

Aegon Béta Aktív Vegyes Befektetési Alap intézményi sorozat

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
Benchmark összetétele:	100% RMAX Index
ISIN kód:	HU0000714928
Indulás:	2015.07.09
Devizanem:	HUF
Ateljes alap nettó eszközértéke:	1 029 832 709 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	963 534 561 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,003339 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

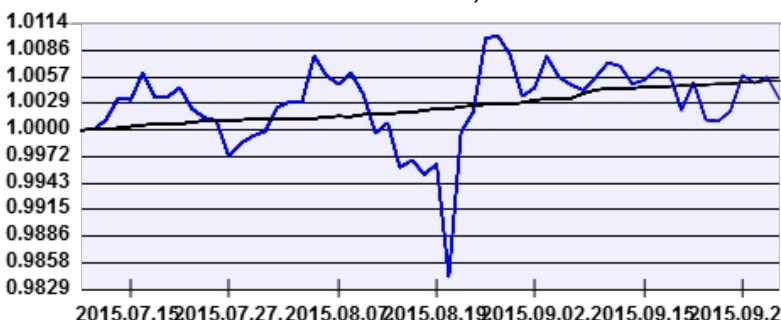
Az Alap célja, hogy az általa felvett pozíciók segítségével, megfelelő kockázati limitek mellett az árfolyamok változásából tőkenövekedésre tegyen szert. Ennek érdekében az Alap alulértékelt, főként részvény és kötvény típusú eszközök vételéből és túlértékelt eszközök eladásából kíván adott kockázati szint mellett minél magasabb hozamot elérni. Az Alap különböző eszközökben levő közép és hosszú távú trendek kombinációját használva részvényeket, kötvényeket és egyéb értékpapírokat vásárolhat, vagy kölcsönvétel után adhat el rövidre, tőzsdéi vagy tőzsdén kívüli határidős ügyletek segítségével vehet fel vételi, illetve eladási pozíciókat, valamint opciós ügyleteket köthet. Az Alap befektetéseinek célja szerint három nagy csoportra oszlanak: Az Alap első csoportba tartozó befektetése hosszú távú, fundamentálisan alulértékelt részvények vételi, és túlértékelté vált részvények eladási pozícióiból állnak. A részvénykiválasztás módja megegyezik az Aegon részvényalapoknál alkalmazott módszerekkel, és többnyire a régiós piacokra fókuszál, ugyanakkor az Alap más fejlett és fejlődő piaci befektetéseket is tarthat. Az Alap második csoportba tartozó befektetése az Alapkezelő globális top-down részvénystratégiáját kívánják megvalósítani, többnyire részvényindexekre szóló futures pozíciók vételével és eladásával. Ez olyan régiók vételét, illetve eladását jelenti, melyek az úgynevezett "kvadrant" modell eredményeként valamilyen, nullától eltérő scoringot érnek el. Az Alap harmadik csoportba tartozó befektetése az Alap kötvényportfólióját fedik le, amelynek célja az RMAX Index hozamát elérő vagy azt meghaladó hozam elérése. Az első és második csoportba tartozó eszközök kitétségeinek célsúlya 45%.

FORGALMAZÓK

Raiffeisen Bank Zrt.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.07.09 - 2015.09.30



----- Aegon Béta Aktív Vegyes Befektetési Alap intézményi sorozat

----- 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.

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

A szeptember eleji relatív magas kockázati kitétséget a hónap második felére ismét visszavágtuk. Továbbra is főként egyedi részvényekben láttunk fantáziát, amit részben fejlődő piaci, részben pedig az amerikai piacot követő határidős eladásokkal fedeztünk. Az alap a 25% és 45% között mozgó részvény súly mellett, a piacok gyenge teljesítménye ellenére az tőke megőrzése volt a cél. Az alap neve a következő hónaptól Aegon Maraton Aktív Vegyes Befektetési Alapra módosul.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	32,98 %
Nemzetközi részvények	20,14 %
Magyar részvények	15,72 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	10,91 %
Kollektív értékpapírok	2,41 %
Számlapénz	24,73 %
Kötelezettség	-6,66 %
Követelés	0,01 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,12 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	28,24 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	107,40 %

A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D151021 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D151125 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 MOL 2015/10/05 3,875% (MOL Nyrt.)
 Richter Nyrt. Részv. Demat

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

Nincs ilyen eszköz a portfólióban

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,33 %	0,53 %
1 hónap	-0,47 %	0,24 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,20 %

Abenchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,08 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:

3 hó 6 hó 1 év 2 év 3 év 4 év 5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas