

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 MONEymaxx EXPRESSZ ABSZOLÚT HOZAMÚ BEFEKTETÉSI ALAP

2015. ÉVES JELENTÉSE



Független könyvvizsgálói jelentés

Az AEGON Magyarországi Befektetési Alapkezelő Zrt. részére

Elvégeztük az AEGON MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap (továbbiakban „az Alap”) mellékelt 2015. évi éves jelentés I., V. és XII. pontjában található számviteli információinak (továbbiakban: „számviteli információk”) a könyvvizsgálatát, amely számviteli információk a számviteli törvény előírásainak megfelelően kerültek meghatározásra.

A vezetés felelőssége az éves jelentésért

Az AEGON Magyarországi Befektetési Alapkezelő Zrt. ügyvezetése (továbbiakban „vezetés”) felelős az éves jelentésnek a *kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról* szóló 2014. évi XVI. törvénnyel, az abban szereplő számviteli információknak a magyar számviteli törvényben foglaltakkal összhangban történő elkészítéséért, különös tekintettel az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által megadott értékelése alapján történő elszámolásáért, valamint az olyan belső kontrollokért, amelyeket a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állításoktól mentes éves jelentés elkészítése.

A könyvvizsgáló felelőssége

A mi felelősségünk az éves jelentés számviteli információinak, különös tekintettel az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárának, valamint az adott időszakban elszámolt kezelési költségeknek a véleményezése az elvégzett könyvvizsgálatunk alapján. A könyvvizsgálatot a magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon érvényes – törvények és egyéb jogszabályok alapján hajtottuk végre. A fentiek megkövetelik, hogy megfeleljünk az etikai követelményeknek, valamint hogy a könyvvizsgálatot úgy tervezzük meg és hajtsuk végre, hogy kellő bizonyosságot szerezzünk arról, hogy az éves jelentésben szereplő számviteli információk mentesek-e a lényeges hibás állításoktól.

A könyvvizsgálat magában foglalja olyan eljárások végrehajtását, amelyek célja könyvvizsgálati bizonyítékokat szerezni az éves jelentés számviteli információiban szereplő összegekről és közzétételekről. A kiválasztott eljárások – beleértve az éves jelentésben szereplő számviteli információk akár csalásból, akár hibából eredő, lényeges hibás állításai kockázatának felmérését is – a könyvvizsgáló megítélésétől függenek. A kockázatok ilyen felmérésekor a könyvvizsgáló az éves jelentésben szereplő számviteli információk ügyvezetés általi elkészítése és valós bemutatása szempontjából releváns belső ellenőrzést azért mérlegeli, hogy olyan könyvvizsgálati eljárásokat tervezzen meg, amelyek az adott körülmények között megfelelőek, de nem azért, hogy a társaság belső ellenőrzésének hatékonyságára vonatkozóan véleményt mondjon. A könyvvizsgálat magában foglalja továbbá az alkalmazott számviteli politikák megfelelőségének és az ügyvezetés által készített számviteli becslések ésszerűségének értékelését.

Meggyőződésünk, hogy a megszerzett könyvvizsgálati bizonyíték elegendő és megfelelő alapot nyújt könyvvizsgálói véleményünk megadásához.

PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft., 1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.
T: (+36) 1 461 9100, F: (+36) 1 461 9101, www.pwc.hu



Vélemény

Véleményünk szerint az AEGON MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap 2015. december 31-ével végződő évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a magyar számviteli törvényben foglaltakkal, valamint a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek összeállításra. Az éves jelentésben szereplő eszközök és kötelezettségek leltárral alátámasztottak. Az éves jelentésben bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

Egyéb kérdések

Könyvvizsgálatunk kizárólag a fent felsorolt számviteli adatokra vonatkozott.

Budapest, 2016. április 29.

Balázs Árpád
Üzletárs
PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft.
1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.
Nyilvántartásba vételi sz.: 001464

Szabados Szilvia
Kamarai tag könyvvizsgáló
Kamarai tagsági sz.: 005314

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az AEGON Moneymaxx Expressz Abszolút Hozamú 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: Kbtv.) 131. § és 132. § alapján készítette az Alap 2015. évi 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.aegonalapkezelelo.hu).

Budapest, 2016.04.29.

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 Moneymaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap

Az Alap rövid neve

Aegon MoneyMaxx Alap

Az Alap lajstromszáma

1111-129

Az Alap fajtája

nyíltvégű

Az Alap típusa

nyilvános

A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa

Sorozat	Deviza	ISIN kód
A	HUF	HU0000703145
P	PLN	HU0000712385
R	HUF	HU0000712278

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: 001464

A könyvvizsgáló munkatársának adatai: Szabados Szilvia
Kamarai tagsági szám: 005314

I. Vagyonkimutatás

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

Megnevezés	2014.12.31.		2015.12.31.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	2 390 957 277	6,09	1 903 731 786	4,61
Repo				
Átruházható értékpapírok	38 436 854 365	97,96	39 438 252 025	95,50
Származékos ügyletek	-784 442 923	-2,00	158 826 480	0,38
Egyéb eszközök	202 316 506	0,52	67 167 192	0,16
Összes eszköz	40 245 685 226	102,57	41 567 977 482	100,66
Kötelezettségek	-1 008 518 031	-2,57	-272 728 744	-0,66
Nettó eszközérték	39 237 170 599	100,00	41 295 252 208	100,00

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

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy				2014.12.31.	2015.12.31.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703145	11 979 379 523	12 295 839 854
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712278	6 771 854 252	7 288 976 920
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712385	19 083 075	13 946 989

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

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy				2014.12.31.	2015.12.31.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703145	2.525519	2.591833
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712278	1.100873	1.136606
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712385	1.083846	1.114439

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

IV. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	2014. 12. 31.		2015. 12. 31.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	616 889 350	1,60	1 086 408 710	2,75
Belföldi nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei		0,00		0,00
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	616 889 350	1,60	1 086 408 710	2,75
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	288 661 922	0,75	361 082 879	0,92
GMU nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	968 877 610	2,52	880 052 044	2,23
Egyéb átruházható értékpapírok	1 257 539 532	3,27	1 241 134 923	3,15
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	18 071 515 081	47,02	16 613 339 809	42,12
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	5 933 182 551	15,44	8 337 513 125	21,14
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	2 223 048 230	5,78	1 802 962 783	4,57
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	3 192 613 888	8,31	2 925 242 932	7,42
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	1 313 601 658	3,42	1 946 559 363	4,94
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények	1 379 298 050	3,59	2 241 402 911	5,68
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok	175 708 463	0,46		
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	4 273 457 562	11,12	3 243 687 469	8,22
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	36 562 425 483	95,12	37 110 708 392	94,10
Értékpapírok összesen	38 436 854 365	100,00	39 438 252 025	100,00

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

V. Befektetési alap eszközeinek alakulása

Befektetésből származó jövedelem:

adatok eFt-ban

Pénzügyi műveletek bevételei	2015.
Pénzintézettől kapott kamatok	10 506
Diszkont papírok ár- és árfolyamnyeresége	43 623
Kamatkozó kötvények ár- és árfolyamnyeresége	1 346 110
Részvények befektetési jegyek ár- és árfolyamnyeresége	264 456
Kötvények árában felhalmozott kamat	103 585
Kötvények kapott kamata	1 489 775
Óvadéki repós kamatok	901
Részvények osztaléka	53 663
Határidős ügyletek nyeresége	1 974 621
Összesen:	5 287 240

Az Alap 2015. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

adatok eFt-ban	
Pénzügyi műveletek ráfordítása	2015.
Kamatkozó kötvények árfolyamvesztesége	112 765
Diszkont papírok árfolyamvesztesége	14
Részvények befektetési jegyek árfolyamvesztesége	119 127
Deviza árf. változással kapcsolatos veszteség	51 287
Fizetendő opciós díj	19 948
Határidős ügyletek vesztesége	3 631 931
Összesen:	3 935 072

Az Alap 2015. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alap 2015-ben **Egyéb bevételként 551 eFt** büntető jutalékot kapott, **Egyéb ráfordításként** a befektetési alapok különadója merült fel **20 349 eFt** értékben.

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

adatok eFt-ban	
Működési költségek	2015.
Alapkezelői díj	364 348
Vezető forgalmazói díjak	21 081
Letétkezelői díj	19 436
Könyvvizsgálói díj	3 787
Keler díj	1 592
Felügyeleti díj	10 264
Megbízási díj	3 845
Bankköltség	375
Sikerdíj	122 791
Tranzakciós díjak	557
Forgalmazói díjak (trailer fee)	299 057
Összesen:	847 133

Az Alap 2015. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

adatok eFt-ban		
Tőkenövekmény:	2014.	2015.
Visszavásárolt befjegyek értékkülönbötéből	12 154 773	12 656 309
Visszavásárolt befjegyek értékkülönbötéből "R" sorozat	422 508	483 471
Visszavásárolt befjegyek értékkülönbötéből "P" sorozat	32 958	-9 337
Értékpapírok értékelési különbötéből	2 137 513	2 580 279
Előző évek eredményből	4 022 244	4 401 888
Üzleti év eredményéből	379 644	485 237
Összesen:	19 149 640	20 597 847

Az Alap 2015. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Az értékelési különbözet tartaléka tartalmazza az értékpapírok és származékos ügyletek év végi beértékelésének különbözetét. Az értékpapírok beértékelési különbözete a MoneyMaxx alap esetében eltérő értéket mutat, mint ami a nettó eszközértékelésben látható, mert amellet, hogy 2015. december 31-i árfolyamon mutatja a papírok beértékelését, a mérleg fordulónap és az éves jelentés összeállítása (2016.

április 30.) között ismertté vált, fordulónapra vonatkozó legfrissebb árfolyam-információkat is tartalmazza. Ezzel szemben a nettó eszközérték kalkuláció viszont az utolsó olyan kereskedési napra készült, melyre nettó eszközérték kalkulációt számítottak (2015. december 31.).

Az érintett papír a PRIMATUM FCP SIF-CROATIA (ISIN kódja: LU0506818581). Az instrumentum a Primatum által 2015. 09. 30-as fordulónapra kalkulált becslés értéken (15 315,19 EUR) szerepel a nettó eszközértékelésben, mivel ekkor még nem állt rendelkezésre a 2014. évre vonatkozó könyvvizsgálói értékelés. Könyveinkben végül a legfrissebb auditált jelentés szerint, és az óvatosság elvének szem előtt tartása végett, a Croatia subfund az auditált értéken (10 363,03 EUR) került beértékelésre. Az aktuális árfolyam-információk a rendelkezésre állásukat követően, 2016. 04. 11-én, a hivatalos nettó eszközértékben megjelennek.

Felosztott és újra befektetett jövedelem:

Az Alap a tőkenövekmény terhére hozamot nem fizet, a teljes tőkenövekmény újra befektetésre kerül az Alap befektetési politikájának megfelelően.

A hozam a befektetési jegy tulajdonosok részére csak a befektetési jegy visszaváltása esetén fizethető ki. Az újra befektetett jövedelem a Saját tőke részét képezi, mely részletesen a Tőkeszámla változásai című pontban kerül bemutatásra.

A befektetési alap a Kezelési szabályzatában meghatározottaknak megfelelően az olyan, devizakockázat fedezésére szolgáló ügyleteket, amelyeknek célja a befektetési alap adott sorozata devizakockázatának csökkentése, az egyes befektetési jegy sorozatok között megoszthatja. A megkötött határidős ügylet adott napi eredménye az előző napi eredménnyel korrigálva részt képez a fedezendő sorozat adott napi nettó eszközértékében.

VI. A nettó eszközértékének és az egy jegyre jutó nettó eszközértékének a változása

Alap neve Fund	Sorozat Serie	Deviza Currency	ISIN	Nettó eszközérték Net Asset Value	1 jegyre jutó eszközérték Unit price	Értéknep Value date
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703145	16 174 780 767	2,266328	2012.12.28.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703145	22 913 404 815	2,418335	2013.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703145	30 254 150 594	2,525519	2014.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703145	31 868 763 496	2,591833	2015.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712278	1 389 828 449	1,045233	2013.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712278	7 454 951 506	1,100873	2014.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712278	8 284 694 901	1,136606	2015.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712385	15 870 770	1,038263	2013.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712385	20 683 115	1,083846	2014.12.31.
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712385	15 543 068	1,114439	2015.12.31.

VII. Származtatott ügyletek

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	400 000	72,460	73,9513	596 520	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	956 000	72,300	73,9513	1 578 643	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 400 000	72,350	73,9513	2 241 820	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.05.19 Forward Vétel	2015.05.19.	6 127 000	72,300	73,9545	10 137 121	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.06.25 Forward Vétel	2015.06.25.	770 000	73,110	73,9784	668 668	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.17 Forward Eladás	2015.02.17.	147 000	245,870	275,1751	-4 307 850	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.17 Forward Eladás	2015.02.17.	288 000	306,920	311,3571	-1 277 885	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.10 Forward Eladás	2015.02.10.	500 000	307,000	311,1891	-2 094 550	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.10 Forward Eladás	2015.02.10.	1 600 000	250,190	275,0423	-39 763 680	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.10 Forward Eladás	2015.02.10.	1 000 000	305,890	311,1891	-5 299 100	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.09 Forward Eladás	2015.02.09.	1 482 000	270,060	275,0303	-7 365 985	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.17 Forward Eladás	2015.02.17.	3 000 000	318,380	311,3571	21 068 700	HUF	2015.01.30.
CHF/HUF 15.03.16 Forward Eladás	2015.03.16.	3 738 000	265,520	297,7652	-120 532 558	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.20 Forward Eladás	2015.02.20.	1 105 000	276,660	275,2193	1 591 974	HUF	2015.01.30.
GBP/HUF 15.02.20 Forward Eladás	2015.02.20.	778 000	420,310	414,9762	4 149 696	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.23 Forward Eladás	2015.02.23.	16 535 615	318,900	311,4662	122 922 455	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.23 Forward Eladás	2015.02.23.	3 445 000	274,250	275,2634	-3 491 163	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.23 Forward Eladás	2015.02.23.	636 000	318,900	311,4662	4 727 897	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.23 Forward Eladás	2015.02.23.	3 506 000	274,650	275,2634	-2 150 580	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.23 Forward Eladás	2015.02.23.	2 000 000	319,060	311,4662	15 187 600	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.23 Forward Eladás	2015.02.23.	508 000	318,810	311,4662	3 730 650	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 260 000	73,370	73,9513	732 438	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	522 000	315,680	311,5207	2 171 155	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	2 733 000	271,550	275,3076	-10 269 521	HUF	2015.01.30.
GBP/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	370 000	412,080	415,0865	-1 112 405	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	7 600 000	271,240	275,3076	-30 913 760	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	2 258 000	315,370	311,5207	8 691 719	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	1 250 000	315,570	311,5207	5 061 625	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	2 000 000	315,570	311,5207	8 098 600	HUF	2015.01.30.
GBP/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	1 615 000	411,880	415,0865	-5 178 498	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.02.26 Forward Eladás	2015.02.26.	10 943 000	271,640	275,3076	-40 134 547	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.03.27 Forward Vétel	2015.03.27.	1 830 000	73,450	73,9318	881 694	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.09 Forward Eladás	2015.02.09.	1 410 000	318,940	311,1746	10 949 214	HUF	2015.01.30.
JPY/HUF 15.02.09 Forward Eladás	2015.02.09.	201 005 000	2,252	2,3378	-17 206 028	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.02.17 Forward Eladás	2015.02.17.	445 000	319,110	311,3571	3 450 041	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.03.16 Forward Eladás	2015.03.16.	491 000	271,670	275,5726	-1 916 177	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.03.16 Forward Eladás	2015.03.16.	435 000	320,730	311,8478	3 863 757	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.03.27 Forward Vétel	2015.03.27.	7 480 000	73,475	73,9318	3 416 864	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.03.27 Forward Vétel	2015.03.27.	600 000	73,370	73,9318	337 080	HUF	2015.01.30.
CZK/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	19 869 000	11,205	11,2165	-228 493	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.03.31 Forward	2015.03.31.	1 500 000	312,060	312,1205	-90 750	HUF	2015.01.30.

Eladás							
USD/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	4 930 000	274,650	275,7935	-5 637 455	HUF	2015.01.30.
USD/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	842 000	274,630	275,7935	-979 667	HUF	2015.01.30.
EUR/HUF 15.03.03 Forward Eladás	2015.03.03.	2 790 000	310,710	311,6116	-2 515 464	HUF	2015.01.30.
Euro Stoxx 50 2015 Marc Vétel	2015.03.20.	15	3 355,000	3 349,0000	-279 927	HUF	2015.01.30.
Euro Stoxx 50 2015 Marc Vétel	2015.03.20.	20	3 371,850	3 349,0000	-1 421 407	HUF	2015.01.30.
Euro Stoxx 50 2015 Marc Vétel	2015.03.20.	60	2 998,900	3 349,0000	65 334 962	HUF	2015.01.30.
mini MSCI Emg Mkt Mar15 Eladás	2015.03.20.	20	892,720	951,5000	-16 159 210	HUF	2015.01.30.
Euro Stoxx 50 2015 Marc Vétel	2015.03.20.	15	3 104,000	3 349,0000	11 430 352	HUF	2015.01.30.
mini MSCI Emg Mkt Mar15 Vétel	2015.03.20.	20	944,825	951,5000	1 835 024	HUF	2015.01.30.
TOPIX Index Future MAR15 Vétel	2015.03.12.	25	1 357,500	1 414,5000	33 297 975	HUF	2015.01.30.
Összesen					-66 210 184	HUF	2015.01.30.
PLN/HUF 15.06.25 Forward Vétel	2015.06.25.	770 000	73,110	73,1028	-5 544	HUF	2015.02.27.
CHF/HUF 15.03.16 Forward Eladás	2015.03.16.	3 738 000	265,520	284,5190	-71 018 262	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.05.19 Forward Vétel	2015.05.19.	6 127 000	72,300	73,0738	4 741 073	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 400 000	72,350	73,0675	1 004 500	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	956 000	72,300	73,0675	733 730	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	400 000	72,460	73,0675	243 000	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.16 Forward Eladás	2015.03.16.	491 000	271,670	270,1856	728 840	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.03.27 Forward Vétel	2015.03.27.	7 480 000	73,475	73,0276	-3 346 552	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.16 Forward Eladás	2015.03.16.	435 000	320,730	303,2313	7 611 935	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.03.27 Forward Vétel	2015.03.27.	600 000	73,370	73,0276	-205 440	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	1 500 000	312,060	303,4972	12 844 200	HUF	2015.02.27.
CZK/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	19 869 000	11,205	11,0292	3 492 970	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.03.27 Forward Vétel	2015.03.27.	1 830 000	73,450	73,0276	-772 992	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 260 000	73,370	73,0675	-381 150	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.05.05 Forward Eladás	2015.05.05.	1 000 000	309,780	304,0998	5 680 200	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.04.07 Forward Eladás	2015.04.07.	2 477 000	309,750	303,6213	15 180 790	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	842 000	274,630	270,4023	3 559 723	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.31 Forward Eladás	2015.03.31.	4 930 000	274,650	270,4023	20 941 161	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.06 Forward Eladás	2015.03.06.	432 000	307,310	303,0505	1 840 104	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.09 Forward Eladás	2015.04.09.	1 482 000	268,970	270,5323	-2 315 329	HUF	2015.02.27.
JPY/HUF 15.04.09 Forward Eladás	2015.04.09.	201 005 000	2,288	2,2656	4 582 914	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.10 Forward Eladás	2015.03.10.	1 000 000	306,470	303,1194	3 350 600	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.10 Forward Eladás	2015.03.10.	1 600 000	267,700	270,1003	-3 840 480	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.10 Forward Eladás	2015.03.10.	500 000	306,490	303,1194	1 685 300	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.13 Forward Eladás	2015.04.13.	1 020 000	273,640	270,5901	3 110 898	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.05.13 Forward Vétel	2015.05.13.	910 000	73,610	73,0691	-492 219	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.04.17 Forward Eladás	2015.04.17.	1 888 000	306,790	303,7985	5 647 952	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.04.17 Forward Eladás	2015.04.17.	445 000	306,890	303,7985	1 375 717	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.17 Forward Eladás	2015.04.17.	147 000	268,220	270,6478	-356 887	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.20 Forward Eladás	2015.03.20.	1 105 000	270,380	270,2434	150 943	HUF	2015.02.27.
GBP/HUF 15.04.20 Forward Eladás	2015.04.20.	778 000	417,440	416,5265	710 703	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.20 Forward Eladás	2015.03.20.	65 000	269,680	270,2434	-36 621	HUF	2015.02.27.

EUR/HUF 15.04.23 Forward Eladás	2015.04.23.	2 508 000	305,960	303,9049	5 154 191	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.23 Forward Eladás	2015.03.23.	14 775 615	305,800	303,3554	36 120 468	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.03.23 Forward Eladás	2015.03.23.	636 000	306,200	303,3554	1 809 166	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	3 250 000	306,250	303,9758	7 391 150	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.03.23 Forward Eladás	2015.03.23.	3 506 000	268,880	270,2867	-4 931 890	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.23 Forward Eladás	2015.04.23.	3 445 000	268,880	270,7345	-6 388 753	HUF	2015.02.27.
GBP/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	1 615 000	416,430	416,6552	-363 698	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	10 858 000	270,170	270,7923	-6 756 933	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	2 733 000	269,970	270,7923	-2 247 346	HUF	2015.02.27.
GBP/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	370 000	416,890	416,6552	86 876	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	522 000	306,330	303,9758	1 228 892	HUF	2015.02.27.
USD/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	7 600 000	270,080	270,7923	-5 413 480	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	2 258 000	306,150	303,9758	4 909 344	HUF	2015.02.27.
EUR/HUF 15.05.04 Forward Eladás	2015.05.04.	2 790 000	303,710	304,0823	-1 038 717	HUF	2015.02.27.
WTI CRUDE FUTURE APR15 Vétel	2015.03.20.	29	54,140	49,7600	-34 287 779	HUF	2015.02.27.
Euro Stoxx 50 2015 Marc Vétel	2015.03.20.	40	3 518,500	3 590,0000	8 663 798	HUF	2015.02.27.
Euro Stoxx 50 2015 Marc Vétel	2015.03.20.	10	3 371,850	3 590,0000	6 608 418	HUF	2015.02.27.
mini MSCI Emg Mkt Mar15 Vétel	2015.03.20.	20	944,825	991,9000	12 707 425	HUF	2015.02.27.
mini MSCI Emg Mkt Mar15 Eladás	2015.03.20.	20	892,720	991,9000	-26 772 649	HUF	2015.02.27.
TOPIX Index Future MAR15 Vétel	2015.03.12.	25	1 357,500	1 525,5000	94 936 800	HUF	2015.02.27.
Összesen					46 005 048	HUF	2015.02.27.
PLN/HUF 15.06.25 Forward Vétel	2015.06.25.	770 000	73,110	73,1992	68 684	HUF	2015.03.31.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	400 000	72,460	73,1724	284 960	HUF	2015.03.31.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	956 000	72,300	73,1724	834 014	HUF	2015.03.31.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 400 000	72,350	73,1724	1 151 360	HUF	2015.03.31.
PLN/HUF 15.05.19 Forward Vétel	2015.05.19.	6 127 000	72,300	73,1787	5 383 795	HUF	2015.03.31.
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 260 000	73,370	73,1724	-248 976	HUF	2015.03.31.
EUR/HUF 15.04.16 Forward Eladás	2015.04.16.	435 000	306,300	299,3991	3 001 892	HUF	2015.03.31.
CHF/HUF 15.04.16 Forward Eladás	2015.04.16.	3 738 000	287,480	286,4738	3 761 176	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.05.20 Forward Eladás	2015.05.20.	1 105 000	286,680	279,6193	7 802 073	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.05.20 Forward Eladás	2015.05.20.	65 000	286,690	279,6193	459 595	HUF	2015.03.31.
EUR/HUF 15.05.04 Forward Eladás	2015.05.04.	2 790 000	303,710	299,6905	11 214 405	HUF	2015.03.31.
EUR/HUF 15.04.10 Forward Eladás	2015.04.10.	1 000 000	304,350	299,2348	5 115 200	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.04.10 Forward Eladás	2015.04.10.	1 600 000	277,320	279,0179	-2 716 640	HUF	2015.03.31.
PLN/HUF 15.06.11 Forward Vétel	2015.06.11.	760 000	74,200	73,1896	-767 904	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.04.16 Forward Eladás	2015.04.16.	491 000	285,700	279,1574	3 212 417	HUF	2015.03.31.
EUR/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	2 258 000	306,150	299,5772	14 841 382	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	7 600 000	270,080	279,3068	-70 123 680	HUF	2015.03.31.
EUR/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	522 000	306,330	299,5772	3 524 962	HUF	2015.03.31.
GBP/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	370 000	416,890	412,2405	1 720 315	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	2 733 000	269,970	279,3068	-25 517 474	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	10 858 000	270,170	279,3068	-99 207 374	HUF	2015.03.31.
GBP/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	1 615 000	416,430	412,2405	6 766 043	HUF	2015.03.31.
USD/HUF 15.04.23 Forward Eladás	2015.04.23.	3 445 000	268,880	279,2525	-35 733 263	HUF	2015.03.31.

Eladás								
EUR/HUF 15.04.27 Forward Eladás	2015.04.27.	3 250 000	306,250	299,5772	21 686 600	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.04.23 Forward Eladás	2015.04.23.	2 508 000	305,960	299,5124	16 170 581	HUF	2015.03.31.	
GBP/HUF 15.04.20 Forward Eladás	2015.04.20.	778 000	417,440	412,1263	4 134 059	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.04.17 Forward Eladás	2015.04.17.	147 000	268,220	279,1710	-1 609 797	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.04.17 Forward Eladás	2015.04.17.	445 000	306,890	299,4153	3 326 241	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.04.17 Forward Eladás	2015.04.17.	1 888 000	306,790	299,4153	13 923 434	HUF	2015.03.31.	
PLN/HUF 15.05.13 Forward Vétel	2015.05.13.	910 000	73,610	73,1740	-396 760	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.04.13 Forward Eladás	2015.04.13.	1 020 000	273,640	279,0413	-5 509 326	HUF	2015.03.31.	
JPY/HUF 15.04.09 Forward Eladás	2015.04.09.	201 005 000	2,288	2,3224	-6 834 170	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.04.09 Forward Eladás	2015.04.09.	1 482 000	268,970	279,0102	-14 879 576	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.04.07 Forward Eladás	2015.04.07.	2 477 000	309,750	299,2064	26 116 497	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.05.05 Forward Eladás	2015.05.05.	1 000 000	309,780	299,7067	10 073 300	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.05.26 Forward Eladás	2015.05.26.	3 506 000	285,400	279,7008	19 981 395	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.05.26 Forward Eladás	2015.05.26.	636 000	304,180	300,0468	2 628 715	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.05.26 Forward Eladás	2015.05.26.	14 475 615	303,670	300,0468	52 448 048	HUF	2015.03.31.	
TRY/HUF 15.04.24 Forward Eladás	2015.04.24.	3 659 000	108,320	105,9581	8 642 192	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.05.27 Forward Eladás	2015.05.27.	2 000 000	299,500	300,0629	-1 125 800	HUF	2015.03.31.	
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	1 830 000	72,980	73,2019	406 077	HUF	2015.03.31.	
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	600 000	72,940	73,2019	157 140	HUF	2015.03.31.	
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	4 137 000	72,950	73,2019	1 042 110	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.05.29 Forward Eladás	2015.05.29.	3 530 000	276,260	279,7415	-12 289 695	HUF	2015.03.31.	
CZK/HUF 15.05.29 Forward Eladás	2015.05.29.	19 869 000	10,930	10,9021	554 345	HUF	2015.03.31.	
EUR/HUF 15.05.29 Forward Eladás	2015.05.29.	1 500 000	300,720	300,0953	937 050	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.06.01 Forward Eladás	2015.06.01.	842 000	276,650	279,7175	-2 582 835	HUF	2015.03.31.	
Euro Stoxx Banks Index Future Jun15 Vétel	2015.03.20.	180	147,450	155,6000	21 941 919	HUF	2015.03.31.	
Euro Stoxx 50 2015 Jun Vétel	2015.03.20.	80	3 569,000	3 631,0000	14 837 344	HUF	2015.03.31.	
Euro Stoxx 50 2015 Jun Vétel	2015.06.19.	50	3 585,000	3 631,0000	6 880 220	HUF	2015.03.31.	
Összesen					-28 173 213	HUF	2015.03.31.	
USD/HUF 15.05.20 Forward Eladás	2015.05.20.	65 000	286,690	270,6132	1 044 992	HUF	2015.04.30.	
USD/HUF 15.05.20 Forward Eladás	2015.05.20.	1 105 000	286,680	270,6132	17 753 814	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.06.11 Forward Vétel	2015.06.11.	760 000	74,200	75,1736	739 936	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.05.13 Forward Vétel	2015.05.13.	910 000	73,610	75,1691	1 418 781	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 260 000	73,370	75,1662	2 263 212	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.05.19 Forward Vétel	2015.05.19.	6 127 000	72,300	75,1607	17 527 509	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	1 400 000	72,350	75,1662	3 942 680	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	956 000	72,300	75,1662	2 740 087	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.05.11 Forward Vétel	2015.05.11.	400 000	72,460	75,1662	1 082 480	HUF	2015.04.30.	
PLN/HUF 15.06.25 Forward Vétel	2015.06.25.	770 000	73,110	75,1815	1 595 055	HUF	2015.04.30.	
USD/HUF 15.06.01 Forward Eladás	2015.06.01.	842 000	276,650	270,7590	4 960 222	HUF	2015.04.30.	
EUR/HUF 15.07.08 Forward Eladás	2015.07.08.	2 477 000	299,650	304,0521	-10 904 002	HUF	2015.04.30.	
EUR/HUF 15.05.29 Forward Eladás	2015.05.29.	1 500 000	300,720	303,5132	-4 189 800	HUF	2015.04.30.	
CZK/HUF 15.05.29 Forward Eladás	2015.05.29.	19 869 000	10,930	11,0649	-2 680 328	HUF	2015.04.30.	
JPY/HUF 15.05.11 Forward Eladás	2015.05.11.	201 005 000	2,301	2,2756	5 145 728	HUF	2015.04.30.	

USD/HUF 15.06.09 Forward Eladás	2015.06.09.	1 482 000	276,140	270,8563	7 830 443	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.07.10 Forward Eladás	2015.07.10.	1 000 000	297,300	304,0808	-6 780 800	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.05.11 Forward Eladás	2015.05.11.	1 600 000	273,500	270,5410	4 734 400	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.06.15 Forward Eladás	2015.06.15.	1 020 000	276,290	270,9292	5 468 016	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.05.29 Forward Eladás	2015.05.29.	3 530 000	276,260	270,7226	19 547 022	HUF	2015.04.30.
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	4 137 000	72,950	75,1837	9 240 817	HUF	2015.04.30.
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	600 000	72,940	75,1837	1 346 220	HUF	2015.04.30.
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	1 830 000	72,980	75,1837	4 032 771	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.05.27 Forward Eladás	2015.05.27.	2 000 000	299,500	303,4820	-7 964 000	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.05.26 Forward Eladás	2015.05.26.	14 475 615	303,670	303,4663	2 948 683	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.05.26 Forward Eladás	2015.05.26.	636 000	304,180	303,4663	453 913	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.05.26 Forward Eladás	2015.05.26.	3 506 000	285,400	270,6861	51 586 933	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.06.17 Forward Eladás	2015.06.17.	1 000 000	296,950	303,8102	-6 860 200	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.06.17 Forward Eladás	2015.06.17.	445 000	298,050	303,8102	-2 563 289	HUF	2015.04.30.
USD/TRY 15.05.05 Forward Vétel	2015.05.05.	2 000 000	2,722	2,6645	-11 686 300	HUF	2015.04.30.
GBP/HUF 15.06.22 Forward Eladás	2015.06.22.	778 000	418,820	418,6244	152 177	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.06.23 Forward Eladás	2015.06.23.	1 208 000	298,560	303,9040	-6 455 552	HUF	2015.04.30.
TRY/HUF 15.05.08 Forward Eladás	2015.05.08.	3 659 000	103,260	101,4258	6 711 338	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	3 250 000	301,800	304,3252	-8 206 900	HUF	2015.04.30.
GBP/HUF 15.05.27 Forward Eladás	2015.05.27.	1 615 000	421,150	418,2349	4 707 886	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	10 858 000	280,420	271,3087	98 930 495	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.06.23 Forward Eladás	2015.06.23.	795 000	278,300	271,0264	5 782 512	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	2 258 000	302,300	304,3252	-4 572 902	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	7 600 000	280,400	271,3087	69 093 880	HUF	2015.04.30.
GBP/HUF 15.05.27 Forward Eladás	2015.05.27.	370 000	420,620	418,2349	882 487	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	522 000	302,030	303,9978	-1 027 192	HUF	2015.04.30.
USD/HUF 15.05.27 Forward Eladás	2015.05.27.	2 533 000	280,000	270,6983	23 561 206	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.07.31 Forward Eladás	2015.07.31.	940 000	302,110	304,3827	-2 136 338	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.08.04 Forward Eladás	2015.08.04.	2 790 000	302,830	304,4403	-4 492 737	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.06.05 Forward Eladás	2015.06.05.	2 000 000	302,830	303,6226	-1 585 200	HUF	2015.04.30.
EUR/HUF 15.06.05 Forward Eladás	2015.06.05.	1 000 000	302,830	303,6226	-792 600	HUF	2015.04.30.
TOPIX Index Future Jun15 Vétel	2015.06.11.	20	1 630,325	1 588,5000	-19 022 847	HUF	2015.04.30.
WIG20 Index Future JUN15 Vétel	2015.06.19.	100	2 408,100	2 500,0000	13 812 570	HUF	2015.04.30.
Euro Stoxx Banks Index Future Jun15 Vétel	2015.03.20.	180	147,450	152,8000	14 592 339	HUF	2015.04.30.
Összesen					294 327 557	HUF	2015.04.30.
PLN/HUF 15.06.11 Forward Vétel	2015.06.11.	760 000	74,200	74,9109	540 284	HUF	2015.05.29.
PLN/HUF 15.06.25 Forward Vétel	2015.06.25.	770 000	73,110	74,9351	1 405 327	HUF	2015.05.29.
USD/HUF 15.06.09 Forward Eladás	2015.06.09.	1 482 000	276,140	282,4043	-9 283 693	HUF	2015.05.29.
USD/HUF 15.06.15 Forward Eladás	2015.06.15.	1 020 000	276,290	282,5441	-6 379 182	HUF	2015.05.29.
EUR/HUF 15.07.10 Forward Eladás	2015.07.10.	1 000 000	297,300	310,0168	-12 716 800	HUF	2015.05.29.
EUR/HUF 15.07.08 Forward Eladás	2015.07.08.	2 477 000	299,650	309,9874	-25 605 740	HUF	2015.05.29.
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	1 830 000	72,980	74,9358	3 579 114	HUF	2015.05.29.
PLN/HUF 15.06.29 Forward Vétel	2015.06.29.	600 000	72,940	74,9358	1 197 480	HUF	2015.05.29.
PLN/HUF 15.06.29 Forward	2015.06.29.	3 063 000	72,950	74,9358	6 082 505	HUF	2015.05.29.

Vétel								
EUR/HUF 15.07.31 Forward Eladás	2015.07.31.	940 000	302,110	310,2424	-7 644 456	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.05 Forward Eladás	2015.06.05.	2 000 000	302,830	309,4522	-13 244 400	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.08.04 Forward Eladás	2015.08.04.	2 790 000	302,830	310,2958	-20 829 582	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	522 000	302,030	309,8552	-4 084 754	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	7 600 000	280,400	283,0235	-19 938 600	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	2 258 000	302,300	310,2665	-17 988 357	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.06.23 Forward Eladás	2015.06.23.	795 000	278,300	282,6355	-3 446 722	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	10 858 000	280,420	283,0235	-28 268 803	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	3 250 000	301,800	310,2665	-27 516 125	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.23 Forward Eladás	2015.06.23.	1 208 000	298,560	309,7671	-13 538 177	HUF	2015.05.29.	
GBP/HUF 15.06.22 Forward Eladás	2015.06.22.	778 000	418,820	431,7559	-10 064 130	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.17 Forward Eladás	2015.06.17.	445 000	298,050	309,6790	-5 174 905	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.17 Forward Eladás	2015.06.17.	1 000 000	296,950	309,6790	-12 729 000	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.05 Forward Eladás	2015.06.05.	1 000 000	302,830	309,4522	-6 622 200	HUF	2015.05.29.	
TRY/HUF 15.06.08 Forward Eladás	2015.06.08.	3 659 000	99,450	105,5833	-22 441 745	HUF	2015.05.29.	
JPY/HUF 15.06.12 Forward Eladás	2015.06.12.	201 005 000	2,255	2,2807	-5 165 829	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.07.13 Forward Vétel	2015.07.13.	400 000	74,830	74,9384	43 360	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.07.13 Forward Vétel	2015.07.13.	1 260 000	74,770	74,9384	212 184	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.06.12 Forward Eladás	2015.06.12.	1 600 000	270,790	282,4191	-18 606 560	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.07.13 Forward Vétel	2015.07.13.	2 356 000	74,570	74,9384	867 950	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.11.13 Forward Vétel	2015.11.13.	910 000	74,880	74,8918	10 738	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.08.19 Forward Vétel	2015.08.19.	6 127 000	75,710	74,9232	-4 820 724	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.07.20 Forward Eladás	2015.07.20.	1 105 000	269,680	282,9437	-14 656 388	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.07.20 Forward Eladás	2015.07.20.	65 000	269,820	282,9437	-853 040	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.06.22 Forward Eladás	2015.06.22.	8 000 000	75,740	74,9345	6 444 000	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.07.21 Forward Eladás	2015.07.21.	805 000	306,620	310,1783	-2 864 431	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.08.26 Forward Eladás	2015.08.26.	636 000	307,330	310,5900	-2 073 360	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.08.28 Forward Eladás	2015.08.28.	14 475 615	307,340	310,6168	-47 433 695	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	2 000 000	307,570	309,8552	-4 570 400	HUF	2015.05.29.	
PLN/HUF 15.06.22 Forward Eladás	2015.06.22.	4 000 000	74,890	74,9345	-178 000	HUF	2015.05.29.	
GBP/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	1 490 000	429,740	431,8509	-3 145 241	HUF	2015.05.29.	
GBP/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	370 000	429,960	432,2307	-840 159	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.08.26 Forward Eladás	2015.08.26.	3 506 000	275,500	283,2263	-27 088 408	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.07.27 Forward Eladás	2015.07.27.	2 533 000	275,220	283,0235	-19 766 265	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	2 000 000	307,270	309,8552	-5 170 400	HUF	2015.05.29.	
EUR/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	1 500 000	309,140	309,8552	-1 072 800	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.06.29 Forward Eladás	2015.06.29.	3 370 000	283,700	282,7039	3 356 857	HUF	2015.05.29.	
USD/HUF 15.08.03 Forward Eladás	2015.08.03.	842 000	281,890	282,9999	-934 536	HUF	2015.05.29.	
TOPIX Index Future Jun15 Vétel	2015.06.11.	20	1 630,325	1 671,0000	18 548 613	HUF	2015.05.29.	
WIG20 Index Future JUN15 Vétel	2015.06.19.	100	2 408,100	2 428,0000	2 982 214	HUF	2015.05.29.	
Euro Stoxx Banks Index Future Jun15 Vétel	2015.03.20.	180	147,450	153,8000	17 682 210	HUF	2015.05.29.	
Összesen					-403 017 808	HUF	2015.05.29.	
GBP/HUF 16.02.22 Forward Eladás	2016.02.22.	778 000	433,860	446,5302	-9 857 416	HUF	2015.06.30.	

USD/HUF	15.07.22	Forward	2015.07.22.	2 230 000	273,040	282,9769	-22 159 287	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.24	Forward	2015.07.24.	795 000	275,040	282,9976	-6 326 292	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.07.24	Forward	2015.07.24.	1 208 000	311,970	315,3720	-4 109 616	HUF	2015.06.30.
Eladás									
PLN/HUF	15.08.25	Forward	2015.08.25.	770 000	74,460	75,1130	502 810	HUF	2015.06.30.
Vétel									
EUR/HUF	15.07.29	Forward	2015.07.29.	522 000	312,360	315,4412	-1 608 386	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.11.30	Forward	2015.11.30.	4 000 000	313,140	316,8767	-14 946 800	HUF	2015.06.30.
Eladás									
GBP/HUF	15.09.29	Forward	2015.09.29.	1 490 000	439,080	445,4429	-9 480 721	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.08.31	Forward	2015.08.31.	2 270 000	278,670	283,2984	-10 506 468	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.09.29	Forward	2015.09.29.	1 500 000	312,490	316,1726	-5 523 900	HUF	2015.06.30.
Eladás									
PLN/HUF	15.07.31	Forward	2015.07.31.	600 000	74,870	75,1161	147 660	HUF	2015.06.30.
Vétel									
PLN/HUF	15.11.30	Forward	2015.11.30.	3 063 000	74,720	75,0376	972 809	HUF	2015.06.30.
Vétel									
PLN/HUF	15.11.30	Forward	2015.11.30.	1 830 000	74,770	75,0376	489 708	HUF	2015.06.30.
Vétel									
EUR/HUF	15.07.10	Forward	2015.07.10.	1 000 000	297,300	315,1018	-17 801 800	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.07.08	Forward	2015.07.08.	2 477 000	299,650	315,0894	-38 243 394	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.07.31	Forward	2015.07.31.	940 000	302,110	315,4689	-12 557 366	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.08.04	Forward	2015.08.04.	2 790 000	302,830	315,5242	-35 416 818	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.07.27	Forward	2015.07.27.	2 258 000	302,300	315,4135	-29 610 283	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.27	Forward	2015.07.27.	7 600 000	280,400	283,0285	-19 976 600	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.07.27	Forward	2015.07.27.	3 250 000	301,800	315,4135	-44 243 875	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.27	Forward	2015.07.27.	10 858 000	280,420	283,0285	-28 323 093	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.08.03	Forward	2015.08.03.	842 000	281,890	283,1007	-1 019 409	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.09.08	Forward	2015.09.08.	2 000 000	312,630	315,9112	-6 562 400	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.09.08	Forward	2015.09.08.	1 000 000	312,630	315,9112	-3 281 200	HUF	2015.06.30.
Eladás									
PLN/HUF	15.09.14	Forward	2015.09.14.	760 000	75,160	75,0868	-55 632	HUF	2015.06.30.
Vétel									
JPY/HUF	16.06.15	Forward	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,3434	-16 060 299	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.13	Forward	2015.07.13.	500 000	276,590	282,7998	-3 104 900	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.09.15	Forward	2015.09.15.	1 020 000	277,250	283,4310	-6 304 620	HUF	2015.06.30.
Eladás									
TRY/HUF	15.09.15	Forward	2015.09.15.	1 710 000	99,870	102,9774	-5 313 654	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	16.06.17	Forward	2016.06.17.	1 000 000	316,000	318,8972	-2 897 200	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.09.17	Forward	2015.09.17.	445 000	313,410	316,0232	-1 162 874	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.27	Forward	2015.07.27.	2 533 000	275,220	283,0285	-19 778 930	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.08.26	Forward	2015.08.26.	3 506 000	275,500	283,3379	-27 479 677	HUF	2015.06.30.
Eladás									
GBP/HUF	15.07.27	Forward	2015.07.27.	370 000	429,960	444,8406	-5 505 822	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.08.28	Forward	2015.08.28.	14 475 615	307,340	315,8563	-123 278 680	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.08.26	Forward	2015.08.26.	636 000	307,330	315,8286	-5 405 110	HUF	2015.06.30.
Eladás									
EUR/HUF	15.07.21	Forward	2015.07.21.	805 000	306,620	315,3305	-7 011 952	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.20	Forward	2015.07.20.	65 000	269,820	282,9563	-853 860	HUF	2015.06.30.
Eladás									
USD/HUF	15.07.20	Forward	2015.07.20.	1 105 000	269,680	282,9563	-14 670 311	HUF	2015.06.30.
Eladás									
PLN/HUF	15.08.19	Forward	2015.08.19.	6 127 000	75,710	75,1138	-3 652 917	HUF	2015.06.30.
Vétel									
PLN/HUF	15.11.13	Forward	2015.11.13.	910 000	74,880	75,0467	151 697	HUF	2015.06.30.
Vétel									
PLN/HUF	15.07.13	Forward	2015.07.13.	2 356 000	74,570	75,0961	1 239 492	HUF	2015.06.30.
Vétel									
PLN/HUF	15.07.13	Forward	2015.07.13.	1 260 000	74,770	75,0961	410 886	HUF	2015.06.30.
Vétel									
PLN/HUF	15.07.13	Forward	2015.07.13.	400 000	74,830	75,0961	106 440	HUF	2015.06.30.
Vétel									

Euro Stoxx Banks Index Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	90	148,000	150,0000	2 835 360	HUF	2015.06.30.
US 10YR NOTE Sep15 Eladás	2015.09.21.	40	124,563	126,1719	-18 202 031	HUF	2015.06.30.
US 10YR NOTE Sep15 Eladás	2015.09.21.	10	124,625	126,1719	-4 373 789	HUF	2015.06.30.
TOPIX Index Future Sep15 Vétel	2015.06.30.	20	1 634,800	1 630,5000	-1 992 534	HUF	2015.06.30.
Euro Stoxx 50 Sep2015 Vétel	2015.09.18.	70	3 627,000	3 436,0000	-42 120 848	HUF	2015.06.30.
Euro Stoxx Banks Index Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	270	147,900	150,0000	8 931 384	HUF	2015.06.30.
Összesen					-560 070 063	HUF	2015.06.30.
GBP/HUF 15.09.29 Forward Eladás	2015.09.29.	1 490 000	439,080	440,5575	-2 201 475	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	4 000 000	313,140	310,5527	10 349 200	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.08.25 Forward Vétel	2015.08.25.	770 000	74,460	74,5191	45 507	HUF	2015.07.31.
GBP/HUF 16.02.22 Forward Eladás	2016.02.22.	778 000	433,860	441,4910	-5 936 918	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.09.08 Forward Eladás	2015.09.08.	2 477 000	316,600	309,5920	17 358 816	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.11.30 Forward Vétel	2015.11.30.	1 830 000	74,770	74,4647	-558 699	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.11.30 Forward Vétel	2015.11.30.	3 063 000	74,720	74,4647	-781 984	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.09.29 Forward Eladás	2015.09.29.	1 500 000	312,490	309,8516	3 957 600	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.08.31 Forward Eladás	2015.08.31.	2 270 000	278,670	282,9118	-9 628 886	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.10.22 Forward Eladás	2015.10.22.	805 000	310,280	310,0915	151 742	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.09.23 Forward Eladás	2015.09.23.	2 230 000	285,320	283,1209	4 903 993	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.10.26 Forward Eladás	2015.10.26.	795 000	282,190	283,3476	-920 292	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.08.24 Forward Eladás	2015.08.24.	1 208 000	308,610	309,4066	-962 293	HUF	2015.07.31.
GBP/HUF 15.08.27 Forward Eladás	2015.08.27.	370 000	439,470	440,2180	-276 760	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	2 533 000	281,080	283,3558	-5 764 601	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	7 600 000	281,080	283,3558	-17 296 080	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	250 000	309,210	310,1506	-235 150	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.10.06 Forward Eladás	2015.10.06.	890 000	318,160	309,9023	7 349 353	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.10.13 Forward Eladás	2015.10.13.	1 000 000	318,610	309,9851	8 624 900	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.09.14 Forward Vétel	2015.09.14.	1 260 000	74,940	74,5105	-541 170	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.10.13 Forward Vétel	2015.10.13.	400 000	74,895	74,4903	-161 880	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.10.13 Forward Vétel	2015.10.13.	2 356 000	74,750	74,4903	-611 853	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.10.13 Forward Eladás	2015.10.13.	500 000	286,360	283,2404	1 559 800	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.08.31 Forward Eladás	2015.08.31.	522 000	311,770	309,4931	1 188 542	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.10.30 Forward Eladás	2015.10.30.	940 000	310,460	310,1861	257 466	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	10 858 000	281,070	283,3558	-24 819 216	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.10.30 Forward Vétel	2015.10.30.	600 000	74,605	74,4812	-74 280	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.10.05 Forward Eladás	2015.10.05.	842 000	282,140	283,1745	-871 049	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.10.05 Forward Eladás	2015.10.05.	2 790 000	309,700	309,8905	-531 495	HUF	2015.07.31.
TRY/HUF 15.09.15 Forward Eladás	2015.09.15.	1 710 000	99,870	100,1287	-442 377	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.09.15 Forward Eladás	2015.09.15.	1 020 000	277,250	283,0482	-5 914 164	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.09.17 Forward Eladás	2015.09.17.	445 000	313,410	309,7033	1 649 482	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 16.06.17 Forward Eladás	2016.06.17.	1 000 000	316,000	312,4919	3 508 100	HUF	2015.07.31.
JPY/HUF 16.06.15 Forward Eladás	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,2979	-6 914 572	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.09.14 Forward Vétel	2015.09.14.	760 000	75,160	74,5105	-493 620	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.09.08 Forward Eladás	2015.09.08.	1 000 000	312,630	309,5920	3 038 000	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.09.08 Forward	2015.09.08.	2 000 000	312,630	309,5920	6 076 000	HUF	2015.07.31.

Eladás							
PLN/HUF 15.11.13 Forward Vétel	2015.11.13.	910 000	74,880	74,4737	-369 733	HUF	2015.07.31.
PLN/HUF 15.08.19 Forward Vétel	2015.08.19.	6 127 000	75,710	74,5217	-7 280 714	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.08.26 Forward Eladás	2015.08.26.	636 000	307,330	309,4313	-1 336 427	HUF	2015.07.31.
EUR/HUF 15.08.28 Forward Eladás	2015.08.28.	14 475 615	307,340	309,4561	-30 631 849	HUF	2015.07.31.
USD/HUF 15.08.26 Forward Eladás	2015.08.26.	3 506 000	275,500	282,8664	-25 826 598	HUF	2015.07.31.
Euro Stoxx Banks Index Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	90	148,000	157,2000	12 797 154	HUF	2015.07.31.
TOPIX Index Future Sep15 Vétel	2015.06.30.	20	1 634,800	1 660,0000	11 465 496	HUF	2015.07.31.
US 10YR NOTE Sep15 Vétel	2015.09.21.	25	127,328	127,4375	772 816	HUF	2015.07.31.
US 10YR NOTE Sep15 Vétel	2015.09.21.	10	127,438	127,4375		HUF	2015.07.31.
EURO-BUND Future Sep15 Vétel	2015.09.08.	15	153,650	154,4000	3 477 488	HUF	2015.07.31.
EURO-BUND Future Sep15 Vétel	2015.09.08.	5	153,750	154,4000	1 004 608	HUF	2015.07.31.
Euro Stoxx 50 Sep2015 Vétel	2015.09.18.	50	3 665,900	3 598,0000	-10 494 285	HUF	2015.07.31.
Euro Stoxx 50 Sep2015 Vétel	2015.09.18.	70	3 627,000	3 598,0000	-6 274 933	HUF	2015.07.31.
Euro Stoxx Banks Index Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	270	147,900	157,2000	38 808 760	HUF	2015.07.31.
Összesen					-81 365 635	HUF	2015.07.31.
GBP/HUF 15.09.29 Forward Eladás	2015.09.29.	1 490 000	439,080	433,2542	8 680 442	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	4 000 000	313,140	315,5951	-9 820 400	HUF	2015.08.31.
GBP/HUF 16.02.22 Forward Eladás	2016.02.22.	778 000	433,860	434,2641	-314 390	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.09.08 Forward Eladás	2015.09.08.	2 477 000	316,600	314,5662	5 037 723	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.11.30 Forward Vétel	2015.11.30.	1 830 000	74,770	74,2714	-912 438	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.09.29 Forward Eladás	2015.09.29.	1 500 000	312,490	314,8586	-3 552 900	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.11.30 Forward Vétel	2015.11.30.	3 063 000	74,720	74,2714	-1 374 062	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.22 Forward Eladás	2015.10.22.	805 000	310,280	315,1511	-3 921 236	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.26 Forward Eladás	2015.10.26.	795 000	282,190	281,2427	753 103	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.09.23 Forward Eladás	2015.09.23.	2 230 000	285,320	280,9465	9 752 905	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	250 000	309,210	315,2146	-1 501 150	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	7 600 000	281,080	281,2517	-1 304 920	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	2 533 000	281,080	281,2517	-434 916	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.13 Forward Eladás	2015.10.13.	1 000 000	318,610	315,0366	3 573 400	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.06 Forward Eladás	2015.10.06.	890 000	318,160	314,9476	2 859 036	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.13 Forward Eladás	2015.10.13.	500 000	286,360	281,1260	2 617 000	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.10.13 Forward Vétel	2015.10.13.	2 356 000	74,750	74,3014	-1 056 902	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.10.13 Forward Vétel	2015.10.13.	400 000	74,895	74,3014	-237 440	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.09.14 Forward Vétel	2015.09.14.	1 260 000	74,940	74,3027	-802 998	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.05 Forward Eladás	2015.10.05.	2 790 000	309,700	314,9349	-14 605 371	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.05 Forward Eladás	2015.10.05.	842 000	282,140	281,0542	914 244	HUF	2015.08.31.
TRY/HUF 15.09.18 Forward Vétel	2015.09.18.	4 000 000	97,380	95,5870	-7 172 000	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.11.19 Forward Vétel	2015.11.19.	5 627 000	74,140	74,2772	772 024	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.10.30 Forward Vétel	2015.10.30.	600 000	74,605	74,2941	-186 540	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	10 858 000	281,070	281,2517	-1 972 899	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.30 Forward Eladás	2015.10.30.	940 000	310,460	315,2528	-4 505 232	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.11.27 Forward Eladás	2015.11.27.	1 208 000	309,500	315,5586	-7 318 789	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.11.27 Forward Vétel	2015.11.27.	770 000	74,090	74,2730	140 910	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.07 Forward Eladás	2015.10.07.	636 000	312,600	314,9603	-1 501 151	HUF	2015.08.31.

USD/HUF 15.10.07 Forward Eladás	2015.10.07.	1 506 000	271,308	281,0722	-14 704 885	HUF	2015.08.31.
GBP/HUF 15.09.28 Forward Eladás	2015.09.28.	370 000	428,510	433,2441	-1 751 617	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.28 Forward Eladás	2015.10.28.	7 000 615	315,160	315,2273	-471 141	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.12 Forward Eladás	2015.10.12.	7 475 000	315,100	315,0239	568 847	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.10.30 Forward Eladás	2015.10.30.	522 000	314,230	315,2528	-533 902	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.08 Forward Eladás	2015.10.08.	1 600 000	280,010	281,0811	-1 713 760	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.10.14 Forward Eladás	2015.10.14.	2 270 000	279,130	281,1350	-4 551 350	HUF	2015.08.31.
USD/HUF 15.09.15 Forward Eladás	2015.09.15.	1 020 000	277,250	280,8747	-3 697 194	HUF	2015.08.31.
TRY/HUF 15.09.15 Forward Eladás	2015.09.15.	1 710 000	99,870	95,6687	7 184 223	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.09.17 Forward Eladás	2015.09.17.	445 000	313,410	314,7061	-576 764	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 16.06.17 Forward Eladás	2016.06.17.	1 000 000	316,000	317,6212	-1 621 200	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.09.08 Forward Eladás	2015.09.08.	2 000 000	312,630	314,5662	-3 872 400	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.09.08 Forward Eladás	2015.09.08.	1 000 000	312,630	314,5662	-1 936 200	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.09.14 Forward Vétel	2015.09.14.	760 000	75,160	74,3027	-651 548	HUF	2015.08.31.
JPY/HUF 16.06.15 Forward Eladás	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,3363	-14 633 164	HUF	2015.08.31.
PLN/HUF 15.11.13 Forward Vétel	2015.11.13.	910 000	74,880	74,2804	-545 636	HUF	2015.08.31.
S&P500 Emini Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	15	1 948,250	1 969,2000	4 411 127	HUF	2015.08.31.
Euro Stoxx Banks Index Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	200	143,200	142,7000	-1 572 450	HUF	2015.08.31.
S&P500 Emini Future Sep15 Vétel	2015.09.18.	30	1 929,308	1 969,2000	16 798 777	HUF	2015.08.31.
Összesen					-70 902 636	HUF	2015.08.31.
EUR/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	700 000	315,630	314,0584	1 100 120	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.11.02 Forward Eladás	2015.11.02.	1 400 000	280,140	279,3459	1 111 740	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.28 Forward Eladás	2015.10.28.	7 000 615	315,160	313,6781	10 374 211	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.30 Forward Eladás	2015.10.30.	522 000	314,230	313,7037	274 729	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.12 Forward Eladás	2015.10.12.	7 475 000	315,100	313,5120	11 870 300	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.07 Forward Eladás	2015.10.07.	1 506 000	271,308	279,1343	-11 786 408	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.07 Forward Eladás	2015.10.07.	636 000	312,600	313,4320	-529 152	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.11.27 Forward Vétel	2015.11.27.	770 000	74,090	73,8839	-158 697	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.11.27 Forward Eladás	2015.11.27.	1 208 000	309,500	314,0618	-5 510 654	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.30 Forward Eladás	2015.10.30.	940 000	310,460	313,7037	-3 049 078	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	10 858 000	281,070	279,2921	19 304 438	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.10.30 Forward Vétel	2015.10.30.	600 000	74,605	73,8965	-425 100	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.11.19 Forward Vétel	2015.11.19.	5 627 000	74,140	73,8875	-1 420 817	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.05 Forward Eladás	2015.10.05.	842 000	282,140	279,1102	2 551 092	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.05 Forward Eladás	2015.10.05.	2 790 000	309,700	313,4000	-10 323 000	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.14 Forward Eladás	2015.10.14.	2 270 000	279,130	279,2186	-201 122	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.11.16 Forward Vétel	2015.11.16.	760 000	74,640	73,8888	-570 912	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.15 Forward Eladás	2015.10.15.	1 020 000	279,520	279,1845	342 210	HUF	2015.09.30.
TRY/HUF 15.10.15 Forward Eladás	2015.10.15.	1 710 000	90,880	91,8412	-1 643 652	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.08 Forward Eladás	2015.10.08.	1 600 000	280,010	279,1464	1 381 760	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.09 Forward Eladás	2015.10.09.	2 000 000	313,380	313,4640	-168 000	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.09 Forward Eladás	2015.10.09.	1 000 000	313,380	313,4640	-84 000	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.09 Forward Eladás	2015.10.09.	2 477 000	313,680	313,4640	535 032	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.09 Forward	2015.10.09.	1 520 000	280,810	279,1584	2 510 432	HUF	2015.09.30.

Eladás							
PLN/HUF 15.11.16 Forward Vétel	2015.11.16.	1 260 000	74,640	73,8888	-946 512	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.12.17 Forward Eladás	2015.12.17.	445 000	312,910	314,2642	-602 619	HUF	2015.09.30.
TRY/HUF 15.10.19 Forward Vétel	2015.10.19.	4 000 000	91,150	91,7329	2 331 600	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.07 Forward Eladás	2015.10.07.	2 230 000	276,030	279,1343	-6 922 589	HUF	2015.09.30.
GBP/HUF 16.03.31 Forward Eladás	2016.03.31.	370 000	425,200	424,8537	128 131	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	1 500 000	314,290	314,0584	347 400	HUF	2015.09.30.
GBP/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	1 490 000	428,930	424,0898	7 211 898	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.10.13 Forward Vétel	2015.10.13.	400 000	74,895	73,9103	-393 880	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.10.13 Forward Vétel	2015.10.13.	2 356 000	74,750	73,9103	-1 978 333	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.13 Forward Eladás	2015.10.13.	500 000	286,360	279,2066	3 576 700	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.06 Forward Eladás	2015.10.06.	890 000	318,160	313,4160	4 222 160	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.13 Forward Eladás	2015.10.13.	1 000 000	318,610	313,5280	5 082 000	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	2 533 000	281,080	279,2921	4 528 751	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	7 600 000	281,080	279,2921	13 588 040	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.27 Forward Eladás	2015.10.27.	250 000	309,210	313,6653	-1 113 825	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.10.26 Forward Eladás	2015.10.26.	795 000	282,190	279,2831	2 310 986	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.10.22 Forward Eladás	2015.10.22.	805 000	310,280	313,6014	-2 673 727	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.11.30 Forward Vétel	2015.11.30.	3 063 000	74,720	73,8750	-2 588 235	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.11.30 Forward Vétel	2015.11.30.	1 830 000	74,770	73,8750	-1 637 850	HUF	2015.09.30.
GBP/HUF 16.02.22 Forward Eladás	2016.02.22.	778 000	433,860	424,5817	7 218 517	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	4 000 000	313,140	314,0584	-3 673 600	HUF	2015.09.30.
PLN/HUF 15.11.13 Forward Vétel	2015.11.13.	910 000	74,880	73,8902	-900 718	HUF	2015.09.30.
JPY/HUF 16.06.15 Forward Eladás	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,3414	-15 658 290	HUF	2015.09.30.
EUR/HUF 16.06.17 Forward Eladás	2016.06.17.	1 000 000	316,000	316,3638	-363 800	HUF	2015.09.30.
Euro Stoxx 50 Dec15 Vétel	2015.12.18.	50	3 165,000	3 091,0000	-11 592 840	HUF	2015.09.30.
US 10YR Note Dec15 Vétel	2015.12.21.	40	127,594	128,7344	12 731 656	HUF	2015.09.30.
US 10YR Note Dec15 Vétel	2015.12.21.	40	127,984	128,7344	8 371 500	HUF	2015.09.30.
Euro Stoxx 50 Dec15 Vétel	2015.12.18.	50	3 228,000	3 091,0000	-21 462 420	HUF	2015.09.30.
S&P500 Emini Future Dec15 Vétel	2015.10.30.	45	1 969,850	1 908,7000	-38 393 792	HUF	2015.09.30.
Euro Stoxx 50 Dec15 Vétel	2015.10.30.	50	3 182,000	3 091,0000	-14 256 060	HUF	2015.09.30.
Összesen					26 577 676	HUF	2015.09.30.
USD/HUF 15.12.07 Forward Eladás	2015.12.07.	842 000	280,620	281,8270	-1 016 294	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.11.30 Forward Eladás	2015.11.30.	700 000	315,630	310,1685	3 823 050	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.12.07 Forward Eladás	2015.12.07.	2 790 000	313,450	310,2584	8 904 564	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.12.07 Forward Eladás	2015.12.07.	890 000	312,420	310,2584	1 923 824	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	636 000	313,910	309,9750	2 502 660	HUF	2015.10.30.
USD/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	3 736 000	279,580	281,6430	-7 707 368	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	2 000 000	311,480	309,9750	3 010 000	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	1 000 000	311,480	309,9750	1 505 000	HUF	2015.10.30.
USD/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	1 600 000	277,290	281,6430	-6 964 800	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	2 477 000	311,990	309,9750	4 991 155	HUF	2015.10.30.
USD/HUF 15.11.09 Forward Eladás	2015.11.09.	1 520 000	277,430	281,6430	-6 403 760	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF 15.11.13 Forward Eladás	2015.11.13.	7 475 000	312,080	310,0571	15 121 177	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	2 356 000	73,530	72,6178	-2 149 143	HUF	2015.10.30.

USD/HUF Eladás	15.11.13 Forward	2015.11.13.	500 000	274,020	281,7082	-3 844 100	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.16 Forward	2015.11.16.	2 270 000	272,510	281,6352	-20 714 204	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.16 Forward	2015.11.16.	1 020 000	273,150	281,6352	-8 654 904	HUF	2015.10.30.
TRY/HUF Eladás	15.11.16 Forward	2015.11.16.	1 710 000	91,810	96,0729	-7 289 559	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.16 Forward	2015.11.16.	900 000	310,330	309,9885	307 350	HUF	2015.10.30.
TRY/HUF Vétel	15.11.19 Forward	2015.11.19.	4 000 000	93,260	95,9945	10 938 000	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.23 Forward	2015.11.23.	805 000	310,630	310,0785	443 957	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.27 Forward	2015.11.27.	795 000	273,660	281,7357	-6 420 181	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.27 Forward	2015.11.27.	10 858 000	274,650	281,7357	-76 936 531	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.27 Forward	2015.11.27.	250 000	311,300	310,1299	292 525	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.27 Forward	2015.11.27.	2 533 000	275,300	281,7357	-16 301 628	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.27 Forward	2015.11.27.	7 600 000	276,150	281,7357	-42 451 320	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	16.01.28 Forward	2016.01.28.	7 000 615	310,850	310,8732	-162 414	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.13 Forward	2015.11.13.	1 000 000	311,980	310,0571	1 922 900	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	16.01.13 Forward	2016.01.13.	400 000	73,580	72,6178	-384 880	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.30 Forward	2015.11.30.	600 000	72,610	72,6469	22 140	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.30 Forward	2015.11.30.	1 462 000	312,310	310,1685	3 130 873	HUF	2015.10.30.
USD/HUF Eladás	15.11.30 Forward	2015.11.30.	1 400 000	284,600	281,7631	3 971 660	HUF	2015.10.30.
EUR/USD Vétel	15.11.30 Forward	2015.11.30.	4 000 000	1,105	1,1008	-5 066 640	HUF	2015.10.30.
EUR/SEK Eladás	15.11.30 Forward	2015.11.30.	5 000 000	9,390	9,3592	5 046 225	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.16 Forward	2015.11.16.	760 000	74,640	72,6528	-1 510 272	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.16 Forward	2015.11.16.	1 260 000	74,640	72,6528	-2 503 872	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.12.17 Forward	2015.12.17.	445 000	312,910	310,3870	1 122 735	HUF	2015.10.30.
GBP/HUF Eladás	15.11.30 Forward	2015.11.30.	1 490 000	428,930	431,9956	-4 567 744	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.30 Forward	2015.11.30.	1 500 000	314,290	310,1685	6 182 250	HUF	2015.10.30.
GBP/HUF Eladás	16.03.31 Forward	2016.03.31.	370 000	425,200	432,8094	-2 815 478	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.19 Forward	2015.11.19.	5 627 000	74,140	72,6515	-8 375 790	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.27 Forward	2015.11.27.	1 208 000	309,500	310,1299	-760 919	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.27 Forward	2015.11.27.	770 000	74,090	72,6481	-1 110 263	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	15.11.30 Forward	2015.11.30.	4 000 000	313,140	310,1685	11 886 000	HUF	2015.10.30.
GBP/HUF Eladás	16.02.22 Forward	2016.02.22.	778 000	433,860	432,7398	871 516	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.30 Forward	2015.11.30.	1 830 000	74,770	72,6469	-3 885 273	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.30 Forward	2015.11.30.	3 063 000	74,720	72,6469	-6 349 905	HUF	2015.10.30.
EUR/HUF Eladás	16.06.17 Forward	2016.06.17.	1 000 000	316,000	312,4594	3 540 600	HUF	2015.10.30.
JPY/HUF Eladás	16.06.15 Forward	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,3549	-18 371 857	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	15.11.13 Forward	2015.11.13.	910 000	74,880	72,6809	-2 001 181	HUF	2015.10.30.
Euro Stoxx 50 Dec15 Vétel		2015.12.18.	75	3 384,000	3 403,0000	4 414 223	HUF	2015.10.30.
Összesen						-173 260 119	HUF	2015.10.30.
PLN/HUF Vétel	16.01.13 Forward	2016.01.13.	1 703 000	73,075	73,0204	-92 984	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF Vétel	16.01.19 Forward	2016.01.19.	5 627 000	73,360	73,0177	-1 926 122	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF Eladás	16.01.19 Forward	2016.01.19.	805 000	310,910	312,1058	-962 619	HUF	2015.11.30.
USD/HUF Eladás	16.01.28 Forward	2016.01.28.	11 653 000	293,130	294,8838	-20 437 031	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF Eladás	16.01.28 Forward	2016.01.28.	250 000	312,530	312,2239	76 525	HUF	2015.11.30.
USD/HUF Forward	16.01.27 Forward	2016.01.27.	2 533 000	295,020	294,8748	367 792	HUF	2015.11.30.

Eladás							
PLN/HUF 16.02.16 Forward Vétel	2016.02.16.	770 000	73,160	72,9958	-126 434	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	1 208 000	312,730	312,1058	754 034	HUF	2015.11.30.
USD/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	7 600 000	294,590	294,8024	-1 614 240	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.29 Forward Vétel	2016.01.29.	1 830 000	73,260	73,0133	-451 461	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	1 500 000	312,550	312,0271	784 350	HUF	2015.11.30.
GBP/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	1 490 000	443,810	442,2768	2 284 468	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	600 000	73,040	73,0204	-11 760	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	2 162 000	312,770	312,0271	1 606 150	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	4 000 000	312,770	312,0271	2 971 600	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	1 000 000	315,160	312,3514	2 808 600	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	2 000 000	314,960	312,3514	5 217 200	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	5 000 000	314,390	312,3514	10 193 000	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	3 113 000	314,470	312,3514	6 595 202	HUF	2015.11.30.
USD/HUF 16.01.11 Forward Eladás	2016.01.11.	5 336 000	288,390	294,7300	-33 830 240	HUF	2015.11.30.
USD/HUF 16.01.11 Forward Eladás	2016.01.11.	1 520 000	288,390	294,7300	-9 636 800	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	7 475 000	312,130	312,0271	769 177	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	910 000	73,850	73,0204	-754 936	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	1 000 000	312,330	312,0271	302 900	HUF	2015.11.30.
USD/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	3 290 000	290,710	294,8916	-13 757 464	HUF	2015.11.30.
USD/HUF 16.02.16 Forward Eladás	2016.02.16.	500 000	291,030	294,9450	-1 957 500	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.02.16 Forward Vétel	2016.02.16.	760 000	73,830	72,9958	-633 992	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	1 260 000	73,820	73,0204	-1 007 496	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	900 000	312,570	312,1058	417 780	HUF	2015.11.30.
TRY/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	1 710 000	98,940	99,6797	-1 264 887	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	2 000 000	315,160	312,3514	5 617 200	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	400 000	73,580	73,0204	-223 840	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.01.28 Forward Eladás	2016.01.28.	7 000 615	310,850	312,2239	-9 618 145	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	2 356 000	73,530	73,0204	-1 200 618	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 15.12.07 Forward Eladás	2015.12.07.	890 000	312,420	311,4811	835 621	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 15.12.07 Forward Eladás	2015.12.07.	2 790 000	313,450	311,4811	5 493 231	HUF	2015.11.30.
USD/HUF 15.12.07 Forward Eladás	2015.12.07.	842 000	280,620	294,3616	-11 570 427	HUF	2015.11.30.
GBP/HUF 16.02.22 Forward Eladás	2016.02.22.	778 000	433,860	442,6223	-6 817 069	HUF	2015.11.30.
GBP/HUF 16.03.31 Forward Eladás	2016.03.31.	370 000	425,200	442,9845	-6 580 265	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 15.12.17 Forward Eladás	2015.12.17.	445 000	312,910	311,6729	550 509	HUF	2015.11.30.
JPY/HUF 16.06.15 Forward Eladás	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,4075	-28 944 720	HUF	2015.11.30.
EUR/HUF 16.06.17 Forward Eladás	2016.06.17.	1 000 000	316,000	313,8731	2 126 900	HUF	2015.11.30.
DAX Index Future Dec15 Vétel	2015.12.18.	20	11 249,000	11 378,5000	20 166 388	HUF	2015.11.30.
Összesen					-103 648 812	HUF	2015.11.30.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	1 703 000	73,075	73,4300	604 565	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	3 680 000	310,000	313,2005	-11 777 840	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	4 000 000	313,550	313,2005	1 398 000	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	445 000	316,780	313,2005	1 592 877	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	4 000 000	312,770	313,2005	-1 722 000	HUF	2015.12.31.

EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	2 162 000	312,770	313,2005	-930 741	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	600 000	73,040	73,4300	234 000	HUF	2015.12.31.
GBP/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	1 490 000	443,810	424,9576	28 090 076	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	1 500 000	312,550	313,2005	-975 750	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.29 Forward Vétel	2016.01.29.	1 830 000	73,260	73,4482	344 406	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	7 600 000	294,590	286,7692	59 438 080	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	1 208 000	312,730	313,3769	-781 455	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.02.16 Forward Vétel	2016.02.16.	770 000	73,160	73,4409	216 293	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.01.27 Forward Eladás	2016.01.27.	2 533 000	295,020	286,8278	20 750 843	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.28 Forward Eladás	2016.01.28.	250 000	312,530	313,4986	-242 150	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.01.28 Forward Eladás	2016.01.28.	11 653 000	293,130	286,8351	73 354 470	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	805 000	310,910	313,3769	-1 985 854	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.19 Forward Vétel	2016.01.19.	5 627 000	73,360	73,4523	519 372	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	2 356 000	73,530	73,4300	-235 600	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.28 Forward Eladás	2016.01.28.	7 000 615	310,850	313,4986	-18 541 829	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	400 000	73,580	73,4300	-60 000	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	2 000 000	315,160	313,6609	2 998 200	HUF	2015.12.31.
TRY/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	1 710 000	98,940	97,3290	2 754 810	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.19 Forward Eladás	2016.01.19.	900 000	312,570	313,3769	-726 210	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	1 260 000	73,820	73,4300	-491 400	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.02.16 Forward Vétel	2016.02.16.	760 000	73,830	73,4409	-295 716	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.02.16 Forward Eladás	2016.02.16.	500 000	291,030	286,9743	2 027 850	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	3 290 000	290,710	286,9230	12 459 230	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	1 000 000	312,330	313,2005	-870 500	HUF	2015.12.31.
PLN/HUF 16.01.13 Forward Vétel	2016.01.13.	910 000	73,850	73,4300	-382 200	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.01.13 Forward Eladás	2016.01.13.	7 475 000	312,130	313,2005	-8 001 987	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.01.11 Forward Eladás	2016.01.11.	1 520 000	288,390	286,6436	2 654 528	HUF	2015.12.31.
USD/HUF 16.01.11 Forward Eladás	2016.01.11.	5 336 000	288,390	286,6436	9 318 790	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	3 113 000	314,470	313,6609	2 518 728	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	1 000 000	314,390	313,6609	729 100	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	2 000 000	314,960	313,6609	2 598 200	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.02.09 Forward Eladás	2016.02.09.	1 000 000	315,160	313,6609	1 499 100	HUF	2015.12.31.
GBP/HUF 16.03.31 Forward Eladás	2016.03.31.	370 000	425,200	425,7748	-212 676	HUF	2015.12.31.
GBP/HUF 16.02.22 Forward Eladás	2016.02.22.	778 000	433,860	425,4894	6 512 327	HUF	2015.12.31.
EUR/HUF 16.06.17 Forward Eladás	2016.06.17.	1 000 000	316,000	315,1615	838 500	HUF	2015.12.31.
JPY/HUF 16.06.15 Forward Eladás	2016.06.15.	201 005 000	2,264	2,3948	-26 391 956	HUF	2015.12.31.
mini MSCI Emg Mkt Mar16 Vétel	2016.03.18.	70	801,587	787,5000	-14 132 299	HUF	2015.12.31.
WIG20 Index Future MAR16 Vétel	2016.03.18.	300	1 854,807	1 859,0000	1 848 253	HUF	2015.12.31.
Összesen					158 826 480	HUF	2015.12.31

VIII. A befektetési alapkezelő működésében bekövetkezett változások, valamint a befektetési politika alakulására ható fontosabb tényezők

A 2015-ös év során az alapkezelő benyújtotta kérelmét a UCITS (ÁÉKBV)-alapkezelővé váláshoz a Magyar Nemzeti Bank felé. Az ÁÉKBV-alapkezelőség feltételeinek megfelelés kisebb szabályzatmódosításokat, és kiegészítő dokumentáció/szabályzatok elkészítését igényelte, ám a magas fokú szabályozottság miatt a működésben nem okozott nagy horderejű változtatást. Az engedély kiadása 2016. első negyedévében várható.

Az alap egy alacsony kockázati szintet célzó abszolút hozamú alap, amely minden piaci környezetben pozitív hozam elérésére törekszik, ehhez pedig szinte minden tőkepiaci instrumentum rendelkezésére áll. Az alap egy kihívásokon teli éven van túl. A csökkenő kamatkörnyezet mellett jelentős részvénypiaci volatilitás volt tapasztalható, főleg a feltörekvő piacokról érkező rossz híreknek köszönhetően. A fejlett piaci növekedés kifulladásra az év második felére már ezeken a részvénypiacokon is éreztette negatív hatását, így még mindig a nem túl magas kockázatú kötvény-típusú befektetéseknak kedvezett a befektetési környezet.

IX. A befektetési alapkezelő által kifizetett javadalmazás

	Javadalmazás teljes összege	ABA kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakoroló személyek (ideértve ügyvezetők)
Létszámadatok (fő)	36	5
Rögzített	290 611 146	114 119 999
Változó	89 966 000	55 233 000
Nyereségrészesedés	0	0

X. Az ABAK – ide nem értve a 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-ot – által kezelt minden uniós ABA és minden, általa az EGT-államokban foglalkoztatott ABA tekintetében

a) az ABA olyan eszközeinek aránya, amelyekre nem likvid jellegüknél fogva különleges szabályok vonatkoznak;

Az Alapban az Alapkezelő Likviditási politikájában definiált nem likvid eszközök aránya 2.16% .

b) az ABA likviditáskezelésével kapcsolatos minden, az adott időszakban kötött új megállapodás;

Az Alapkezelő a tárgyidőszakban nem kötött új megállapodást az Alap likviditáskezelésével kapcsolatban.

c) az ABA aktuális kockázati profilja és az ABAK által e kockázatok kezelése érdekében alkalmazott kockázatkezelési rendszerek.

Az Alap alapdevizában denominált „A” sorozata az alábbi befektetői profillal rendelkezik:

ABA neve	ABA alapdevizája	javasolt minimális befektetési idő	kockázati besorolás
Aegon MoneyMaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap	HUF	1 év	3 (mérsékelt)

Az Alapot elsősorban olyan Befektetőknek szánjuk, akik legalább a javasolt minimális befektetési időre terveznek befektetni, és a kockázat/nyereség profil 1-től 7-ig terjedő skáláján a megjelölt értéket a kockázatviselési hajlandóságukhoz mérten elfogadhatónak tartják.

Az Alap célja, hogy olyan befektetési portfóliót hozzon létre Befektetői számára, amelyben szerepelhetnek mind magyar mind nemzetközi pénz- és tőkepiaci eszközök, és ezeken belül az Alapkezelő dinamikus portfólió-allokációval mozoghasson a lehető legnagyobb hozam elérése érdekében.

Az Alap úgynevezett „total-return fund”, azaz ahelyett, hogy csak egy pénz- illetve tőkepiaci részterületre koncentrálna, minden adott pillanatban a lehető legnagyobb hozammal kecsegtető területre összpontosítja befektetéseit. Az Alap nem kíván egy fix benchmarkot követni, nem ragaszkodik egy állandó részvénykötvény portfólióarányhoz. Az alap referenciaindex: 100% RMAX.

Az Alap származékos ügyleteket használ a portfólió hatékony kezelésének céljából, a befektetési célok elérésének érdekében.

A Kbftv befektetési jegy sorozatokra vonatkozó rendelkezései értelmében az Alapkezelő az Alap egyes eszközeit a befektetési jegy sorozatok közt megoszthatja azon devizakockázat fedezésére szolgáló ügyletek esetében, amelyek célja az Alap adott sorozatainak az Alap alapdevizájával szembeni devizakockázatának csökkentése.

Az Alapkezelő a kockázatkezelési feladatok ellátására külön szervezeti egységet hoz létre, melynek működéséért a kockázatkezelési vezető felelős. A kockázatkezelési egység célja, hogy olyan kockázatkezelési gyakorlatot alakítson ki, amely alkalmas az Alap kockázatainak azonosítására, mérésére, folyamatos nyomon követésére és kezelésére. Az alkalmazott eljárások és szabályok biztosítják, hogy a befektetők tudomására hozott kockázati profil összhangban legyen az Alap kezelési szabályzatában meghatározott kockázati korlátokkal.

A kockázatkezelési egység a kockázatkezelési folyamat részeként limitrendszerrel működik, melyben külön alrendszerekben figyeli az egyes tranzakciók megkötésére, az egyes partnerek felé irányuló kitétségre vonatkozó törvényi, szerződéses és belső limiteket, valamint azon befektetési korlátokat, melyeket az Alapkezelő az Alap kezelési szabályzatában felállított és befektetői irányába kommunikált.

Az Alapkezelő az Alap vonatkozásában likviditáskezelési rendszert alkalmaz, hogy nyomon követhesse az Alap likviditási kockázatát, valamint, hogy az Alap befektetéseinek likviditási profilja megfeleljen az Alap kötelezettségeinek.

XI. Tőkeáttétel alkalmazása

Az Alap tőkeáttételt csak a törvényben megengedett korlátokon belül vehet fel: A befektetési alap teljes nettósított kockázati kitétsége nem haladhatja meg a befektetési alap nettó eszközértékének a kétszeresét, azaz az Alap felvehető tőkeáttétel maximális értéke 2. Az Alap befektetési politikája további korlátozásokat nem tartalmaz. Az Alap a tárgyidőszakban fedezeti céllal, illetve a hatékony portfólió kialakítás céljából is kötött származékos ügyleteket. . Az Alap teljes nettósított kockázati kitétsége 2015.12.31-én a következő: 1.06.

XII. Eredménykimutatás

Aegon Moneymaxx Expressz Abszolút Hozamú Befektetési Alap

	Előző év	Tárgyév
	eFt	eFt
I. Pénzügyi műveletek bevételei	3 853 042	5 287 240
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	2 712 214	3 935 072
III. Egyéb bevételek	1 080	551
IV. Működési költségek	762 264	847 133
V. Egyéb ráfordítások	0	20 349
VI. Rendkívüli bevételek	0	0
VII. Rendkívüli ráfordítások	0	0
VIII. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.+VI.-VII.-VIII.)	379 644	485 237

Az Alap 2015. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Budapest, 2016.04.29.