

**AEGON Alfa Származtatott
Befektetési Alap**
2013. Éves jelentés

Tartalomjegyzék

Független könyvvizsgálói jelentés

Éves jelentés

Független könyvvizsgálói jelentés

Az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. részére

1.) Elvégeztük az AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban „az Alap”) mellékelt 2013. évi éves jelentés V. és IX. pontjaiban található számviteli információinak a könyvvizsgálatát.

A vezetés felelőssége az éves jelentésért

2.) Az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. ügyvezetése (továbbiakban „vezetés”) felelős ennek az éves jelentésnek a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. törvénnyel (továbbiakban „a Törvény”) összhangban történő elkészítéséért, beleértve a Törvény 107. § (1) bekezdésében előírt információkat és az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által adott 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

3.) A Törvény 110. § (1) bekezdésével összhangban a mi felelősségünk az éves jelentésben közölt számviteli információknak véleményezése könyvvizsgálatunk alapján, és annak vizsgálata, hogy az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárral alátámasztottak-e, valamint az adott időszaki kezelési költségek elszámolása a letétkezelő által adott értékelés alapján történt-e. Könyvvizsgálatunkat a magyar Nemzeti Könyvvizsgálói Standardok és a könyvvizsgálatra vonatkozó - Magyarországon érvényes - törvények és egyéb jogszabályokkal összhangban hajtottuk végre. Ezek a standardok megkövetelik, hogy megfeleljünk az etikai követelményeknek, valamint hogy a könyvvizsgálatot úgy tervezzük meg és hajtsuk végre, hogy kellő bizonyosságot szerezzünk arról, hogy az éves jelentés mentes-e a lényeges hibás állításoktól.

4.) A könyvvizsgálat magában foglalja olyan eljárások végrehajtását, amelyek célja könyvvizsgálói bizonyítékot szerezni az éves jelentésben közölt számviteli információkról. A kiválasztott eljárások - beleértve az éves jelentés akár csalásból, akár hibából eredő, lényeges hibás állításai kockázatainak felmérését is, a könyvvizsgáló megítélésétől függenek. A kockázatok ilyen felmérésekor az éves jelentés gazdálkodó egység általi elkészítése és valós bemutatása szempontjából releváns belső kontrollt azért mérlegeljük, hogy olyan könyvvizsgálói eljárásokat tervezzük meg, amelyek az adott körülmények között megfelelőek, de nem azért, hogy a gazdálkodó egység belső kontrolljának hatékonyságára vonatkozóan véleményt mondjunk. A könyvvizsgálat magában foglalja továbbá az alkalmazott számviteli politikák megfelelőségének és a vezetés által készített számviteli becslések ésszerűségének, valamint az éves jelentés átfogó bemutatásának értékelését.

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

Vélemény

6.) Véleményünk szerint az AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap 2013. december 31-ével végződő évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. törvénnyel összhangban kerültek bemutatásra, az éves jelentésben szereplő eszközök és kötelezettségek a leltárral alátámasztottak, az éves jelentésben bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

Egyéb kérdések

7.) Könyvvizsgálatunk kizárólag az első bekezdésben hivatkozott számviteli információkra vonatkozott, és nem tartalmazta az éves jelentésben bemutatott egyéb információk vizsgálatát.

Budapest, 2014. április 25.



Szabó Gergely
Ernst & Young Kft.
Nyilvántartásba-vételi szám: 001165



Mészáros Péter
Kamarai tag könyvvizsgáló
Kamarai tagsági szám: 005805

AEGON ALFA SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP

2013. ÉVES JELENTÉS

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2011. évi CXCVIII. Törvény (a továbbiakban: Batv.) 106. § és 107. § alapján készítette az Alap 2013. 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.aegonalapkezelo.hu).

Budapest, 2014. április 25.



Kocsis Bálint
vezérigazgató



Kadocsa Péter
elnök-vezérigazgató

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

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL

Az Alap elnevezése:

AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap

Az Alap rövid neve:

AEGON Alfa Alap

Az Alap lajstromszáma:

1111-171

Az Alap fajtája

nyíltvégű

Az Alap típusa

nyilvános

A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa

AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap „A”	HU0000703970
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap „B”	HU0000708318
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap „R”	HU0000712286

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) 476-20-42

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

Vezető forgalmazó adatai AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
1091 Budapest, Üllői út 1.

A megbízott könyvvizsgáló társaság adatai Ernst & Young Kft.
1132 Budapest, Váci út 20.
Cégjegyzékszám: 01-09-267553
Nyilvántartásba vételi szám: 001165

Az Ernst & Young munkatársának adatai Mészáros Péter
Kamarai tagsági szám: 005805
Lakcím: 1222 Budapest, Kötélgyártó u. 4.

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

Megnevezés	2012.12.28.		2013.12.31.	
	Összeg / érték (HUF)	A NEE százalékában (%)	Összeg / érték (HUF)	A NEE százalékában (%)
Banki egyenlegek	329 745 628	2,95	87 266 751	0,42
Repo	9 612 300	0,09	223 342 502	1,08
Átruházható értékpapírok	11 201 209 652	100,08	20 078 255 382	96,80
Származékos ügyletek	-142 493 169	-1,27	148 238 159	0,71
Egyéb eszközök	69 016 165	0,62	455 377 390	2,20
Összes eszköz	11 467 090 576	102,46	20 992 480 184	101,21
Kötelezettségek	-275 045 474	-2,46	-251 138 208	-1,21
Nettó eszközérték	11 192 045 102	100,00	20 741 341 976	100,00

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

A számviteli nyilvántartások alapján számított nettó eszközérték 20 501 263 989 HUF. Az eltérés abból adódik, hogy a letétkezelő által számított NAV 2014. január 2-án készült, ezen a napon rendelkezésre álló információk alapján, míg a számviteli eszközérték a mérleg fordulónap és az éves jelentés összeállításáig között ismertté vált, fordulónapra vonatkozó legfrissebb árfolyam-információkat is tartalmazza. Ezen információk a rendelkezésre állásukat követően a hivatalos nettó eszközértékben is megjelennek.

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2012.12.28.	2013.12.31.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	3 307 227 425	5 527 162 669
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	33 140 731	55 805 915
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	-	150 772 105

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2012.12.28.	2013.12.31.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	2.05353	2.250079
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	1.857117	2.038152
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	-	1.067427

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Nevnevezés	2012.12.28.		2013.12.31.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	-83 000 000	-0,74	512 500 000	2,55
Részvény - Belföld - Biztosítók és Nyugdíjpénztárak	-	0,00	212 401 706	1,06
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	1 429 993 170	12,77	2 112 228 762	10,52
Részvény - Egyéb külföld	818 253 344	7,31	1 787 316 058	8,90
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	403 346 250	3,60	200 315 430	1,00
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	2 568 592 764	22,93	4 824 761 956	24,03
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen	-	0,00	-	0,00
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen	-	0,00	-	0,00
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	162 563 727	1,45	522 024 473	2,60
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 565 717 326	13,98	1 517 909 192	7,56
Egyéb átruházható értékpapírok	1 728 281 054	15,43	2 039 933 666	10,16
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	4 581 175 571	40,90	5 562 352 946	27,70
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	1 139 213 061	10,17	6 397 565 348	31,86
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők	619 798 298	5,53	-	0,00
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	276 540 379	2,47	1 253 641 466	6,24
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények	287 608 526	2,57	-	0,00
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	6 904 335 834	61,64	13 213 559 760	65,81
Értékpapírok összesen	11 201 209 652	100,00	20 078 255 382	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	2013
Pénzintézettől kapott kamatok	1 197
Diszkont kincstárjegyek árnyeresége	104 951
Deviza árfolyamváltozással kapcsolatos nyereség	4
Pénzeszközök év végi átértékeléséből származó nyereség	115 104
Részvények ár- és árfolyamnyeresége	1 604 193
Kötvények ár- és árfolyamnyeresége	753 242
Repo ügyletek kamata	10 418
Értékpapírok felhalmozott kamata	-93 581
Kamatkozó papírok kapott kamata	328 198
Kapott osztalék	130 833
Származékos ügyletek nyeresége	1 382 881
Értékpapír kölcsön bevétele	5 144
Értékpapír kölcsönzés díjbevétele	100
Összesen:	4 342 687

Az Alap 2013. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

	adatok eFt-ban
Pénzügyi műveletek ráfordításai	2013
Kötvények ár- és árfolyamvesztesége	65 497
Részvények ár- és árfolyamvesztesége	1 326 206
Fizetett kamat	65
Értékpapír kölcsönzés ráfordítása	4 562
Értékpapír kölcsönzés díja	8 850
Opció díj	23 122
Származékos ügyletek vesztesége	1 300 830
Deviza árfolyamváltozással kapcsolatos veszteség	414
Összesen:	2 729 545

Az Alap 2013. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alapnál 2013-ban Egyéb ráfordításként 128 eFt díj túlfizetést, valamint kerekítési különbözeteket könyveltünk el (1 eFt). Egyéb bevételként szintén kerekítési különbözeteket (3 eFt), illetve büntető jutalékot számoltunk el (1 eFt).

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

adatok eFt-ban	
Működési költségek	2013
Alapkezelői díj	213 075
Letétkezelői díj	12 382
Könyvvizsgálói díj	3 990
Közzétételi díjak	0
Megbízási díj	92 767
KELER díj	503
Felügyeleti díj	3 745
Bankköltség	465
Fizetendő sikerdíj	145 204
Főforgalmazói jutalék	9 027
Forgalmazói jutalék	87 500
Tranzakciós díjak	5 446
Összesen:	574 103

Az Alap 2013. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

adatok eFt-ban		
Tőkenövekmény:	2012	2013
visszavásárolt bef.jegyek bevonási értékkülönbözete	65 625	4 227 698
értékelési különbözetéből	590 387	792 161
előző évek eredményből	3 576 625	5 055 904
üzleti év eredményéből	1 479 280	1 038 913
Összesen:	5 711 916	11 114 676

Az Alap 2013. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Felosztott és újra befektetett jövedelemmel az alap nem rendelkezett 2013-ban.

VI. A NETTÓ ESZKÖZÉRTÉKNEK ÉS AZ EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉNEK A 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 Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	11 509 306 056	1,835063	2010.12.31.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	9 959 023 622	1,784976	2011.12.30.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	6 791 490 734	2,053530	2012.12.28.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000703970	12 436 552 651	2,250079	2013.12.31.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	6 854 894	1,684139	2010.12.31.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	63 216 387	1,635616	2011.12.30.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	61 546 215	1,857117	2012.12.28.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	B	PLN	HU0000708318	113 740 937	2,038152	2013.12.31.
AEGON Alfa Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712286	160 938 216	1,067427	2013.12.31.

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

VII. SZÁRMAZTATOTT ÜGYLETEK

Ügylet	Lejárati	Nyitott	Zárás	Utolsó ár	Érték	Deviza	Nap
USD/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	4 000 000	221,960	217,1233	19 346 800	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.06.19 Forward Eladás	2013.06.19.	5 339 000	295,500	298,2242	-14 544 504	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.02.28 Forward Eladás	2013.02.28.	800 000	288,930	293,6381	-3 766 480	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.02.28 Forward Eladás	2013.02.28.	900 000	288,550	293,6381	-4 579 290	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.02.28 Forward Eladás	2013.02.28.	1 460 000	285,530	293,6381	-11 837 826	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.02.05 Forward Eladás	2013.02.05.	2 200 000	283,390	292,6057	-20 274 540	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.02.07 Forward Eladás	2013.02.07.	4 000 000	285,020	292,6880	-30 672 000	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	3 000 000	286,480	294,5224	-24 127 200	HUF	2013.01.31.
CZK/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	16 000 000	11,326	11,5008	-2 796 800	HUF	2013.01.31.
CZK/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	9 540 000	11,391	11,5008	-1 047 492	HUF	2013.01.31.
TRY/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	200 000	122,560	122,2782	56 360	HUF	2013.01.31.
CZK/HUF 13.02.28 Forward Eladás	2013.02.28.	9 400 000	11,447	11,4671	-188 940	HUF	2013.01.31.
DAX 1303 Vétel	2013.03.15.	10	817,783 ⁷	7 796,0000	-1 592 362	HUF	2013.01.31.
Összesen					-94 431 912	HUF	2013.01.31.
EUR/HUF 13.06.19 Forward Eladás	2013.06.19.	5 339 000	295,500	300,8884	-28 768 668	HUF	2013.02.28.
CZK/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	16 000 000	11,326	11,5925	-4 264 000	HUF	2013.02.28.
CZK/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	9 540 000	11,391	11,5925	-1 922 310	HUF	2013.02.28.

Forward Eladás							
TRY/HUF 13.03.20 Forward Eladás	2013.03.20.	200 000	122,560	125,7110	-630 200	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.05.06 Forward Eladás	2013.05.06.	2 200 000	295,950	299,0502	-6 820 440	HUF	2013.02.28.
TRY/HUF 13.03.07 Forward Eladás	2013.03.07.	3 000 000	123,170	125,7115	-7 624 500	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.04.08 Forward Eladás	2013.04.08.	4 000 000	294,350	297,9169	-14 267 600	HUF	2013.02.28.
TRY/HUF 13.03.21 Forward Eladás	2013.03.21.	750 000	123,150	125,7105	-1 920 375	HUF	2013.02.28.
PLN/HUF 13.05.28 Forward Vétel	2013.05.28.	8 500 000	70,760	71,5359	6 595 150	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.03.28 Forward Eladás	2013.03.28.	1 500 000	296,590	297,4468	-1 285 200	HUF	2013.02.28.
USD/HUF 13.03.28 Forward Eladás	2013.03.28.	2 000 000	227,030	226,6861	687 800	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.03.28 Forward Eladás	2013.03.28.	1 700 000	296,090	297,4468	-2 306 560	HUF	2013.02.28.
CZK/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	4 000 000	11,648	11,6586	-42 400	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.03.28 Forward Eladás	2013.03.28.	1 500 000	297,370	297,4468	-115 200	HUF	2013.02.28.
USD/HUF 13.03.28 Forward Eladás	2013.03.28.	1 900 000	227,280	226,6861	1 128 410	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	1 460 000	298,570	298,8831	-457 126	HUF	2013.02.28.
Összesen					-62 013 219	HUF	2013.02.28.
EUR/HUF 13.06.19 Forward Eladás	2013.06.19.	5 339 000	295,500	307,6047	-64 626 993	HUF	2013.03.29.
EUR/HUF 13.05.06 Forward Eladás	2013.05.06.	2 200 000	295,950	305,8862	-21 859 640	HUF	2013.03.29.
EUR/HUF 13.04.08 Forward Eladás	2013.04.08.	4 000 000	294,350	304,6781	-41 312 400	HUF	2013.03.29.
CZK/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	4 000 000	11,648	11,8638	-863 200	HUF	2013.03.29.
EUR/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	1 460 000	298,570	305,7192	-10 437 832	HUF	2013.03.29.
TRY/HUF 13.04.08 Forward Eladás	2013.04.08.	3 000 000	127,720	130,8553	-9 405 900	HUF	2013.03.29.
EUR/HUF 13.06.13 Forward Eladás	2013.06.13.	600 000	305,350	307,3630	-1 207 800	HUF	2013.03.29.
TRY/HUF 13.04.22 Forward Eladás	2013.04.22.	1 100 000	130,490	130,8073	-349 030	HUF	2013.03.29.
EUR/HUF 13.05.31 Forward Eladás	2013.05.31.	4 700 000	305,720	306,8392	-5 260 240	HUF	2013.03.29.
USD/HUF 13.05.31 Forward Eladás	2013.05.31.	3 900 000	237,260	239,2770	-7 866 300	HUF	2013.03.29.
TRY/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	1 850 000	129,680	130,7606	-1 999 110	HUF	2013.03.29.
TRY/HUF 13.07.02 Forward Eladás	2013.07.02.	1 200 000	130,300	130,4783	-213 960	HUF	2013.03.29.
CZK/HUF 13.04.22 Forward Eladás	2013.04.22.	25 540 000	11,997	11,8479	3 808 014	HUF	2013.03.29.
TRY/HUF 13.04.22 Forward Eladás	2013.04.22.	600 000	129,830	130,8073	-586 380	HUF	2013.03.29.
TRY/HUF 13.04.22 Forward Eladás	2013.04.22.	750 000	129,830	130,8073	-732 975	HUF	2013.03.29.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	547,800	1 562,7000	884 166	HUF	2013.03.29.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	550,000	1 562,7000	753 618	HUF	2013.03.29.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	549,200	1 562,7000	801 090	HUF	2013.03.29.
Összesen					-162 913 746	HUF	2013.03.29.
EUR/HUF 13.06.19 Forward Eladás	2013.06.19.	5 339 000	295,500	301,9803	-34 598 322	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.05.06 Forward Eladás	2013.05.06.	2 200 000	295,950	300,3161	-9 605 420	HUF	2013.04.30.
CZK/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	4 000 000	11,648	11,6437	17 200	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	1 460 000	298,570	300,1254	-2 270 884	HUF	2013.04.30.

EUR/HUF 13.06.13 Forward Eladás	2013.06.13.	600 000	305,350	301,7463	2 162 220	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.07.25 Forward Eladás	2013.07.25.	2 000 000	302,150	303,2308	-2 161 600	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.05.31 Forward Eladás	2013.05.31.	4 700 000	305,720	301,2392	21 059 760	HUF	2013.04.30.
USD/HUF 13.05.31 Forward Eladás	2013.05.31.	3 900 000	237,260	230,6484	25 785 240	HUF	2013.04.30.
TRY/HUF 13.05.02 Forward Eladás	2013.05.02.	1 850 000	129,680	127,9251	3 246 565	HUF	2013.04.30.
TRY/HUF 13.07.02 Forward Eladás	2013.07.02.	1 200 000	130,300	127,8014	2 998 320	HUF	2013.04.30.
TRY/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	3 000 000	128,910	127,7883	3 365 100	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	4 000 000	303,840	302,6355	4 818 000	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.06.11 Forward Eladás	2013.06.11.	300 000	300,080	301,6683	-476 490	HUF	2013.04.30.
TRY/HUF 13.05.24 Forward Eladás	2013.05.24.	2 450 000	126,900	127,8878	-2 420 110	HUF	2013.04.30.
CZK/HUF 13.05.24 Forward Eladás	2013.05.24.	25 540 000	11,608	11,6754	-1 708 626	HUF	2013.04.30.
WIG20 2013 JUN WIM3 Eladás	2013.06.21.	40	255,575 ²	2 292,0000	-1 055 159	HUF	2013.04.30.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	40	226,350 ²	2 229,0000	-76 765	HUF	2013.04.30.
WIG20 2013 JUN WIM3 Eladás	2013.06.21.	160	252,369 ²	2 292,0000	-4 592 152	HUF	2013.04.30.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	549,200 ¹	1 592,2000	2 469 813	HUF	2013.04.30.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	547,800 ¹	1 592,2000	2 550 225	HUF	2013.04.30.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	550,000 ¹	1 592,2000	2 423 863	HUF	2013.04.30.
Összesen					10 210 953	HUF	2013.04.30.
EUR/HUF 13.06.19 Forward Eladás	2013.06.19.	5 339 000	295,500	297,3239	-9 737 802	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.06.13 Forward Eladás	2013.06.13.	600 000	305,350	297,0204	4 997 760	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.07.25 Forward Eladás	2013.07.25.	2 000 000	302,150	298,6384	7 023 200	HUF	2013.05.31.
TRY/HUF 13.07.02 Forward Eladás	2013.07.02.	1 200 000	130,300	120,9133	11 264 040	HUF	2013.05.31.
TRY/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	3 000 000	128,910	120,9009	24 027 300	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	4 000 000	303,840	298,0542	23 143 200	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.06.11 Forward Eladás	2013.06.11.	300 000	300,080	296,9603	935 910	HUF	2013.05.31.
TRY/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	2 300 000	126,290	120,9027	12 390 790	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	2 200 000	298,100	298,0177	181 060	HUF	2013.05.31.
TRY/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	1 550 000	125,600	120,9027	7 280 815	HUF	2013.05.31.
USD/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	500 000	226,190	228,9432	-1 376 600	HUF	2013.05.31.
TRY/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	2 500 000	125,150	120,9027	10 618 250	HUF	2013.05.31.
PLN/HUF 13.08.16 Forward Vétel	2013.08.16.	20 000 000	70,910	69,3858	-30 484 000	HUF	2013.05.31.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	10 000 000	69,820	69,4946	-3 254 000	HUF	2013.05.31.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	10 000 000	69,990	69,4946	-4 954 000	HUF	2013.05.31.
PLN/HUF 13.10.28 Forward Vétel	2013.10.28.	10 000 000	70,040	69,6231	-4 169 000	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	4 700 000	290,670	298,0542	-34 705 740	HUF	2013.05.31.
USD/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	3 900 000	223,830	228,9432	-19 941 480	HUF	2013.05.31.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	40	226,350 ²	2 412,0000	-5 133 594	HUF	2013.05.31.

WIG20 2013 JUN WIM3 Eladás	2013.06.21.	40	2 ² 255,575	2 483,0000	-6 288 756	HUF	2013.05.31.
WIG20 2013 JUN WIM3 Eladás	2013.06.21.	160	2 ² 252,369	2 483,0000	-25 509 661	HUF	2013.05.31.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	1 ¹ 547,800	1 629,0000	4 626 573	HUF	2013.05.31.
S&P 500 Future 13 JUN Vétel	2013.06.21.	1	1 ¹ 550,000	1 629,0000	4 501 223	HUF	2013.05.31.
Összesen					-6 760 297	HUF	2013.05.31.
EUR/HUF 13.07.25 Forward Eladás	2013.07.25.	2 000 000	302,150	296,0853	12 129 400	HUF	2013.06.28.
TRY/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	2 300 000	126,290	117,4634	20 301 180	HUF	2013.06.28.
EUR/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	2 200 000	298,100	295,4368	5 859 040	HUF	2013.06.28.
TRY/HUF 13.07.08 Forward Eladás	2013.07.08.	1 550 000	125,600	117,4634	12 611 730	HUF	2013.06.28.
PLN/HUF 13.08.16 Forward Vétel	2013.08.16.	20 000 000	70,910	68,3452	-51 296 000	HUF	2013.06.28.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	10 000 000	69,820	68,4424	-13 776 000	HUF	2013.06.28.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	10 000 000	69,990	68,4424	-15 476 000	HUF	2013.06.28.
PLN/HUF 13.10.28 Forward Vétel	2013.10.28.	10 000 000	70,040	68,5597	-14 803 000	HUF	2013.06.28.
EUR/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	4 700 000	290,670	295,4644	-22 533 680	HUF	2013.06.28.
EUR/HUF 13.09.19 Forward Eladás	2013.09.19.	3 639 000	292,750	297,9171	-18 803 077	HUF	2013.06.28.
TRY/HUF 13.07.02 Forward Eladás	2013.07.02.	1 200 000	130,300	117,5213	15 334 440	HUF	2013.06.28.
TRY/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	3 000 000	128,910	117,4538	34 368 600	HUF	2013.06.28.
EUR/HUF 13.07.09 Forward Eladás	2013.07.09.	4 000 000	303,840	295,4644	33 502 400	HUF	2013.06.28.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	40	2 ² 226,350	2 182,0000	1 209 868	HUF	2013.06.28.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	80	2 ² 391,512	2 182,0000	11 431 002	HUF	2013.06.28.
BUX1312 Eladás	2013.12.20.	735	19 ¹⁹ 071,727	19 002,0000	512 495	HUF	2013.06.28.
DXY USD Index Futures 2013 Vétel	2013.09.16.	50	82,179	83,3760	13 533 593	HUF	2013.06.28.
Euro Stoxx 50 2013 SEP Vétel	2013.09.20.	75	2 ² 602,507	2 598,0000	-997 642	HUF	2013.06.28.
DAX 1309 Vétel	2013.09.20.	6	7 ⁷ 760,000	7 966,5000	9 142 581	HUF	2013.06.28.
DAX 1309 Vétel	2013.09.20.	6	7 ⁷ 856,333	7 966,5000	4 877 516	HUF	2013.06.28.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	100	2 ² 125,670	2 182,0000	-3 841 706	HUF	2013.06.28.
DXY USD Index Futures 2013 Vétel	2013.09.16.	50	83,247	83,3760	1 458 861	HUF	2013.06.28.
DAX 1309 Vétel	2013.09.20.	6	8 ⁸ 018,000	7 966,5000	-2 280 111	HUF	2013.06.28.
E-mini S&P 500 1309 Vétel	2013.09.20.	19	1 ¹ 611,250	1 599,3000	-2 567 708	HUF	2013.06.28.
Összesen					-2 580 967	HUF	2013.06.28.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	5 000 000	69,820	70,8710	5 255 000	HUF	2013.07.31.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	10 000 000	69,990	70,8710	8 810 000	HUF	2013.07.31.
PLN/HUF 13.10.28 Forward Vétel	2013.10.28.	10 000 000	70,040	70,9646	9 246 000	HUF	2013.07.31.
TRY/HUF 13.08.05 Forward Eladás	2013.08.05.	1 200 000	116,930	116,8662	76 560	HUF	2013.07.31.
EUR/HUF 13.10.09 Forward Eladás	2013.10.09.	2 200 000	296,950	302,2651	-11 693 220	HUF	2013.07.31.
EUR/HUF 13.11.12 Forward Eladás	2013.11.12.	8 700 000	298,520	303,3406	-41 939 220	HUF	2013.07.31.
TRY/HUF 13.08.12 Forward Eladás	2013.08.12.	6 000 000	116,800	116,7770	138 000	HUF	2013.07.31.

EUR/HUF 13.10.28 Forward Eladás	2013.10.28.	3 700 000	298,390	302,8662	-16 561 940	HUF	2013.07.31.
USD/HUF 13.09.26 Forward Eladás	2013.09.26.	2 900 000	224,700	227,1528	-7 113 120	HUF	2013.07.31.
EUR/HUF 13.11.04 Forward Eladás	2013.11.04.	2 300 000	301,600	303,0876	-3 421 480	HUF	2013.07.31.
Euro Stoxx 50 2013 SEP Vétel	2013.09.20.	50	742,000 ²	2 756,0000	2 100 350	HUF	2013.07.31.
SILVER 2013 SEP Vétel	2013.09.26.	17	20,403	19,6280	-14 872 765	HUF	2013.07.31.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	80	391,512 ²	2 311,0000	4 555 719	HUF	2013.07.31.
DXY USD Index Futures 2013 Vétel	2013.09.16.	42	83,247	81,5390	-16 197 271	HUF	2013.07.31.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	40	226,350 ²	2 311,0000	-2 394 918	HUF	2013.07.31.
Összesen					-57 203 420	HUF	2013.07.31.
TRY/HUF 13.09.13 Forward Eladás	2013.09.13.	6 000 000	115,560	111,1620	26 388 000	HUF	2013.08.30.
USD/HUF 13.09.13 Forward Eladás	2013.09.13.	1 350 000	223,040	227,1745	-5 581 575	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 13.09.16 Forward Vétel	2013.09.16.	10 000 000	71,580	70,5029	-10 771 000	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 13.11.18 Forward Vétel	2013.11.18.	10 000 000	71,680	70,6406	-10 394 000	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	10 000 000	71,780	70,8324	-9 476 000	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,770	71,1535	-6 165 000	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,800	71,1535	-6 465 000	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 13.09.18 Forward Vétel	2013.09.18.	15 000 000	71,380	70,5079	-13 081 500	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 13.10.28 Forward Vétel	2013.10.28.	10 000 000	71,430	70,6084	-8 216 000	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,830	71,1535	-8 456 250	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,900	71,1535	-9 331 250	HUF	2013.08.30.
EUR/HUF 13.10.09 Forward Eladás	2013.10.09.	2 200 000	296,950	301,8010	-10 672 200	HUF	2013.08.30.
EUR/HUF 13.11.12 Forward Eladás	2013.11.12.	8 700 000	298,520	302,7874	-37 126 380	HUF	2013.08.30.
EUR/HUF 13.10.28 Forward Eladás	2013.10.28.	3 700 000	298,390	302,3904	-14 801 480	HUF	2013.08.30.
USD/HUF 13.09.26 Forward Eladás	2013.09.26.	2 900 000	224,700	227,5357	-8 223 530	HUF	2013.08.30.
EUR/HUF 13.11.04 Forward Eladás	2013.11.04.	2 300 000	301,600	302,5467	-2 177 410	HUF	2013.08.30.
DXY USD Index Futures 2013 Vétel	2013.09.16.	17	82,115	82,1420	104 156	HUF	2013.08.30.
DXY USD Index Futures 2013 Vétel	2013.09.16.	33	82,337	82,1420	-1 456 486	HUF	2013.08.30.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	80	391,512 ²	2 355,0000	2 058 137	HUF	2013.08.30.
DXY USD Index Futures 2013 Vétel	2013.09.16.	42	83,247	82,1420	-10 531 357	HUF	2013.08.30.
Összesen					-134 550 575	HUF	2013.08.30.
PLN/HUF 14.09.19 Forward Vétel	2014.09.19.	12 000 000	71,360	71,3700	120 000	HUF	2013.09.30.
USD/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	1 300 000	219,340	223,3964	-5 273 320	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	500 000	298,070	301,7209	-1 825 450	HUF	2013.09.30.
USD/HUF 13.10.24 Forward Eladás	2013.10.24.	2 750 000	220,050	221,5641	-4 163 775	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.10.09 Forward Eladás	2013.10.09.	2 200 000	296,950	298,6799	-3 805 780	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.11.12 Forward Eladás	2013.11.12.	8 700 000	298,520	299,7328	-10 551 360	HUF	2013.09.30.

EUR/HUF 13.10.28 Forward Eladás	2013.10.28.	3 700 000	298,390	299,2958	-3 351 460	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.11.04 Forward Eladás	2013.11.04.	2 300 000	301,600	299,4997	4 830 690	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 13.11.18 Forward Vétel	2013.11.18.	10 000 000	71,680	70,9066	-7 734 000	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	10 000 000	71,780	71,0580	-7 220 000	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,770	71,3196	-4 504 000	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,800	71,3196	-4 804 000	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 13.10.28 Forward Vétel	2013.10.28.	10 000 000	71,430	70,8610	-5 690 000	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,830	71,3196	-6 380 000	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,900	71,3196	-7 255 000	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.12.06 Forward Eladás	2013.12.06.	3 200 000	303,600	300,3685	10 340 800	HUF	2013.09.30.
TRY/HUF 13.11.18 Forward Eladás	2013.11.18.	6 000 000	111,280	107,9977	19 693 800	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 13.12.16 Forward Vétel	2013.12.16.	10 000 000	71,780	70,9491	-8 309 000	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.11.25 Forward Eladás	2013.11.25.	3 000 000	299,900	300,1115	-634 500	HUF	2013.09.30.
USD/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	2 900 000	223,400	222,6654	2 130 340	HUF	2013.09.30.
PLN/HUF 13.11.18 Forward Vétel	2013.11.18.	4 000 000	71,120	70,9066	-853 600	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	6 500 000	301,040	300,7067	2 166 450	HUF	2013.09.30.
TRY/HUF 13.12.02 Forward Eladás	2013.12.02.	1 400 000	107,670	107,8388	-236 320	HUF	2013.09.30.
WIG20 2013 DEC WIZ3 Eladás	2013.12.20.	100	² 371,090	2 377,0000	-418 428	HUF	2013.09.30.
MIDWIG 2013 DEC BMZ3 Eladás	2013.12.20.	75	³ 244,367	3 315,0000	-3 750 628	HUF	2013.09.30.
Euro Stoxx Banks Index Futures DEC13 Vétel	2013.12.20.	215	129,337	125,2000	-13 274 900	HUF	2013.09.30.
Összesen					-43 309 485	HUF	2013.09.30.
EUR/HUF 13.11.12 Forward Eladás	2013.11.12.	8 700 000	298,520	294,7540	32 764 200	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 13.11.18 Forward Vétel	2013.11.18.	10 000 000	71,680	70,5317	-11 483 000	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	10 000 000	71,780	70,6689	-11 111 000	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,770	70,8571	-9 129 000	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,800	70,8571	-9 429 000	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,830	70,8571	-12 161 250	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,900	70,8571	-13 036 250	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.12.06 Forward Eladás	2013.12.06.	3 200 000	303,600	295,4728	26 007 040	HUF	2013.10.31.
TRY/HUF 13.11.18 Forward Eladás	2013.11.18.	6 000 000	111,280	107,8254	20 727 600	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 13.12.16 Forward Vétel	2013.12.16.	10 000 000	71,780	70,5808	-11 992 000	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.09.19 Forward Vétel	2014.09.19.	12 000 000	71,360	70,8954	-5 575 200	HUF	2013.10.31.
USD/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	1 300 000	219,340	216,6187	3 537 690	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	500 000	298,070	296,6804	694 800	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.11.25 Forward Eladás	2013.11.25.	3 000 000	299,900	295,1756	14 173 200	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 13.11.18 Forward Vétel	2013.11.18.	4 000 000	71,120	70,5317	-2 353 200	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	6 500 000	301,040	295,7970	34 079 500	HUF	2013.10.31.

TRY/HUF 13.12.02 Forward Eladás	2013.12.02.	1 400 000	107,670	107,6749	-6 860	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.10.14 Forward Vétel	2014.10.14.	11 500 000	70,850	70,9253	865 950	HUF	2013.10.31.
USD/HUF 13.12.16 Forward Eladás	2013.12.16.	670 000	218,400	215,9480	1 642 840	HUF	2013.10.31.
USD/HUF 13.12.16 Forward Eladás	2013.12.16.	1 700 000	218,550	215,9480	4 423 400	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	1 800 000	294,900	295,7970	-1 614 600	HUF	2013.10.31.
USD/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	2 750 000	215,880	215,9866	-293 150	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	3 700 000	294,370	295,7970	-5 279 900	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 13.12.18 Forward Vétel	2013.12.18.	9 000 000	69,980	70,5843	5 438 700	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 13.12.18 Forward Vétel	2013.12.18.	10 000 000	69,980	70,5843	6 043 000	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	1 550 000	294,550	295,7970	-1 932 850	HUF	2013.10.31.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	2 300 000	294,240	295,7970	-3 581 100	HUF	2013.10.31.
DAX 1312 Eladás	2013.12.20.	14	984,321 ⁸	9 032,5000	-4 966 009	HUF	2013.10.31.
Összesen					51 419 560	HUF	2013.10.31.
PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	10 000 000	71,780	71,7526	-274 000	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,770	71,9315	1 615 000	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,800	71,9315	1 315 000	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,830	71,9315	1 268 750	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,900	71,9315	393 750	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 13.12.06 Forward Eladás	2013.12.06.	3 200 000	303,600	301,0718	8 090 240	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 13.12.16 Forward Vétel	2013.12.16.	10 000 000	71,780	71,6737	-1 063 000	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.09.19 Forward Vétel	2014.09.19.	12 000 000	71,360	71,8963	6 435 600	HUF	2013.11.29.
USD/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	1 300 000	219,340	222,0133	-3 475 290	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	500 000	298,070	302,3506	-2 140 300	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	6 500 000	301,040	301,4273	-2 517 450	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.10.14 Forward Vétel	2014.10.14.	11 500 000	70,850	71,9167	12 267 050	HUF	2013.11.29.
USD/HUF 13.12.16 Forward Eladás	2013.12.16.	670 000	218,400	221,3064	-1 947 288	HUF	2013.11.29.
USD/HUF 13.12.16 Forward Eladás	2013.12.16.	1 700 000	218,550	221,3064	-4 685 880	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	1 800 000	294,900	301,4273	-11 749 140	HUF	2013.11.29.
USD/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	2 750 000	215,880	221,3436	-15 024 900	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	3 700 000	294,370	301,4273	-26 112 010	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 13.12.18 Forward Vétel	2013.12.18.	9 000 000	69,980	71,6764	15 267 600	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 13.12.18 Forward Vétel	2013.12.18.	10 000 000	69,980	71,6764	16 964 000	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	1 550 000	294,550	301,4273	-10 659 815	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 13.12.18 Forward Eladás	2013.12.18.	2 300 000	294,240	301,4273	-16 530 790	HUF	2013.11.29.
USD/JPY 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	2 100 000	99,880	102,4280	11 565 754	HUF	2013.11.29.
GBP/JPY 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	1 300 000	160,580	167,4574	19 325 150	HUF	2013.11.29.
GBP/JPY 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	1 300 000	161,250	167,4574	17 442 484	HUF	2013.11.29.

PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	14 000 000	71,340	71,7526	5 776 400	HUF	2013.11.29.
USD/JPY 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	2 100 000	100,950	102,4280	6 708 864	HUF	2013.11.29.
EUR/HUF 14.02.28 Forward Eladás	2014.02.28.	4 600 000	300,130	303,2210	-14 218 600	HUF	2013.11.29.
GBP/HUF 14.03.03 Forward Vétel	2014.03.03.	2 700 000	363,380	363,2797	-270 810	HUF	2013.11.29.
Összesen					13 766 369	HUF	2013.11.29.
PLN/HUF 14.01.21 Forward Vétel	2014.01.21.	19 000 000	71,590	71,6204	577 600	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.01.21 Forward Eladás	2014.01.21.	6 500 000	299,780	297,3946	15 505 100	HUF	2013.12.31.
USD/JPY 14.03.24 Forward Vétel	2014.03.24.	2 500 000	104,000	105,2962	6 656 635	HUF	2013.12.31.
EUR/USD 14.03.24 Forward Eladás	2014.03.24.	4 000 000	1,366	1,3745	-7 332 780	HUF	2013.12.31.
GBP/JPY 14.03.24 Forward Vétel	2014.03.24.	1 500 000	170,260	174,2484	12 289 457	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.01.30 Forward Eladás	2014.01.30.	500 000	298,950	297,6023	673 850	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.01.30 Forward Eladás	2014.01.30.	510 000	297,700	297,6023	49 827	HUF	2013.12.31.
USD/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	1 600 000	216,340	216,0602	447 680	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	10 000 000	71,780	71,6476	-1 324 000	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,770	71,7485	-215 000	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	10 000 000	71,800	71,7485	-515 000	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,830	71,7485	-1 018 750	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.08.18 Forward Vétel	2014.08.18.	12 500 000	71,900	71,7485	-1 893 750	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.09.19 Forward Vétel	2014.09.19.	12 000 000	71,360	71,7687	4 904 400	HUF	2013.12.31.
USD/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	1 300 000	219,340	216,0602	4 263 740	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.01.23 Forward Eladás	2014.01.23.	500 000	298,070	297,4408	314 600	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.10.14 Forward Vétel	2014.10.14.	11 500 000	70,850	71,7342	10 168 300	HUF	2013.12.31.
GBP/JPY 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	1 300 000	161,250	174,3097	34 875 406	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	14 000 000	71,340	71,6476	4 306 400	HUF	2013.12.31.
USD/JPY 14.02.18 Forward Vétel	2014.02.18.	2 100 000	100,950	105,3115	18 814 726	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.02.28 Forward Eladás	2014.02.28.	4 600 000	300,130	298,2713	8 550 020	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.02.26 Forward Eladás	2014.02.26.	1 800 000	304,710	298,2252	11 672 640	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.03.06 Forward Eladás	2014.03.06.	3 200 000	303,950	298,3698	17 856 640	HUF	2013.12.31.
EUR/USD 14.03.06 Forward Eladás	2014.03.06.	4 500 000	1,354	1,3746	-19 604 403	HUF	2013.12.31.
EUR/USD 14.03.06 Forward Eladás	2014.03.06.	2 500 000	1,373	1,3746	-970 515	HUF	2013.12.31.
EUR/USD 14.03.06 Forward Eladás	2014.03.06.	3 000 000	1,372	1,3746	-1 876 329	HUF	2013.12.31.
PLN/HUF 14.01.16 Forward Vétel	2014.01.16.	10 000 000	72,360	71,6156	-7 444 000	HUF	2013.12.31.
EUR/HUF 14.01.21 Forward Eladás	2014.01.21.	9 350 000	300,800	297,3946	31 840 490	HUF	2013.12.31.
USD/HUF 14.01.21 Forward Eladás	2014.01.21.	2 750 000	218,450	216,0263	6 665 175	HUF	2013.12.31.
DXY USD Index Futures 2014 MAR Vétel	2014.09.15.	55	80,380	80,1890	-2 265 613	HUF	2013.12.31.
MIDWIG 2014 MAR BMH4 Eladás	2014.03.21.	45	3 301,911	3 380,0000	-2 516 024	HUF	2013.12.31.
Összesen					148 238 159	HUF	2013.12.31.

VIII. BEFEKTETÉSI ALAPKEZELŐ MŰKÖDÉSÉBEN BEKÖVETKEZETT VÁLTOZÁSOK, VALAMINT A BEFEKTETÉSI POLITIKA ALAKULÁSÁRA HATÓ FŐBB TÉNYEZŐK

A 2012. január 1-től hatályos 2011. évi CXCI. törvény (Bat.) alapján a Társaság a (ma már a Magyar Nemzeti Bank részeként működő) Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete 2012. november 21-én kelt H-EN-III-116/2012. számú határozatának megfelelően rendelkezik engedéllyel a következő tevékenységek végzésére:

- befektetéskezelés (kollektív portfóliókezeléshez kapcsolódóan)
- kollektív portfóliókezeléshez kapcsolódó adminisztratív feladatok részben vagy egészben történő ellátása
- a Társaság által az értékesítést végző személyek oktatása
- portfóliókezelés
- befektetési tanácsadás

Szintén a Bat. hatályba lépésével vált lehetővé, hogy alapkezelők is végezhesenek letétkezelési és számlavezetési tevékenységet, viszont az 1995. évi CXVII. törvény a személyi jövedelemadóról törvényből (SZJA tv.) hiányzó, TBSZ számla vezetésére vonatkozó része miatt tartós befektetési számlát nem vezethettek. Azonban a 2012. november 30-án elfogadott, 2013. január 1.-től hatályos SZJA tv. már lehetővé teszi, hogy a befektetési alapkezelők is vezethessenek tartós befektetési számlát (TBSZ) az ügyfelek számára. Ezért az Aegon Magyarország Befektetési Alapkezelő, mint az Aegon Magyarország Befektetési Jegy Forgalmazó Zrt. 100%-os tulajdonosa, a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyeletének szükséges tevékenységi engedélyének megszerzését követően a Forgalmazó beolvadása mellett döntött. A beolvadást a Cégbíróság 2013.07.31-i dátummal bejegyezte. Ennek következtében az alapkezelő, elsőként a magyar piacon, közvetlenül, forgalmazók beiktatása nélkül is értékesíti befektetési alapjait ügyfelei részére. Társaságunk és az Aegon-csoport kevés ügyfélszolgálati irodával rendelkezik, ezért az értékesítési tevékenységet leginkább az online csatornára összpontosítjuk.

Az Alap befektetési politikájával összhangban, a portfólióban 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. A hozam nagyobb részét a részvény befektetések adták 2013-ban.

IX. EREDMÉNYKIMUTATÁS**AEGON Atticus Alfa Származtatott Befektetési Alap**

2013. év

	Előző év eFt	Tárgyév eFt
I. Pénzügyi műveletek bevételei	4 409 236	4 342 687
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	2 437 677	2 729 545
III. Egyéb bevételek	1 016	4
IV. Működési költségek	492 530	574 103
V. Egyéb ráfordítások	766	129
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.)	1 479 280	1 038 913

Az Alap 2013. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Budapest, 2014. április 25.