

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 Förgalmazó Zrt.**Förgalmazók:** 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.**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:** 11 492 974 777**1 jegyre jutó nettó eszközérték:** 1,733247**B sorozat nettó eszközértéke PLN-ben:** 1 082,47**1 jegyre jutó nettó eszközérték:** 1,699318

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 árupiacokon is befektethet az Alap, amely sokkal kockázatosabb, mint a MoneyMaxx, ugyanis származtatott, határidős ügyletek révén kétszeres tőkeáttételeit is felvehet. Ez azt jelenti, hogy az Alap pozícióinak értéke duplája lehet az alap saját tőkéjének. Azaz, ha az alap által tartott eszközök 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 minden vételi, minden 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 AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap a 2009-es év utolsó hónapjában 0,25%-os nominális hozamot ért el. Az Alap 12 havi visszatekintő teljesítménye 16,55 %, míg a nettó benchmark 8,73 %-ot ért csak el, így az Alap a 2009-es évben 7,82%-kal felülteljesítette a nettó viszonyhozam indexét. Az indulástól számított éves átlagos hozam 15,22%, amely az Alap közepes kockázati szintje mellett felettesebb stabil és kimagaslé eredmény. E teljesítmény láttnán leginkább az juthat az eszünkbe, hogy miért nem fektettünk már korábban, vagy többet az AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alapba?! Igen örvendetes tény továbbá, hogy egyszerűt a fentiekben bemutatott teljesítmény, másrészt a folyamatosan növekvő jegyzések hatására az Alap nettó eszközértéke a 2008. 12. 31-én 5 198 220 062 forinthonál 6 294 754 715 forinttal (121,09%-kal), 11,492 974 777 forintra nőtt 2009. 12. 31-re. Decemberben az Alapkezelő törekedett az év során elérte kimagaslé hozamszint megtartására, amely sikerült is, hiszen az Alap 0,35%-kal tovább emelkedett, míg a MAX Index a piacon bekövetkezett hozamemelkedések hatására -1,28%-kal csökkent. Mindez nem jelentette azt, hogy az év utolsó hónapjában nem vettünk fel új pozíciókat,

Az alap eszközösszetétele, 2009. 12. 31.

Diszkont kincstárjegyek	80,80%
Magyar állampapírok	11,32%
Magyar részvények	0,00%
Betét	0,90%
Külföldi részvények	0,00%
Állampapír repo	1,44%
Számlapénz	4,78%
Egyéb eszközök	0,77%
Összesen	100,00%
Nettó korrekciós tőkeáttétel	55,08%
Származtatott ügyletek	42,13%

pusztán a befektetési politika vált óvatosabbá, de az aktív kereskedés mit sem változott. Továbbra is tartjuk a novemberben nyitott 4,3595-os kötésárú EUR/RON short pozíciót, melyen azóta tetemes mennyiséggű hozam keletkezett, mivel a román lej nagymértékben erősödött az euróval szemben. A soft commodities piacra nyitott búa és kukorica pozíciók december végéig nem mutattak markáns elmozdulást, azonban január elejére ezek a pozíciók is termőre fordultak, valamint tovább növeltük súlyukat az alap portfoliójában. Ennek megfelelően 160 kontraktus búa, 210 kontraktus kukorica long pozíciójával rendelkezünk az újév januárjának első egyharmadában. Az év utolsó napján egy jelentősebb, 500 kontraktust számláló long pozíciót vettünk fel az indiai részvény futures piacra. (Nifty futures). December hónapban felépítettünk egy közepes méretű EUR/JPY long pozíciót is, amelyet 2010. januárjában tovább növeltünk, így összesen 15 millió eurónyi EUR/JPY long-gal rendelkezik az Alap. Hogy ne legyen unalmas az élet az óév utolsó hónapjában sem, EURHUF short pozíciókat is nyitottunk 280,06-os és 279,56-os szintekről, melyeken szintén számottevő hozam keletkezett a forint euróval szembeni markáns erősödését követően.

Az alap által elérte nettó hozam:

Időtáv	1 hónap	12 hónap*	2009 év	2008 év	2007 év	Indulástól
Hozam ^a HUF	-	16,55%	16,55%	18,82%	12,86%	-
Hozam ^b PLN	0,09%	-	-	-	-	-1,58%
Referencia	0,38%	8,73%	8,73%	6,70%	5,92%	0,63%
hozam*						

^a Az alap 2009. 12. 31-ig elérte teljesítményt mutatja;
az alap 2006. 02. 13-án indul.

^b Az alap 2009. 12. 31-ig elérte teljesítményt mutatja;
az alap 2009. 11. 18-án indul.

* 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.