	1,400,000	252.35	216.20	50,610,140	HUF	2012/ február
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	20,000,000	70.12	71.69	31,358,000	HUF	2012/ február
PLNHUF forward Vétel	05/03/2012	20,000,000	70.08	70.09	158,000	HUF	2012/ február
EURHUF forward Eladás	21/03/2012	2,110,000	292.56	291.01	3,271,133	HUF	2012/ február
USDHUF forward Eladás	04/04/2012	9,300,000	220.9	216.78	38,318,790	HUF	2012/ február
EURHUF forward Eladás	04/04/2012	16,729,000	292.8	291.76	17,356,338	HUF	2012/ február
USDHUF forward Eladás	18/04/2012	1,650,000	222.6	217.36	8,646,990	HUF	2012/ február
USDHUF forward Eladás	18/04/2012	1,100,000	216.45	217.36	-1,000,340	HUF	2012/ február
					148,719,051		2012/ február Összesen
USDHUF forward Eladás	04/04/2012	4,300,000	220.9	221.80	-3,865,270	HUF	2012/ március

Ügylet típusa	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó határidős ár	Értékelési különbözete	dev	Hó végi állomány
EURHUF forward Eladás	04/04/2012	16,729,000	292.8	295.85	-50,971,590	HUF	2012/ március
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	1,500,000	303.9	309.06	-7,736,100	HUF	2012/ március
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	2,110,000	299.64	309.06	-19,870,714	HUF	2012/ március
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	1,400,000	226.05	232.16	-8,560,860	HUF	2012/ március
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	2,500,000	305	309.42	-11,053,000	HUF	2012/ március
USDHUF forward Eladás	18/04/2012	1,650,000	222.6	222.42	302,280	HUF	2012/ március
USDHUF forward Eladás	18/04/2012	1,100,000	216.45	222.42	-6,563,480	HUF	2012/ március
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	4,750,000	303.46	309.06	-26,587,650	HUF	2012/ március
					-134,906,384		2012/ március Összesen
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	2,110,000	299.64	299.26	807,075	HUF	2012/ április
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	500,000	226.05	226.87	-409,550	HUF	2012/ április
USDHUF forward Eladás	05/09/2012	3,250,000	226.3	223.09	10,431,200	HUF	2012/ április
EURHUF forward Eladás	05/09/2012	15,229,000	301	294.51	98,849,916	HUF	2012/ április
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	2,700,000	306.53	299.26	19,635,750	HUF	2012/ április
PLNHUF forward Vétel	20/06/2012	15,000,000	69.03	69.05	273,000	HUF	2012/ április
PLNHUF forward Vétel	31/05/2012	15,000,000	69.15	68.95	-2,955,000	HUF	2012/ április
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	500,000	307.71	299.61	4,049,650	HUF	2012/ április
USDHUF forward Eladás	16/05/2012	1,100,000	229.57	218.53	12,140,700	HUF	2012/ április
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	2,500,000	305	299.61	13,473,250	HUF	2012/ április
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	4,750,000	303.46	299.26	19,961,875	HUF	2012/ április
					176,257,866		2012/ április Összesen

Ügylet típusa	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó határidős ár	Értékelési különbözete	dev	Hó végi állomány
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	2,110,000	299.64	310.77	-23,493,795	HUF	2012/május
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	500,000	226.05	250.67	-12,310,450	HUF	2012/május
USDHUF forward Eladás	05/09/2012	3,250,000	226.3	246.44	-65,453,050	HUF	2012/május
EURHUF forward Eladás	05/09/2012	13,579,000	301	305.70	-63,811,795	HUF	2012/május
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	2,700,000	306.53	310.77	-11,460,150	HUF	2012/május
PLNHUF forward Vétel	20/06/2012	15,000,000	69.03	68.54	-7,392,000	HUF	2012/május
PLNHUF forward Vétel	02/07/2012	15,000,000	68.486	68.59	1,549,500	HUF	2012/május
TRYHUF forward Eladás	04/07/2012	670,000	130.46	130.60	-93,197	HUF	2012/május
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	500,000	307.71	311.15	-1,718,050	HUF	2012/május
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	2,500,000	305	311.15	-15,365,250	HUF	2012/május
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	3,460,000	303.46	310.77	-25,308,170	HUF	2012/május
					-224,856,407		2012/május Összesen
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	500,000	226.05	236.03	-4,991,450	HUF	2012/június
USDHUF forward Eladás	05/09/2012	1,750,000	226.3	232.04	-10,052,525	HUF	2012/június
EURHUF forward Eladás	05/09/2012	13,579,000	301	291.83	124,471,904	HUF	2012/június
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	15,000,000	67.38	68.33	14,308,500	HUF	2012/június
EURHUF forward Eladás	05/09/2012	3,000,000	289.22	291.83	-7,840,500	HUF	2012/június
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	2,500,000	305	297.09	19,785,000	HUF	2012/június
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	3,460,000	303.46	296.73	23,290,298	HUF	2012/június
					158,971,227		2012/június Összesen
EURHUF forward Eladás	05/09/2012	11,579,000	301	280.68	235,309,596	HUF	2012/július

Ügylet típusa	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó határidős ár	Értékelési különbözete	dev	Hó végi állomány
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	15,000,000	67.38	68.42	15,577,500	HUF	2012/ július
EURHUF forward Eladás	19/12/2012	2,500,000	293.57	286.02	18,887,500	HUF	2012/ július
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	9,000,000	289.96	285.90	36,534,600	HUF	2012/ július
USDHUF forward Eladás	19/12/2012	2,700,000	242.66	233.15	25,672,140	HUF	2012/ július
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	1,150,000	242.1	233.04	10,416,585	HUF	2012/ július
					342,397,921		2012/ július Összesen
EURHUF forward Eladás	05/09/2012	11,579,000	301	283.76	199,602,276	HUF	2012/ augusztus
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	9,000,000	289.96	288.98	8,834,400	HUF	2012/ augusztus
TRYHUF forward Eladás	19/12/2012	1,600,000	125.59	124.30	2,071,520	HUF	2012/ augusztus
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	1,150,000	242.1	230.11	13,782,865	HUF	2012/ augusztus
					224,291,061		2012/ augusztus Összesen
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	9,000,000	289.96	287.52	21,919,500	HUF	2012/ szeptember
TRYHUF forward Eladás	19/12/2012	1,600,000	125.59	122.30	5,258,560	HUF	2012/ szeptember
EURHUF forward Eladás	19/06/2013	5,339,000	295.5	296.87	-7,317,099	HUF	2012/ szeptember
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	3,500,000	293	287.52	19,164,250	HUF	2012/ szeptember
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	1,400,000	232.65	222.02	14,878,780	HUF	2012/ szeptember
USDHUF forward Eladás	12/12/2012	900,000	223.63	222.02	1,446,930	HUF	2012/ szeptember
					55,350,920		2012/ szeptember Összesen
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	9,000,000	289.96	285.60	39,228,300	HUF	2012/ október
TRYHUF forward Eladás	19/12/2012	1,600,000	125.59	121.66	6,294,880	HUF	2012/ október
EURHUF forward Eladás	19/06/2013	5,339,000	295.5	294.49	5,402,534	HUF	2012/ október

Ügylet típusa	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó határidős ár	Értékelési különbözete	dev	Hó végi állomány
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	3,500,000	293	285.60	25,895,450	HUF	2012/október
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	800,000	288.93	289.36	-342,000	HUF	2012/október
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	900,000	288.55	289.36	-726,750	HUF	2012/október
USDHUF forward Eladás	28/02/2013	800,000	222.59	222.46	100,560	HUF	2012/október
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	15,000,000	67.993	68.73	11,017,500	HUF	2012/október
USDHUF forward Eladás	28/02/2013	1,400,000	223.8	222.46	1,869,980	HUF	2012/október
PLNHUF forward Vétel	27/12/2012	5,000,000	67.7	68.75	5,257,000	HUF	2012/október
					93,997,454		2012/október Összesen
EURHUF forward Eladás	12/12/2012	4,000,000	289.96	280.85	36,448,800	HUF	2012/november
TRYHUF forward Eladás	19/12/2012	1,600,000	125.59	120.75	7,749,760	HUF	2012/november
EURHUF forward Eladás	19/06/2013	5,339,000	295.5	289.38	32,693,366	HUF	2012/november
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	800,000	288.93	284.47	3,571,760	HUF	2012/november
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	900,000	288.55	284.47	3,676,230	HUF	2012/november
USDHUF forward Eladás	28/02/2013	800,000	222.59	218.66	3,140,560	HUF	2012/november
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	15,000,000	68.25	68.32	1,006,500	HUF	2012/november
PLNHUF forward Vétel	19/12/2012	5,000,000	68.27	68.32	235,500	HUF	2012/november
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	1,460,000	285.53	284.47	1,554,462	HUF	2012/november
PLNHUF forward Vétel	27/12/2012	5,000,000	67.7	68.34	3,205,500	HUF	2012/november
USDHUF forward Eladás	28/02/2013	1,400,000	223.8	218.66	7,189,980	HUF	2012/november
					100,472,419		2012/november Összesen
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	800,000	288.93	294.11	-4,143,600	HUF	2012/december

Ügylet típusa	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó határidős ár	Értékelési különbözete	dev	Hó végi állomány
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	900,000	288.55	294.11	-5,003,550	HUF	2012/december
USDHUF forward Eladás	28/02/2013	800,000	222.59	223.00	-327,600	HUF	2012/december
EURHUF forward Eladás	20/03/2013	3,000,000	286.48	295.02	-25,616,100	HUF	2012/december
TRYHUF forward Eladás	22/01/2013	1,600,000	121.17	123.30	-3,405,920	HUF	2012/december
EURHUF forward Eladás	19/06/2013	5,339,000	295.5	298.99	-18,642,186	HUF	2012/december
EURHUF forward Eladás	07/02/2013	4,000,000	285.02	293.18	-32,640,400	HUF	2012/december
USDHUF forward Eladás	28/02/2013	1,400,000	223.8	223.00	1,120,700	HUF	2012/december
TRYHUF forward Eladás	20/03/2013	2,000,000	122.56	123.28	-1,437,800	HUF	2012/december
CZKHUF forward Eladás	28/02/2013	9,400,000	11.447	11.73	-2,644,220	HUF	2012/december
EURHUF forward Eladás	05/02/2013	2,200,000	283.39	293.09	-21,335,380	HUF	2012/december
USDHUF forward Eladás	20/03/2013	900,000	221.2	223.67	-2,220,030	HUF	2012/december
CZKHUF forward Eladás	20/03/2013	16,000,000	11.326	11.76	-6,995,200	HUF	2012/december
USDHUF forward Eladás	20/03/2013	750,000	219.5	223.67	-3,125,025	HUF	2012/december
CZKHUF forward Eladás	20/03/2013	9,540,000	11.391	11.76	-3,550,788	HUF	2012/december
EURHUF forward Eladás	28/02/2013	1,460,000	285.53	294.11	-12,526,070	HUF	2012/december
					-142,493,169		2012/december Összesen
IRS- Kamat swap 170224 Pay fixed		600,000,000	0		-1,151,259	HUF	2012/február
					-1,151,259		2012/február Összesen
IRS- Kamat swap 170224 Pay fixed		600,000,000	0		4,954,939	HUF	2012/március
					4,954,939		2012/március Összesen

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

Napi elszámolású futures ügyletek hóvégi állománya:

instrumentum	nyitott	napiÁr	pont Változás	napi eredmény	deviza	hónap
WIG20 2012 MAR WIH2	93	2,349.00	19	17,670	PLN	2012/ január
BUX1212	160	19,401.00	-149	238,400	HUF	2012/ január
BUX1212	1320	19,401.00	-149	1,966,800	HUF	2012/ január
BUX1212	740	19,401.00	-149	1,102,600	HUF	2012/ január
WIG20 2012 MAR WIH2	93	2,311.00	-21	- 19,530	PLN	2012/ február
BUX1212	160	19,890.00	50.5	- 80,800	HUF	2012/ február
BUX1212	1320	19,890.00	50.5	- 666,600	HUF	2012/ február
BUX1212	740	19,890.00	50.5	- 373,700	HUF	2012/ február
BUX1212	160	19,150.00	-51	81,600	HUF	2012/ március
BUX1212	1320	19,150.00	-51	673,200	HUF	2012/ március
BUX1212	740	19,150.00	-51	377,400	HUF	2012/ március
DAX 1206	12	6,239.00	-44.5	- 13,350	EUR	2012/ május
DAX 1209	12	6,411.50	260.5	78,150	EUR	2012/ június
GOLD DEC 12	3	1,614.60	-9.4	- 2,820	USD	2012/ július
DAX 1209	12	6,784.00	1.5	450	EUR	2012/ július
DAX 1212	6	7,238.50	-53	- 7,950	EUR	2012/ szeptember
DAX 1212	12	7,238.50	-91	- 27,300	EUR	2012/ szeptember
DAX 1212	10	7,271.00	-5.5	- 1,375	EUR	2012/ október
GOLD DEC 12	3	1,719.10	-6.7	- 2,010	USD	2012/ október

A táblázat 2012-es év utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

VIII. BEFEKTETÉSI ALAPKEZELŐ MŰKÖDÉSÉBEN BEKÖVETKEZETT VÁLTOZÁSOK, VALAMINT A BEFEKTETÉSI POLITIKA ALAKULÁSÁRA HATÓ FŐBB TÉNYEZŐK

A Társaság 100%-os tulajdonában lévő leányvállalatát, az Aegon Magyarország Befektetési Jegy Forgalmazó Zrt-t várhatóan beolvadással megszünteti, és átveszi tőle a Bszt. (2007. évi CXXXVIII. törvény a befektetési vállalkozásokról és az árutőzsdei szolgáltatókról, valamint az általuk végezhető tevékenységek szabályairól) szerinti forgalmazói és főforgalmazói tevékenységeket.

Az Alap befektetési politikájával összhangban, a portfolióban 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 történt változásokat a különböző piaci lehetőségek kiaknázásának célja indokolta.

IX. EREDMÉNYKIMUTATÁS

AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap 2012. év

	Előző év eFt	Tárgyév eFt
I. Pénzügyi műveletek bevételei	3 663 670	4 409 236
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	3 764 308	2 437 677
III. Egyéb bevételek	219	1 016
IV. Működési költségek	370 865	492 530
V. Egyéb ráfordítások	955	766
VI. Rendkívüli bevételek	0	0
VII. Rendkívüli ráfordítások	0	0
VIII. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.+VI.-VII.-VIII.)	-472 238	1 479 280

Az Alap 2012-es éves beszámolójában szereplő számviteli adatok alapján készült.

Budapest, 2013. április 26.



ERNST & YOUNG

Ernst & Young Kft.
H-1132 Budapest, Váci ut. 20,
1399 Budapest 62 Pf. 632. Hungary
Tel: +36 1 451 8100, Fax: +36 1 451 8199
www.ey.com/hu
Cg. 01-09-267553

Független könyvvizsgálói jelentés

Az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. részére

1.) Elvégeztük az AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban „az Alap”) mellékelt 2012. évi éves jelentés V. és IX. pontjaiban található számviteli információinak a könyvvizsgálatát.

A vezetés felelőssége az éves jelentésért

2.) Az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. ügyvezetése (továbbiakban „vezetés”) felelős ennek az éves jelentésnek a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. törvénnyel (továbbiakban „a Törvény”) összhangban történő elkészítéséért, beleértve a Törvény 107. § (1) bekezdésében előírt információkat és az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által adott értékelése alapján történő elszámolásáért, valamint az olyan belső kontrollokért, amelyeket a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állításoktól mentes éves jelentés elkészítése.

A könyvvizsgáló felelőssége

3.) A Törvény 110. § (1) bekezdésével összhangban a mi felelősségünk az éves jelentésben közölt számviteli információknak véleményezése könyvvizsgálatunk alapján, és annak vizsgálata, hogy az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárral alátámasztottak-e, valamint az adott időszaki kezelési költségek elszámolása a letétkezelő által adott értékelés alapján történt-e. Könyvvizsgálatunkat a magyar Nemzeti Könyvvizsgálói Standardok és a könyvvizsgálatra vonatkozó - Magyarországon érvényes - törvények és egyéb jogszabályokkal összhangban hajtottuk végre. Ezek a standardok megkövetelik, hogy megfeleljünk az etikai követelményeknek, valamint hogy a könyvvizsgálatot úgy tervezzük meg és hajtsuk végre, hogy kellő bizonyosságot szerezzünk arról, hogy az éves jelentés mentes-e a lényeges hibás állításoktól.

4.) A könyvvizsgálat magában foglalja olyan eljárások végrehajtását, amelyek célja könyvvizsgálói bizonyítékot szerezni az éves jelentésben közölt számviteli információkról. A kiválasztott eljárások - beleértve az éves jelentés akár csalásból, akár hibából eredő, lényeges hibás állításai kockázatainak felmérését is, a könyvvizsgáló megítélésétől függenek. A kockázatok ilyen felmérésekor az éves jelentés gazdálkodó egység általi elkészítése és valós bemutatása szempontjából releváns belső kontrollt azért mérlegeljük, hogy olyan könyvvizsgálói eljárásokat tervezzünk meg, amelyek az adott körülmények között megfelelőek, de nem azért, hogy a gazdálkodó egység belső kontrolljának hatékonyságára vonatkozóan véleményt mondjunk. A könyvvizsgálat magában foglalja továbbá az alkalmazott számviteli politikák megfelelőségének és a vezetés által készített számviteli becslések ésszerűségének, valamint az éves jelentés átfogó bemutatásának értékelését.

5.) Meggyőződésünk, hogy a megszerzett könyvvizsgálói bizonyíték elegendő és megfelelő alapot nyújt könyvvizsgálói véleményünk megadásához.



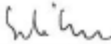
Vélemény

6.) Véleményünk szerint az AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap 2012. december 31-ével végződő évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. törvénnyel összhangban kerültek bemutatásra, az éves jelentésben szereplő eszközök és kötelezettségek a leltárral alátámasztottak, az éves jelentésben bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

Egyéb kérdések

7.) Könyvvizsgálatunk kizárólag az első bekezdésben hivatkozott számviteli információkra vonatkozott, és nem tartalmazta az éves jelentésben bemutatott egyéb információk vizsgálatát.

Budapest, 2013. április 26.


Szabó Gergely
Ernst & Young Kft.
Nyilvántartásba-vételi szám: 001165


Mészáros Péter
Kamarai tag könyvvizsgáló
Kamarai tagsági szám: 05805