

Aegon Pénzpiaci Befektetési Alap intézményi sorozat

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:	HU0000718135
Indulás:	2016.12.01
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	7 671 796 791 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	129 222 668 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,002302 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 kormánya, regionális vagy helyi önkormányzata, jegybankja, illetőleg az Európai Unió, az Európai Központi Bank vagy az Európai Beruházási Bank által kibocsátott vagy garantált hitelviszonyt megtestesítő értékpapírba. A változó kamatozású, forintban denominált, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok esetében a hátralévő átlagos futamidő a legközelebbi kamatfizetési napig hátralévő napok számával egyezik meg. Az Alap pénzeszközait 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

A SOROZAT ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,17 %	0,12 %
1 hónap	-0,02 %	0,00 %
3 hónap	-0,03 %	-0,01 %
6 hónap	-0,02 %	0,01 %
2017	0,18 %	0,11 %

A SOROZAT TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.04.01 - 2018.03.31



— Aegon Pénzpiaci 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 listával 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:

Az MNB-nél elhelyezett 3 hónapos betétek állománya december óta a korábban megcélzott 75 milliárdos mennyiségi korlátot áll, így az irányadó eszközökből az idei évben már nem áramlott többletlikviditás a piacra. Az MNB márciusban egy darab 1 hónapos és négy darab 12 hónapos devizalikviditás-nyújtó FX-swap tendert hirdetett meg, így az éven belüli hozamokra helyeződő nyomás nem változott.

A Monetáris Tanács március 27-i kamatdöntő ülésén változatlanul hagyta a kamatkondíciókat, az ülést követően közleményében pedig ismét megerősítette a tartósan laza monetáris kondíciók huzamosabb ideig való fenntartása melletti elkötelezettségét.

A februári diszkontkincstárjegy aukciókon enyhe hozamemelkedést figyelhattunk meg, a 3 hós aukciók 0-4 bázispont közötti, a 12 hónapos aukciók 3 és 5 bázispontos átlaghozamokkal zárultak.

A 3 hónapos referenciahozam értéke márciusban -2-ről 0 bázispontra nőtt, míg a 12 hónapos referenciahozam -2-ről 3 bázispontra nőtt.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.03.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	59,29 %
Államkötvények	13,03 %
Vállalati és hitelintézetek kötvények	9,95 %
Számlapénz	30,64 %
Kötelezettség	-13,02 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,06 %
Követelés	0,06 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	20,34 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

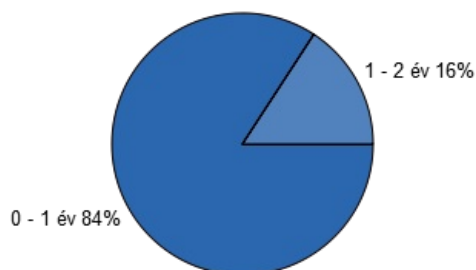
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2019B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D180704 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D181227 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 MFB 2018/04/16 1,875% (Magyar Fejlesztési Bank Zrt.)
 D180718 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2019B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D180704 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D181227 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,18 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,04 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:

