

The logo features the word "AEGON" in a bold, black, sans-serif font. The letter "A" is partially enclosed by a blue square graphic element.

Transform tomorrow

AEGON ALFA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

2016. FÉLÉVI JELENTÉSE

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az AEGON Belföldi Kötvény Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény (a továbbiakban: Kbfvtv.) 131. § és 132. § alapján készítette az Alap 2016. félévi működésének bemutatása céljából.

Az Alap általános működésével kapcsolatos további adatokat az Alap befektetési jegyeinek nyilvános forgalomba hozatalához készült MNB által jóváhagyott tájékoztató tartalmazza, mely megtalálható az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelőnél, az Alap befektetési jegyeinek forgalmazási helyein, valamint az Alapkezelő honlapján (www.aegonalapkezelo.hu).

Budapest, 2016.08.25

Kocsis Bálint
vezérigazgató

Kadocsa Péter
elnök-vezérigazgató

Jelen dokumentum sajátkezű aláírás képet biztonsági okból nem tartalmaz. Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással és egyéb felelős személy aláírásával ellátott papír alapú dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL

Az Alap elnevezése

Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap

Az Alap rövid neve

Aegon Alfa Alap

Az Alap lajstromszáma

1111-171

Az Alap fajtája

nyíltvégű

Az Alap típusa

nyilvános

A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa

Sorozat	Deviza	ISIN kód	Sorozat	Deviza	ISIN kód
A	HUF	HU0000703970	C	CZK	HU0000716006
B	EUR	HU0000708318	E	EUR	HU0000715982
R	HUF	HU0000712286	U	USD	HU0000715990
I	HUF	HU0000715974			

Hozamfizetés

Az Alapok a tőkenövekmény terhére hozamot nem fizetnek, a teljes tőkenövekmény újra befektetésre kerül az Alapok befektetési politikájának megfelelően. A Befektetők a tőkenövekményt a tulajdonukban álló Befektetési jegyek vételi és visszavásárlási árának különbözeteként, mint árfolyamnyereséget realizálhatják.

A Befektetők köre

A Befektetési jegyeket egyaránt megvásárolhatják devizabelföldi es devizakülföldi természetes személyek, jogi személyek es jogi személyiség nélküli gazdasági társaságok.

Alapkezelő adatai AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
1091 Budapest, Üllői út 1.
Telefon: (06-1) 476-20-59

Letétkezelő adatai Unicredit Bank Hungary Zrt.
1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.

A megbízott könyvvizsgáló társaság adatai: PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft.
1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.
Cégjegyzékszám: 01 09 063022
Nyilvántartásba vételi szám: 002950

A könyvvizsgáló munkatársának adatai: Tímár Pál
Kamarai tagsági szám: 002527

I. Vagyonkimutatás

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak összetétele a tárgyidőszak elején és végén, valamint az adott eszköz összes eszközön belüli aránya:

Megnevezés	2015. 12. 30.		2016. 06. 30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEE százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEE százalékában (%)
Banki egyenlegek	8 393 887 228	11,55	7 816 388 402	10,36
Repo				
Átruházható értékpapírok	64 916 075 962	89,31	69 257 507 566	91,83
Származékos ügyletek	-2 255 231	0,00	-305 921 695	-0,41
Egyéb eszközök	184 892 626	0,25	13 134 703 605	17,42
Összes eszköz	73 492 600 586	101,11	89 902 677 878	119,21
Kötelezettségek	-808 334 766	-1,11	-14 485 546 052	-19,21
Nettó eszközérték	72 684 256 781	100,00	75 417 126 306	100,00

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy					2015. 12. 30.	2016. 06. 30.
alap	sorozat	deviza	ISIN			
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	22 233 293 629	22 668 324 439	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	71 977 289	72 170 875	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	3 986 838 179	2 200 326 909	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974		2 280 463 443	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006		300 000	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982		1 376 812	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990		672 641	

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy					2015. 12. 30.	2016. 06. 30.
alap	sorozat	deviza	ISIN			
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	2.506657	2.551131	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	2.288548	2.324665	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	1.204717	1.229797	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974		0.998077	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006		0.981379	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982		0.982537	
Aegon Alfa Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990		0.985172	

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

IV. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	2015.12.30.		2016.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Biztosítók és Nyugdíjpénztárak	189 751 495	0,29	182 460 860	0,26
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	5 450 935 129	8,40	4 325 209 972	6,25
Részvény - GMU	831 813 950	1,28	1 831 355 016	2,64
Részvény - Egyéb külföld	8 935 365 795	13,76	11 082 868 504	16,00
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	15 407 866 369	23,74	17 421 894 352	25,16
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	660 176 664	1,02	603 765 499	0,87
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 216 116 572	1,87	1 167 878 254	1,69
Egyéb átruházható értékpapírok	1 876 293 237	2,89	1 771 643 754	2,56
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	23 390 097 028	36,03	31 333 271 802	45,24
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	10 398 506 493	16,02	9 501 742 344	13,72
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	3 728 440 238	5,74		
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	6 012 071 992	9,26	5 105 051 020	7,37
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények	4 102 800 606	6,32	4 123 904 294	5,95
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	47 631 916 356	73,37	50 063 969 460	72,29
Értékpapírok összesen	64 916 075 962	100,00	69 257 507 566	100,00

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült

Budapest, 2016.08.25.