

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.
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: 11 126 552 811
1 jegyre jutó nettó eszközérték: 1.791273
B sorozat nettó eszközértéke PLN-ben: 9 222 111,88
1 jegyre jutó nettó eszközérték: 1,656895

FORGALMAZÓK

	A SOROZAT	B SOROZAT
AEGON Magyarország Befektetési Jegy Forgalmazó Zrt.	✓	✓
BNP Paribas Magyarországi Fióktelepe	✓	
CIB Bank Zrt.	✓	
Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe	✓	
Codex Értéktár és Értékpapír Zrt.	✓	
Commerzbank Zrt.	✓	
Concorde Értékpapír Zrt.	✓	
Equilor Befektetési Zrt.	✓	
ERSTE Befektetési Zrt.	✓	
OTP Bank Nyrt.	✓	
Raiffeisen Bank Zrt.	✓	
Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.	✓	
UniCredit Bank Hungary Zrt.	✓	

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

Az AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap gyakorlatilag „mindenbe” fektethet, az Alapkezelő véleményének megfelelően. Elsősorban részvények, részvényindexek, és devizapozíciók lesznek jellemzők, 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 időszakai szórása alapján



AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE

2010. 11. 30.

Magyar kincstárjegyek	46,76%
Magyar államkötvények	32,85%
Magyar részvények	0,00%
Külföldi részvények	4,30%
Egyéb eszközök	9,56%
Állampapír repo ügyletek	1,18%
Számlapénz	6,18%
Betét	0,00%
Követelés	0,14%
Kötelezettség	0,98%
Összesen	100,00%
Nettó korrekciós tőkeáttétel	43,19%
Származtatott ügyletek	28,19%

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az Alap kisebb veszteséget szenvedett el az elmúlt hónapban. November elején EURJPY long pozíciót nyitottunk 7M EUR értékben az euró jennel szembeni erősödésére fogadva 113,52-ről. Az euró övezettel kapcsolatos aggodalmak felerősödésével az árfolyam kedvezőtlen irányba mozdult el, így a kisbefektetőket védő szigorú stop loss politikánk értelmében a pozíciót kis veszteséggel fokozatosan leépítettük. A földgáz vételi fogadásunkat szintén minimális veszteséggel kizártuk, amint a kurzus csökkenni kezdett. A BUX határidős shortjainkat 22105-ön zártuk, több mint ezer pont kontraktusonkénti nyereséggel. A határidős búza vételeket tartjuk, ám mivel hamarosan kifutnak átkötésre kerültek 2011. decemberre. A részvénypiacok elbizonytalanodása miatt eladtuk Morgan Stanley China A, Tracker Fund of Hong Kong, RIMM kitétségünket, a defenzív gyógyszerpapírt a Pfizer részvényt megtartottuk. A kötvényportfoliónk stabil tudott maradni a hozamemelkedés ellenére is, az általunk tartott relatív rövid (1 év körüli) átlagos hátralévő futamidő miatt. A legnagyobb súlyú hitelpapírjaink jelenleg 2014C, MNB101208, D110126. Spekulatív befektetések szempontjából a kukorica és búza vétel meghatározó. A portfólió árfolyamkockázatát 277-es EURHUF és 204-es USDHUF szintekről fedezzük.

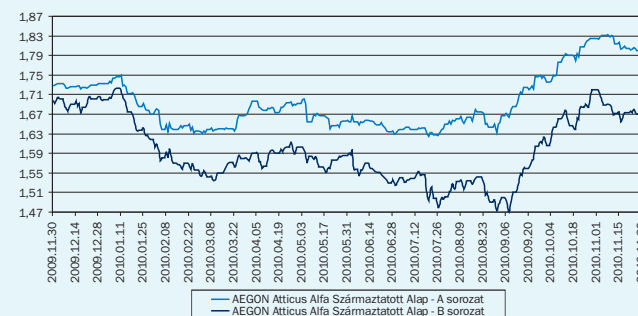
AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	12 hónap*	2009 év	2008 év	2007 év	Indulástól
Hozam ^a HUF	3,71%	16,55%	18,82%	12,86%	-
Hozam ^b PLN	-	-	-	-	-3,91%
Referencia hozam*	3,37%	8,73%	6,70%	5,92%	2,72%

^a Az alap 2010. 11. 30-ig elért teljesítményt mutatja; az alap 2006. 02. 13-án indult.
^b Az alap 2010. 11. 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.