



# AEGON ALFA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

## 2014. I. FÉLÉVES JELENTÉS

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (a továbbiakban: Kbtv.) 131. § és 132. § alapján készítette az az Alap 2014. I. félévi működésének bemutatása céljából.

Az Alap általános működésével kapcsolatos további adatokat az Alap befektetési jegyeinek nyilvános forgalomba hozatalához készült MNB 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](http://www.aegonalapkezelo.hu)).

Budapest, 2014. augusztus 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 Alfa Származtatott Befektetési Alap

**Az Alap rövid neve:**

AEGON Alfa Alap

**Az Alap lajstromszáma:**

1111-171

**Az Alap fajtája**

nyíltvégű

**Az Alap típusa**

nyilvános

**A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa**

AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap „A”

HU0000703970

AEGON 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**

PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft.  
1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.  
Cégjegyzékszám: 01 09 063022  
Nyilvántartásba vételi szám: 002950

**Az PWC munkatársának adatai**

Tímár Pál  
Kamarai tagsági szám: 002527  
Lakcím: 1188 Budapest, Táncsics M. u. 98/b

## I. Vagyonkimutatás

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

Megnevezés	2013.12.30.		2014.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	633 151 820	3,07	1 504 619 844	4,61
Repo				
Átruházható értékpapírok	20 223 779 438	97,95	32 005 295 966	98,05
Származékos ügyletek	112 681 467	0,55	181 218 008	0,56
Egyéb eszközök	16 698 468 778	80,87	10 742 107 642	32,91
<b>Összes eszköz</b>	<b>37 668 081 503</b>	<b>182,43</b>	<b>44 433 241 460</b>	<b>136,12</b>
Kötelezettségek	-17 020 146 389	-82,43	-11 790 449 364	-36,12
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>20 647 932 523</b>	<b>100,00</b>	<b>32 642 789 934</b>	<b>100,00</b>

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

## II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy				2013.12.30.	2014.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	5 519 624 810	9 008 708 316
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	55 805 915	60 450 178
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	104 913 232	1 643 036 840

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

## III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy				2013.12.30.	2014.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	2.246687	2.352568
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	2.035146	2.13304
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	1.065795	1.119327

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

## IV. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	2013.12.30.		2014.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	512 500 000	2,53	-1 347 880 000	-4,21
Részvény - Belföld - Biztosítók és Nyugdíjpénztárak	212 401 706	1,05	215 010 824	0,67
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	2 112 228 762	10,44	2 998 417 894	9,37
Részvény - GMU			985 559 640	3,08
Részvény - Egyéb külföld	1 774 050 860	8,77	2 133 344 281	6,67
Egyéb külföld nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	198 428 930	0,98	159 536 112	0,50
GMU nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei			316 676 003	0,99
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	4 809 610 258	23,78	5 460 664 753	17,06
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
GMU nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	1 519 314 987	7,51	1 317 466 956	4,12
Belföldi nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	521 807 491	2,58	38 024 289	0,12
Egyéb átruházható értékpapírok	2 041 122 478	10,09	1 355 491 245	4,24
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	5 566 918 924	27,53	11 358 975 884	35,49
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	6 550 910 941	32,39	8 448 446 407	26,40
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	1 255 216 838	6,21	2 238 071 179	6,99
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények			3 143 646 498	9,82
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	13 373 046 703	66,13	25 189 139 968	78,70
Értékpapírok összesen	20 223 779 438	100,00	32 005 295 966	100,00

*A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.*

Az Alap összetételében történt változásokat a különböző piaci lehetőségek kiaknázásának célja, valamint a folyamatos tőkemozgások indokolták.

Budapest, 2014. augusztus 26.