

**AEGON ALFA SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP**

2015. I. FÉLÉVES JELENTÉS

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az AEGON 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 2015. 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 forgalmazási helyein, valamint az Alapkezelő honlapján (www.aegonalapkezelo.hu).

Budapest, 2015. augusztus 19.

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
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap „R”	HU0000712286

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.

A megbízott könyvvizsgáló társaság adatai PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft.
1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.
Cégjegyzékszám: 01-09-063022
Nyilvántartásba vételi szám: 001464

A PricewaterhouseCoopers munkatársának adatai Tímár Pál
Kamarai tagsági szám: 002527

I. Vagyongkimutatás

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

Megnevezés	2014.12.30.		2015.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEE százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEE százalékában (%)
Banki egyenlegek	5 503 609 626	10,94	2 504 875 621	3,87
Repo	-	-	-	-
Átruházható értékpapírok	46 644 205 779	92,70	62 420 129 999	96,54
Származékos ügyletek	-681 566 010	-1,35	-470 668 006	-0,73
Egyéb eszközök	10 269 990 829	20,41	13 636 605 229	21,09
Összes eszköz	61 736 240 224	122,69	78 090 942 843	120,78
Kötelezettségek	-11 416 798 085	-22,69	-13 436 679 025	-20,78
Nettó eszközérték	50 319 443 528	100,00	64 654 272 531	100,00

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

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy				2014.12.30.	2015.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	15 099 530 567	19 781 825 521
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	62 968 015	60 971 374
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	3 434 162 993	4 111 311 504

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

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy				2014.12.30.	2015.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	2.404241	2.493952
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	2.188521	2.272056
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	1.148528	1.194983

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

IV. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	2014. 12. 30.		2015. 06. 30.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	-	-	192 208 800	0,31
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	997 302 592	2,14	7 073 324 579	11,33
Részvény - GMU	485 007 835	1,04	1 759 506 367	2,82
Részvény - Egyéb külföld	3 565 330 828	7,64	8 380 403 310	13,43
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	48 520 857	0,10	60 422 544	0,10
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	5 096 162 112	10,93	17 465 865 601	27,98
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen	-	-	-	-
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen	-	-	-	-
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	95 318 110	0,20	112 577 982	0,18
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 310 354 242	2,81	1 301 625 013	2,09
Egyéb átruházható értékpapírok	1 405 672 352	3,01	1 414 202 995	2,27
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	20 736 849 160	44,46	21 218 575 252	33,99
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	8 305 218 519	17,81	8 651 352 621	13,86
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	1 499 827 001	3,22	2 595 758 583	4,16
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	4 289 622 984	9,20	6 236 534 719	9,99
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények	4 608 178 879	9,88	4 414 630 773	7,07
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	702 674 771	1,51	423 209 454	0,68
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	40 142 371 314	86,06	43 540 061 403	69,75
Értékpapírok összesen	46 644 205 779	100,00	62 420 129 999	100,00

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