

# AEGON ATTICUS ALFA

SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

## ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

**ISIN kód:** HU-0000703970  
**Bloomberg kód:** AEGCITA HB Equity  
**ISIN kód (B sorozat):** HU-0000708318  
**Bloomberg kód (B sorozat):** AEGONAB HB Equity  
**Alapkezelő:** AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.  
**Letétkezelő:** UniCredit Bank Hungary Zrt.  
**Vezető forgalmazó:** AEGON Magyarország Befektetési Jegy Forgalmazó Zrt.  
**Forgalmazók:** CIB Bank Zrt.; Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe; Codex Értéktár és Értékpapír Zrt.; Equilor Befektetési Zrt.; ERSTE Befektetési Zrt.; UniCredit Bank Hungary Zrt.; Raiffeisen Bank Zrt.; Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.; BNP Paribas Magyarországi Fióktelepe; Commerzbank Zrt.; Concorde Értékpapír Zrt.; OTP Bank Nyrt.  
**Az alap nyilvántartásba vételének kelte:** 2006. 02. 13.  
**Devizanem:** HUF  
**B sorozat indulása:** 2009. 11. 18.  
**Devizanem:** PLN  
**Benchmark összetétele:** 100% RMAX Index  
**Alap nettó eszközértéke:** 11 109 646 280  
**1 jegyre jutó nettó eszközérték:** 1,743814  
**B sorozat nettó eszközértéke PLN-ben:** 6 582 680,44  
**1 jegyre jutó nettó eszközérték:** 1,620187

## Az alap eszközüsszetétele, 2010. 09. 30.

Diszkont kincstárjegyek	0,00%
Magyar állampapírok	66,41%
Magyar részvények	0,00%
Betét	0,00%
Külföldi részvények	8,75%
Állampapír repo	0,00%
Számlapénz	8,30%
Egyéb eszközök	16,54%
Összesen	100,00%
Nettó korrekciós tőkeáttétel	158,44%
Származtatott ügyletek	98,15%

gyengülésére és az S&P500 index szárnyalására fogadtunk. Továbbá az előző havi hírlevélben említett fedezeti pozíciók, amelyek a forint erősödése ellen védik a nem HUF denominált értékpapírokat szintén nyereséget termeltek. A portfólióban tartott 560 kontraktus kukorica határidős vételi pozíció több mint felén nyereséget realizáltunk (vétel 439 USD, nyereséget realizálás: 507 USD), illetve az 1135-ös szintről komoly fogadásokat kötöttünk az S&P500 index árfolyamának erősödésére, amely az Alap nettó eszközértékének körülbelül 9%-át teszi ki. Az amerikai dollár fonttal szembeni gyengülésére (10 millió font értékben) kötött pozíciókat továbbra is tartjuk, mivel az amerikai pénznymodra továbbra is maximumon pörög, így reális lehetőségnek tartjuk az USD további értékvesztését. Az Alap stabilitásáért felelős hitelpapírok közül kedvenceink a 2015A és a 2014C, illetve átlagos hátralévő futamidőnk 2,55 év.

## Befektetési politika:

Az AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap gyakorlatilag „mindenbe” fektethet, az Alapkezelő véleményének megfelelően. Elsősorban részvények, részvényindexek, és devizapozíciók lesznek jellemzőek, de az áru piacokon is befektethet az Alap, amely sokkal kockázatosabb, mint a Moneymaxx, ugyanis származtatott, határidős ügyletek révén kétszeres tőkeáttételt is felvehet. Ez azt jelenti, hogy az Alap pozícióinak értéke duplája lehet az alap saját tőkéjének. Azaz, ha az alap által tartott eszköz(ök) árfolyama 1%-kal mozdul el, akkor az alap vagyona akár 2%-kal is változhat. Nyilvánvalóan ez mind a pozitív mind a negatív árfolyam alakulás esetén is igaz, ami a kockázatot növeli. Az Alap mind vételi, mind fedezetlen eladási pozíciókat is nyithat, azaz akár emelkedésre, akár esésre is „játszhat”. Az Alap befektetési politikája igen közel áll az úgynevezett globális „macro hedge fund” típushoz, amelyet Soros György Quantum alapja tett híressé.

## Befektetési horizont:

A javasolt minimális befektetési idő



Kockázati besorolás a napi hozamok elmúlt időszaki szórása alapján



## Piaci összefoglaló:

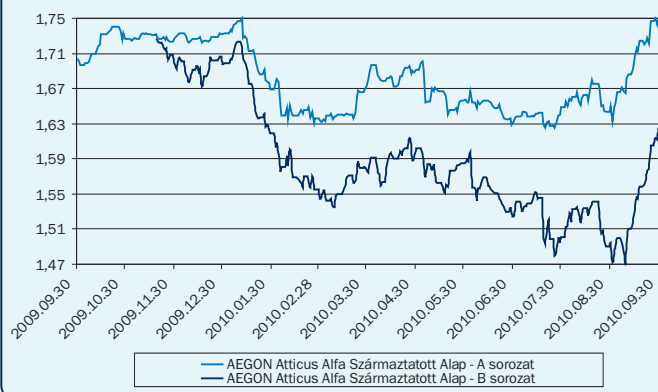
Az Alap indulástól számított éves átlagos hozama 12,76%, amely igen figyelemre méltó különösen, hogy a nettó benchmark éves átlagos 5,96%-teljesítményt tud csak felmutatni. Az Alap forintban 6,78%, míg zlotyban 10,04% profitot termelt szeptemberben, szemben a nettó benchmark 0,4%-os teljesítményével. A ragyogó eredmény elsősorban a spekulatív származtatott pozícióknak köszönhető, mivel az áru piaci termékek árfolyamának emelkedésére, az amerikai dollár

## Az alap által elért nettó hozam:

Időtáv	1 hónap	3 hónap	6 hónap	12 hónap*	2009 év	2008 év	2007 év	Indulástól
Hozam <sup>a</sup> HUF	-	-	-	2,31%	16,55%	18,82%	12,86%	-
Hozam <sup>b</sup> PLN	10,04%	6,27%	2,90%	-	-	-	-	-6,16%
Referencia hozam*	0,40%	0,86%	1,41%	4,43%	8,73%	6,70%	5,92%	2,72%

<sup>a</sup> Az alap 2010. 09. 30-ig elért teljesítményt mutatja; az alap 2006. 02. 13-án indult.  
<sup>b</sup> Az alap 2010. 09. 30-ig elért teljesítményt mutatja; az alap 2009. 11. 18-án indult.  
 \* A referencia index nettó hozama

## AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN (EGY JEGYRE JUTÓ ESZKÖZÉRTÉK)



Az alapok múltbeli teljesítménye nem nyújt garanciát a jövőbeli hozamok nagyságára. 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.