

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:	10 745 205 898 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	10 745 205 898 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	2,257826 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 értékpapírokba. A változó kamatozású, forintban denominált, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok esetében a hátralévő átlagos futamidő a legközelebbi kamatfizetési napig hátralévő napok számával egyezik meg. Az Alap pénzeszközeit 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 Tőzsdeügynökség 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	6,36 %	6,91 %
1 hónap	-0,04 %	-0,02 %
3 hónap	0,22 %	0,19 %
6 hónap	0,67 %	0,62 %
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 időszaki szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

A szeptemberi nagymértékű hozamesés után októberben éles fordulat vette kezdetét a rövid kötvényhozamok mozgásában. A hónap végéig a rövid hozamok átlagosan 30-40 bázisponttal kerültek feljebb, ami annak köszönhető, hogy az MNB szeptemberi eszköztár-változásait követően kezdetét vette a piaci alkalmazkodás, így a korábbi élénk banki kereslet csökkent. Az ÁKK által jelentősen visszavágott DKJ-kibocsátás ellenére az aukciós lefedettségek is szerényen alakultak a korábbi hónapokhoz viszonyítva. A három hónapos és egyéves hozamok október végére egyaránt 74 bázisponttal emelkedtek. A rövid hozamok emelkedése mellett a határidős devizaárfolyamokból visszaszámított kamatok is jelentősen nőttek.

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

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.10.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	84,79 %
Államkötvények	19,32 %
Kötelezettség	-4,67 %
Állampapír repo ügyletek	0,41 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,10 %
Számlapénz	0,04 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	19,22 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

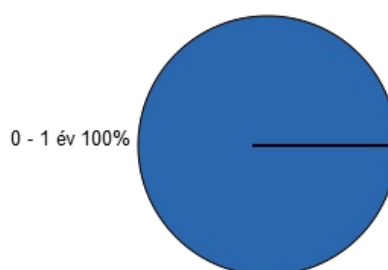
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

PEMÁK 2015/12/21 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160217 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151223 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151125 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151216 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

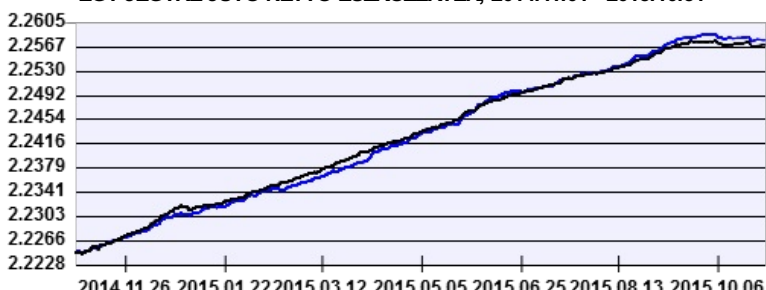
PEMÁK 2015/12/21 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160217 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2014.11.01 - 2015.10.31



— 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: 0,16 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,14 %