

Aegon Pénzpiaci Befektetési Alap

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Hungary Zrt.
Vezető forgalmazó:	AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index
ISIN kód:	HU0000702303
Indulás:	2002.09.25
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	11 452 651 579 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	11 452 651 579 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	2,258653 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

Az Alap célja, hogy stabil, nagyon alacsony kockázatú befektetési formaként funkcionáljon, ám a banki hozamoknál magasabb hozamot nyújtson a befektetőknek. Az Alapkezelő a fenti elveknek megfelelően választja ki a portfólióelemeket. A likviditás biztosításának érdekében az Alap elsősorban az ÁKK által forgalomba hozott államkötvényeket és diszkontkincstárjegyeket, valamint a Magyar Nemzeti Bank által kibocsátott kötvényeket kívánja portfóliójában tartani. A portfólióban lévő eszközök átlagos hátralévő futamideje a 6 hónapot, az eszközök átlagos hátralévő élettartama a 12 hónapot nem haladhatja meg. Az Alap alacsony kockázatú, ugyanakkor az állampapíroknál várhatóan magasabb hozamot biztosító banki és vállalati kibocsátású, forintban denominált, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokat is tarthat a portfóliójában. Az Alap továbbá korlátozott mértékben fektethet az OECD vagy G20 ország által kibocsátott állampapírokba, illetve az EU bármely tagállamának központi kormányza, regionális vagy helyi önkormányzata, jegybankja, illetőleg az Európai Unió, az Európai Központi Bank vagy az Európai Beruházási Bank által kibocsátott vagy garantált hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokat. A változó kamatozású, forintban denominált, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok esetében a hátralévő átlagos futamidő a legközelebbi kamatfizetési napig hátralévő napok számával egyezik meg. Az Alap pénzeszközait bankbetétben is elhelyezheti. Az alap korlátozott mértékben devizaeszközöket is tarthat a portfóliójában, de csak a devizaárfolyam-kockázat teljes fedezése mellett (a származtatott ügylet és a fedezni kívánt értékpapír devizakitettsége között 5%-nál nagyobb eltérés nem adódhat). Az Aegon Pénzpiaci Befektetési Alap mindenkor befektetési portfóliójának legalább 80 százalékos arányban kell EGT-állam által kibocsátott, forintban jegyzett, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírt tartalmaznia.

FORGALMAZÓK

Aegon Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., CIB Bank Zrt., Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe, Codex Tőzsdéügynökség és Értéktár Zrt., Commerzbank Zrt., CONCORDE Értékpapír Zrt., Equilor Befektetési Zrt, Erste Befektetési Zrt., OTP Bank Nyrt., Quantis Alpha Befektetési Zrt., Raiffeisen Bank Zrt., SPB Befektetési Zrt., Unicredit Bank Hungary Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	6,41 %	6,96 %
1 hónap	0,14 %	0,12 %
3 hónap	0,39 %	0,34 %
6 hónap	0,89 %	0,79 %
2014	2,21 %	2,46 %
2013	4,54 %	5,23 %
2012	8,32 %	8,52 %
2011	4,65 %	5,17 %
2010	4,94 %	5,53 %
2009	9,20 %	9,30 %
2008	8,78 %	8,95 %
2007	6,88 %	7,89 %
2006	6,12 %	6,92 %
2005	7,09 %	7,63 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Szeptemberben tovább folytatódott a rövid kötvényhozamok csökkenése, melyet alapvetően az MNB eszköztár-változása, illetve az azzal kapcsolatos várakozások indukáltak. Szeptember 23-ával a jegybank irányadó instrumentumává a 3 hónapos betét vált, melyhez csak korlátozott mértékben férhetnek hozzá a piaci szereplők, illetve meg kell felelniük a szigorodó likviditásfedezeti előírásoknak. A piac számára további meglepetést okozott a kamatfolyosó 25 bázisponttal történő eltérése, amely az egy napos betétek tartása felől a rövid lejáratú állampapírok piacára tereli a bankokat. A jelentős többletterület következtében a rövid hozamok átlagosan 29 bázisponttal csökkentek.

Alapunk a benchmarkhoz képest némileg magasabb kamatkockázatot vállalt, így a piaci fejlemények kedvezően hatottak a teljesítményünkre.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	76,27 %
Államkötvények	20,62 %
Számlapénz	0,04 %
Kötelezettség	-0,04 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,02 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	17,99 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

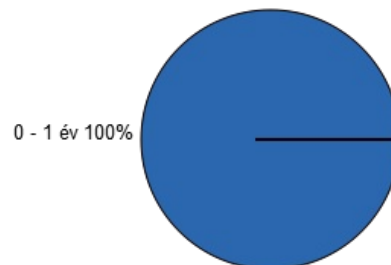
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D160217 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
PEMÁK 2015/12/21 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151021 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151223 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

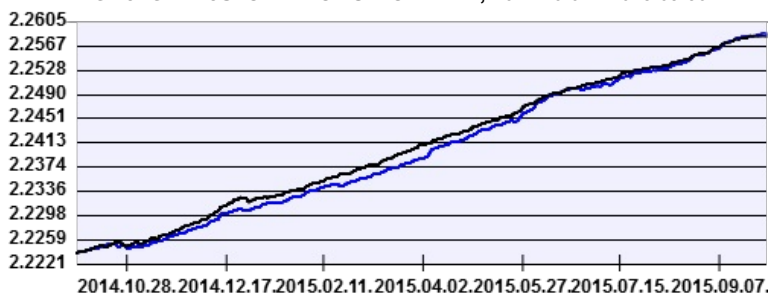
D160217 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
PEMÁK 2015/12/21 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151021 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2014.10.01 - 2015.09.30



— Aegon Pénzpiaci Befektetési Alap — Benchmark

A múltbeli hozamok nem jelentenek garanciát az alap jövőbeli teljesítményére nézve. Jelen hirdetés nem minősül ajánlattételnek vagy befektetési tanácsadásnak. A befektetés részletes feltételeit az Alap Tájékoztatója tartalmazza, mely a mindenkor érvényes kondíciós listákkal együtt megtalálható a forgalmazási helyeken. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,14 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,13 %