

AEGON ALFA ABSZOLÚT HOZAMÚ BEFEKTETÉSI ALAP

2020. ÉVES JELENTÉSE

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az Aegon Alfa 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 2020. 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, 2021. április 28.

Kadocsa Péter

elnök-vezérigazgató

Kocsis Bálint

adminisztrációs vezérigazgató-
helyettes

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

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL**Az Alap elnevezése**

Aegon Alfa Abszolút Hozamú 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	I	HUF	HU0000715974
B	PLN	HU0000708318	C	CZK	HU0000716006
R	HUF	HU0000712286	E	EUR	HU0000715982
U	USD	HU0000715990			

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 és 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	2019.12.31.		2020.12.31.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEE százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEE százalékában (%)
Banki egyenlegek	1 682 685 804	3,09	6 891 037 269	16,55
Repo				
Átruházható értékpapírok	54 091 208 260	98,99	35 184 870 854	84,48
Származékos ügyletek	60 810 737	0,11	-262 182 195	-0,63
Egyéb eszközök	307 471 588	0,56	63 585 933	0,15
Összes eszköz	56 142 176 389	102,75	41 877 311 861	100,55
Kötelezettségek	-1 501 740 439	-2,75	-230 668 670	-0,55
Nettó eszközérték	54 640 435 950	100,00	41 646 643 191	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy alap	sorozat	deviza	ISIN	2019.12.31.	2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	12 588 339 797	9 503 473 628
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	37 812 772	28 202 124
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	186 125 473	161 489 401
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974	6 315 607 955	4 072 054 995
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006	300 000	300 000
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982	7 113 512	7 007 970
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990	6 072 129	4 197 375

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy alap	sorozat	deviza	ISIN	2019.12.31.	2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	2.783527	2.810303
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	2.637935	2.656932
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	1.384983	1.409601
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974	1.122742	1.137179
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006	1.060995	1.057971
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982	1.052889	1.052795
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990	1.135836	1.154612

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2019.12.31.		2020.12.31.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	11 229 003 048	20,76	7 837 865 520	22,28
Részvény - GMU	2 054 308 944	3,80	1 533 166 858	4,36
Részvény - Egyéb külföld	4 757 658 654	8,79	19 378 476	0,06
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	18 040 970 646	33,35	9 390 410 854	26,69
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	3 065 467 560	5,67	3 390 237 554	9,64
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	470 864 115	0,87	432 056 822	1,23
Egyéb átruházható értékpapírok	3 536 331 675	6,54	3 822 294 376	10,86
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	2 154 085 262	3,98	9 016 977 133	25,63
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	6 036 909 678	11,16	949 522 938	2,70
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	1 732 046 431	3,20	2 426 443 446	6,90
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	5 147 577 365	9,52	3 530 703 056	10,03
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	17 443 287 203	32,25	6 048 519 051	17,19
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	32 513 905 939	60,11	21 972 165 624	62,45
Értékpapírok összesen	54 091 208 260	100,00	35 184 870 854	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	2020
Pénzintézettől kapott kamatok	6 929
Diszkont kincstárjegyek árnyeresége	27 016
Részvények ár- és árfolyamnyeresége	3 753 125
Kötvények ár- és árfolyamnyeresége	2 451 594
Értékpapírok felhalmozott kamata	175 870
Kamatkozó papírok kapott kamata	975 814
Kapott osztalék	1 176 739
Deviza árf. változással kapcsolatos nyereség	4 730 134
Összesen:	13 297 221

Az Alap 2020. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

adatok eFt-ban	
Pénzügyi műveletek ráfordításai	2020
Diszkont papírok árvesztesége	6 547
Kötvények ár- és árfolyamvesztesége	948 266
Részvények ár- és árfolyamvesztesége	1 866 928
Fizetett kamat	3 838
Opció díj	137 300
Származékos ügyletek vesztesége	5 955 626
Pénzeszközök év végi átértékeléséből származó veszteség	16 719
Összesen:	8 935 224

Az Alap 2020. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alap 2019-ben **Egyéb bevételként 3 642e** Ft büntető jutalékot, **1 e** Ft kerekítési különbözetet, **Egyéb ráfordításként** a befektetési alapok külön adóját számolta el **20 608 e** Ft értékben.

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

adatok eFt-ban	
Működési költségek	2020
Alapkezelői díj	364 347
Letétkezelői díj	19 119
Fizetendő sikerdíj	45 825
Ügynöki jutalékok	20 940
Főforgalmazói jutalék	22 256
Forgalmazói jutalék	343 564
Felügyeleti díj	15 314
Bankköltség	800
Tranzakciós díjak	1 917
Könyvvizsgálói díj	9 008
Megbízási díj	101 699
KELER díj	1 892
Összesen:	946 681

Az Alap 2020. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

Tőkenövekmény:	2020
visszavásárolt bef.jegyek bevonási értékülönbözete	3 164 171
értékelési különbözetéből	1 783 908
előző évek eredményből	14 863 130
üzleti év eredményéből	3 398 351
Összesen:	23 209 560

Az Alap 2020. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Felosztott és újrabefektetett jövedelemmel az alap nem rendelkezett 2020-ban.

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

Alap neve Fund	Sorozat Serie	Deviza Currency	ISIN	Nettó eszközérték Net Asset Value	1 jegyre jutó eszközérték Unit price	Értéknap Value date
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	60 172 247 192		2,688459 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	48 423 986 962		2,592140 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	35 039 983 710		2,783527 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	26 707 640 447		2,810303 2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	134 413 007		2,482734 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	104 952 626		2,429839 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	99 747 635		2,637935 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	74 931 126		2,656932 2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	2 483 204 449		1,307754 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	2 524 873 352		1,276694 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	257 780 616		1,384983 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	227 635 621		1,409601 2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974	8 513 423 151		1,065560 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974	9 778 121 703		1,037069 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974	7 090 798 307		1,122742 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	I	HUF	HU0000715974	4 630 655 427		1,137179 2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006	305 032		1,016773 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006	293 763		0,979211 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006	318 299		1,060995 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716006	317 391		1,057971 2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982	8 787 750		1,026664 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982	9 695 401		0,984765 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982	7 489 739		1,052889 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	E	EUR	HU0000715982	7 377 956		1,052795 2020.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990	7 526 891		1,052536 2017.12.29.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990	8 334 308		1,035044 2018.12.28.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990	6 896 943		1,135836 2019.12.31.
Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap	U	USD	HU0000715990	4 846 340		1,154612 2020.12.31.

VII. Származtatott ügyletek

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 20.05.04 Forward Eladás	2020.05.04.	4 000 000	338,229	337,2277	4 006 400	HUF	2020.01.31.
PLN/HUF 20.02.21 Forward Eladás	2020.02.21.	7 020 000	77,550	78,1980	-4 548 960	HUF	2020.01.31.
CZK/HUF 20.02.28 Forward Eladás	2020.02.28.	23 000 000	13,120	13,3200	-4 588 500	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.02.03 Forward Eladás	2020.02.03.	5 620 000	335,730	336,6684	-5 273 808	HUF	2020.01.31.
CZK/HUF 20.03.02 Forward Vétel	2020.03.02.	318 000	12,968	13,3179	111 268	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.03.02 Forward Vétel	2020.03.02.	351 000	295,250	304,8484	3 369 038	HUF	2020.01.31.
TRY/HUF 20.04.06 Forward Eladás	2020.04.06.	16 700 000	47,560	50,0831	-42 135 770	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.02.10 Forward Vétel	2020.02.10.	92 000	329,870	336,7114	629 400	HUF	2020.01.31.
PLN/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	44 475 000	76,692	78,0551	60 623 873	HUF	2020.01.31.
PLN/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	55 500 000	77,740	78,0551	17 488 050	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	230 000	294,960	304,3589	2 161 747	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.14 Forward Vétel	2020.04.14.	280 000	297,655	304,2953	1 859 284	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.14 Forward Vétel	2020.04.14.	310 000	297,590	304,2953	2 078 643	HUF	2020.01.31.
CZK/HUF 20.04.14 Forward Eladás	2020.04.14.	45 000 000	13,150	13,2876	-6 192 000	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.03.16 Forward Vétel	2020.03.16.	596 000	333,235	336,9354	2 205 438	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.16 Forward Vétel	2020.04.16.	461 000	298,250	304,2698	2 775 128	HUF	2020.01.31.
PLN/HUF 20.03.16 Forward Eladás	2020.03.16.	30 000 000	78,690	78,1272	16 884 000	HUF	2020.01.31.
PLN/HUF 20.02.18 Forward Eladás	2020.02.18.	35 000 000	78,650	78,2068	15 512 000	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.02.18 Forward Vétel	2020.02.18.	4 234 000	333,270	336,7641	14 794 019	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.02.18 Forward Vétel	2020.02.18.	2 620 000	333,380	336,7641	8 866 342	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.21 Forward Eladás	2020.04.21.	4 000 000	297,890	304,2062	-25 264 800	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.03.23 Forward Eladás	2020.03.23.	10 000 000	335,760	336,9799	-12 199 000	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.02.21 Forward Eladás	2020.02.21.	8 000 000	335,758	336,7832	-8 204 000	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.02.21 Forward Eladás	2020.02.21.	7 500 000	336,000	336,7832	-5 874 000	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.02.24 Forward Eladás	2020.02.24.	7 000 000	303,050	304,9367	-13 206 900	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.27 Forward Eladás	2020.04.27.	16 000 000	302,580	304,1300	-24 800 000	HUF	2020.01.31.
EUR/HUF 20.04.28 Forward Eladás	2020.04.28.	7 120 000	336,395	337,1907	-5 665 384	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.02.28 Forward Vétel	2020.02.28.	4 350 000	305,660	304,8863	-3 365 595	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.02.28 Forward Vétel	2020.02.28.	1 073 000	306,090	304,8863	-1 291 570	HUF	2020.01.31.
PLN/HUF 20.04.30 Forward Eladás	2020.04.30.	6 000 000	78,790	77,9930	4 782 000	HUF	2020.01.31.
US 5YR NOTE (CBT) Mar20 Vétel	2020.03.31.	100	119,781	120,3203	16 454 359	HUF	2020.01.31.
GOLD 100 OZ FUTR Apr20 Vétel	2020.04.28.	93	1 581,900	1 587,9000	17 032 392	HUF	2020.01.31.
Összesen					-4 463 648	HUF	2020.01.31.
USD/HUF 20.04.30 Forward Vétel	2020.04.30.	4 425 000	311,110	307,2692	-16 995 540	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.30 Forward Vétel	2020.04.30.	1 073 000	311,320	307,2692	-4 346 508	HUF	2020.02.28.
TRY/HUF 20.04.06 Forward Eladás	2020.04.06.	16 700 000	47,560	48,6977	-18 999 590	HUF	2020.02.28.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
PLN/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	44 475 000	76,692	78,3109	72 000 578	HUF	2020.02.28.
PLN/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	55 500 000	77,740	78,3109	31 684 950	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	230 000	294,960	307,3753	2 855 519	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.14 Forward Vétel	2020.04.14.	280 000	297,655	307,3334	2 709 952	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.14 Forward Vétel	2020.04.14.	310 000	297,590	307,3334	3 020 454	HUF	2020.02.28.
CZK/HUF 20.04.14 Forward Eladás	2020.04.14.	7 300 000	13,150	13,3194	-1 236 620	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.03.16 Forward Vétel	2020.03.16.	596 000	333,235	340,0507	4 062 157	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.16 Forward Vétel	2020.04.16.	461 000	298,250	307,3166	4 179 703	HUF	2020.02.28.
PLN/HUF 20.03.16 Forward Eladás	2020.03.16.	30 000 000	78,690	78,3630	9 810 000	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.21 Forward Eladás	2020.04.21.	4 000 000	297,890	307,2746	-37 538 400	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.03.23 Forward Eladás	2020.03.23.	10 000 000	335,760	340,1211	-43 611 000	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.27 Forward Eladás	2020.04.27.	16 000 000	302,590	307,2244	-74 310 400	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.04.28 Forward Eladás	2020.04.28.	7 120 000	336,395	340,4830	-29 106 560	HUF	2020.02.28.
PLN/HUF 20.04.30 Forward Eladás	2020.04.30.	6 000 000	78,790	78,2654	3 147 600	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.04 Forward Eladás	2020.05.04.	4 000 000	338,229	340,5543	-9 300 000	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.05 Forward Eladás	2020.05.05.	5 620 000	338,300	340,5646	-12 727 052	HUF	2020.02.28.
TRY/HUF 20.03.09 Forward Eladás	2020.03.09.	13 350 000	50,340	49,0549	17 156 085	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.07 Forward Eladás	2020.05.07.	4 000 000	337,110	340,5850	-13 900 000	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.06 Forward Eladás	2020.05.06.	4 000 000	337,620	340,5748	-11 819 200	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.03.09 Forward Eladás	2020.03.09.	1 310 000	304,840	307,5972	-3 611 932	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.03.10 Forward Vétel	2020.03.10.	92 000	337,230	339,9525	250 470	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.14 Forward Eladás	2020.05.14.	900 000	339,380	340,6566	-1 148 940	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.11.16 Forward Eladás	2020.11.16.	1 350 000	307,470	306,1077	1 839 105	HUF	2020.02.28.
TRY/HUF 20.04.14 Forward Eladás	2020.04.14.	8 450 000	50,260	48,5933	14 083 615	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.18 Forward Eladás	2020.05.18.	4 000 000	339,180	340,6975	-6 070 000	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.03.18 Forward Vétel	2020.03.18.	4 234 000	335,230	340,0708	20 495 947	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.03.18 Forward Vétel	2020.03.18.	2 620 000	335,330	340,0708	12 420 896	HUF	2020.02.28.
PLN/HUF 20.03.19 Forward Eladás	2020.03.19.	22 800 000	78,750	78,3565	8 971 800	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	8 000 000	338,816	341,0762	-18 081 600	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	7 500 000	338,720	341,0762	-17 671 500	HUF	2020.02.28.
PLN/HUF 20.08.24 Forward Eladás	2020.08.24.	7 020 000	78,605	78,0117	4 164 966	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.08.26 Forward Eladás	2020.08.26.	7 000 000	311,140	306,6088	31 718 400	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.26 Forward Eladás	2020.05.26.	8 000 000	338,670	340,7794	-16 875 200	HUF	2020.02.28.
EUR/HUF 20.05.26 Forward Eladás	2020.05.26.	8 000 000	339,220	340,7794	-12 475 200	HUF	2020.02.28.
CZK/HUF 20.04.02 Forward Vétel	2020.04.02.	318 000	13,367	13,3274	-12 593	HUF	2020.02.28.
USD/HUF 20.04.02 Forward Vétel	2020.04.02.	351 000	308,310	307,4341	-307 441	HUF	2020.02.28.
DAX INDEX FUTURE Mar20 Vétel	2020.03.20.	5	11 856,900	11 819,0000	-1 610 181	HUF	2020.02.28.
S&P500 EMINI FUT Mar20 Esrte Vétel	2020.03.20.	6	2 903,563	2 951,1000	4 388 472	HUF	2020.02.28.
S&P500 EMINI FUT Mar20 Esrte Vétel	2020.03.20.	6	2 943,563	2 951,1000	695 832	HUF	2020.02.28.
US 10YR NOTE (CBT)Jun20 Eladás	2020.06.19.	49	132,641	134,7500	-31 805 747	HUF	2020.02.28.
DAX INDEX FUTURE Mar20 Vétel	2020.03.20.	5	12 391,300	11 819,0000	-24 314 165	HUF	2020.02.28.
Összesen					-105 573 080	HUF	2020.02.28.
GBP/HUF 20.09.24 Forward Eladás	2020.09.24.	626 000	382,950	402,2269	-12 067 339	HUF	2020.03.31.
CZK/HUF 20.05.04 Forward Vétel	2020.05.04.	286 000	13,130	13,1226	-2 116	HUF	2020.03.31.
GBP/HUF 20.10.02 Forward Eladás	2020.10.02.	800 000	405,220	402,2033	2 413 360	HUF	2020.03.31.
TRY/HUF 20.04.06 Forward Eladás	2020.04.06.	3 300 000	47,560	49,7669	-7 282 770	HUF	2020.03.31.
PLN/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	39 062 000	76,692	78,8527	84 401 263	HUF	2020.03.31.
PLN/HUF 20.04.09 Forward Vétel	2020.04.09.	39 307 000	77,740	78,8527	43 736 899	HUF	2020.03.31.
CZK/HUF 20.04.14 Forward Eladás	2020.04.14.	7 300 000	13,150	13,1267	170 090	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.04.21 Forward Eladás	2020.04.21.	2 500 000	297,890	326,9646	-72 686 500	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.04.27 Forward Eladás	2020.04.27.	16 000 000	302,590	326,9345	-389 672 000	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.04 Forward Eladás	2020.05.04.	4 000 000	338,229	359,3709	-84 566 400	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.05 Forward Eladás	2020.05.05.	2 620 000	338,300	359,3791	-55 227 242	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.07 Forward Eladás	2020.05.07.	4 000 000	337,110	359,3957	-89 142 800	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.06 Forward Eladás	2020.05.06.	4 000 000	337,620	359,3874	-87 069 600	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.14 Forward Eladás	2020.05.14.	900 000	339,380	359,4535	-18 066 150	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.11.16 Forward Eladás	2020.11.16.	1 350 000	307,470	325,5865	-24 457 275	HUF	2020.03.31.
TRY/HUF 20.04.14 Forward Eladás	2020.04.14.	4 750 000	50,260	49,6698	2 803 450	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.18 Forward Eladás	2020.05.18.	4 000 000	339,180	359,4866	-81 226 400	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	8 000 000	338,816	359,6963	-167 042 400	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	7 500 000	338,720	359,6963	-157 322 250	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.08.26 Forward Eladás	2020.08.26.	7 000 000	311,140	326,1129	-104 810 300	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.26 Forward Eladás	2020.05.26.	1 000 000	339,220	359,5527	-20 332 700	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.04.30 Forward Vétel	2020.04.30.	3 620 000	311,110	326,9194	57 230 028	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.04.30 Forward Vétel	2020.04.30.	1 073 000	311,320	326,9194	16 738 156	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	1 000 000	299,060	325,4522	-26 392 200	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.04.16 Forward Vétel	2020.04.16.	57 000	338,070	359,2221	1 205 670	HUF	2020.03.31.
RON/HUF 20.05.18 Forward Eladás	2020.05.18.	13 500 000	69,920	74,1743	-57 433 050	HUF	2020.03.31.
RON/HUF 20.06.17 Forward Eladás	2020.06.17.	13 100 000	69,570	74,0590	-58 805 900	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	2 800 000	341,230	360,2180	-53 166 400	HUF	2020.03.31.
GBP/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	140 000	373,610	402,2445	-4 008 830	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.06.18 Forward Vétel	2020.06.18.	4 234 000	342,630	359,6535	72 077 499	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.06.18 Forward Vétel	2020.06.18.	2 253 000	344,930	359,6535	33 172 046	HUF	2020.03.31.
USD/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	310 000	304,610	325,9650	-6 620 050	HUF	2020.03.31.
DAX INDEX FUTURE Jun20 Vétel	2020.06.19.	10	8 540,500	9 907,5000	122 719 007	HUF	2020.03.31.
S&P500 EMINI FUT Jun20 (Esrte) Vétel	2020.06.19.	12	2 400,833	2 569,7000	33 138 875	HUF	2020.03.31.
Összesen					-1 263 452 212	HUF	2020.03.31.
EUR/HUF 20.05.05 Forward Eladás	2020.05.05.	2 620 000	338,300	353,0869	-38 741 678	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.05.07 Forward Eladás	2020.05.07.	4 000 000	337,110	353,1177	-64 030 800	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.05.06 Forward Eladás	2020.05.06.	4 000 000	337,620	353,1023	-61 929 200	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.05.14 Forward Eladás	2020.05.14.	900 000	339,380	353,2254	-12 460 860	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.11.16 Forward Eladás	2020.11.16.	1 350 000	307,470	324,9088	-23 542 300	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.05.18 Forward Eladás	2020.05.18.	4 000 000	339,180	353,2710	-56 364 000	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	8 000 000	338,816	353,8079	-119 935 200	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	7 500 000	338,720	353,8079	-113 159 250	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.08.26 Forward Eladás	2020.08.26.	7 000 000	311,140	324,8464	-95 944 800	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.05.26 Forward Eladás	2020.05.26.	1 000 000	339,220	353,3870	-14 167 000	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	1 000 000	299,060	324,9745	-25 914 500	HUF	2020.04.30.
RON/HUF 20.05.18 Forward Eladás	2020.05.18.	13 500 000	69,920	72,8521	-39 583 350	HUF	2020.04.30.
RON/HUF 20.06.17 Forward Eladás	2020.06.17.	13 100 000	69,570	72,7726	-41 954 060	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	2 800 000	341,230	354,6302	-37 520 560	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.06.18 Forward Vétel	2020.06.18.	4 234 000	342,630	353,7208	46 958 447	HUF	2020.04.30.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 20.06.18 Forward Vétel	2020.06.18.	2 253 000	344,930	353,7208	19 805 672	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	310 000	304,610	324,7238	-6 235 278	HUF	2020.04.30.
GBP/HUF 20.09.24 Forward Eladás	2020.09.24.	626 000	382,950	405,2135	-13 936 951	HUF	2020.04.30.
PLN/HUF 20.07.06 Forward Eladás	2020.07.06.	13 200 000	79,430	77,7937	-21 599 160	HUF	2020.04.30.
TRY/HUF 20.07.07 Forward Eladás	2020.07.07.	3 300 000	45,490	45,8088	-1 052 040	HUF	2020.04.30.
PLN/HUF 20.05.11 Forward Vétel	2020.05.11.	39 062 000	79,038	77,7347	-50 909 505	HUF	2020.04.30.
PLN/HUF 20.05.11 Forward Vétel	2020.05.11.	39 307 000	78,913	77,7347	-46 315 438	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.07.14 Forward Eladás	2020.07.14.	5 000 000	329,840	324,6403	-25 998 500	HUF	2020.04.30.
TRY/HUF 20.07.14 Forward Eladás	2020.07.14.	4 750 000	46,830	45,7449	5 154 225	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.06.16 Forward Vétel	2020.06.16.	57 000	352,450	353,6918	70 783	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	16 000 000	331,520	324,8493	106 731 200	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	1 300 000	358,210	355,0900	4 056 000	HUF	2020.04.30.
PLN/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	5 100 000	78,640	77,9226	3 658 740	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.06.30 Forward Vétel	2020.06.30.	3 620 000	329,620	324,5731	-18 269 778	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.06.30 Forward Vétel	2020.06.30.	1 231 000	328,815	324,5731	-5 221 779	HUF	2020.04.30.
CZK/HUF 20.06.05 Forward Vétel	2020.06.05.	291 000	13,041	13,0210	-5 820	HUF	2020.04.30.
EUR/HUF 20.08.05 Forward Eladás	2020.08.05.	4 000 000	353,493	354,2233	-2 919 600	HUF	2020.04.30.
EURO STOXX BANK Jun20 Vétel	2020.06.19.	423	56,245	55,0000	-9 292 989	HUF	2020.04.30.
Összesen					-656 081 099	HUF	2020.04.30.
USD/HUF 20.11.16 Forward Eladás	2020.11.16.	1 350 000	307,470	313,9591	-8 760 285	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	8 000 000	338,816	348,6966	-79 044 800	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.06.24 Forward Eladás	2020.06.24.	7 500 000	338,720	348,6966	-74 824 500	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.08.26 Forward Eladás	2020.08.26.	7 000 000	311,140	313,7881	-18 536 700	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	1 000 000	299,060	314,0338	-14 973 800	HUF	2020.05.29.
RON/HUF 20.06.17 Forward Eladás	2020.06.17.	13 100 000	69,570	71,8588	-29 983 280	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	2 800 000	341,230	349,7133	-23 753 240	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.06.18 Forward Vétel	2020.06.18.	4 234 000	342,630	348,6166	25 347 264	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.06.18 Forward Vétel	2020.06.18.	2 253 000	344,930	348,6166	8 305 910	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	310 000	304,610	313,9012	-2 880 272	HUF	2020.05.29.
GBP/HUF 20.09.24 Forward Eladás	2020.09.24.	626 000	382,950	386,1610	-2 010 086	HUF	2020.05.29.
PLN/HUF 20.07.06 Forward Eladás	2020.07.06.	13 200 000	79,430	78,3536	14 208 480	HUF	2020.05.29.
TRY/HUF 20.07.07 Forward Eladás	2020.07.07.	3 300 000	45,490	45,5766	-285 780	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.07.14 Forward Eladás	2020.07.14.	5 000 000	329,840	313,6412	80 994 000	HUF	2020.05.29.
TRY/HUF 20.07.14 Forward Eladás	2020.07.14.	4 750 000	46,830	45,5156	6 243 400	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.18 Forward Eladás	2020.08.18.	770 000	355,360	349,3357	4 638 711	HUF	2020.05.29.
RON/HUF 20.08.19 Forward Eladás	2020.08.19.	13 500 000	72,450	71,6916	10 238 400	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.19 Forward Eladás	2020.08.19.	4 000 000	354,900	349,3478	22 208 800	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.06.16 Forward Vétel	2020.06.16.	57 000	352,450	348,5899	-220 026	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	16 000 000	331,520	313,8916	282 054 400	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	1 300 000	358,210	349,9951	10 679 370	HUF	2020.05.29.
PLN/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	5 100 000	78,640	78,5311	555 390	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.06.30 Forward Vétel	2020.06.30.	3 620 000	329,620	313,5526	-58 163 988	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.06.30 Forward Vétel	2020.06.30.	1 231 000	328,815	313,5526	-18 788 014	HUF	2020.05.29.
CZK/HUF 20.06.05 Forward Vétel	2020.06.05.	291 000	13,041	12,9113	-37 743	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.05 Forward Eladás	2020.08.05.	4 000 000	353,493	349,1774	17 264 000	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.06 Forward Eladás	2020.08.06.	2 620 000	354,210	349,1895	13 153 710	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.07 Forward Eladás	2020.08.07.	4 000 000	352,430	349,2017	12 913 200	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.10 Forward Eladás	2020.08.10.	4 000 000	350,540	349,2382	5 207 200	HUF	2020.05.29.
PLN/HUF 20.08.11 Forward Vétel	2020.08.11.	39 062 000	77,110	78,4074	50 679 039	HUF	2020.05.29.
PLN/HUF 20.08.11 Forward Vétel	2020.08.11.	39 307 000	77,127	78,4074	50 328 683	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.17 Forward Eladás	2020.08.17.	900 000	354,570	349,3235	4 721 850	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.08.27 Forward Eladás	2020.08.27.	1 000 000	351,620	349,4453	2 174 700	HUF	2020.05.29.
USD/HUF 20.07.02 Forward Vétel	2020.07.02.	265 000	316,950	313,5653	-896 946	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.07.03 Forward Vétel	2020.07.03.	352 000	349,130	348,8166	-110 317	HUF	2020.05.29.
MSCI EmgMkt Jun20 Eladás	2020.06.19.	150	897,670	932,9000	-82 793 729	HUF	2020.05.29.
EURO STOXX BANK Jun20 Vétel	2020.06.19.	450	52,315	57,4000	39 858 204	HUF	2020.05.29.
EURO STOXX BANK Jun20 Vétel	2020.06.19.	450	52,621	57,4000	37 458 075	HUF	2020.05.29.
EURO STOXX BANK Jun20 Vétel	2020.06.19.	423	56,245	57,4000	8 511 931	HUF	2020.05.29.
Összesen					288 646 731	HUF	2020.05.29.
EUR/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	2 800 000	341,230	357,4916	-45 532 480	HUF	2020.06.30.
PLN/HUF 20.07.06 Forward Eladás	2020.07.06.	6 900 000	79,430	79,8443	-2 858 670	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	1 300 000	358,210	357,9531	333 970	HUF	2020.06.30.
PLN/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	5 100 000	78,640	79,9943	-6 906 930	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.05 Forward Eladás	2020.08.05.	4 000 000	353,493	357,0068	-14 053 600	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.06 Forward Eladás	2020.08.06.	2 620 000	354,210	357,0189	-7 359 318	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.07 Forward Eladás	2020.08.07.	4 000 000	352,430	357,0311	-18 404 400	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.10 Forward Eladás	2020.08.10.	4 000 000	350,540	357,0675	-26 110 000	HUF	2020.06.30.
PLN/HUF 20.08.11 Forward Vétel	2020.08.11.	39 062 000	77,110	79,8968	108 857 982	HUF	2020.06.30.
PLN/HUF 20.08.11 Forward Vétel	2020.08.11.	39 307 000	77,127	79,8968	108 872 529	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.17 Forward Eladás	2020.08.17.	900 000	354,570	357,1525	-2 324 250	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.18 Forward Eladás	2020.08.18.	770 000	355,360	357,1646	-1 389 542	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.19 Forward Eladás	2020.08.19.	4 000 000	354,900	357,1768	-9 107 200	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.08.27 Forward Eladás	2020.08.27.	1 000 000	351,620	357,2740	-5 654 000	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.07.03 Forward Vétel	2020.07.03.	352 000	349,130	356,5971	2 628 419	HUF	2020.06.30.
CZK/HUF 20.07.07 Forward Vétel	2020.07.07.	302 000	13,016	13,3002	85 828	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.07.16 Forward Vétel	2020.07.16.	256 000	346,200	356,7641	2 704 410	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.07.20 Forward Vétel	2020.07.20.	4 234 000	346,340	356,8126	44 340 988	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.07.20 Forward Vétel	2020.07.20.	2 350 000	346,440	356,8126	24 375 610	HUF	2020.06.30.
USD/HUF 20.09.29 Forward Eladás	2020.09.29.	5 800 000	314,010	318,1816	-24 195 280	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.09.29 Forward Eladás	2020.09.29.	2 400 000	353,850	357,6185	-9 044 400	HUF	2020.06.30.
USD/HUF 20.07.31 Forward Vétel	2020.07.31.	3 620 000	316,530	317,9881	5 278 322	HUF	2020.06.30.
USD/HUF 20.07.31 Forward Vétel	2020.07.31.	1 489 000	316,680	317,9881	1 947 761	HUF	2020.06.30.
USD/HUF 20.09.30 Forward Eladás	2020.09.30.	5 700 000	317,080	318,1855	-6 301 350	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.10.01 Forward Eladás	2020.10.01.	2 500 000	357,500	357,6415	-353 750	HUF	2020.06.30.
USD/HUF 20.12.02 Forward Vétel	2020.12.02.	265 000	318,680	318,3365	-91 028	HUF	2020.06.30.
PLN/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	10 000 000	78,785	79,9557	-11 707 000	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	2 400 000	351,500	357,6069	-14 656 560	HUF	2020.06.30.
USD/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	5 800 000	310,410	318,1778	-45 053 240	HUF	2020.06.30.
PLN/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	9 000 000	78,825	79,9557	-10 176 300	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.09.25 Forward Eladás	2020.09.25.	1 450 000	349,270	357,5723	-12 038 335	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.09.25 Forward Eladás	2020.09.25.	7 500 000	349,200	357,5723	-62 792 250	HUF	2020.06.30.
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	64,232	62,9000	-47 479 078	HUF	2020.06.30.

Ügylet	lejárát	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	125	999,490	985,7000	27 393 768	HUF	2020.06.30.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	20	3 072,550	3 090,2000	-5 609 699	HUF	2020.06.30.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	120	982,842	985,7000	-5 450 784	HUF	2020.06.30.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	60	3 106,950	3 090,2000	15 970 958	HUF	2020.06.30.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	60	984,483	985,7000	-1 160 080	HUF	2020.06.30.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	20	3 092,313	3 090,2000	671 416	HUF	2020.06.30.
Összesen					-36 684 064	HUF	2020.06.30.
EUR/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	2 800 000	341,230	345,2572	-11 276 160	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	1 300 000	358,210	345,6314	16 352 180	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	5 100 000	78,640	78,2908	1 780 920	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.05 Forward Eladás	2020.08.05.	4 000 000	353,493	344,7975	34 783 600	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.06 Forward Eladás	2020.08.06.	2 620 000	354,210	344,8090	24 630 620	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.07 Forward Eladás	2020.08.07.	4 000 000	352,430	344,8205	30 438 000	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.10 Forward Eladás	2020.08.10.	4 000 000	350,540	344,8550	22 740 000	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.08.11 Forward Vétel	2020.08.11.	39 062 000	77,110	78,2142	43 132 260	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.08.11 Forward Vétel	2020.08.11.	39 307 000	77,127	78,2142	42 734 570	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.17 Forward Eladás	2020.08.17.	900 000	354,570	344,9194	8 685 540	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.18 Forward Eladás	2020.08.18.	770 000	355,360	344,9299	8 031 177	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.19 Forward Eladás	2020.08.19.	4 000 000	354,900	344,9405	39 838 000	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.08.27 Forward Eladás	2020.08.27.	1 000 000	351,620	345,0249	6 595 100	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.09.25 Forward Eladás	2020.09.25.	1 450 000	349,270	345,3312	5 711 260	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.09.25 Forward Eladás	2020.09.25.	7 500 000	349,200	345,3312	29 016 000	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.09.29 Forward Eladás	2020.09.29.	5 800 000	314,010	290,8856	134 121 520	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.09.29 Forward Eladás	2020.09.29.	2 400 000	353,850	345,3735	20 343 600	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.09.30 Forward Eladás	2020.09.30.	5 700 000	317,080	290,8429	149 551 470	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.01 Forward Eladás	2020.10.01.	2 500 000	357,500	345,3607	30 348 250	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.12.02 Forward Vétel	2020.12.02.	265 000	318,680	291,0214	-7 329 529	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.10.05 Forward Eladás	2020.10.05.	6 000 000	314,950	290,8571	144 557 400	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.05 Forward Eladás	2020.10.05.	1 690 000	354,430	345,4008	15 259 348	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	352 000	355,580	345,4008	-3 583 078	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.10.07 Forward Eladás	2020.10.07.	6 900 000	78,680	78,2694	2 833 140	HUF	2020.07.31.
CZK/HUF 20.11.09 Forward Vétel	2020.11.09.	305 000	13,250	13,1896	-18 422	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.10.16 Forward Eladás	2020.10.16.	1 620 000	313,320	290,8883	36 339 354	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.19 Forward Vétel	2020.10.19.	256 000	355,000	345,5411	-2 421 478	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	3 620 000	294,120	290,8571	-11 811 698	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	1 189 000	294,180	290,8571	-3 950 928	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	1 000 000	299,320	290,8820	8 438 000	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	10 000 000	78,785	78,2628	5 222 000	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	2 400 000	351,500	345,3629	14 729 040	HUF	2020.07.31.
USD/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	5 800 000	310,410	290,8820	113 262 400	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	9 000 000	78,825	78,2628	5 059 800	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.20 Forward Vétel	2020.10.20.	4 234 000	354,945	345,5512	-39 773 349	HUF	2020.07.31.
EUR/HUF 20.10.20 Forward Vétel	2020.10.20.	2 805 000	355,210	345,5512	-27 092 934	HUF	2020.07.31.
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	69,288	59,0000	-354 673 683	HUF	2020.07.31.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	125	999,490	1 069,3000	-126 822 228	HUF	2020.07.31.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	20	3 072,550	3 263,5000	-55 503 436	HUF	2020.07.31.
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	66,844	59,0000	-270 403 714	HUF	2020.07.31.
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	64,232	59,0000	-180 352 455	HUF	2020.07.31.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	120	982,842	1 069,3000	-150 785 062	HUF	2020.07.31.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	60	3 106,950	3 263,5000	-136 513 166	HUF	2020.07.31.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	60	984,483	1 069,3000	-73 960 982	HUF	2020.07.31.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	20	3 092,313	3 263,5000	-49 759 071	HUF	2020.07.31.
Összesen					887 276 973	HUF	2020.07.31.
PLN/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	8 000 000	78,785	80,5513	-14 130 400	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	2 400 000	351,500	354,3755	-6 901 200	HUF	2020.08.31.
PLN/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	9 000 000	78,825	80,5513	-15 536 700	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.20 Forward Vétel	2020.10.20.	4 234 000	354,945	354,6236	-1 360 808	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.20 Forward Vétel	2020.10.20.	2 805 000	355,210	354,6236	-1 644 852	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.09.25 Forward Eladás	2020.09.25.	1 450 000	349,270	354,3417	-7 353 965	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.09.25 Forward Eladás	2020.09.25.	7 500 000	349,200	354,3417	-38 562 750	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.09.18 Forward Eladás	2020.09.18.	900 000	341,230	354,2628	-11 729 520	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	1 300 000	358,210	354,7139	4 544 930	HUF	2020.08.31.
PLN/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	5 100 000	78,640	80,5849	-9 918 990	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.09.29 Forward Eladás	2020.09.29.	5 800 000	314,010	297,4061	96 302 620	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.09.29 Forward Eladás	2020.09.29.	2 400 000	353,850	354,3868	-1 288 320	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.09.30 Forward Eladás	2020.09.30.	5 700 000	317,080	297,4098	112 120 140	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.01 Forward Eladás	2020.10.01.	2 500 000	357,500	354,4093	7 726 750	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.12.02 Forward Vétel	2020.12.02.	265 000	318,680	297,5910	-5 588 585	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.10.05 Forward Eladás	2020.10.05.	6 000 000	314,950	297,4281	105 131 400	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.05 Forward Eladás	2020.10.05.	1 690 000	354,430	354,4544	-41 236	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	352 000	355,580	354,4544	-396 211	HUF	2020.08.31.
PLN/HUF 20.10.07 Forward Eladás	2020.10.07.	6 900 000	78,680	80,5614	-12 981 660	HUF	2020.08.31.
CZK/HUF 20.11.09 Forward Vétel	2020.11.09.	305 000	13,250	13,5174	81 557	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.10.16 Forward Eladás	2020.10.16.	1 620 000	313,320	297,4683	25 679 754	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.19 Forward Vétel	2020.10.19.	256 000	355,000	354,6123	-99 251	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	3 620 000	294,120	297,4281	11 975 322	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	1 189 000	294,180	297,4281	3 861 991	HUF	2020.08.31.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	39 062 000	78,650	80,6317	77 409 165	HUF	2020.08.31.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	36 080 000	78,625	80,6317	72 401 736	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.11.24 Forward Eladás	2020.11.24.	4 000 000	349,940	355,0047	-20 258 800	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	5 000 000	353,000	354,3755	-6 877 500	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.27 Forward Eladás	2020.10.27.	5 000 000	353,400	354,7026	-6 513 000	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.11.27 Forward Eladás	2020.11.27.	5 800 000	353,860	355,0381	-6 832 980	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.10.27 Forward Eladás	2020.10.27.	7 000 000	299,390	297,5086	13 169 800	HUF	2020.08.31.
USD/HUF 20.09.28 Forward Eladás	2020.09.28.	1 000 000	299,320	297,4025	1 917 500	HUF	2020.08.31.
US ULTRA BOND CBT Dec20 Eladás	2020.12.21.	33	217,423	220,9063	-34 170 913	HUF	2020.08.31.
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	66,844	61,9000	-175 036 642	HUF	2020.08.31.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	120	982,842	1 100,4000	-209 700 554	HUF	2020.08.31.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	60	3 106,950	3 498,9000	-349 580 205	HUF	2020.08.31.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	60	984,483	1 100,4000	-103 386 075	HUF	2020.08.31.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	20	3 092,313	3 498,9000	-120 878 464	HUF	2020.08.31.
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	64,232	61,9000	-82 550 859	HUF	2020.08.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EURO STOXX BANK Sep20 Vétel	2020.09.18.	2 000	69,288	61,9000	-261 584 839	HUF	2020.08.31.
MSCI EmgMkt Sep20 Eladás	2020.09.18.	125	999,490	1 100,4000	-187 502 651	HUF	2020.08.31.
S&P500 EMINI FUT Sep20 (Erste) Eladás	2020.09.18.	20	3 072,550	3 498,9000	-126 753 855	HUF	2020.08.31.
Összesen					364 305 937	HUF	2020.08.31.
EUR/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	1 300 000	358,210	365,0241	-8 858 330	HUF	2020.09.30.
PLN/HUF 20.10.28 Forward Eladás	2020.10.28.	5 100 000	78,640	80,6007	-9 999 570	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.12.02 Forward Vétel	2020.12.02.	265 000	318,680	311,6920	-1 851 820	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.10.05 Forward Eladás	2020.10.05.	6 000 000	314,950	311,4239	21 156 600	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.10.05 Forward Eladás	2020.10.05.	1 690 000	354,430	364,7115	-17 375 735	HUF	2020.09.30.
PLN/HUF 20.10.07 Forward Eladás	2020.10.07.	6 900 000	78,680	80,5696	-13 038 240	HUF	2020.09.30.
CZK/HUF 20.11.09 Forward Vétel	2020.11.09.	282 000	13,250	13,4267	49 829	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.10.16 Forward Eladás	2020.10.16.	1 620 000	313,320	311,4833	2 975 454	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.10.20 Forward Vétel	2020.10.20.	4 234 000	354,945	364,9172	42 222 295	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.10.20 Forward Vétel	2020.10.20.	2 805 000	355,210	364,9172	27 228 696	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	3 280 000	294,120	311,4239	56 756 792	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.10.05 Forward Vétel	2020.10.05.	1 189 000	294,180	311,4239	20 502 997	HUF	2020.09.30.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	34 243 000	78,650	80,6647	68 989 372	HUF	2020.09.30.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	36 080 000	78,625	80,6647	73 592 376	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.24 Forward Eladás	2020.11.24.	4 000 000	349,940	365,3851	-61 780 400	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.10.27 Forward Eladás	2020.10.27.	5 000 000	353,400	365,0107	-58 053 500	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.27 Forward Eladás	2020.11.27.	5 800 000	353,860	365,4253	-67 078 740	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.10.27 Forward Eladás	2020.10.27.	7 000 000	299,390	311,5405	-85 053 500	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.23 Forward Eladás	2020.11.23.	900 000	361,550	365,3718	-3 439 620	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	1 450 000	364,780	365,4476	-968 020	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	7 500 000	364,820	365,4476	-4 707 000	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	2 400 000	363,400	365,4476	-4 914 240	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	5 000 000	363,400	365,4476	-10 238 000	HUF	2020.09.30.
PLN/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	12 500 000	79,815	80,6487	-10 421 250	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	5 800 000	312,590	311,6828	5 261 760	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	2 400 000	364,100	365,4476	-3 234 240	HUF	2020.09.30.
EUR/HUF 20.12.02 Forward Eladás	2020.12.02.	2 500 000	365,530	365,4738	140 500	HUF	2020.09.30.
MSCI EmgMkt Dec20 Eladás	2020.12.18.	305	1 104,280	1 088,5000	74 938 411	HUF	2020.09.30.
S&P500 EMINI FUT Dec20 (Erste) Eladás	2020.12.18.	100	3 379,300	3 352,0000	42 506 100	HUF	2020.09.30.
EURO STOXX BANK Dec20 Vétel	2020.12.18.	6 000	59,940	54,6000	-584 169 300	HUF	2020.09.30.
Összesen					-42 135 534	HUF	2020.09.30.
USD/HUF 20.12.02 Forward Vétel	2020.12.02.	265 000	318,680	315,2161	-917 934	HUF	2020.10.30.
CZK/HUF 20.11.09 Forward Vétel	2020.11.09.	282 000	13,250	13,4710	62 322	HUF	2020.10.30.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	34 243 000	78,650	79,6704	34 941 557	HUF	2020.10.30.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	36 080 000	78,625	79,6704	37 718 032	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.24 Forward Eladás	2020.11.24.	4 000 000	349,940	368,0851	-72 580 400	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.27 Forward Eladás	2020.11.27.	5 800 000	353,860	368,1253	-82 738 740	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.23 Forward Eladás	2020.11.23.	900 000	361,550	368,0717	-5 869 530	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	1 450 000	364,780	368,1656	-4 909 120	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	7 500 000	364,820	368,1656	-25 092 000	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	2 400 000	363,400	368,1656	-11 437 440	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	5 000 000	363,400	368,1656	-23 828 000	HUF	2020.10.30.
PLN/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	12 500 000	79,815	79,6546	2 005 000	HUF	2020.10.30.
USD/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	5 800 000	312,590	315,2054	-15 169 320	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.11.30 Forward Eladás	2020.11.30.	2 400 000	364,100	368,1656	-9 757 440	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.12.02 Forward Eladás	2020.12.02.	2 500 000	365,530	368,1924	-6 656 000	HUF	2020.10.30.
USD/HUF 21.01.05 Forward Vétel	2021.01.05.	3 280 000	307,285	315,3648	26 501 744	HUF	2020.10.30.
USD/HUF 21.01.05 Forward Vétel	2021.01.05.	1 189 000	307,480	315,3648	9 375 027	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	1 690 000	359,500	368,2595	-14 803 555	HUF	2020.10.30.
USD/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	6 000 000	306,430	315,2427	-52 876 200	HUF	2020.10.30.
PLN/HUF 20.12.08 Forward Eladás	2020.12.08.	6 900 000	80,210	79,6661	3 752 910	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.12.09 Forward Eladás	2020.12.09.	1 000 000	360,270	368,2863	-8 016 300	HUF	2020.10.30.
USD/HUF 21.01.19 Forward Eladás	2021.01.19.	1 620 000	311,460	315,4327	-6 435 774	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 21.02.22 Forward Vétel	2021.02.22.	4 149 000	366,195	369,2794	12 797 176	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 21.02.22 Forward Vétel	2021.02.22.	2 805 000	366,340	369,2794	8 245 017	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 21.01.28 Forward Eladás	2021.01.28.	5 000 000	366,540	368,9465	-12 032 500	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 21.01.29 Forward Eladás	2021.01.29.	1 300 000	366,390	368,9598	-3 340 740	HUF	2020.10.30.
PLN/HUF 21.01.29 Forward Eladás	2021.01.29.	5 100 000	79,680	79,7408	-310 080	HUF	2020.10.30.
S&P500 EMINI FUT Dec20 (Erste) Eladás	2020.12.18.	100	3 379,300	3 264,7000	180 517 920	HUF	2020.10.30.
EURO STOXX BANK Dec20 Vétel	2020.12.18.	6 000	59,940	53,4000	-721 525 500	HUF	2020.10.30.
Összesen					-221 372 288	HUF	2020.10.30.
EUR/HUF 20.12.02 Forward Eladás	2020.12.02.	2 500 000	365,530	360,1107	13 548 250	HUF	2020.11.30.
USD/HUF 21.01.05 Forward Vétel	2021.01.05.	3 280 000	307,285	300,6292	-21 831 024	HUF	2020.11.30.
USD/HUF 21.01.05 Forward Vétel	2021.01.05.	1 189 000	307,480	300,6292	-8 145 601	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	1 690 000	359,500	360,1625	-1 119 625	HUF	2020.11.30.
USD/HUF 20.12.07 Forward Eladás	2020.12.07.	6 000 000	306,430	300,4713	35 752 200	HUF	2020.11.30.
PLN/HUF 20.12.08 Forward Eladás	2020.12.08.	6 900 000	80,210	80,4276	-1 501 440	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 20.12.09 Forward Eladás	2020.12.09.	1 000 000	360,270	360,1833	86 700	HUF	2020.11.30.
USD/HUF 21.01.19 Forward Eladás	2021.01.19.	1 620 000	311,460	300,6989	17 432 982	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.02.22 Forward Vétel	2021.02.22.	4 149 000	366,195	361,1934	-20 751 638	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.02.22 Forward Vétel	2021.02.22.	2 805 000	366,340	361,1934	-14 436 213	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.01.28 Forward Eladás	2021.01.28.	5 000 000	366,540	360,8778	28 311 000	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.01.29 Forward Eladás	2021.01.29.	1 300 000	366,390	360,8912	7 148 440	HUF	2020.11.30.
PLN/HUF 21.01.29 Forward Eladás	2021.01.29.	5 100 000	79,680	80,5071	-4 218 210	HUF	2020.11.30.
CZK/HUF 20.12.09 Forward Vétel	2020.12.09.	282 000	13,420	13,7607	96 077	HUF	2020.11.30.
CZK/HUF 20.12.28 Forward Vétel	2020.12.28.	24 000	13,787	13,7648	-533	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.02.26 Forward Eladás	2021.02.26.	5 800 000	362,080	361,2460	4 837 200	HUF	2020.11.30.
PLN/HUF 21.03.01 Forward Eladás	2021.03.01.	12 500 000	80,620	80,5501	873 750	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.02.01 Forward Eladás	2021.02.01.	9 900 000	363,040	360,9173	21 014 730	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.02.01 Forward Eladás	2021.02.01.	2 400 000	362,970	360,9173	4 926 480	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.02.01 Forward Eladás	2021.02.01.	1 450 000	362,970	360,9173	2 976 415	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.03.02 Forward Vétel	2021.03.02.	536 000	360,490	361,2986	433 410	HUF	2020.11.30.
USD/HUF 20.12.02 Forward Vétel	2020.12.02.	265 000	318,680	300,4561	-4 829 334	HUF	2020.11.30.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	34 243 000	78,650	80,4304	60 966 237	HUF	2020.11.30.
PLN/HUF 20.12.11 Forward Vétel	2020.12.11.	36 080 000	78,625	80,4304	65 138 832	HUF	2020.11.30.
S&P500 EMINI FUT Dec20 (Erste) Eladás	2020.12.18.	100	3 379,300	3 623,2000	-366 398 775	HUF	2020.11.30.
EURO STOXX BANK Dec20 Vétel	2020.12.18.	3 690	59,940	74,2000	947 385 987	HUF	2020.11.30.
US ULTRA BOND CBT Mar21 Eladás	2021.03.22.	6	215,563	216,0313	-845 016	HUF	2020.11.30.

Ügylet	lejárát	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
Összesen					186 709 085	HUF	2020.11.30.
EUR/HUF 21.03.16 Forward Vétel	2021.03.16.	593 000	354,720	366,1325	6 767 613	HUF	2020.12.31.
CZK/HUF 21.03.29 Forward Vétel	2021.03.29.	29 000	13,789	13,8832	2 732	HUF	2020.12.31.
USD/HUF 21.02.04 Forward Vétel	2021.02.04.	180 000	297,220	297,5352	56 736	HUF	2020.12.31.
USD/HUF 21.01.05 Forward Vétel	2021.01.05.	3 280 000	307,285	297,3717	-32 515 624	HUF	2020.12.31.
USD/HUF 21.01.05 Forward Vétel	2021.01.05.	1 189 000	307,480	297,3717	-12 018 769	HUF	2020.12.31.
USD/HUF 21.01.19 Forward Eladás	2021.01.19.	1 620 000	311,460	297,4551	22 687 938	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.22 Forward Vétel	2021.02.22.	4 149 000	366,195	365,8487	-1 436 799	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.22 Forward Vétel	2021.02.22.	2 112 000	366,340	365,8487	-1 037 626	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.01.28 Forward Eladás	2021.01.28.	5 000 000	366,540	365,5095	5 152 500	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.01.29 Forward Eladás	2021.01.29.	1 300 000	366,390	365,5231	1 126 970	HUF	2020.12.31.
PLN/HUF 21.01.29 Forward Eladás	2021.01.29.	5 100 000	79,680	79,3315	1 777 350	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.26 Forward Eladás	2021.02.26.	5 800 000	362,080	365,9030	-22 173 400	HUF	2020.12.31.
PLN/HUF 21.03.01 Forward Eladás	2021.03.01.	12 500 000	80,620	79,3759	15 551 250	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.01 Forward Eladás	2021.02.01.	9 900 000	363,040	365,5638	-24 985 620	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.01 Forward Eladás	2021.02.01.	2 400 000	362,970	365,5638	-6 225 120	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.01 Forward Eladás	2021.02.01.	1 450 000	362,970	365,5638	-3 761 010	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.03.02 Forward Vétel	2021.03.02.	536 000	360,490	365,9452	2 923 987	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.03 Forward Eladás	2021.02.03.	2 500 000	358,020	365,5909	-18 927 250	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.08 Forward Eladás	2021.02.08.	1 690 000	359,180	365,6587	-10 949 003	HUF	2020.12.31.
PLN/HUF 21.02.09 Forward Eladás	2021.02.09.	6 900 000	80,398	79,3473	7 249 830	HUF	2020.12.31.
CZK/HUF 21.04.09 Forward Vétel	2021.04.09.	287 000	13,601	13,8849	81 393	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.02.10 Forward Eladás	2021.02.10.	1 000 000	361,160	365,6859	-4 525 900	HUF	2020.12.31.
PLN/HUF 21.01.11 Forward Vétel	2021.01.11.	34 243 000	80,465	79,2981	-39 958 157	HUF	2020.12.31.
PLN/HUF 21.01.11 Forward Vétel	2021.01.11.	40 135 000	80,536	79,2981	-49 683 116	HUF	2020.12.31.
EUR/HUF 21.06.14 Forward Eladás	2021.06.14.	8 000 000	357,950	367,2992	-74 793 600	HUF	2020.12.31.
USD/HUF 21.06.14 Forward Eladás	2021.06.14.	5 000 000	293,530	298,0439	-22 569 500	HUF	2020.12.31.
US ULTRA BOND CBT Mar21 Eladás	2021.03.22.	7	214,500	213,5625	1 951 425	HUF	2020.12.31.
US ULTRA BOND CBT Mar21 Eladás	2021.03.22.	6	215,563	213,5625	3 568 200	HUF	2020.12.31.
Összesen					-262 182 195	HUF	2020.12.31.

Az Alapkezelő napi elszámolású Futures ügyleteket köt, amelynek értelés napi eredménye a követelés vagy kötelezettségek között kerül kimutatásra. Jelen táblázatban szereplő, még le nem zárt származékos ügyletek esetén kimutatott eredmény a 2020.12.31-ig számított időarányos eredményt mutatja, pénzügyi rendezéstől függetlenül.

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

Az Alapkezelő működésében a 2020-as évben a következő fontosabb változások következtek be. Az Alapkezelő Felügyelőbizottságában 2020. július 7-én Olaf Adriaan Wilhelmus Johannes van den Heuvel került megválasztásra felügyelőbizottsági tagként. Az Alapkezelő Felügyelőbizottságának elnöki pozícióját 2020. július 29-től Jane Daniel tölti be. Az Alapkezelő befektetési igazgatói pozícióját Loncsák András látja el, aki közvetlenül az Alapkezelő vezérigazgatójának jelent.

A fenti változások nem érintették az alap befektetési politikáját, az a 2020-as évben nem változott.

2019 végén láttak napvilágot az első hírek a Kínában megjelent Covid-19-ről (Koronavírusról). 2020 első néhány hónapjában a vírus globálisan is elterjedt és több hullámban érezteti mind a társadalomra, mind pedig a gazdaságra gyakorolt hatását. Ugyan 2020 év végén már megjelentek és elérhetővé váltak szűk körben vakcinák, a tömeges oltások elterjedése várhatólag 2021 folyamán fog megtörténni. A pénz- és tőkepiaci folyamatokat 2020 folyamán leginkább a koronavírus következményei befolyásolták, s várhatóan a pandémia hatásai kihatnak a 2021-es évre is. Az Aegon Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. működése és befektetési döntéshozatala során mindvégig kiemelt figyelmet fordított, és fordít a jövőben is a koronavírus piaci hatásainak értékelésére. Az éves jelentés összeállításakor nem ismert olyan tény amely megkérdőjelezné az Alap jövőben való fennmaradását.

A pénz- és tőkepiaci folyamatokat 2020 folyamán leginkább a koronavírus következményei befolyásolták, s AEGON MAGYARORSZÁG BEFEKTETÉSI ALAPKEZELŐ ZRT.

várhatóan a pandémia hatásai kihatnak a 2021-es évre is. Az Aegon Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. működése és befektetési döntéshozatala során mindvégig kiemelt figyelmet fordított, és fordít a jövőben is a koronavírus piaci hatásainak értékelésére. Az éves jelentés összeállításakor nem ismert olyan tény amely megkérdőjelezné az Alap jövőben való fennmaradását.

Az Alap befektetési politikájával összhangban, a portfolióban részvények, hazai diszkont kincstárjegyek, illetve rövid és hosszú lejáratú forintban és devizában kibocsátott államkötvények, vállalati kötvények, átváltható kötvények és származtatott termékek vannak. Az Alap összetételében történt változásokat a különböző piaci lehetőségek kiaknázásának célja indokolta.

IX. A befektetési alapkezelő által kifizetett javadalmazás

a)- b) a javadalmazás teljes összege, az alkalmazottak számára kifizetett rögzített és változó javadalmazás szerinti, valamint munkavállalói kategóriánkénti bontásban, a kedvezményezettek számának megjelölésével

	Javadalmazás teljes összege	ABA kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakorló személyek (ideértve ügyvezetők)
Létszámadatok (fő)	57	6
Rögzített	634 224 470	196 047 892
Változó	73 635 862	37 520 755
Nyereségrészesedés	0	0

c) javadalmazások és juttatások kiszámításának módja

A bónusz rendszer a menedzsment tagjai, a nem junior vagyongazdálkodók és elemzők, az értékesítési terület tapasztalt kollégái, a kockázatkezelési vezető, projektmenedzser valamint a pénzügyi vezető számára személyre szabott feltételek szerint kívánja díjazni a kiváló teljesítményeket. A fenti területeken dolgozó munkavállalók besorolása alapján a maximális kifizethető bónusz az éves jövedelem 45 és 100 százaléka között mozoghat. A személyre szabott célok meghatározása az elnök-vezérigazgató feladata, amit az Azonosított Munkavállalók esetében a Kockázatkezelési Vezető is ellenőriz. A Vezérigazgató és a Kockázatkezelési Vezető feladatkiírását a Felügyelő Bizottság és/vagy az Aegon Asset Management képviselője hagyja jóvá. A célok teljesülésének megítélése, ellenőrzése és jóváhagyása a fentiekkel összhangban történik.

A bónuszként kifizethető összegek meghatározásakor az egyéni célok elérése mellett további kontrollt jelent az Aegon Asset Management javadalmazási bizottsága által meghatározott feltételrendszer alapján kiszámított és általuk jóváhagyott bónusz keret mennyisége.

d) javadalmazási politika felülvizsgálatának eredménye

A belső ellenőrzés a javadalmazási politika éves felülvizsgálata nem tett megállapítást, mindent az előírásoknak megfelelőnek talált. Az ellenőri jelentésről az Alapkezelő Felügyelő Bizottsága is tájékoztatva lett.

e) javadalmazási politika érdemi változásai

A javadalmazási politikában a tárgyévben jelentős változás nem történt.

X. Az ABAK – ide nem értve a 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-ot – által kezelt minden uniós ABA és minden, általa az EGT-államokban forgalmazott 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 9,18%.

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:

Alap neve	Alap alapdevizája	javasolt minimális befektetési időtáv (A sorozat)	kockázati besorolás
Aegon Alfa 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 komoly kockázatvállalás és derivatív pozíciók aktív használata mellett jelentős hozamhoz juttassa a befektetőket.

Az Alap az összes igénybe vehető befektetési eszközt - hazai és külföldi kötvényt, részvényt és egyéb értékpapírokat, indexeket és devizákat - hajlandó megvásárolni, vagy eladni, amennyiben komoly nyereséglehetőséget lát. Ebből a szempontból az alap opportunisztikus, megközelítésében a multistratégiát követő alapok közé sorolandó.

Az alap benchmarkja 100% RMAX.

Az Alap származékos ügyleteket használ fedezeti célból, valamint 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 és megfelelési feladatok ellátására külön szervezeti részleget hoz létre, melynek működéséért a kockázatkezelési és megfelelési vezető felelős. A részlegen belül 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 limitrendszert működtet, melyben külön alrendszerekben figyeli az egyes tranzakciók megkötésére, az egyes partnerek felé irányuló kitettségre 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 kitettsége 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 egyes sorozatainak az alapdevizával szembeni devizakockázatának csökkentése céljából is kötött fedezeti ügyleteket. Az Alap teljes nettósított kockázati kitettsége 2020.12.31-én a következő: 1,02.

XII. Eredménykimutatás

Aegon Alfa Abszolút Hozamú Befektetési Alap

	Előző év	Tárgyév
	eFt	eFt
I. Pénzügyi műveletek bevételei	9 205 121	13 297 221
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	5 158 272	8 935 224
III. Egyéb bevételek	953	3 643
IV. Működési költségek	2 279 447	946 681
V. Egyéb ráfordítások	30 738	20 608
VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.-VI.)	1 737 617	3 398 351

Az Alap 2020. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.