

# **AEGON PANORÁMA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP**

## **2021. ÉVES JELENTÉSE**

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény (a továbbiakban: Kbfvtv.) 131. § és 132. § alapján készítette az Alap 2021. 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](http://www.aegonalapkezelo.hu)).

Budapest, 2022. április 25.

Kadocsa Péter

elnök-vezérigazgató

Kocsis Bálint

adminisztrációs vezérigazgató-  
helyettes

\*\*\*

Jelen dokumentum sajátkezű 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 sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.

**ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL****Az Alap elnevezése**

Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap

**Az Alap rövid neve**

Aegon Panoráma Alap

**Az Alap lajstromszáma**

1111-586

**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	HU0000714266	P	PLN	HU0000714290
I	HUF	HU0000714308	R	HUF	HU0000714316
E	EUR	HU0000714274	U	USD	HU0000714282

**Hozamfizetés**

Az Alap a tőkenövekmény terhére hozamot nem fizet, a teljes tőkenövekmény újra befektetésre kerül az Alap 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 és 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** Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe  
1051 Budapest, Szabadság tér 7.

**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:** Könczöl Enikő  
Kamarai tagsági szám: 007367

## I. Vagyonkimutatás

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

Megnevezés	2020.12.31.		2021.12.31.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	789 042 346	31,52	3 849 599 129	41,25
Repo				
Átruházható értékpapírok	1 678 444 851	67,05	5 429 679 563	58,18
Származékos ügyletek	47 166 102	1,88	9 904 682	0,11
Egyéb eszközök	9 701 001	0,39	74 032 582	0,79
Összes eszköz	2 524 354 300	100,84	9 363 215 956	100,33
Kötelezettségek	-20 953 627	-0,84	-30 792 956	-0,33
Nettó eszközérték	2 503 400 673	100,00	9 332 423 000	100,00

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

## II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy				2020.12.31.	2021.12.31.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714266	1 599 393 767	1 675 971 127
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714308	442 716 699	2 683 580 628
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714274	550 534	2 137 913
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714290	2 522 564	2 014 243
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714316	415 068 918	4 112 134 302
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000714282	313 129	919 945

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

## III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy				2020.12.31.	2021.12.31.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714266	0.833608	0.923663
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714308	0.885443	0.992945
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714274	0.79372	0.867544
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714290	0.896065	0.983577
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714316	0.863726	0.970057
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000714282	0.868315	0.958678

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

## IV. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	2020.12.31.		2021.12.31.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	63 872 942	3,81	540 911 005	9,96
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	243 341 582	14,50	170 518 305	3,14
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	53 440 000	3,18	21 912 000	0,40
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	40 229 060	2,40		
Részvény - GMU	196 874 665	11,73		
Részvény - Egyéb külföld			45 098 488	0,83
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	597 758 249	35,61	778 439 798	14,34
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei			368 882 195	6,79
Egyéb átruházható értékpapírok			368 882 195	6,79
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	446 447 976	26,60	3 813 093 345	70,23
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	236 776 186	14,11	243 093 125	4,48
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	397 462 440	23,68	226 171 100	4,17
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	1 080 686 602	64,39	4 282 357 570	78,87
Értékpapírok összesen	1 678 444 851	100,00	5 429 679 563	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

<b>Pénzügyi műveletek bevételei</b>	<b>2021</b>
Pénzintézetektől kapott kamatok	8 437
Diszkont kincstárjegyek árnyeresége	5 514
Kamatkozó papírok ár- és árfolyamnyeresége	17 069
Részvény, befegy ár- és árfolyamnyeresége	353 019
Értékpapírok felh. kamata	4 308
Értékpapírok kapott kamata	23 011
Részvények osztaléka	9 805
Pénzeszközök év végi átértékeléséből származó deviza árfolyamváltozással kapcsolatos nyereség	58 141
Származékos ügyletek nyeresége	786 638
<b>Összesen:</b>	<b>1 265 942</b>

*Az Alap 2021. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült*

adatok eFt-ban

<b>Pénzügyi műveletek ráfordításai</b>	<b>2021</b>
Kamatkozó papírok ár- és árfolyamvesztesége	15 491
Részvény, befegy ár- és árfolyamvesztesége	44 884
Fizetendő kamatok	2 100
Fizetendő opciós díj	5 341
Származékos ügyletek vesztesége	550 991
<b>Összesen:</b>	<b>618 807</b>

*Az Alap 2021. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült*

**Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:**

Az Alap 2021-ben **Egyéb bevételként 1 589 eFt** büntető jutalékot számolt el. **Egyéb ráfordításként** a befektetési alap különadója merült fel, **2 954 eFt** értékben.

**Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:**

adatok eFt-ban

<b>Működési költségek</b>	<b>2021</b>
Alapkezelői díj	48 491
Letétkezelői díj	2 701
Főforgalmazói jutalék	3 031
Forgalmazói jutalék	7 151
Felügyeleti díj	2 113
Bankköltség	255
Ügynöki jutalékok	4 749
Könyvvizsgálói díj	633
Megbízási díj	4 074
<b>Összesen:</b>	<b>73 198</b>

*Az Alap 2021. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.*

## Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

adatok eFt-ban

<b>Tőkenövekmény:</b>	
Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	-73 490
Értékpapírok értékelési különbözetéből	186 243
Előző évek eredményből	-953 129
Üzleti év eredményéből	572 572
<b>Összesen:</b>	<b>-267 804</b>

Az Alap 2021. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Felosztott és újrabefektetett jövedelemmel az alap nem rendelkezett 2021-ben.

## 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 Panoráma Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714266	1 724 034 737	0,747124	2018.12.28.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714266	1 689 420 367	0,814589	2019.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714266	1 333 267 439	0,833608	2020.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714266	1 548 032 519	0,923663	2021.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714308	1 099 433 702	0,777528	2018.12.28.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714308	1 494 815 091	0,856355	2019.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714308	392 000 402	0,885443	2020.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714308	2 664 647 967	0,992945	2021.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714274	601 672	0,718190	2018.12.28.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714274	584 325	0,777074	2019.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714274	436 970	0,793720	2020.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714274	1 854 734	0,867544	2021.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714290	3 220 410	0,792346	2018.12.28.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714290	11 167 156	0,875112	2019.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714290	2 260 381	0,896065	2020.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714290	1 981 163	0,983577	2021.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714316	1 484 435 640	0,756175	2018.12.28.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714316	646 541 126	0,834095	2019.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714316	358 505 816	0,863726	2020.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714316	3 989 004 665	0,970057	2021.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000714282	290 730	0,757550	2018.12.28.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000714282	473 167	0,841096	2019.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000714282	271 895	0,868315	2020.12.31.
Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap	U	USD	HU0000714282	881 931	0,958678	2021.12.31.

## VII. Származtatott ügyletek

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
TRY/USD 21.02.24 Forward Vétel	2021.02.24.	1 500 000	8,143	7,4362	5 251 060	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.02.08 Forward Vétel	2021.02.08.	72 000	294,895	295,9098	73 069	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.04.20 Forward Vétel	2021.04.20.	61 000	298,389	296,2336	-131 477	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	700 000	298,840	296,2344	1 823 922	HUF	2021.01.29.
EUR/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	1 670 000	361,810	359,5538	3 767 842	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	1 857 000	299,108	296,2348	5 335 628	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.04.14 Forward Vétel	2021.04.14.	23 000	296,120	296,2099	2 067	HUF	2021.01.29.
TRY/USD 21.02.24 Forward Vétel	2021.02.24.	1 000 000	8,202	7,4369	3 763 834	HUF	2021.01.29.
RUB/USD 21.02.08 Forward Vétel	2021.02.08.	15 000 000	74,754	76,3499	-1 242 524	HUF	2021.01.29.
BRL/USD 21.04.06 Forward Vétel	2021.04.06.	3 300 000	5,172	5,4520	-9 714 618	HUF	2021.01.29.
RUB/USD 21.02.08 Forward Vétel	2021.02.08.	16 000 000	73,446	76,3483	-2 453 119	HUF	2021.01.29.
EUR/HUF 21.04.07 Forward Vétel	2021.04.07.	86 000	359,253	359,3898	11 774	HUF	2021.01.29.
EUR/HUF 21.02.26 Forward Vétel	2021.02.26.	175 000	362,380	358,8820	-612 143	HUF	2021.01.29.
PLN/HUF 21.03.03 Forward Vétel	2021.03.03.	132 000	79,930	79,0606	-114 761	HUF	2021.01.29.
EUR/HUF 21.03.02 Forward Vétel	2021.03.02.	104 000	360,490	358,9310	-162 132	HUF	2021.01.29.
TRY/USD 21.02.24 Forward Vétel	2021.02.24.	2 500 000	8,125	7,4359	8 553 890	HUF	2021.01.29.
PLN/HUF 21.04.27 Forward Vétel	2021.04.27.	2 139 000	78,835	79,1295	630 277	HUF	2021.01.29.
TRY/USD 21.02.24 Forward Vétel	2021.02.24.	1 000 000	7,532	7,4283	555 300	HUF	2021.01.29.
EUR/HUF 21.04.21 Forward Vétel	2021.04.21.	57 000	359,450	359,5698	6 828	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.03.29 Forward Vétel	2021.03.29.	90 000	293,959	296,1773	199 645	HUF	2021.01.29.
USD/HUF 21.02.26 Forward Vétel	2021.02.26.	39 000	293,110	296,0183	113 424	HUF	2021.01.29.
COPPER FUTURE Mar21 Vétel	2021.03.29.	1	352,500	355,6000	229 299	HUF	2021.01.29.
GOLD 100 OZ FUTR Apr21 Vétel	2021.04.28.	1	1 858,900	1 850,3000	-254 448	HUF	2021.01.29.
BRENT CRUDE FUTR Apr21 Vétel	2021.02.26.	3	55,571	55,0400	-471 442	HUF	2021.01.29.
COPPER FUTURE Mar21 Vétel	2021.03.29.	1	358,350	355,6000	-203 411	HUF	2021.01.29.
US ULTRA BOND CBT Mar21 Eladás	2021.03.22.	1	214,094	204,7188	2 773 781	HUF	2021.01.29.
SILVER FUTURE Mar21 Vétel	2021.03.29.	1	22,350	26,9140	6 751 753	HUF	2021.01.29.
CORN FUTURE Mar21 Vétel	2021.03.12.	4	431,000	547,0000	6 864 184	HUF	2021.01.29.
COPPER FUTURE Mar21 Vétel	2021.03.29.	1	358,350	355,6000	-203 411	HUF	2021.01.29.
COPPER FUTURE Mar21 Eladás	2021.03.29.	1	348,500	355,6000	-525 169	HUF	2021.01.29.
SOYBEAN FUTURE Mar21 Vétel	2021.03.12.	3	1 254,750	1 370,0000	5 114 853	HUF	2021.01.29.
LME PRI ALUM FUTR Mar21 Vétel	2021.03.15.	2	2 025,000	1 967,8800	-845 005	HUF	2021.01.29.
US ULTRA BOND CBT Mar21 Eladás	2021.03.22.	3	214,588	204,7188	8 759 601	HUF	2021.01.29.
<b>Összesen</b>					<b>15 657 785</b>	<b>HUF</b>	<b>2021.01.29.</b>
TRY/USD 21.03.24 Forward Vétel	2021.03.24.	1 500 000	7,125	7,4490	-2 757 149	HUF	2021.02.26.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 21.05.03 Forward Vétel	2021.05.03.	45 000	361,000	361,8887	39 994	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.05.03 Forward Vétel	2021.05.03.	39 000	294,765	298,0354	127 545	HUF	2021.02.26.
EUR/HUF 21.03.02 Forward Vétel	2021.03.02.	104 000	360,490	361,0699	60 313	HUF	2021.02.26.
PLN/HUF 21.03.03 Forward Vétel	2021.03.03.	83 000	79,930	79,8900	-3 320	HUF	2021.02.26.
EUR/HUF 21.04.07 Forward Vétel	2021.04.07.	86 000	359,253	361,5381	196 527	HUF	2021.02.26.
BRL/USD 21.04.06 Forward Vétel	2021.04.06.	3 300 000	5,172	5,5372	-12 542 968	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.04.14 Forward Vétel	2021.04.14.	23 000	296,120	297,9682	42 508	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	1 857 000	299,108	298,0012	2 055 472	HUF	2021.02.26.
EUR/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	1 670 000	361,810	361,7201	150 134	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	700 000	298,840	298,0009	587 351	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.04.20 Forward Vétel	2021.04.20.	61 000	298,389	298,0004	-23 703	HUF	2021.02.26.
EUR/HUF 21.04.21 Forward Vétel	2021.04.21.	57 000	359,450	361,7274	129 814	HUF	2021.02.26.
PLN/HUF 21.04.27 Forward Vétel	2021.04.27.	2 139 000	78,835	79,9686	2 425 161	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.04.08 Forward Vétel	2021.04.08.	88 000	297,157	297,9293	67 984	HUF	2021.02.26.
RUB/USD 21.03.05 Forward Vétel	2021.03.05.	31 000 000	75,772	74,6799	1 782 046	HUF	2021.02.26.
USD/HUF 21.03.29 Forward Vétel	2021.03.29.	90 000	293,959	297,8775	352 662	HUF	2021.02.26.
EUR/HUF 21.05.25 Forward Vétel	2021.05.25.	121 000	359,510	362,1750	322 463	HUF	2021.02.26.
TRY/USD 21.03.24 Forward Vétel	2021.03.24.	3 500 000	7,120	7,4489	-6 540 146	HUF	2021.02.26.
GOLD 100 OZ FUTR Apr21 Vétel	2021.04.28.	1	1 775,000	1 728,8000	-1 375 466	HUF	2021.02.26.
GOLD 100 OZ FUTR Apr21 Vétel	2021.04.28.	1	1 840,000	1 728,8000	-3 310 646	HUF	2021.02.26.
LME PRI ALUM FUTR Mar21 Vétel	2021.03.15.	2	2 025,000	2 131,7500	1 589 081	HUF	2021.02.26.
US ULTRA BOND CBT Jun21 Eladás	2021.06.21.	4	186,438	189,0625	-3 126 060	HUF	2021.02.26.
COPPER FUTURE May21 Vétel	2021.05.26.	2	433,100	409,2500	-3 550 311	HUF	2021.02.26.
BRENT CRUDE FUTR May21 Vétel	2021.03.31.	3	65,960	64,4200	-1 375 466	HUF	2021.02.26.
SILVER FUTURE May21 Vétel	2021.05.26.	1	27,995	26,4400	-2 314 773	HUF	2021.02.26.
SOYBEAN FUTURE May21 Vétel	2021.05.14.	3	1 398,750	1 404,2500	245 619	HUF	2021.02.26.
CORN FUTURE May21 Vétel	2021.05.14.	4	544,500	547,5000	178 632	HUF	2021.02.26.
Összesen					-13 527 310	HUF	2021.02.26.
EUR/HUF 21.04.07 Forward Vétel	2021.04.07.	86 000	359,253	363,8194	392 718	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.04.14 Forward Vétel	2021.04.14.	23 000	296,120	309,7263	312 946	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	1 857 000	299,108	309,7656	-19 790 902	HUF	2021.03.31.
EUR/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	1 670 000	361,810	363,9991	-3 655 777	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.04.20 Forward Eladás	2021.04.20.	700 000	298,840	309,7654	-7 647 813	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.04.20 Forward Vétel	2021.04.20.	61 000	298,389	309,7653	693 952	HUF	2021.03.31.
EUR/HUF 21.04.21 Forward Vétel	2021.04.21.	57 000	359,450	364,0080	259 806	HUF	2021.03.31.
PLN/HUF 21.04.27 Forward Vétel	2021.04.27.	2 115 000	78,835	78,0504	-1 658 919	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.04.08 Forward Vétel	2021.04.08.	88 000	297,157	309,6981	1 103 632	HUF	2021.03.31.
EUR/HUF 21.05.25 Forward Vétel	2021.05.25.	121 000	359,510	364,4643	599 473	HUF	2021.03.31.
EUR/HUF 21.05.03 Forward Vétel	2021.05.03.	45 000	361,000	364,1678	142 552	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.04.29 Forward Vétel	2021.04.29.	94 000	308,849	309,8194	91 172	HUF	2021.03.31.
BRL/USD 21.04.15 Forward Vétel	2021.04.15.	3 000 000	5,497	5,7776	-8 231 019	HUF	2021.03.31.
USD/HUF 21.05.03 Forward Vétel	2021.05.03.	39 000	294,765	309,8296	587 521	HUF	2021.03.31.
EUR/HUF 21.06.03 Forward Vétel	2021.06.03.	104 000	364,260	364,5796	33 235	HUF	2021.03.31.
PLN/HUF 21.06.04 Forward Vétel	2021.06.04.	83 000	80,478	78,1033	-197 059	HUF	2021.03.31.
BRL/USD 21.04.15 Forward Vétel	2021.04.15.	2 000 000	5,608	5,7777	-3 247 206	HUF	2021.03.31.
EUR/HUF 21.05.18 Forward Vétel	2021.05.18.	41 000	368,010	364,3836	-148 681	HUF	2021.03.31.
WTI CRUDE FUTURE May21 Vétel	2021.04.20.	1	58,580	59,1600	179 603	HUF	2021.03.31.
BRENT CRUDE FUTR Jun21 Vétel	2021.04.30.	1	62,130	62,7400	188 893	HUF	2021.03.31.
LME PRI ALUM FUTR May21 Vétel	2021.05.17.	2	2 160,500	2 200,2500	615 449	HUF	2021.03.31.
PLATINUM FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.28.	2	1 165,500	1 191,5000	805 116	HUF	2021.03.31.
GOLD 100 OZ FUTR Jun21 Vétel	2021.06.28.	3	1 684,600	1 715,6000	2 879 838	HUF	2021.03.31.
WTI CRUDE FUTURE May21 Vétel	2021.04.20.	1	60,660	59,1600	-464 490	HUF	2021.03.31.
COTTON NO.2 FUTR Jul21 Vétel	2021.07.08.	1	88,400	82,1700	-964 591	HUF	2021.03.31.
BRENT CRUDE FUTR Jul21 Vétel	2021.05.28.	3	63,360	62,3100	-975 429	HUF	2021.03.31.
COPPER FUTURE May21 Vétel	2021.05.26.	1	433,100	399,5500	-2 597 273	HUF	2021.03.31.
SILVER FUTURE May21 Vétel	2021.05.26.	1	27,995	24,5320	-5 361 763	HUF	2021.03.31.
SOYBEAN FUTURE May21 Vétel	2021.05.14.	3	1 398,750	1 436,7500	1 765 062	HUF	2021.03.31.
CORN FUTURE May21 Vétel	2021.05.14.	4	544,500	564,2500	1 223 157	HUF	2021.03.31.
US ULTRA BOND CBT Jun21 Eladás	2021.06.21.	4	185,531	181,2188	5 341 635	HUF	2021.03.31.
COPPER FUTURE May21 Vétel	2021.05.26.	1	400,000	399,5500	-34 837	HUF	2021.03.31.
NATURAL GAS FUTR May21 Vétel	2021.04.28.	5	2,562	2,6080	712 218	HUF	2021.03.31.
Összesen					-40 360 368	HUF	2021.03.31.
PLN/HUF 21.06.28 Forward Vétel	2021.06.28.	2 110 000	79,815	78,8512	-2 033 650	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.05.07 Forward Vétel	2021.05.07.	86 000	362,715	359,6804	-260 985	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.05.14 Forward Vétel	2021.05.14.	25 000	299,500	297,3705	-53 236	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.05.20 Forward Vétel	2021.05.20.	61 000	301,453	297,4117	-246 508	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.05.21 Forward Eladás	2021.05.21.	1 250 000	360,940	359,8705	1 336 915	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.05.25 Forward Vétel	2021.05.25.	121 000	359,510	359,9198	49 584	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.06.03 Forward Vétel	2021.06.03.	104 000	364,260	360,0430	-438 569	HUF	2021.04.30.
PLN/HUF 21.06.04 Forward Vétel	2021.06.04.	83 000	80,478	78,8112	-138 302	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.05.18 Forward Vétel	2021.05.18.	41 000	368,010	359,8331	-335 254	HUF	2021.04.30.
BRL/USD 21.05.13 Forward Vétel	2021.05.13.	5 000 000	5,732	5,3439	18 854 572	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.05.17 Forward Vétel	2021.05.17.	24 000	359,292	359,8098	12 416	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.05.21 Forward Vétel	2021.05.21.	59 000	360,885	359,8704	-59 859	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.05.21 Forward Eladás	2021.05.21.	1 857 000	299,727	297,4110	4 301 344	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.05.21 Forward Eladás	2021.05.21.	700 000	299,625	297,4110	1 549 822	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.06.30 Forward Vétel	2021.06.30.	100 000	300,509	297,6139	-289 532	HUF	2021.04.30.
EUR/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	68 000	360,780	360,4804	-20 370	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	39 000	297,790	297,6402	-5 841	HUF	2021.04.30.
USD/HUF 21.05.10 Forward Vétel	2021.05.10.	88 000	304,516	297,3513	-630 484	HUF	2021.04.30.
LIVE CATTLE FUTR Jun21 Vétel	2021.06.30.	2	116,150	116,5750	101 082	HUF	2021.04.30.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	2	63,310	63,4800	101 082	HUF	2021.04.30.
CORN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	4	651,500	673,2500	1 293 255	HUF	2021.04.30.
BRENT CRUDE FUTR Jul21 Vétel	2021.05.28.	1	66,540	66,7600	65 406	HUF	2021.04.30.
SILVER FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.28.	1	25,990	25,8730	-173 920	HUF	2021.04.30.
EURO-BUND FUTURE Jun21 Eladás	2021.06.08.	10	171,060	170,0000	3 811 654	HUF	2021.04.30.
COTTON NO.2 FUTR Jul21 Vétel	2021.07.08.	1	90,900	88,0800	-419 193	HUF	2021.04.30.
NATURAL GAS FUTR Jul21 Vétel	2021.06.28.	8	2,983	2,9780	-127 839	HUF	2021.04.30.
COFFEE 'C' FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.20.	1	129,150	141,4500	1 371 296	HUF	2021.04.30.
COFFEE 'C' FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.20.	1	131,950	141,4500	1 059 131	HUF	2021.04.30.
LUMBER FUTURE May21 Eladás	2021.05.14.	1	1 180,000	1 500,5000	-10 481 312	HUF	2021.04.30.
COTTON NO.2 FUTR Jul21 Vétel	2021.07.08.	1	88,400	88,0800	-47 568	HUF	2021.04.30.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
BRENT CRUDE FUTR Jul21 Vétel	2021.05.28.	3	63,360	66,7600	3 032 460	HUF	2021.04.30.
GOLD 100 OZ FUTR Jun21 Vétel	2021.06.28.	2	1 684,600	1 767,7000	4 941 126	HUF	2021.04.30.
US ULTRA BOND CBT Jun21 Eladás	2021.06.21.	4	185,531	185,9063	-445 950	HUF	2021.04.30.
LME PRI ALUM FUTR May21 Vétel	2021.05.17.	2	2 160,500	2 390,5000	3 418 950	HUF	2021.04.30.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	2	59,250	63,4800	2 515 158	HUF	2021.04.30.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	1	62,270	63,4800	359 733	HUF	2021.04.30.
EURO-BUND FUTURE Jun21 Eladás	2021.06.08.	6	170,080	170,0000	172 603	HUF	2021.04.30.
SOYBEAN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	3	1 518,500	1 534,2500	702 371	HUF	2021.04.30.
LIVE CATTLE FUTR Jun21 Vétel	2021.06.30.	2	119,725	116,5750	-749 196	HUF	2021.04.30.
COPPER FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.28.	2	449,350	446,8000	-379 058	HUF	2021.04.30.
<b>Összesen</b>					<b>21 592 062</b>	<b>HUF</b>	<b>2021.04.30.</b>
BRL/USD 21.06.14 Forward Vétel	2021.06.14.	3 400 000	5,235	5,2318	106 307	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.14 Forward Vétel	2021.06.14.	49 000	295,150	285,5023	-472 740	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.06.17 Forward Vétel	2021.06.17.	40 000	357,082	348,4733	-344 338	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.25 Forward Eladás	2021.06.25.	200 000	287,332	285,5810	350 205	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.06.28 Forward Vétel	2021.06.28.	121 000	349,420	348,6105	-97 949	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.21 Forward Vétel	2021.06.21.	114 000	287,238	285,5608	-191 226	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.25 Forward Eladás	2021.06.25.	700 000	287,315	285,5810	1 213 826	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.25 Forward Eladás	2021.06.25.	1 857 000	287,397	285,5810	3 373 223	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.07.07 Forward Vétel	2021.07.07.	120 000	360,336	348,7395	-1 391 516	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.07.07 Forward Vétel	2021.07.07.	22 000	299,524	285,6614	-304 977	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.07.12 Forward Vétel	2021.07.12.	88 000	298,183	285,6917	-1 099 238	HUF	2021.05.31.
RUB/USD 21.06.07 Forward Vétel	2021.06.07.	80 000 000	74,697	73,4513	5 187 578	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.06.03 Forward Vétel	2021.06.03.	104 000	364,260	348,2708	-1 662 877	HUF	2021.05.31.
PLN/HUF 21.06.04 Forward Vétel	2021.06.04.	83 000	80,478	77,7102	-229 687	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.28 Forward Vétel	2021.06.28.	33 000	285,570	285,6000	989	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.06.21 Forward Vétel	2021.06.21.	139 000	351,395	348,5213	-399 439	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.06.18 Forward Vétel	2021.06.18.	41 000	356,125	348,4831	-313 320	HUF	2021.05.31.
PLN/HUF 21.06.28 Forward Vétel	2021.06.28.	2 110 000	79,815	77,7413	-4 375 527	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.06.30 Forward Vétel	2021.06.30.	100 000	300,509	285,6199	-1 488 927	HUF	2021.05.31.
EUR/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	68 000	360,780	348,7296	-819 424	HUF	2021.05.31.
USD/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	39 000	297,790	285,6497	-473 471	HUF	2021.05.31.
LIVE CATTLE FUTR Jun21 Vétel	2021.06.30.	2	116,150	115,8750	-62 770	HUF	2021.05.31.
SOYBEAN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	1	1 518,500	1 530,5000	171 192	HUF	2021.05.31.
CORN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	4	651,500	656,7500	299 586	HUF	2021.05.31.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	1	62,270	66,3200	1 155 546	HUF	2021.05.31.
COTTON NO.2 FUTR Jul21 Vétel	2021.07.08.	1	90,900	82,1200	-1 252 555	HUF	2021.05.31.
NATURAL GAS FUTR Jul21 Vétel	2021.06.28.	4	2,983	2,9860	29 959	HUF	2021.05.31.
EURO-BUND FUTURE Jun21 Eladás	2021.06.08.	6	170,080	169,9400	292 522	HUF	2021.05.31.
EURO-BUND FUTURE Jun21 Eladás	2021.06.08.	6	170,400	169,9400	961 142	HUF	2021.05.31.
SOYBEAN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	2	1 561,750	1 530,5000	-891 625	HUF	2021.05.31.
CORN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	4	711,500	656,7500	-3 124 254	HUF	2021.05.31.
COFFEE 'C' FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.20.	2	151,450	162,3500	2 332 491	HUF	2021.05.31.
COTTON NO.2 FUTR Jul21 Vétel	2021.07.08.	1	89,440	82,1200	-1 044 271	HUF	2021.05.31.
LIVE CATTLE FUTR Jun21 Vétel	2021.06.30.	2	115,200	115,8750	154 073	HUF	2021.05.31.
LME PRI ALUM FUTR Jul21 Vétel	2021.07.19.	5	2 477,500	2 473,2600	-151 220	HUF	2021.05.31.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	3	65,213	66,3200	947 263	HUF	2021.05.31.
SOYBEAN FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.14.	2	1 520,750	1 530,5000	278 187	HUF	2021.05.31.
US ULTRA BOND CBT Sep21 Eladás	2021.09.21.	6	185,094	185,2500	-267 488	HUF	2021.05.31.
BRENT CRUDE FUTR Aug21 Vétel	2021.06.30.	7	68,220	69,3200	2 197 888	HUF	2021.05.31.
EURO-BUND FUTURE Jun21 Eladás	2021.06.08.	10	169,900	169,9400	-139 296	HUF	2021.05.31.
GOLD 100 OZ FUTR Aug21 Vétel	2021.08.27.	1	1 896,400	1 905,3000	253 935	HUF	2021.05.31.
COTTON NO.2 FUTR Jul21 Vétel	2021.07.08.	1	88,400	82,1200	-895 905	HUF	2021.05.31.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	2	59,250	66,3200	4 034 425	HUF	2021.05.31.
COFFEE 'C' FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.20.	1	129,150	162,3500	3 552 234	HUF	2021.05.31.
COFFEE 'C' FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.20.	1	131,950	162,3500	3 252 648	HUF	2021.05.31.
LIVE CATTLE FUTR Jun21 Vétel	2021.06.30.	2	119,725	115,8750	-878 786	HUF	2021.05.31.
EURO-BUND FUTURE Jun21 Eladás	2021.06.08.	10	171,060	169,9400	3 900 288	HUF	2021.05.31.
WTI CRUDE FUTURE Jul21 Vétel	2021.06.22.	2	63,310	66,3200	1 717 626	HUF	2021.05.31.
PLATINUM FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.28.	2	1 236,000	1 182,4000	-1 529 315	HUF	2021.05.31.
COPPER FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.28.	2	459,900	467,7500	1 119 881	HUF	2021.05.31.
COPPER FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.28.	4	473,012	467,7500	-1 501 496	HUF	2021.05.31.
<b>Összesen</b>					<b>-3 432 528</b>	<b>HUF</b>	<b>2021.05.31.</b>
USD/HUF 21.07.22 Forward Eladás	2021.07.22.	700 000	293,035	296,1783	-2 200 290	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.29 Forward Vétel	2021.07.29.	131 000	351,650	352,3195	87 706	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.29 Forward Vétel	2021.07.29.	33 000	293,180	296,2278	100 577	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.30 Forward Vétel	2021.07.30.	100 000	294,871	296,2390	136 827	HUF	2021.06.30.
PLN/HUF 21.07.29 Forward Vétel	2021.07.29.	2 088 000	78,038	77,9101	-268 114	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.26 Forward Eladás	2021.07.26.	500 000	354,390	352,2814	1 054 315	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.22 Forward Eladás	2021.07.22.	1 857 000	292,852	296,1782	-6 176 142	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.22 Forward Eladás	2021.07.22.	200 000	293,070	296,1783	-621 658	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.22 Forward Eladás	2021.07.22.	500 000	297,690	296,1808	754 585	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.15 Forward Vétel	2021.07.15.	67 000	286,210	296,1363	665 061	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.19 Forward Vétel	2021.07.19.	126 000	352,628	352,1802	-56 459	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.22 Forward Vétel	2021.07.22.	94 000	299,298	296,1817	-292 959	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	24 000	283,750	296,0493	295 182	HUF	2021.06.30.
PLN/HUF 21.07.07 Forward Vétel	2021.07.07.	112 000	77,567	77,8700	33 878	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	170 000	347,160	351,9597	815 951	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.12 Forward Vétel	2021.07.12.	53 000	347,760	352,0095	225 223	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.21 Forward Vétel	2021.07.21.	64 000	355,075	352,2115	-183 264	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.22 Forward Vétel	2021.07.22.	139 000	356,135	352,2222	-543 886	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	68 000	360,780	351,9605	-599 724	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.06 Forward Vétel	2021.07.06.	39 000	297,790	296,0501	-67 856	HUF	2021.06.30.
EUR/HUF 21.07.07 Forward Vétel	2021.07.07.	120 000	360,336	351,9606	-1 004 990	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.07 Forward Vétel	2021.07.07.	22 000	299,524	296,0602	-76 203	HUF	2021.06.30.
USD/HUF 21.07.12 Forward Vétel	2021.07.12.	88 000	298,183	296,0703	-185 922	HUF	2021.06.30.
LME PRI ALUM FUTR Jul21 Vétel	2021.07.19.	5	2 477,500	2 519,5000	1 554 210	HUF	2021.06.30.
US ULTRA BOND CBT Sep21 Eladás	2021.09.21.	6	185,094	192,6875	-13 488 323	HUF	2021.06.30.
GOLD 100 OZ FUTR Aug21 Vétel	2021.08.27.	1	1 896,400	1 771,6000	-3 694 579	HUF	2021.06.30.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	549,750	588,5000	2 294 310	HUF	2021.06.30.
WHEAT FUTURE (CBT) Sep21 Vétel	2021.09.14.	4	652,250	679,5000	1 613 418	HUF	2021.06.30.
SUGAR #11 (WORLD) Oct21 Vétel	2021.09.30.	3	16,780	17,8900	1 104 111	HUF	2021.06.30.



Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
LIVE CATTLE FUTR Aug21 Vétel	2021.08.31.	6	118,650	122,7250	2 895 271	HUF	2021.06.30.
EURO-BUND FUTURE Sep21 Eladás	2021.09.08.	32	171,750	172,6100	-9 684 288	HUF	2021.06.30.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	8	549,000	588,5000	4 677 432	HUF	2021.06.30.
WTI CRUDE FUTURE Dec21 Vétel	2021.11.19.	8	67,650	70,1300	5 873 434	HUF	2021.06.30.
COPPER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.28.	3	422,250	428,9000	1 476 499	HUF	2021.06.30.
COTTON NO.2 FUTR Dec21 Vétel	2021.12.08.	4	85,345	84,9000	-263 476	HUF	2021.06.30.
NATURAL GAS FUTR Sep21 Vétel	2021.08.27.	4	3,259	3,6240	4 322 184	HUF	2021.06.30.
PLATINUM FUTURE Oct21 Vétel	2021.10.27.	2	1 057,400	1 072,9000	458 862	HUF	2021.06.30.
BRENT CRUDE FUTR Dec21 Vétel	2021.10.29.	7	71,690	72,3700	1 409 150	HUF	2021.06.30.
COFFEE 'C' FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.20.	4	151,000	159,7500	3 885 525	HUF	2021.06.30.
SILVER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.28.	1	25,985	26,1940	309 362	HUF	2021.06.30.
GOLD 100 OZ FUTR Aug21 Vétel	2021.08.27.	1	1 775,900	1 771,6000	-127 297	HUF	2021.06.30.
LUMBER FUTURE Jul21 Vétel	2021.07.15.	1	906,500	716,0000	-6 203 518	HUF	2021.06.30.
COPPER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.28.	2	414,800	428,9000	2 087 082	HUF	2021.06.30.
SOYBEAN FUTURE Nov21 Vétel	2021.11.12.	5	1 313,750	1 399,0000	6 309 353	HUF	2021.06.30.
Összesen					-8 108 160	HUF	2021.06.30.
PLN/HUF 21.08.30 Forward Vétel	2021.08.30.	2 088 000	78,268	78,3399	150 181	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.09.23 Forward Eladás	2021.09.23.	700 000	306,570	300,8605	3 996 673	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.09.02 Forward Vétel	2021.09.02.	100 000	302,005	300,6515	-135 307	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.23 Forward Vétel	2021.08.23.	220 000	358,195	358,0401	-34 073	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.12 Forward Vétel	2021.08.12.	88 000	302,987	300,4308	-224 953	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.30 Forward Vétel	2021.08.30.	39 000	304,306	300,6338	-143 216	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	82 000	351,390	357,7684	523 031	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	170 000	351,810	357,7685	1 012 950	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	22 000	298,501	300,4095	41 996	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	120 000	353,729	357,7690	484 764	HUF	2021.07.30.
PLN/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	71 000	78,657	78,2801	-26 796	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.16 Forward Vétel	2021.08.16.	67 000	302,880	300,5013	-159 370	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.19 Forward Vétel	2021.08.19.	129 000	360,081	357,9714	-272 150	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.23 Forward Vétel	2021.08.23.	74 000	360,180	358,0417	-158 233	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.23 Forward Eladás	2021.08.23.	500 000	306,405	300,5647	2 920 214	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.09.23 Forward Eladás	2021.09.23.	1 857 000	306,525	300,8604	10 519 004	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.23 Forward Vétel	2021.08.23.	139 000	359,400	358,0411	-188 889	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.26 Forward Eladás	2021.08.26.	500 000	357,931	358,0998	-84 424	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.30 Forward Vétel	2021.08.30.	85 000	359,807	358,1717	-139 001	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	39 000	296,500	300,4090	152 452	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.09 Forward Vétel	2021.08.09.	24 000	296,500	300,4090	93 817	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.09.23 Forward Eladás	2021.09.23.	200 000	306,610	300,8605	1 149 892	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.23 Forward Vétel	2021.08.23.	94 000	304,810	300,5634	-399 143	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.08.12 Forward Vétel	2021.08.12.	53 000	358,740	357,8103	-49 274	HUF	2021.07.30.
USD/HUF 21.08.12 Forward Eladás	2021.08.12.	300 000	298,310	300,4293	-635 796	HUF	2021.07.30.
LME PRI ALUM FUTR Sep21 Vétel	2021.09.13.	5	2 535,200	2 595,0000	2 245 042	HUF	2021.07.30.
US ULTRA BOND CBT Sep21 Eladás	2021.09.21.	6	185,094	199,5313	-26 016 952	HUF	2021.07.30.
LIVE CATTLE FUTR Aug21 Vétel	2021.08.31.	6	118,650	122,0750	2 468 795	HUF	2021.07.30.
EURO-BUND FUTURE Sep21 Eladás	2021.09.08.	20	171,750	176,5700	-34 474 568	HUF	2021.07.30.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	549,750	545,2500	-270 306	HUF	2021.07.30.
WHEAT FUTURE (CBT) Sep21 Vétel	2021.09.14.	4	652,250	703,7500	3 093 502	HUF	2021.07.30.
SUGAR #11 (WORLD) Oct21 Vétel	2021.09.30.	3	16,780	17,9100	1 140 331	HUF	2021.07.30.
WTI CRUDE FUTURE Dec21 Vétel	2021.11.19.	8	67,650	71,5700	9 418 662	HUF	2021.07.30.
COPPER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.28.	2	414,800	448,2500	5 023 186	HUF	2021.07.30.
COFFEE 'C' FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.20.	1	151,000	179,5500	3 215 515	HUF	2021.07.30.
SILVER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.28.	1	25,985	25,5470	-657 745	HUF	2021.07.30.
SOYBEAN FUTURE Nov21 Vétel	2021.11.12.	5	1 313,750	1 349,2500	2 665 518	HUF	2021.07.30.
COPPER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.28.	3	422,250	448,2500	5 856 630	HUF	2021.07.30.
COTTON NO.2 FUTR Dec21 Vétel	2021.12.08.	2	85,345	89,3900	1 214 875	HUF	2021.07.30.
NATURAL GAS FUTR Sep21 Vétel	2021.08.27.	4	3,259	3,9140	7 868 908	HUF	2021.07.30.
PLATINUM FUTURE Oct21 Vétel	2021.10.27.	2	1 057,400	1 048,4000	-270 306	HUF	2021.07.30.
BRENT CRUDE FUTR Dec21 Vétel	2021.10.29.	7	71,690	73,8000	4 436 022	HUF	2021.07.30.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	8	549,000	545,2500	-450 510	HUF	2021.07.30.
US 10YR NOTE (CBT) Sep21 Eladás	2021.09.21.	14	133,750	134,4531	-2 956 472	HUF	2021.07.30.
LUMBER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.15.	1	744,500	621,2000	-4 073 511	HUF	2021.07.30.
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	2	1 803,100	1 817,2000	846 959	HUF	2021.07.30.
PLATINUM FUTURE Oct21 Vétel	2021.10.27.	1	1 062,000	1 048,4000	-204 231	HUF	2021.07.30.
US 10YR NOTE (CBT) Sep21 Eladás	2021.09.21.	28	134,359	134,4531	-788 392	HUF	2021.07.30.
Összesen					18 394 349	HUF	2021.07.30.
EUR/HUF 21.11.26 Forward Eladás	2021.11.26.	500 000	349,840	350,2982	-229 114	HUF	2021.08.31.
PLN/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	40 000	78,000	76,8919	-44 323	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.09 Forward Vétel	2021.09.09.	120 000	354,436	348,6215	-697 766	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.13 Forward Vétel	2021.09.13.	66 000	353,075	348,6816	-289 963	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.13 Forward Vétel	2021.09.13.	88 000	301,672	294,8725	-598 320	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	300 000	303,665	295,2849	2 514 026	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	67 000	301,470	296,5319	-330 854	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.23 Forward Vétel	2021.09.23.	171 000	351,522	348,9425	-441 136	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.23 Forward Vétel	2021.09.23.	74 000	351,055	348,9420	-156 361	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.30 Forward Vétel	2021.09.30.	85 000	350,890	349,0822	-153 659	HUF	2021.08.31.
PLN/HUF 21.09.30 Forward Vétel	2021.09.30.	2 088 000	76,650	76,8498	417 082	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.23 Forward Vétel	2021.09.23.	359 000	351,170	348,9421	-799 809	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.23 Forward Vétel	2021.09.23.	94 000	299,278	295,0440	-398 031	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.30 Forward Vétel	2021.09.30.	39 000	298,140	295,1237	-117 634	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.09 Forward Vétel	2021.09.09.	82 000	354,266	348,6214	-462 887	HUF	2021.08.31.
EUR/HUF 21.09.09 Forward Vétel	2021.09.09.	170 000	354,400	348,6215	-982 350	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.09 Forward Vétel	2021.09.09.	22 000	298,716	294,8410	-85 246	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.09 Forward Vétel	2021.09.09.	39 000	298,690	294,8410	-150 112	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.09 Forward Vétel	2021.09.09.	24 000	298,700	294,8410	-92 616	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.23 Forward Eladás	2021.09.23.	1 857 000	306,525	295,0509	21 307 176	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.23 Forward Eladás	2021.09.23.	200 000	306,610	295,0510	2 311 799	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.09.23 Forward Eladás	2021.09.23.	700 000	306,570	295,0510	8 063 324	HUF	2021.08.31.
USD/HUF 21.10.04 Forward Vétel	2021.10.04.	92 000	295,402	295,1603	-22 214	HUF	2021.08.31.
US ULTRA BOND CBT Dec21 Eladás	2021.12.21.	6	197,813	197,2813	939 491	HUF	2021.08.31.
WHEAT FUTURE (CBT) Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	735,750	722,2500	-795 879	HUF	2021.08.31.
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	2	1 803,100	1 818,1000	884 310	HUF	2021.08.31.
PLATINUM FUTURE Oct21 Vétel	2021.10.27.	1	1 062,000	1 014,1000	-705 974	HUF	2021.08.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EURO-BUND FUTURE Sep21 Eladás	2021.09.08.	20	171,750	175,4500	-25 787 520	HUF	2021.08.31.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	549,750	534,2500	-913 787	HUF	2021.08.31.
SUGAR #11 (WORLD) Oct21 Vétel	2021.09.30.	3	16,780	19,8400	3 030 707	HUF	2021.08.31.
WTI CRUDE FUTURE Dec21 Vétel	2021.11.19.	5	67,650	67,9400	427 416	HUF	2021.08.31.
SOYBEAN FUTURE Nov21 Vétel	2021.11.12.	5	1 313,750	1 292,5000	-1 565 966	HUF	2021.08.31.
COTTON NO.2 FUTR Dec21 Vétel	2021.12.08.	2	85,345	92,5300	2 117 922	HUF	2021.08.31.
PLATINUM FUTURE Oct21 Vétel	2021.10.27.	2	1 057,400	1 014,1000	-1 276 354	HUF	2021.08.31.
BRENT CRUDE FUTR Dec21 Vétel	2021.10.29.	7	71,690	71,0000	-1 423 739	HUF	2021.08.31.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	8	549,000	534,2500	-1 739 143	HUF	2021.08.31.
LUMBER FUTURE Sep21 Vétel	2021.09.15.	1	744,500	482,8000	-8 485 544	HUF	2021.08.31.
LME PRI ALUM FUTR Sep21 Vétel	2021.09.13.	5	2 535,200	2 713,0000	6 551 263	HUF	2021.08.31.
COPPER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	3	437,150	437,5000	77 377	HUF	2021.08.31.
SILVER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	24,085	24,0060	-116 434	HUF	2021.08.31.
US 10YR NOTE (CBT)Dec21 Eladás	2021.12.21.	42	133,453	133,4531		HUF	2021.08.31.
LIVE CATTLE FUTR Oct21 Vétel	2021.10.29.	6	129,083	126,9000	-1 544 595	HUF	2021.08.31.
NATURAL GAS FUTR Oct21 Vétel	2021.09.28.	4	3,913	4,3770	5 470 931	HUF	2021.08.31.
COFFEE 'C' FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.20.	1	180,450	195,9000	1 707 824	HUF	2021.08.31.
<b>Összesen</b>					<b>28 561 012</b>	<b>HUF</b>	<b>2021.08.31.</b>
USD/HUF 21.10.14 Forward Vétel	2021.10.14.	88 000	295,667	310,8972	1 340 285	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	1 857 000	300,959	310,8823	-18 426 937	HUF	2021.09.30.
TRY/USD 21.10.25 Forward Eladás	2021.10.25.	6 000 000	8,929	9,0007	1 692 897	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	600 000	360,070	360,8794	-485 621	HUF	2021.09.30.
PLN/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	40 000	78,000	77,8701	-5 196	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	300 000	303,665	310,8844	-2 165 811	HUF	2021.09.30.
TRY/USD 21.10.25 Forward Eladás	2021.10.25.	4 000 000	8,988	9,0014	212 915	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	200 000	301,000	310,8823	-1 976 458	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	600 000	353,106	360,8739	-4 660 465	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	171 000	355,485	363,1764	1 315 294	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	56 000	355,210	363,1748	446 031	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	307 000	355,300	363,1753	2 417 729	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.25 Forward Vétel	2021.10.25.	105 000	301,601	310,9892	985 776	HUF	2021.09.30.
PLN/EUR 21.10.29 Forward Vétel	2021.10.29.	4 500 000	4,596	4,6358	-3 032 725	HUF	2021.09.30.
PLN/HUF 22.02.28 Forward Vétel	2022.02.28.	2 054 000	78,390	78,3404	-101 909	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 22.01.04 Forward Vétel	2022.01.04.	102 000	311,329	312,0068	69 097	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	500 000	349,366	360,8710	-5 752 713	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.13 Forward Eladás	2021.10.13.	1 000 000	295,814	310,8782	-15 064 350	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	22 000	293,726	310,8677	377 121	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	39 000	293,700	310,8676	669 538	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	24 000	293,840	310,8677	408 666	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	71 000	349,873	360,8421	778 806	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	82 000	349,550	360,8419	925 933	HUF	2021.09.30.
EUR/HUF 21.10.12 Forward Vétel	2021.10.12.	125 000	349,590	360,8419	1 406 487	HUF	2021.09.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	67 000	301,470	312,1526	715 731	HUF	2021.09.30.
COFFEE 'C' FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.20.	1	180,450	194,0000	1 578 541	HUF	2021.09.30.
COPPER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	3	437,150	408,9000	-6 582 109	HUF	2021.09.30.
SILVER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	24,085	22,0470	-3 165 625	HUF	2021.09.30.
US 10YR NOTE (CBT)Dec21 Eladás	2021.12.21.	42	133,453	131,6094	24 056 734	HUF	2021.09.30.
US ULTRA BOND CBT Dec21 Eladás	2021.12.21.	6	197,813	191,0625	12 581 730	HUF	2021.09.30.
WHEAT FUTURE (CBT) Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	735,750	725,5000	-636 853	HUF	2021.09.30.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	549,750	536,7500	-807 716	HUF	2021.09.30.
WTI CRUDE FUTURE Dec21 Vétel	2021.11.19.	5	67,650	74,7000	10 950 765	HUF	2021.09.30.
SOYBEAN FUTURE Nov21 Vétel	2021.11.12.	5	1 313,750	1 256,0000	-4 485 154	HUF	2021.09.30.
COTTON NO.2 FUTR Dec21 Vétel	2021.12.08.	1	85,345	105,8000	3 177 275	HUF	2021.09.30.
BRENT CRUDE FUTR Dec21 Vétel	2021.10.29.	7	71,690	78,3100	14 395 984	HUF	2021.09.30.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	8	549,000	536,7500	-1 522 234	HUF	2021.09.30.
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	1 803,100	1 757,0000	-1 432 143	HUF	2021.09.30.
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	1 794,800	1 757,0000	-1 174 295	HUF	2021.09.30.
WTI CRUDE FUTURE Dec21 Vétel	2021.11.19.	5	68,750	74,7000	9 242 135	HUF	2021.09.30.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	19,850	20,3400	511 471	HUF	2021.09.30.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	6	131,833	130,6500	-882 275	HUF	2021.09.30.
PLATINUM FUTURE Jan22 Vétel	2022.01.27.	4	971,275	962,4000	-551 422	HUF	2021.09.30.
EURO-BUND FUTURE Dec21 Eladás	2021.12.08.	20	171,670	169,8200	13 339 240	HUF	2021.09.30.
COPPER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	429,800	408,9000	-1 623 199	HUF	2021.09.30.
LME PRI ALUM FUTR Dec21 Vétel	2021.12.13.	3	2 889,500	2 857,2500	-751 409	HUF	2021.09.30.
SILVER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	2	21,555	22,0470	1 528 447	HUF	2021.09.30.
<b>Összesen</b>					<b>-37 909 879</b>	<b>HUF</b>	<b>2021.09.30.</b>
USD/HUF 22.01.04 Forward Vétel	2022.01.04.	102 000	311,329	310,7721	-56 843	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 21.11.12 Forward Vétel	2021.11.12.	71 000	358,882	361,0689	155 247	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 21.11.12 Forward Vétel	2021.11.12.	82 000	358,700	361,0688	194 240	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 21.11.12 Forward Vétel	2021.11.12.	169 000	358,820	361,0688	380 055	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	142 000	312,780	311,0081	-251 605	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 22.01.14 Forward Eladás	2022.01.14.	600 000	361,650	362,8050	-692 976	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 21.12.14 Forward Eladás	2021.12.14.	500 000	311,780	310,3633	708 344	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 21.11.15 Forward Eladás	2021.11.15.	1 100 000	360,528	361,2094	-749 662	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 21.12.14 Forward Eladás	2021.12.14.	2 857 000	312,356	310,3647	5 689 554	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	88 000	312,756	311,0080	-153 822	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 21.11.22 Forward Vétel	2021.11.22.	89 000	362,456	361,3813	-95 674	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	67 000	301,470	310,9565	635 593	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	171 000	355,485	363,0328	1 290 740	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	56 000	355,210	363,0314	438 001	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	307 000	355,300	363,0319	2 373 688	HUF	2021.10.29.
PLN/HUF 22.02.28 Forward Vétel	2022.02.28.	2 054 000	78,390	78,4198	61 197	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 21.11.26 Forward Vétel	2021.11.26.	118 000	312,582	310,0935	-293 638	HUF	2021.10.29.
EUR/HUF 21.11.22 Forward Vétel	2021.11.22.	90 000	365,840	361,3854	-400 911	HUF	2021.10.29.
PLN/HUF 22.01.12 Forward Vétel	2022.01.12.	40 000	78,755	78,2820	-18 920	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 21.11.12 Forward Vétel	2021.11.12.	22 000	310,168	309,8202	-7 663	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 21.11.12 Forward Vétel	2021.11.12.	39 000	310,260	309,8202	-17 151	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 21.11.12 Forward Vétel	2021.11.12.	24 000	310,225	309,8202	-9 715	HUF	2021.10.29.
COFFEE 'C' FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.20.	1	202,100	203,9500	214 834	HUF	2021.10.29.
SOYBEAN FUTURE Jan22 Vétel	2021.11.12.	5	1 249,250	1 249,5000	19 354	HUF	2021.10.29.
WTI CRUDE FUTURE Jun22 Vétel	2022.05.20.	10	75,069	75,4200	1 086 942	HUF	2021.10.29.
BRENT CRUDE FUTR Jun22 Vétel	2022.04.29.	7	78,540	78,8700	715 338	HUF	2021.10.29.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	1 758,900	1 783,9000	774 175	HUF	2021.10.29.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	19,850	19,2700	-603 485	HUF	2021.10.29.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	6	131,833	134,2250	1 777 505	HUF	2021.10.29.
SILVER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	2	21,555	23,9490	7 413 500	HUF	2021.10.29.
PLATINUM FUTURE Jan22 Vétel	2022.01.27.	4	971,275	1 020,7000	3 061 088	HUF	2021.10.29.
COFFEE 'C' FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.20.	1	180,450	203,9500	2 728 967	HUF	2021.10.29.
COPPER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	3	437,150	436,8000	-81 288	HUF	2021.10.29.
SILVER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	24,085	23,9490	-210 576	HUF	2021.10.29.
US 10YR NOTE (CBT)Dec21 Eladás	2021.12.21.	42	133,453	130,7031	35 766 885	HUF	2021.10.29.
US ULTRA BOND CBT Dec21 Eladás	2021.12.21.	6	197,813	196,4063	2 612 841	HUF	2021.10.29.
WHEAT FUTURE (CBT) Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	735,750	772,7500	2 291 558	HUF	2021.10.29.
COPPER FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	429,800	436,8000	541 923	HUF	2021.10.29.
EURO-BUND FUTURE Dec21 Eladás	2021.12.08.	20	171,670	168,1200	25 616 800	HUF	2021.10.29.
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	1 794,800	1 783,9000	-337 540	HUF	2021.10.29.
LME PRI ALUM FUTR Dec21 Vétel	2021.12.13.	3	2 889,500	2 718,7500	-3 965 711	HUF	2021.10.29.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	4	549,750	568,2500	1 145 779	HUF	2021.10.29.
CORN FUTURE Dec21 Vétel	2021.12.14.	8	549,000	568,2500	2 384 459	HUF	2021.10.29.
GOLD 100 OZ FUTR Dec21 Vétel	2021.12.29.	1	1 803,100	1 783,9000	-594 566	HUF	2021.10.29.
PLATINUM FUTURE Jan22 Vétel	2022.01.27.	2	1 055,250	1 020,7000	-1 069 910	HUF	2021.10.29.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	2	133,150	134,2250	266 316	HUF	2021.10.29.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	20,010	19,2700	-769 963	HUF	2021.10.29.
Összesen					9 178 077	HUF	2021.10.29.
USD/HUF 22.01.04 Forward Vétel	2022.01.04.	102 000	311,329	323,6836	1 260 129	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	142 000	312,780	324,0435	1 599 424	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.14 Forward Eladás	2022.01.14.	600 000	361,650	368,4642	-4 088 515	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 21.12.14 Forward Eladás	2021.12.14.	500 000	311,780	322,9735	-5 596 757	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 21.12.14 Forward Eladás	2021.12.14.	2 857 000	312,356	322,9738	-30 334 905	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	88 000	312,756	324,0434	993 295	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	67 000	301,470	323,9971	1 509 315	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	171 000	355,485	368,7984	2 276 654	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	56 000	355,210	368,7971	760 878	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	307 000	355,300	368,7975	4 143 738	HUF	2021.11.30.
PLN/HUF 22.02.28 Forward Vétel	2022.02.28.	2 011 000	78,390	78,5784	378 935	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.04 Forward Vétel	2022.01.04.	58 000	311,103	323,6829	729 637	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.10 Forward Vétel	2022.01.10.	99 000	361,170	368,3253	708 376	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.10 Forward Vétel	2022.01.10.	99 000	311,390	323,8370	1 232 258	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	22 000	318,724	324,0680	117 578	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	39 000	318,850	324,0685	203 521	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	24 000	319,000	324,0691	121 658	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	71 000	367,027	368,6334	114 053	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	82 000	366,682	368,6320	159 905	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	260 000	366,800	368,6324	476 435	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.14 Forward Eladás	2022.01.14.	1 100 000	367,201	368,4851	-1 412 769	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Eladás	2022.01.18.	1 100 000	365,770	368,6282	-3 144 033	HUF	2021.11.30.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	404 000	368,570	368,8587	116 620	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	68 000	325,359	324,0952	-85 931	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.26 Forward Vétel	2022.01.26.	118 000	330,022	324,3273	-671 925	HUF	2021.11.30.
CORN FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.14.	12	572,250	567,5000	-919 980	HUF	2021.11.30.
WHEAT FUTURE (CBT) Mar22 Vétel	2022.03.14.	4	832,500	787,2500	-2 921 340	HUF	2021.11.30.
GOLD 100 OZ FUTR Apr22 Vétel	2022.04.27.	1	1 809,500	1 778,3000	-1 007 136	HUF	2021.11.30.
GOLD 100 OZ FUTR Apr22 Vétel	2022.04.27.	1	1 805,100	1 778,3000	-865 104	HUF	2021.11.30.
COPPER FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.29.	3	431,000	428,0000	-726 300	HUF	2021.11.30.
SILVER FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.29.	3	23,349	22,8150	-2 585 628	HUF	2021.11.30.
US 10YR NOTE (CBT)Mar22 Eladás	2022.03.22.	42	130,250	130,8125	-7 626 150	HUF	2021.11.30.
US ULTRA BOND CBT Mar22 Eladás	2022.03.22.	6	197,680	200,5625	-5 583 432	HUF	2021.11.30.
WTI CRUDE FUTURE Jan22 Vétel	2021.12.20.	8	66,660	66,1800	-1 239 552	HUF	2021.11.30.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	19,850	18,6000	-1 355 760	HUF	2021.11.30.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	6	131,833	137,9000	4 699 967	HUF	2021.11.30.
EURO-BUND FUTURE Dec21 Eladás	2021.12.08.	8	171,670	172,3700	-2 054 248	HUF	2021.11.30.
LME PRI ALUM FUTR Dec21 Vétel	2021.12.13.	3	2 889,500	2 640,5000	-6 028 290	HUF	2021.11.30.
PLATINUM FUTURE Jan22 Vétel	2022.01.27.	2	1 055,250	927,3000	-4 130 226	HUF	2021.11.30.
SOYBEAN FUTURE Jan22 Vétel	2021.11.12.	5	1 249,250	1 217,2500	-2 582 400	HUF	2021.11.30.
WTI CRUDE FUTURE Jun22 Vétel	2022.05.20.	8	75,069	64,4700	-27 370 858	HUF	2021.11.30.
BRENT CRUDE FUTR Jun22 Vétel	2022.04.29.	6	78,540	67,8200	-20 762 496	HUF	2021.11.30.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	2	133,150	137,9000	1 226 640	HUF	2021.11.30.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	20,010	18,6000	-1 529 297	HUF	2021.11.30.
Összesen					-28 432 427	HUF	2021.11.30.
USD/HUF 22.01.04 Forward Vétel	2022.01.04.	102 000	311,329	325,8056	1 476 575	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	150 000	366,480	369,8532	505 978	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Eladás	2022.01.18.	2 857 000	325,588	326,3485	-2 172 645	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	51 000	329,385	326,3561	-154 488	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	200 000	370,960	370,1522	-161 565	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	142 000	312,780	326,3226	1 923 055	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.14 Forward Eladás	2022.01.14.	600 000	361,650	369,4717	-4 693 036	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	88 000	312,756	326,3226	1 193 860	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.04 Forward Vétel	2022.01.04.	58 000	311,103	325,8056	852 748	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.10 Forward Vétel	2022.01.10.	99 000	361,170	369,3438	809 209	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.10 Forward Vétel	2022.01.10.	99 000	311,390	325,9390	1 440 352	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	22 000	318,724	326,3346	167 445	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	39 000	318,850	326,3349	291 910	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	24 000	319,000	326,3352	176 044	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	71 000	367,027	369,8543	200 738	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	82 000	366,682	369,8536	260 079	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	260 000	366,800	369,8538	793 996	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.14 Forward Eladás	2022.01.14.	1 100 000	367,201	369,4776	-2 504 471	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.18 Forward Eladás	2022.01.18.	1 100 000	365,770	369,8518	-4 489 930	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	404 000	368,570	370,1458	636 605	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	68 000	325,359	326,3480	67 259	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.26 Forward Vétel	2022.01.26.	118 000	330,022	326,6498	-397 868	HUF	2021.12.31.
USD/HUF 22.01.18 Forward Vétel	2022.01.18.	67 000	301,470	326,2998	1 663 600	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	171 000	355,485	370,1106	2 501 047	HUF	2021.12.31.
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	56 000	355,210	370,1099	834 393	HUF	2021.12.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 22.01.24 Forward Vétel	2022.01.24.	307 000	355,300	370,1101	4 546 704	HUF	2021.12.31.
PLN/HUF 22.02.28 Forward Vétel	2022.02.28.	1 928 000	78,390	80,5358	4 137 088	HUF	2021.12.31.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	19,850	18,8800	-1 061 554	HUF	2021.12.31.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	6	131,833	139,7000	6 149 404	HUF	2021.12.31.
CORN FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.14.	12	572,250	593,2500	4 103 946	HUF	2021.12.31.
WHEAT FUTURE (CBT) Mar22 Vétel	2022.03.14.	4	832,500	770,7500	-4 022 518	HUF	2021.12.31.
GOLD 100 OZ FUTR Apr22 Vétel	2022.04.27.	1	1 809,500	1 831,0000	700 277	HUF	2021.12.31.
GOLD 100 OZ FUTR Apr22 Vétel	2022.04.27.	1	1 805,100	1 831,0000	843 589	HUF	2021.12.31.
COPPER FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.29.	3	431,000	446,3500	3 749 736	HUF	2021.12.31.
SILVER FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.29.	3	23,349	23,3520	14 657	HUF	2021.12.31.
US 10YR NOTE (CBT)Mar22 Eladás	2022.03.22.	42	130,250	130,4688	-2 992 461	HUF	2021.12.31.
US ULTRA BOND CBT Mar22 Eladás	2022.03.22.	6	197,680	197,1250	1 084 003	HUF	2021.12.31.
EURO-BUND FUTURE Mar22 Eladás	2022.03.08.	8	174,510	171,3700	9 287 115	HUF	2021.12.31.
LME PRI ALUM FUTR Jan22 Vétel	2022.01.17.	3	2 620,500	2 803,0000	4 458 156	HUF	2021.12.31.
WTI CRUDE FUTURE Jun22 Vétel	2022.05.20.	8	75,069	73,3700	-4 427 050	HUF	2021.12.31.
BRENT CRUDE FUTR Jun22 Vétel	2022.04.29.	6	78,540	76,3900	-4 201 659	HUF	2021.12.31.
LUMBER FUTURE Jan22 Eladás	2022.01.14.	1	1 010,100	1 147,9000	-4 937 112	HUF	2021.12.31.
SOYBEAN FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.14.	5	1 368,500	1 339,2500	-2 381 754	HUF	2021.12.31.
LUMBER FUTURE Jan22 Eladás	2022.01.14.	1	1 105,000	1 147,9000	-1 537 025	HUF	2021.12.31.
LIVE CATTLE FUTR Feb22 Vétel	2022.02.28.	2	133,150	139,7000	1 706 720	HUF	2021.12.31.
SUGAR #11 (WORLD) Mar22 Vétel	2022.02.28.	3	20,010	18,8800	-1 236 656	HUF	2021.12.31.
Összesen					9 904 682	HUF	2021.12.31.

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

#### Az Alapkezelő tulajdonosi szerkezetében bekövetkezett változások

Az Aegon N.V. 2020 novemberében megállapodott a Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe-val (VIG) a magyarországi, lengyelországi, romániai és törökországi biztosítási, nyugdíj-megtakarítási és alapkezelési üzletágának értékesítéséről. A szerződő felek a vonatkozó jogszabályi rendelkezések szerint kezdeményezték a szükséges hatósági engedélyek beszerzését minden érintett országban.

2021. áprilisában a magyar Belügyminisztérium megvétózta a tervezett tranzakciót, melynek okán a VIG egyeztetést kezdeményezett a magyar Pénzügyminisztériummal. A tárgyalások eredményeképp a felek 2022. februárjában megállapodást írtak alá, mely alapján a magyar fél képviseletében a Corvinus Befektetési Zrt. – a VIG 55%-os irányító befolyása mellett - 45%-os kisebbségi tulajdonosi részesedést szerez az Aegon Biztosítóban és az Union Biztosítóban. A tranzakció két lépcsőben került lezárásra: 2022. március 23-án az Aegon-csoporttól a VIG megvásárolta az Aegon Biztosítót a magyarországi leányvállalataival együtt, 2022. március 25-én pedig a VIG az Aegon és Union Biztosítók 45%-os tulajdonrészét értékesítette a Magyar Állam részére. Ennek következtében az Aegon Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt. közvetetten 55% VIG és 45% Magyar állami tulajdonba került.

#### Covid-19 Alapra gyakorolt hatásai

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, az oltások tömeges elterjedése 2021-ben valósult meg. Tekintettel arra, hogy világszerte növekszik az átoltottság, valamint a vakcinákon túl már megjelennek gyógyszerek is a piacon, ezért várakozásaink szerint az elkövetkezendő években esetlegesen felbukkanó Covid-mutánsok már korántsem lesznek olyan

jelentős hatással a pénz-és tőkepiaci mozgásokra - ezáltal az Alap tevékenységére - , mint a járvány kezdeti éveiben.

### **Az ukrán-orosz válság Alapra gyakorolt hatásai**

Az Alapkezelő kockázatkezelési részlege a fokozódó orosz-ukrán politikai feszültség miatt 2022. január vége óta fokozott monitoringot működtet a releváns kitétségek nyomon követésére és a szükséges döntések előkészítésére. A befektetési részleg kiemelten nyomon követte a geopolitikai fejleményeket és értékelt a lehetséges forgatókönyveket. A megvalósult, szélsőségesen negatív forgatókönyvet a befektetési részlegünk az alacsony valószínűséggel bekövetkező scenáriók között tartotta számon.

2022. február 24-én háborúvá eszkalálódott a konfliktus, ezért a Likviditási politika alapján a Kockázatkezelési Vezető összehívta a Likviditási Bizottságot, amely szükség esetén naponta akár több alkalommal is ülésezett, elemzte a helyzetet, és döntés előkészítési feladatokat látott el. A kiemelt fókuszba azon alapjaink kerültek, amelyek közvetlenül vagy közvetve szignifikáns mértékben tartalmaztak oroszországi vagy ukránai kibocsátású eszközöket.

Az Alapkezelő a jogszabályi rendelkezésekkel összhangban, figyelemmel a befektetői érdekekre a szükséges és lehetséges intézkedéseket haladéktalanul megtette. Ezen intézkedési körben hozott döntés értelmében 2022. február 24-én a következő 5 befektetési alap folyamatos forgalmazásának átmeneti felfüggesztése mellett döntött:

Aegon Russia Részvény Befektetési Alap

Aegon Feltörekvő Európa Kötvény Befektetési Alap

Aegon Prémium Dynamic Alapokba Fektető Részalap

Aegon Prémium Expert Alapokba Fektető Részalap

Aegon Tempó Maxx Alapokba Fektető Részalap

Az Aegon Russia Részvény Befektetési Alap kivételével a felfüggesztett alapok folyamatos forgalmazása 2022. március 1-én újraindult és azóta is folyamatos. Az Aegon Russia Részvény Befektetési Alap esetében az Alapkezelő kérelmére a forgalmazás felfüggesztését a Magyar Nemzeti Bank, mint Felügyelet a felfüggesztését kiváltó okok megszűnésének időpontjáig, de legfeljebb 2023. március 25. napjáig meghosszabbította.

Mindazonáltal elmondható, hogy az Alapkezelő által kezelt közvetlen vagyon összességében csekély mértékben tartalmaz orosz illetve ukrán kitétséget, ugyanakkor a konfliktus közvetett negatív hatása jelentős volt azokra a régiókra és piacokra, amelyek hagyományosan jelentős részt tesznek ki a kezelt portfóliók

befektetési mixében. Ez utóbbi helyzet hatékony kezelése a jelenleg a befektetési részleg stratégiai fókuszában van

### Alap dokumentumaiban bekövetkező változások

2021. márciusában az Alap hivatalos dokumentumaiban beépítésre kerültek a Közzétételi Rendelet [Európai Parlament és Tanács 2019/2088 rendelete a pénzügyi szolgáltatási ágazatban a fenntarthatósággal kapcsolatos közzétételekről (2019. november 27.)], és a Taxonómia Rendelet [Európai Parlament és Tanács 2020/852 rendelete a fenntartható befektetések előmozdítását célzó keret létrehozásáról, valamint az 2019/2088 módosításáról (2020. június 18.)] által megfogalmazott elvárások.

A fenti változások nem érintették az alap befektetési politikáját, az a 2021-es évben nem változott.

Az Alap egy magas kockázatú származtatott alap. A befektetési politikájával összhangban, a portfólióban részvények, rövid és hosszú lejáratú forintban és devizában kibocsátott államkötvények, vállalati kötvények, átváltható kötvények és származtatott termékek lehetnek. Az alapban a portfóliómenedzserek globális makrofolyamatokról kialakított képe alapján alakítjuk ki az eszközosztályok közti allokációt és választunk egyedi befektetési instrumentumokat. 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)
Létszám adatok (fő)	57	6
Rögzített	707 123 791	219 556 085
Változó	109 889 812	54 523 947
Nyereségrészesedés	0	0

### c) javadalmazások és juttatások kiszámításának módja

A bónusz rendszer az Igazgatóság tagjai, a nem junior vagyongazdálkodók és elemzők, az értékesítési terület tapasztalt kollégái, valamint az Adminisztrációs igazgatóság részlegvezetői 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 a tulajdonos cégcsoport 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 a tulajdonos cégcsoport javadalmazási bizottsága által meghatározott feltételrendszer alapján kiszámított és általuk jóváhagyott bónusz keret mennyisége.

**d) javadalmazási politika felülvizsgálatának eredménye**

A belső ellenőrzés a javadalmazási politika végrehajtásának legutóbbi éves felülvizsgálata során nem tett megállapítást, mindent az előírásoknak megfelelőnek talált. Az ellenőri jelentésről az Alapkezelő Felügyelő Bizottságát is tájékoztatták.

**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 3,95%.

**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 idő	kockázati besorolás
<b>Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap</b>	HUF	3 év	5 (jelentős)

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 az általa felvett pozíciók segítségével, megfelelő kockázati limitek mellett az árfolyamok változásából tőkenövekedésre tegyen szert. Az alap a különböző befektetési eszközökből igyekszik a legnagyobb szabadsággal, iparági vagy földrajzi specifikáció nélkül válogatni. Az alap különböző eszközökben levő közép és hosszú távú trendek kombinációit használva részvényeket, kötvényeket és egyéb értékpapírokat vásárolhat, vagy kölcsönvétel után adhat el rövidre, tőzsdei vagy tőzsdén kívüli határidős ügyletek segítségével vehet fel vételi, illetve eladási pozíciókat, valamint opciós ügyleteket köthet. Az alap kezelője fundamentális és technikai elemzés segítségével választja ki a befektetési eszközöket, és azokat úgy

kombinálja, hogy ésszerű kockázatok mellett az alapnak lehetősége és mozgástere legyen a referenciamutatót meghaladó hozamot elérni. Az alap nem jelöl ki magának befektetési célországot, illetve régiót vagy iparágat, de kitékintése globális, pozícióinak jelentős részét pedig az Amerikai Egyesült Államok és az Európai Unió tagországainak piacain veszi fel. Az alap a jogszabályban meghatározott limitek és szorzószámok figyelembe vételével tőkeáttételes, illetve nettó eladási (short) pozíciókat is felvehet.

Az Alapkezelő a kockázatkezelési és megfelelési feladatok ellátására külön szervezeti részleget hozott 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 kitétségre vonatkozó törvényi, szerződéses és belső limiteket, valamint azon befektetési korlátokat, melyeket az Alapkezelő az Alap kezelési szabályzatában felállított és befektetői irányába kommunikált.

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

## **XI. Tőkeáttétel alkalmazása**

Az Alap származtatott befektetési alap, ezért tőkeáttételt speciális befektetési szabályok figyelembevételével vehet fel. Az Alap jogszabályban meghatározott szorzószámokkal korrigált értéken számított nettósított kockázati kitétsége nem haladhatja meg a nettó eszközértékének a kétszeresét. Az Alap korrekció nélkül számított nettósított kockázati kitétsége pedig nem haladhatja meg a nettó eszközértékének nyolcszorosát, azaz az Alap felvehető tőkeáttétel maximális értéke 8. 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 jogszabályban meghatározott szorzószámokkal korrigált értéken számított nettósított kockázati kitétsége 2021.12.31-én a következő: 1.24. Az Alap teljes nettósított kockázati kitétsége 2021.12.31-én a következő: 1.43.



**XII. Eredménykimutatás****Aegon Panoráma Származtatott Befektetési Alap**

	Előző év eFT	Tárgyév eFT
I. Pénzügyi műveletek bevételei	1 063 207	1 265 942
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	1 232 548	618 807
III. Egyéb bevételek	14	1 589
IV. Működési költségek	57 486	73 198
V. Egyéb ráfordítások	1 593	2 954
VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
<b>Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.-VI.)</b>	<b>-228 406</b>	<b>572 572</b>

*Az Alap 2021. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.*