



H O L D
A L A P K E Z E L Ő

HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap

Éves jelentés

2023

Tartalomjegyzék

I. FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

II. ÉVES JELENTÉS

III. ÉVES BESZÁMOLÓ

MÉRLEG

EREDMÉNYKIMUTATÁS

CASH FLOW KIMUTATÁS

KIEGÉSZÍTŐ MELLÉKLET

IV. ÜZLETI JELENTÉS



FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

A HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük a HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap (az „Alap”) 2023. évi éves jelentésének I - VII. pontjaiban található számviteli információinak (a „számviteli információk”) könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap mellékelt 2023. december 31-ével végződő üzleti évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a Magyarországon hatályos, a számvitelről szóló 2000. évi C. törvénnyel (a „számviteli törvény”), valamint a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek összeállításra. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban szereplő eszközök és kötelezettségek leltárral alátámasztottak. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

A vélemény alapja

Könyvvizsgálatunkat a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálói Standardokkal összhangban és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok alapján hajtottuk végre. Ezen standardok értelmében fennálló felelősségünk bővebb leírását jelentésünk „*A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége*” szakasza tartalmazza.

Függetlenek vagyunk az Alaptól és annak kezelőjétől, a HOLD Alapkezelő Zrt.-től a vonatkozó, Magyarországon hatályos jogszabályokban és a Magyar Könyvvizsgálói Kamara „A könyvvizsgálói hivatás magatartási (etikai) szabályairól és a fegyelmi eljárásról szóló szabályzata”-ban, valamint az ezekben nem rendezett kérdések tekintetében a Könyvvizsgálók Nemzetközi Etikai Standardok Testülete által kiadott „Nemzetközi etikai kódex kamarai tag könyvvizsgálóknak (a nemzetközi függetlenségi standardokkal egybefoglalva)” című kézikönyvében (az IESBA Kódex-ben) foglaltak szerint, és megfelelünk az ugyanezen normákban szereplő további etikai előírásoknak is.

Meggyőződésünk, hogy az általunk megszerzett könyvvizsgálói bizonyíték elegendő és megfelelő alapot nyújt véleményünkhöz.

Egyéb információk

Az egyéb információk az éves jelentésben foglalt nem számviteli információkból állnak. A HOLD Alapkezelő Zrt. ügyvezetése (a „vezetés”) felelős az egyéb információk elkészítéséért. Az éves jelentésben közölt számviteli információkra a független könyvvizsgálói jelentésünk „Vélemény” szakaszában adott véleményünk nem vonatkozik az egyéb információkra, és az egyéb információkra vonatkozóan nem bocsátunk ki semmilyen formájú bizonyosságot nyújtó következtetést.

Az éves jelentés általunk végzett könyvvizsgálatával kapcsolatban a mi felelősségünk az egyéb információk átolvasása és ennek során annak mérlegelése, hogy az éves jelentésben foglalt egyéb információk lényegesen ellentmondanak-e az éves jelentésben közölt számviteli információknak vagy a könyvvizsgálat során szerzett ismereteinknek, vagy egyébként úgy tűnik-e, hogy azok lényeges hibás állítást tartalmaznak. Ha az elvégzett munkánk alapján arra a következtetésre jutunk, hogy az egyéb információk lényeges hibás állítást tartalmaznak, kötelességünk erről és a hibás állítás jellegéről jelentést tenni.

Az egyéb információkban lényeges ellentmondás vagy lényeges hibás állítás nem jutott a tudomásunkra, így e tekintetben nincs jelenteni valónk.

A vezetés és az irányítással megbízott személyek felelőssége az éves jelentésben közölt számviteli információkért

A vezetés felelős a megbízható és valós képet adó éves beszámoló elkészítéséért a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel és a számviteli törvénnyel összhangban, különös tekintettel az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által megadott értékelése alapján történő elszámolásáért, valamint az olyan belső kontrollért, amelyet a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állítástól mentes éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése során a vezetés felelős azért, hogy felmérje az Alapnak a vállalkozás folytatására való képességét és az adott helyzetnek megfelelően közze tegye a vállalkozás folytatásával kapcsolatos információkat, valamint a vezetés felel a vállalkozás folytatásának elvén alapuló, éves jelentésben közölt számviteli információk összeállításáért. A vezetésnek a vállalkozás folytatásának elvéből kell kiindulnia, ha ennek az elvnek az érvényesülését eltérő rendelkezés nem akadályozza, illetve a vállalkozási tevékenység folytatásának ellentmondó tényező, körülmény nem áll fenn.

Az irányítással megbízott személyek felelősek az Alap pénzügyi beszámolási folyamatának felügyeletéért.

A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálataért való felelőssége

A könyvvizsgálat során célunk kellő bizonyosságot szerezni arról, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk egésze nem tartalmaz akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állítást, valamint az, hogy ennek alapján a véleményünket tartalmazó független könyvvizsgálói jelentést bocsássunk ki. A kellő bizonyosság magas fokú bizonyosság, de nem garancia arra, hogy a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvényekkel és egyéb jogszabályokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálat mindig feltárja az egyébként létező lényeges hibás állítást. A hibás állítások eredhetnek csalásból vagy hibából, és lényegesnek minősülnek, ha észszerű lehet az a várakozás, hogy ezek önmagukban vagy együttesen befolyásolhatják a felhasználók adott éves jelentésben közölt számviteli információk alapján meghozott gazdasági döntéseit.

A Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardok és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok szerinti könyvvizsgálat egésze során szakmai megítélést alkalmazunk és szakmai szkepticizmust tartunk fenn.

Továbbá:

- Azonosítjuk és felmérjük az éves jelentésben közölt számviteli információk akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állításainak a kockázatait, kialakítjuk és végrehajtjuk az ezen kockázatok kezelésére alkalmas könyvvizsgálati eljárásokat, valamint elegendő és megfelelő könyvvizsgálati bizonyítékot szerzünk a véleményünk megalapozásához. A csalásból eredő lényeges hibás állítás fel nem tárásának a kockázata nagyobb, mint a hibából eredőé, mivel a csalás magában foglalhat összejátszást, hamisítást, szándékos kihagyásokat, téves nyilatkozatokat, vagy a belső kontroll felülírását.
- Megismerjük a könyvvizsgálat szempontjából releváns belső kontrollt annak érdekében, hogy olyan könyvvizsgálati eljárásokat tervezzünk meg, amelyek az adott körülmények között megfelelőek, de nem azért, hogy a belső kontroll hatékonyságára vonatkozóan véleményt nyilvánítsunk.
- Értékeljük a vezetés által alkalmazott számviteli politika megfelelőségét és a vezetés által készített számviteli becslések és kapcsolódó közzétételek észszerűségét.
- Következtetést vonunk le arról, hogy helyénvaló-e a vezetés részéről a vállalkozás folytatásának elvén alapuló számvitel alkalmazása, valamint a megszerzett könyvvizsgálati bizonyíték alapján arról, hogy fennáll-e lényeges bizonytalanság olyan eseményekkel vagy feltételekkel kapcsolatban, amelyek jelentős kétséget vethetnek fel az Alap vállalkozás folytatására való képességét illetően.

- Amennyiben azt a következtetést vonjuk le, hogy lényeges bizonytalanság áll fenn, független könyvvizsgálói jelentésünkben fel kell hívnunk a figyelmet az éves jelentésben közölt számviteli információkban lévő kapcsolódó közzétételekre, vagy ha a közzétételek e tekintetben nem megfelelőek, minősítenünk kell véleményünket.
- Következtetéseink a független könyvvizsgálói jelentésünk dátumáig megszerzett könyvvizsgálói bizonyítékon alapulnak. Jövőbeli események vagy feltételek azonban okozhatják azt, hogy az Alap nem tudja a vállalkozást folytatni.
- Megvizsgáljuk az éves jelentésben közölt számviteli információkat, különös tekintettel az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárára, valamint az adott időszakban elszámolt kezelési költségekre. Megvizsgáljuk, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek-e összeállításra.

Az irányítással megbízott személyek tudomására hozzuk - egyéb kérdések mellett - a könyvvizsgálat tervezett hatókörét és ütemezését, a könyvvizsgálat jelentős megállapításait, beleértve az Alapkezelő által alkalmazott belső kontrollnak a könyvvizsgálatunk során általunk azonosított jelentős hiányosságait is, ha voltak ilyenek.

Budapest, 2024. április 17.

Dr. Hegedűs Mihály
a HK ADÓCONTROLL Kft. képviselőjeként
illetve, mint bejegyzett könyvvizsgáló
HK ADÓCONTROLL Kft.
6055. Felsőlajos, Hársfa utca 10.
kamarai nyilvántartási szám: 002125
bejegyzett könyvvizsgáló kamarai tagsági szám: 006219

ÉVES JELENTÉS

A HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap Éves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült, melynek melléklete az Alap Éves Beszámolója.

I. Vagyongkimutatás

adatok Ft-ban

2023.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	30 248 623 026	85,28%	85,91%
ADRIAS GRUPA DD - PFD	874 955 079	2,47%	2,49%
ALIBABA GROUP ADR	292 021 638	0,82%	0,83%
ALPHA BANK	394 519 801	1,11%	1,12%
AP MOLLER MAERSK B ORD	520 529 815	1,47%	1,48%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	939 773 666	2,65%	2,67%
BILFINGER BERGER AG	469 866 071	1,32%	1,33%
CAIRO MEZZ ORD	94 442 868	0,27%	0,27%
CENTRAL EUROPE & RUSSIA FUND	172 942 848	0,49%	0,49%
DAIWA INDUSTRIES	265 429 008	0,75%	0,75%
DEEP VALUE DRILLER ORD	325 418 060	0,92%	0,92%
DIGI	1 075 976 768	3,03%	3,06%
ENEA SA	1 043 846 103	2,94%	2,96%
ERSTE BANK STAMMAKT	853 412 221	2,41%	2,42%
EUROBANK HOLDINGS SA	1 180 565 655	3,33%	3,35%
EUROCASH	483 319 474	1,36%	1,37%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	239 638 559	0,68%	0,68%
FOTEX HOLDING SE ORDINARY SHARES	386 439 254	1,09%	1,10%
FOURLIS	602 844 815	1,70%	1,71%
GALAXY COSMOS MEZZ PLC	102 802 072	0,29%	0,29%
GRAPHISOFT PARK SE	522 303 233	1,47%	1,48%
HELLENIC BANK PUBLIC COMPANY ORD	780 680 671	2,20%	2,22%
HYUNDAI MOTOR AKTIE	95 038 431	0,27%	0,27%
HYUNDAI MOTOR GDR	80 238 968	0,23%	0,23%
ISHARES MSCI POLAND INVESTABLE ETF	353 893 657	1,00%	1,01%
JUMBO R	761 494 264	2,15%	2,16%
KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF	456 469 344	1,29%	1,30%
LINAMAR CORP	592 503 564	1,67%	1,68%
MAGYAR TELEKOM	1 208 098 210	3,41%	3,43%
MÁK 2027/B	1 129 609 318	3,18%	3,21%
MAYR MELNHOF KARTON	633 904 580	1,79%	1,80%
MPC CONTAINER SHIP	240 469 613	0,68%	0,68%
MURAKAMI CORP	193 627 434	0,55%	0,55%
NAK KAZA JOINT STOCK COMP NAT GDR	589 446 874	1,66%	1,67%
NATL BANK OF GREECE SA	995 660 105	2,81%	2,83%
NEW WORLD RES 4% 10/07/20	86 265	0,00%	0,00%
OHASHI TECHNICA	167 801 670	0,47%	0,48%
ORANGE POLSKA	811 535 927	2,29%	2,30%
ORIGIN ENTERPRISES ORD	732 927 515	2,07%	2,08%
PEPCO GROUP ORD	765 615 385	2,16%	2,17%
PKN ORLEN	1 028 182 579	2,90%	2,92%
POSTNL	490 050 333	1,38%	1,39%
PUBLIC POWER CORPORATION	550 467 344	1,55%	1,56%
PZU	633 603 011	1,79%	1,80%
RICHTER GEDEON	423 972 500	1,20%	1,20%
ROMANIA 2% 2032/01/28	653 218 242	1,84%	1,86%
ROMANIA 7.625% 2053/01/17	200 237 816	0,56%	0,57%
SHELL ORD	466 747 680	1,32%	1,33%

SUNRISEMEZZ PLC	31 766 379	0,09%	0,09%
TRINITY INDUSTRIAL CORP	132 294 583	0,37%	0,38%
US TREASURY 0.125% 2052/02/15	708 833 867	2,00%	2,01%
US TREASURY 0.625% 2043/02/15	364 645 169	1,03%	1,04%
VALARIS ORD	908 643 698	2,56%	2,58%
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	687 558 682	1,94%	1,95%
VIENNA INSURANCE GROUP	1 097 037 911	3,09%	3,12%
VOLKSWAGEN ELS.	441 214 429	1,24%	1,25%
Banki egyenlegek	3 035 478 453	8,56%	8,62%
AED	0	0,00%	0,00%
ARS	4 539	0,00%	0,00%
CAD	7 083 793	0,02%	0,02%
CHF	269 219	0,00%	0,00%
CZK	19 678	0,00%	0,00%
DKK	224 718	0,00%	0,00%
EUR	2 474 925 584	6,98%	7,03%
GBP	2 349 589	0,01%	0,01%
HUF	2 363 137	0,01%	0,01%
JPY	13 498 186	0,04%	0,04%
NOK	20 681 325	0,06%	0,06%
PLN	164 241	0,00%	0,00%
RON	473 844 626	1,34%	1,35%
RUB	1 054	0,00%	0,00%
TRY	33 863	0,00%	0,00%
USD	40 014 901	0,11%	0,11%
Követelések (ügyletszámla)	1 248 363 894	3,52%	3,55%
AED	0	0,00%	0,00%
EUR	500 221 268	1,41%	1,42%
USD	748 142 626	2,11%	2,12%
Egyéb eszközök	937 900 535	2,64%	2,66%
Követelések értékpapír eladásból	80 526 771	0,23%	0,23%
Követelések értékpapír kölcsönadásból	0	0,00%	0,00%
Követelések értékpapír kölcsönadásból értékkülönbözete	0	0,00%	0,00%
Egyéb követelés	0	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek változó letét	567 189 150	1,60%	1,61%
Származtatott ügyletek	276 772 946	0,78%	0,79%
Aktív időbeli elhatárolások	13 411 668	0,04%	0,04%
Összes ESZKÖZ	35 470 365 908	100,00%	100,74%
Kötelezettségek	261 632 576	0,74%	0,74%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	77 636 249	0,22%	0,22%
Kötelezettségek bizományosi jutalékból	126 532	0,00%	0,00%
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	0	0,00%	0,00%
Kötelezettségek kölcsönkapott értékpapírból	0	0,00%	0,00%
Felügyeleti díj	2 934 000	0,01%	0,01%
Alapkezelői díj	168 884 796	0,48%	0,48%
Letétkezelői díj	1 849 628	0,01%	0,01%
Bizományosi díj	234 674	0,00%	0,00%
Forgalmazási díj	0	0,00%	0,00%
Sikerdíj	0	0,00%	0,00%
Könyvelési díj	625 000	0,00%	0,00%
Könyvvizsgálói díj	660 400	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek jutaléka	0	0,00%	0,00%
Különadó	4 188 000	0,01%	0,01%
Borrowing cost	546 017	0,00%	0,00%
Carrying Cost	251 249	0,00%	0,00%
Térítés nélkül kapott értékpapír bekerülési értéke miatt	3 696 031	0,01%	0,01%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	35 208 733 332	99,26%	100,00%

adatok Ft-ban

2022.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	21 738 812 413	83,23%	86,26%
NEW WORLD RES 4% 10/07/20	23 195	0,00%	0,00%
ADRI GRUPA DD - PFD	701 463 071	2,69%	2,78%
ALIBABA GROUP ADR	359 893 457	1,38%	1,43%
ALPHA BANK	268 047 825	1,03%	1,06%
ANADOLU EFES BIRACILIK	276 027 728	1,06%	1,10%
AP MOLLER MAERSK B ORD	382 575 193	1,46%	1,52%
ARYZTA AG	380 326 335	1,46%	1,51%
BILFINGER BERGER AG	607 003 636	2,32%	2,41%
CAIRO MEZZ ORD	5 860 589	0,02%	0,02%
DAIWA INDUSTRIES	201 905 544	0,77%	0,80%
DEEP VALUE DRILLER ORD	375 265 508	1,44%	1,49%
DIGI	715 376 847	2,74%	2,84%
ELECTRICA SA	451 431 174	1,73%	1,79%
ERSTE BANK STAMMAKT	707 277 773	2,71%	2,81%
EUROBANK HOLDINGS SA	707 986 405	2,71%	2,81%
EUROCASH	448 551 326	1,72%	1,78%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	179 975 905	0,69%	0,71%
FOTEX TÖRZSRÉSZVÉNY	396 101 073	1,52%	1,57%
FOURLIS	512 166 304	1,96%	2,03%
GALAXY COSMOS MEZZ PLC	2 445 119	0,01%	0,01%
HELLENIC BANK PUBLIC COMPANY ORD	287 862 702	1,10%	1,14%
HYUNDAI MOTOR AKTIE	69 380 387	0,27%	0,28%
HYUNDAI MOTOR GDR	58 737 568	0,22%	0,23%
ISHARES MSCI POLAND INVESTABLE ETF	331 056 730	1,27%	1,31%
JUMBO R	527 637 608	2,02%	2,09%
KOC HOLDING	207 647 371	0,80%	0,82%
KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF	448 148 672	1,72%	1,78%
LINAMAR CORP	554 960 670	2,12%	2,20%
LYXOR ETF MSCI RUSSIA	3 692 739	0,01%	0,01%
MAYR MELNHOF KARTON	333 150 489	1,28%	1,32%
MOTOR OIL CORINTH REFINERIES R	326 779 686	1,25%	1,30%
MPC CONTAINER SHIP	340 250 625	1,30%	1,35%
MURAKAMI CORP	103 647 462	0,40%	0,41%
NAK KAZA JOINT STOCK COMP NAT GDR	382 693 194	1,47%	1,52%
NATL BANK OF GREECE SA	600 829 036	2,30%	2,38%
NOBLE CORPORATION ORD	278 421 944	1,07%	1,10%
OHASHI TECHNICA	118 175 243	0,45%	0,47%
PKN ORLEN	779 112 334	2,98%	3,09%
PKO BANK POLSKI	427 342 073	1,64%	1,70%
POSTNL	392 720 697	1,50%	1,56%
PUBLIC POWER CORPORATION	499 278 454	1,91%	1,98%
PZU	778 592 586	2,98%	3,09%
ROMGAZ SA	175 160 178	0,67%	0,70%
SHELL ORD	564 908 487	2,16%	2,24%
TAURON POLSKA ENERGIA SA	464 608 436	1,78%	1,84%
TRINITY INDUSTRIAL CORP	89 083 452	0,34%	0,35%
VALARIS ORD	731 620 270	2,80%	2,90%
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	689 087 283	2,64%	2,73%
VANECK VECTORS RUSSIA ETF	6 730 957	0,03%	0,03%
VIENNA INSURANCE GROUP	809 128 389	3,10%	3,21%
VOLKSWAGEN ELS.	409 588 553	1,57%	1,63%
GRAPHISOFT PARK SE	428 079 970	1,64%	1,70%
MAGYAR TELEKOM	761 992 335	2,92%	3,02%
RICHTER GEDEON	294 591 900	1,13%	1,17%

US TREASURY 0.625% 2043/02/15	394 290 913	1,51%	1,56%
US TREASURY 0.125% 2052/02/15	390 119 013	1,49%	1,55%
Banki egyenlegek	895 694 089	3,43%	3,55%
ARS	14 091	0,00%	0,00%
CAD	3 505 540	0,01%	0,01%
CHF	265 725	0,00%	0,00%
CZK	21 331	0,00%	0,00%
DKK	394 726	0,00%	0,00%
EUR	3 296 511	0,01%	0,01%
GBP	2 412 520	0,01%	0,01%
HUF	371 822 890	1,42%	1,48%
JPY	6 331 669	0,02%	0,03%
NOK	39 251 261	0,15%	0,16%
PLN	163 929 294	0,63%	0,65%
RON	11 850	0,00%	0,00%
RUB	1 406	0,00%	0,00%
TRY	194 494	0,00%	0,00%
USD	304 240 781	1,16%	1,21%
Követelések (ügyletszámla)	1 203 069 439	4,61%	4,77%
EUR	230 913 892	0,88%	0,92%
USD	972 155 547	3,72%	3,86%
Egyéb eszközök	2 280 738 710	8,73%	9,05%
Követelések értékpapír eladásból	380 525 509	1,46%	1,51%
Határidős ügyletek változó letét	796 215 000	3,05%	3,16%
Származtatott ügyletek	1 059 042 270	4,05%	4,20%
Aktív időbeli elhatárolások	44 955 931	0,17%	0,18%
Összes ESZKÖZ	26 118 314 651	100,00%	103,64%
Kötelezettségek	917 067 572	3,51%	3,64%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	783 836 652	3,00%	3,11%
Kötelezettségek bizományosi jutalékból	0	0,00%	0,00%
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	0	0,00%	0,00%
Kötelezettségek kölcsönkapott értékpapírból	0	0,00%	0,00%
Felügyeleti díj	2 100 000	0,01%	0,01%
Alapkezelői díj	120 854 419	0,46%	0,48%
Letétkezelői díj	1 342 153	0,01%	0,01%
Bizományosi díj	568 667	0,00%	0,00%
Forgalmazási díj	0	0,00%	0,00%
Sikerdíj	0	0,00%	0,00%
Könyvelési díj	317 500	0,00%	0,00%
Könyvvizsgálói díj	446 443	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek jutaléka	0	0,00%	0,00%
Különadó	2 997 000	0,01%	0,01%
Borrowing cost	559 208	0,00%	0,00%
Carrying Cost	1 490 906	0,01%	0,01%
Corporate Actions	2 554 624	0,01%	0,01%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	25 201 247 079	96,49%	100,00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Forgalomban lévő befektetési jegyek száma : 4 223 413 786 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó Eszközérték

Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték : 8,33749
(befektetési jegy névértéke 1 HUF)

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NAV %-ban	Záró állomány (Ft)	NAV %-ban
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	19 930 565 735	79,07%	25 977 683 427	73,77%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0,00%	0	0,00%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0,00%	0	0,00%
Egyéb átruházható értékpapírok	1 023 836 752	4,06%	1 214 395 187	3,45%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	784 409 926	3,11%	3 056 544 412	8,68%
Származtatott pozíciók értéke	1 059 042 270	4,20%	276 772 946	0,79%
Nettó eszközérték	25 206 241 355	100,00%	35 212 669 573	100,00%

V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban**a) Befektetésből származó jövedelem**

PÉNZÜGYI BEVÉTELEK		2023.12.31	adatok Ft-ban
			9 112 100 943
Árfolyamnyereség értékpapír értékesítésből			2 151 704 484
ebből: Államkötvények, diszkont kincstárjegyek			18 839 948
Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok			22 877 635
Részvények			1 988 692 769
Jelzáloglevelek			0
Befektetési jegyek			121 294 132
Értékpapírok után kapott kamat, osztalék			853 769 911
Bankoktól kapott kamat			160 730 346
Értékpapír kölcsönzési díj			0
Adott óvadék kamata			0
Devizakészletek átváltásának árfolyamnyeresége			4 299 215 569
Külföldi pénzürt. eszközök, követelés - kötelezettség árfolyamnyeresége			78 028 548
Lezárt és lejárt határidős ügyletek árfolyamnyeresége			1 394 401 479
Opció díjbevétele			163 501 019
Forgalmazási jutalék, büntető jutalék bevétele			0
Saxo Corporate action			2 479 697
CYEP Income			8 269 890
Hozamfizető alap hozama			0

PÉNZÜGYI RÁFORDÍTÁSOK		2023.12.31	3 781 273 754
Árfolyamvesztesség értékpapír értékesítésből			206 709 820
ebből: Államkötvények, diszkont kincstárjegyek			58 645 036
Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok			25 727 119
Részvények			122 337 665
Jelzáloglevelek			0
Befektetési jegyek			0
Értékpapírok vételárában fizetett kamat, osztalék			0
Banki kamat			1 854 420
Értékpapír kölcsönzési díj			7 481 852
Short hitel kamat			0
Devizakészletek átváltásának árfolyamvesztése			1 299 067 938
Külföldi pénzürt. eszközök, követelés - kötelezettség árfolyamvesztése			85 532 816
Lezárt és lejárt határidős ügyletek árfolyamvesztése			1 144 927 708
Opció nyitási díj			989 168 717
Értékpapírok után kapott osztalék kamata			0
Saxo Corporate action			46 530 483

BEFEKTETÉSBŐL SZÁRMAZÓ JÖVEDELEM	5 330 827 189
----------------------------------	---------------

b) Egyéb bevételek

EGYÉB BEVÉTELEK		adatok Ft-ban 2023.12.31
Céltartalék felhasználás		0
Egyéb bevétel		6 048 337
Értékvesztések (AIH)		0
Összesen :		6 048 337

c) Kezelési költségek d) Letétkezelő díja

KEZELÉSI KÖLTSÉGEK és LETÉTKÉZELŐ DÍJA		adatok Ft-ban 2023.12.31
Bizományosi díj		21 779 897
Forgalmazási díj		0
Sikerdíj		0
Könyvelési díj		2 500 000
Könyvvizsgálói díj		660 400
Bankköltség		6 691 573
Folyószla.felhamozott kamat		0
Bankköltség (negatív kamat)		3 000 658
Alapkezelői díj		589 145 457
Letétkezelői díj		18 558 090
Borrowing cost		0
Összesen :		642 336 075

e) Egyéb díjak és adók

EGYÉB DÍJAK és ADÓK		adatok Ft-ban 2023.12.31
Egyéb ráfordítás		25 067 521
Értékvesztések (AIH)		0
Céltartalék képzés		0
Összesen :		25 067 521

f) Nettó jövedelem

Tárgyévi eredmény	4 669 472 eFt
-------------------	---------------

g) Felosztott és újra befektetett jövedelem

Az Alap a kezelési szabályzatában meghatározottaknak megfelelően hozamot nem fizet, így az Alap összes realizált jövedelme újra befektetésre kerül.

h) A tőkeszámla változásai

adatok eFt-ban

Az Alap saját tőkéjének és az egy jegyre jutó nettó eszközértékének változása			
Dátum	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó nettó eszközérték	Jegyek száma
2022.12.31	25 206 241 355,00	6,617531	3 809 010 040,00
2023.01.31	26 388 973 895,00	6,951627	3 796 086 012,00
2023.02.28	26 641 511 455,00	7,069979	3 768 259 015,00
2023.03.31	26 047 287 268,00	6,952584	3 746 418 260,00
2023.04.28	26 896 018 009,00	7,093240	3 791 781 716,00
2023.05.31	27 093 707 313,00	7,221175	3 751 980 325,00
2023.06.30	27 611 040 453,00	7,377741	3 742 478 732,00
2023.07.31	31 371 984 017,00	7,923603	3 959 307 854,00
2023.08.31	31 502 688 294,00	7,915120	3 980 064 634,00
2023.09.29	32 425 188 242,00	7,949355	4 078 971 145,00
2023.10.31	33 250 761 159,00	7,991706	4 160 658 723,00
2023.11.30	33 769 147 965,00	8,112490	4 162 612 129,00
2023.12.31	35 212 669 573,00	8,337490	4 223 413 786,00

i) A befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése

adatok eFt-ban

Befektetések értéknövekedése és értékcsökkenése	2022.12.31	2023.12.31
Értékpapírok	21 738 813	30 248 623
Értékpapírok	18 265 090	23 945 955
Értékpapírok értékkülönbözete	3 473 723	6 302 668
a) kamatokból, osztalékokból	68 782	169 708
b) egyéb	3 404 941	6 132 960

j) Minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire

Egyéb befolyásoló változás nem volt.

VI. Összehasonlító táblázat az Alap elmúlt három üzleti évéről

adatok eFt-ban

Az Alap elmúlt három üzleti évének összehasonlítása		
Dátum	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó nettó eszközérték
2021.12.31	22 321 501 292,00	5,577631
2022.12.31	25 206 241 355,00	6,617531
2023.12.31	35 212 669 573,00	8,337490

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.01.31	AAPL	CFD	-12 400	78 820 165
2023.01.31	CBA XASX	CFD	-13 000	-107 074 947
2023.01.31	CM:XYNS	CFD	-8 000	-2 965 643
2023.01.31	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-86 029 121
2023.01.31	MC:XPAR	CFD	-1 350	-61 035 487
2023.01.31	RY:XTSE	CFD	-10 250	-72 413 150
2023.01.31	TSLA:XNAS	CFD	-3 600	75 844 341
2023.01.31	USDCNHOP230215C6.80	DEVIZA OPCIO	4 500 000	3 518 234
2023.01.31	EURHUFF230328E428.2865	FORWARD	1 200 000	35 520 758
2023.01.31	EURHUFF230328E432.2	FORWARD	1 744 000	58 273 212
2023.01.31	EURHUFF230328V404.18	FORWARD	164 000	-1 002 658
2023.01.31	EURHUFF230328V404.51	FORWARD	1 030 000	-6 628 344
2023.01.31	EURHUFF230328V415.15	FORWARD	520 000	-8 736 933
2023.01.31	EURHUFF230328V417.588	FORWARD	1 232 000	-23 626 221
2023.01.31	EURHUFF230328V421.13	FORWARD	257 000	-5 815 417
2023.01.31	EURHUFF230406E398.75	FORWARD	3 502 000	1 002 669
2023.01.31	EURHUFF230713E461.14	FORWARD	10 000 000	469 012 043
2023.01.31	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	5 659 669
2023.01.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	-545 166
2023.01.31	EURUSDF230207E1.060239	FORWARD	600 000	-5 008 975
2023.01.31	EURUSDF230207E1.06448	FORWARD	1 030 000	-7 031 070
2023.01.31	EURUSDF230403V1.09514	FORWARD	1 100 000	-3 162 416
2023.01.31	JPYHUFF230214E3.176	FORWARD	92 580 000	36 986 409
2023.01.31	JPYHUFF230214E3.18	FORWARD	97 000 000	39 137 535
2023.01.31	PLNHUFF230420E84.62	FORWARD	840 000	297 706
2023.01.31	PLNHUFF230420E85.515	FORWARD	11 160 000	13 603 617
2023.01.31	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	25 292 322
2023.01.31	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	41 376 033
2023.01.31	RONHUFF230424E81.81	FORWARD	7 680 000	8 548 849
2023.01.31	RONHUFF230424E81.921	FORWARD	2 586 100	3 155 483
2023.01.31	RONHUFF230424E81.95	FORWARD	3 873 000	4 834 030
2023.01.31	TRYHUFF230221E20.37	FORWARD	8 383 000	10 408 244
2023.01.31	TRYHUFF230221E20.5191	FORWARD	5 067 000	7 039 222
2023.01.31	TRYHUFF230221V20.54	FORWARD	2 795 000	-3 940 737
2023.01.31	TRYHUFF230323E19.53	FORWARD	12 563 000	4 628 858
2023.01.31	TRYHUFF230323V19.3	FORWARD	10 000 000	-1 438 481
2023.01.31	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-13 612 060
2023.01.31	USDHUFF230209E378.8	FORWARD	260 000	4 760 272
2023.01.31	USDHUFF230209E397.17	FORWARD	2 000 000	73 192 891
2023.01.31	USDHUFF230209E398.04	FORWARD	193 000	7 230 272
2023.01.31	USDHUFF230209E399.15232	FORWARD	240 000	9 256 772
2023.01.31	USDHUFF230209E401.4559	FORWARD	160 000	6 538 103
2023.01.31	USDHUFF230209E402.48	FORWARD	355 000	14 868 343
2023.01.31	USDHUFF230209E435.4	FORWARD	682 600	50 959 627
2023.01.31	USDHUFF230417E378.05	FORWARD	500 000	5 007 133
2023.01.31	USDHUFF230713E421.28	FORWARD	6 791 000	285 280 104
2023.01.31	USDHUFF230713E431.1513	FORWARD	4 302 500	220 409 428
2023.01.31	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	275 967 428
2023.01.31	XAUUSDF230207V1640.751	FORWARD	2 100	217 884 291
2023.01.31	ESH3-S&P 500	FUTURES	-8	-16 522 280
2023.01.31	FESXH3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-101	-36 207 189

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.01.31	GCJ3 - COMEX	FUTURES	20	-1 221 212
2023.01.31	MMEH3	FUTURES	50	53 025 743
2023.01.31	SJBH3-MINI JGB	FUTURES	-125	54 118 121
2023.01.31	ZBH3-US T-NOTES	FUTURES	7	6 757 074
2023.02.28	AAPL	CFD	-12 400	64 745 260
2023.02.28	CBA XASX	CFD	-13 000	-73 027 008
2023.02.28	CM:XNYS	CFD	-8 000	-3 272 676
2023.02.28	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-72 094 471
2023.02.28	MC:XPAR	CFD	-1 350	-53 967 682
2023.02.28	RY:XTSE	CFD	-10 250	-77 883 251
2023.02.28	TSLA:XNAS	CFD	-4 400	34 258 617
2023.02.28	SX5EOP230317P4250	EP OPCIO	238	57 866 368
2023.02.28	EURHUFF230328E428.2865	FORWARD	1 200 000	52 183 329
2023.02.28	EURHUFF230328E432.2	FORWARD	1 744 000	82 575 178
2023.02.28	EURHUFF230328V398.36	FORWARD	135 000	-1 883 667
2023.02.28	EURHUFF230328V404.18	FORWARD	164 000	-3 230 236
2023.02.28	EURHUFF230328V404.51	FORWARD	1 030 000	-20 622 892
2023.02.28	EURHUFF230328V415.15	FORWARD	520 000	-15 871 611
2023.02.28	EURHUFF230328V417.588	FORWARD	1 232 000	-40 567 633
2023.02.28	EURHUFF230328V421.13	FORWARD	257 000	-9 360 892
2023.02.28	EURHUFF230406E398.75	FORWARD	3 502 000	45 232 597
2023.02.28	EURHUFF230713E461.14	FORWARD	10 000 000	585 765 840
2023.02.28	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	8 159 629
2023.02.28	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	9 466 415
2023.02.28	EURUSDF230403E1.076	FORWARD	2 100 000	9 870 385
2023.02.28	EURUSDF230403E1.08629	FORWARD	1 100 000	9 206 679
2023.02.28	EURUSDF230403V1.09514	FORWARD	1 100 000	-12 678 284
2023.02.28	EURUSDF230508E1.0836	FORWARD	1 030 000	6 794 976
2023.02.28	EURUSDF230508E1.084129	FORWARD	600 000	4 070 866
2023.02.28	JPYHUFF230515E2.901	FORWARD	97 000 000	17 954 875
2023.02.28	JPYHUFF230515E2.91	FORWARD	92 580 000	17 942 260
2023.02.28	PLNHUFF230420E84.62	FORWARD	840 000	2 387 686
2023.02.28	PLNHUFF230420E85.515	FORWARD	11 160 000	41 473 671
2023.02.28	PLNHUFF230420V82.13	FORWARD	3 207 000	-1 319 610
2023.02.28	PLNHUFF230420V84.44	FORWARD	605 000	-1 613 383
2023.02.28	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	40 516 574
2023.02.28	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	64 469 879
2023.02.28	RONHUFF230424E81.81	FORWARD	7 680 000	24 792 691
2023.02.28	RONHUFF230424E81.921	FORWARD	2 586 100	8 628 223
2023.02.28	RONHUFF230424E81.95	FORWARD	3 873 000	13 031 268
2023.02.28	RONHUFF230424V81.36	FORWARD	680 000	-1 896 990
2023.02.28	TRYHUFF230323E19.53	FORWARD	12 563 000	6 580 665
2023.02.28	TRYHUFF230323V19.3	FORWARD	10 000 000	-2 963 031
2023.02.28	TRYHUFF230821E17.50508	FORWARD	5 067 000	-6 672 956
2023.02.28	TRYHUFF230821E17.57	FORWARD	5 588 000	-7 022 336
2023.02.28	USDCNHF230817V6.7835	FORWARD	4 510 946	22 754 896
2023.02.28	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-13 337 634
2023.02.28	USDHUFF230411E365.83	FORWARD	130 000	314 724
2023.02.28	USDHUFF230411E375.52	FORWARD	367 600	4 382 194
2023.02.28	USDHUFF230411E375.96	FORWARD	2 000 000	24 704 946
2023.02.28	USDHUFF230411E375.981	FORWARD	400 000	4 949 225

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszköztérték
2023.02.28	USDHUFF230411E375.985	FORWARD	708 000	8 762 904
2023.02.28	USDHUFF230417E378.05	FORWARD	500 000	6 821 820
2023.02.28	USDHUFF230713E421.28	FORWARD	6 791 000	307 892 109
2023.02.28	USDHUFF230713E431.1513	FORWARD	4 302 500	235 095 439
2023.02.28	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	291 047 530
2023.02.28	XAUUSDF230307V1875.822	FORWARD	1 000	-16 936 615
2023.02.28	ESH3-S&P 500	FUTURES	-8	-71 638
2023.02.28	FESXH3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-101	-64 522 216
2023.02.28	GCJ3 - COMEX	FUTURES	31	-96 883 231
2023.02.28	SJBH3-MINI JGB	FUTURES	-135	47 423 114
2023.03.31	AAPL	CFD	-10 100	-18 191 543
2023.03.31	CBA XASX	CFD	-13 000	-63 768 371
2023.03.31	CM:XNYS	CFD	-8 000	6 067 552
2023.03.31	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-84 852 351
2023.03.31	MC:XPAP	CFD	-1 350	-82 616 767
2023.03.31	RY:XTSE	CFD	-10 250	-54 093 210
2023.03.31	TSLA:XNAS	CFD	-4 400	30 767 103
2023.03.31	EURJPYOP230426P137.5	DEVIZA OPCIO	5 000 000	2 292 065
2023.03.31	EURHUFF230406E398.75	FORWARD	3 502 000	58 659 793
2023.03.31	EURHUFF230707E397.75	FORWARD	91 000	271 707
2023.03.31	EURHUFF230707E401.13	FORWARD	1 360 000	8 462 169
2023.03.31	EURHUFF230707V393.87	FORWARD	1 000 000	729 361
2023.03.31	EURHUFF230713E461.14	FORWARD	10 000 000	627 266 077
2023.03.31	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	8 815 234
2023.03.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	11 074 235
2023.03.31	EURUSDF230403E1.076	FORWARD	2 100 000	-9 683 102
2023.03.31	EURUSDF230403E1.08629	FORWARD	1 100 000	-1 113 739
2023.03.31	EURUSDF230403V1.076	FORWARD	2 100 000	9 683 102
2023.03.31	EURUSDF230403V1.09514	FORWARD	1 100 000	-2 290 683
2023.03.31	EURUSDF230508E1.0836	FORWARD	1 030 000	-2 723 689
2023.03.31	EURUSDF230508E1.084129	FORWARD	600 000	-1 476 135
2023.03.31	EURUSDF230703E1.09412	FORWARD	2 100 000	-169 496
2023.03.31	JPYHUFF230515E2.901	FORWARD	97 000 000	21 235 509
2023.03.31	JPYHUFF230515E2.91	FORWARD	92 580 000	21 083 563
2023.03.31	PLNHUFF230420E82.51	FORWARD	224 000	123 971
2023.03.31	PLNHUFF230420E83.36	FORWARD	590 000	823 287
2023.03.31	PLNHUFF230420E83.75	FORWARD	600 000	1 069 028
2023.03.31	PLNHUFF230420E83.95	FORWARD	930 000	1 841 233
2023.03.31	PLNHUFF230420E84.62	FORWARD	840 000	2 220 525
2023.03.31	PLNHUFF230420E85.03	FORWARD	1 629 000	4 967 805
2023.03.31	PLNHUFF230420E85.29	FORWARD	88 000	291 029
2023.03.31	PLNHUFF230420E85.515	FORWARD	11 160 000	39 394 982
2023.03.31	PLNHUFF230420V82.13	FORWARD	3 207 000	-567 759
2023.03.31	PLNHUFF230420V84.44	FORWARD	605 000	-1 491 437
2023.03.31	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	38 406 025
2023.03.31	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	61 310 849
2023.03.31	RONHUFF230424E79.39	FORWARD	785 000	1 452 549
2023.03.31	RONHUFF230424E81.81	FORWARD	7 680 000	32 585 944
2023.03.31	RONHUFF230424E81.921	FORWARD	2 586 100	11 256 527
2023.03.31	RONHUFF230424E81.95	FORWARD	3 873 000	16 969 066
2023.03.31	RONHUFF230424V81.36	FORWARD	680 000	-2 582 681

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.03.31	TRYHUFF230724E17.36	FORWARD	1 933 000	-1 646 285
2023.03.31	TRYHUFF230821E17.50508	FORWARD	5 067 000	-3 328 312
2023.03.31	TRYHUFF230821E17.57	FORWARD	5 588 000	-3 329 442
2023.03.31	USDCNH230817V6.7835	FORWARD	4 510 946	7 145 975
2023.03.31	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-10 041 287
2023.03.31	USDHUFF230411E365.83	FORWARD	130 000	1 884 146
2023.03.31	USDHUFF230411E375.52	FORWARD	367 600	8 870 346
2023.03.31	USDHUFF230411E375.96	FORWARD	2 000 000	49 136 048
2023.03.31	USDHUFF230411E375.981	FORWARD	400 000	9 835 564
2023.03.31	USDHUFF230411E375.985	FORWARD	708 000	17 411 764
2023.03.31	USDHUFF230417E378.05	FORWARD	500 000	12 975 502
2023.03.31	USDHUFF230713E421.28	FORWARD	6 791 000	389 799 655
2023.03.31	USDHUFF230713E431.1513	FORWARD	4 302 500	287 522 410
2023.03.31	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	333 001 744
2023.03.31	XAUUSDF230411V1857.382	FORWARD	1 000	40 178 344
2023.03.31	ESM3-S&P 500	FUTURES	-8	-33 921 456
2023.03.31	FESXM3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-190	-132 918 013
2023.03.31	GCM3-COMEX	FUTURES	29	20 697 126
2023.03.31	JGB1M3-JGB1	FUTURES	-13	-71 002 890
2023.03.31	NQM3-NASDAQ	FUTURES	20	80 262 587
2023.03.31	SJBM3-MINI JGB	FUTURES	-8	-3 928 879
2023.04.28	AAPL	CFD	-10 100	-34 028 702
2023.04.28	CBA XASX	CFD	-13 000	-63 912 839
2023.04.28	CM:XNYS	CFD	-8 000	7 161 403
2023.04.28	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-104 282 808
2023.04.28	MC:XPAR	CFD	-1 350	-94 273 530
2023.04.28	RY:XTSE	CFD	-10 250	-63 142 372
2023.04.28	TSLA:XNAS	CFD	-4 400	94 272 685
2023.04.28	EURJPYOP230509P140	DEVIZA OPCIO	5 000 000	35 028
2023.04.28	SX5EOP230616P4200	EP OPCIO	123	26 791 899
2023.04.28	EURHUFF230707E382.3002	FORWARD	300 000	-6 748
2023.04.28	EURHUFF230707E389.47	FORWARD	3 502 000	24 261 718
2023.04.28	EURHUFF230707E397.75	FORWARD	91 000	1 360 873
2023.04.28	EURHUFF230707E401.13	FORWARD	1 360 000	24 794 497
2023.04.28	EURHUFF230707V389.34	FORWARD	1 100 000	-7 482 131
2023.04.28	EURHUFF230707V393.87	FORWARD	1 000 000	-11 193 352
2023.04.28	EURHUFF230713E461.14	FORWARD	10 000 000	754 365 084
2023.04.28	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	11 105 918
2023.04.28	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	21 431 219
2023.04.28	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	1 952 141
2023.04.28	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	-197 634
2023.04.28	EURUSDF230508E1.0836	FORWARD	1 030 000	-5 614 946
2023.04.28	EURUSDF230508E1.084129	FORWARD	600 000	-3 163 277
2023.04.28	EURUSDF230508E1.098341	FORWARD	2 000 000	-911 441
2023.04.28	EURUSDF230703E1.09412	FORWARD	2 100 000	-6 095 139
2023.04.28	EURUSDF230703E1.09555	FORWARD	1 000 000	-2 421 661
2023.04.28	EURUSDF230703V1.09615	FORWARD	500 000	1 109 966
2023.04.28	EURUSDF230703V1.10212	FORWARD	1 000 000	212 737
2023.04.28	JPYHUFF230515E2.901	FORWARD	97 000 000	36 447 363
2023.04.28	JPYHUFF230515E2.91	FORWARD	92 580 000	35 613 115
2023.04.28	PLNHUFF230821E82.6	FORWARD	10 400 000	-10 235 543

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.04.28	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	44 173 227
2023.04.28	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	70 087 623
2023.04.28	RONHUFF230824E79	FORWARD	4 863 000	5 105 720
2023.04.28	RONHUFF230824E79.02084	FORWARD	2 586 100	2 766 348
2023.04.28	RONHUFF230824E79.08	FORWARD	7 785 000	8 764 903
2023.04.28	TRYHUFF230724E17.36	FORWARD	1 933 000	-165 332
2023.04.28	TRYHUFF230821E17.50508	FORWARD	5 067 000	257 592
2023.04.28	TRYHUFF230821E17.57	FORWARD	5 588 000	628 970
2023.04.28	USDCNHF230817V6.7835	FORWARD	4 510 946	20 097 186
2023.04.28	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-9 538 861
2023.04.28	USDHUFF230713E347.96	FORWARD	500 000	344 515
2023.04.28	USDHUFF230713E352.5	FORWARD	367 600	1 866 903
2023.04.28	USDHUFF230713E353.77	FORWARD	708 000	4 465 040
2023.04.28	USDHUFF230713E355.08	FORWARD	2 130 000	16 130 822
2023.04.28	USDHUFF230713E355.53	FORWARD	400 000	3 203 299
2023.04.28	USDHUFF230713E421.28	FORWARD	6 791 000	486 100 227
2023.04.28	USDHUFF230713E431.1513	FORWARD	4 302 500	349 037 503
2023.04.28	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	386 031 114
2023.04.28	XAUUSDF230719V2017.178	FORWARD	1 000	-1 456 857
2023.04.28	ESM3-S&P 500	FUTURES	-8	-39 792 181
2023.04.28	FESXM3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-214	-175 067 612
2023.04.28	GCM3-COMEX	FUTURES	29	32 771 030
2023.04.28	JGB1M3-JGB1	FUTURES	-13	-83 391 660
2023.04.28	NQM3-NASDAQ	FUTURES	20	80 364 867
2023.04.28	SJBM3-MINI JGB	FUTURES	-8	-5 772 114
2023.05.31	AAPL	CFD	-10 100	-61 511 963
2023.05.31	CBA XASX	CFD	-13 000	-56 945 672
2023.05.31	CM:XYNS	CFD	-8 000	9 405 458
2023.05.31	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-100 486 229
2023.05.31	MC:XPAR	CFD	-1 350	-65 185 075
2023.05.31	RY:XTSE	CFD	-10 250	-30 640 419
2023.05.31	TSLA:XNAS	CFD	-4 400	36 014 717
2023.05.31	SX5EOP230616P4200	EP OPCIO	123	24 326 323
2023.05.31	EURHUFF230707E382.3002	FORWARD	300 000	1 809 749
2023.05.31	EURHUFF230707E389.47	FORWARD	3 502 000	45 812 249
2023.05.31	EURHUFF230707E397.75	FORWARD	91 000	1 931 249
2023.05.31	EURHUFF230707E401.13	FORWARD	1 360 000	33 382 125
2023.05.31	EURHUFF230707V375.93	FORWARD	130 000	29 977
2023.05.31	EURHUFF230707V377.97	FORWARD	40 000	-71 004
2023.05.31	EURHUFF230707V380.11	FORWARD	20 000	-77 582
2023.05.31	EURHUFF230707V389.34	FORWARD	1 100 000	-14 249 317
2023.05.31	EURHUFF230707V393.87	FORWARD	1 000 000	-17 407 754
2023.05.31	EURHUFF230713E461.14	FORWARD	10 000 000	825 109 155
2023.05.31	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	12 633 823
2023.05.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	25 156 353
2023.05.31	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	5 498 616
2023.05.31	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	1 938 248
2023.05.31	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	9 576 484
2023.05.31	EURUSDF230703E1.09412	FORWARD	2 100 000	19 007 669
2023.05.31	EURUSDF230703E1.09555	FORWARD	1 000 000	9 546 648
2023.05.31	EURUSDF230703V1.09615	FORWARD	500 000	-4 877 249

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.05.31	EURUSDF230703V1.10212	FORWARD	1 000 000	-11 822 611
2023.05.31	EURUSDF230804E1.107851	FORWARD	3 100 000	40 980 569
2023.05.31	EURUSDF230804E1.10795	FORWARD	1 030 000	13 651 282
2023.05.31	JPYHUFF230814E2.6025	FORWARD	92 580 000	3 061 192
2023.05.31	JPYHUFF230814E2.63563	FORWARD	97 000 000	6 319 169
2023.05.31	PLNHUFF230821E82.6	FORWARD	10 400 000	-8 056 597
2023.05.31	PLNHUFF230821V83.55	FORWARD	600 000	-85 516
2023.05.31	PLNHUFF230821V84.51	FORWARD	2 166 000	-2 316 281
2023.05.31	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	46 419 007
2023.05.31	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	73 539 958
2023.05.31	RONHUFF230824E79	FORWARD	4 863 000	12 682 168
2023.05.31	RONHUFF230824E79.02084	FORWARD	2 586 100	6 796 231
2023.05.31	RONHUFF230824E79.08	FORWARD	7 785 000	20 902 960
2023.05.31	TRYHUFF230724E17.36	FORWARD	1 933 000	942 040
2023.05.31	TRYHUFF230821E17.50508	FORWARD	5 067 000	3 456 574
2023.05.31	TRYHUFF230821E17.57	FORWARD	5 588 000	4 162 235
2023.05.31	USDCNHF230817V6.7835	FORWARD	4 510 946	67 273 118
2023.05.31	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-6 386 150
2023.05.31	USDHUFF230713E347.96	FORWARD	500 000	-2 373 457
2023.05.31	USDHUFF230713E352.5	FORWARD	367 600	-108 586
2023.05.31	USDHUFF230713E353.77	FORWARD	708 000	672 500
2023.05.31	USDHUFF230713E355.08	FORWARD	2 130 000	4 759 122
2023.05.31	USDHUFF230713E355.53	FORWARD	400 000	1 070 224
2023.05.31	USDHUFF230713E421.28	FORWARD	6 791 000	455 976 327
2023.05.31	USDHUFF230713E431.1513	FORWARD	4 302 500	330 531 541
2023.05.31	USDHUFF230713V345.08	FORWARD	150 000	1 135 618
2023.05.31	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	372 669 600
2023.05.31	XAUUSDF230719V2017.178	FORWARD	1 000	-14 056 325
2023.05.31	ESM3-S&P 500	FUTURES	-8	-41 090 783
2023.05.31	FESXM3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-214	-56 930 004
2023.05.31	FSTTM3	FUTURES	70	-9 734 759
2023.05.31	GCQ3-COMEX GOLD	FUTURES	29	10 699 057
2023.05.31	JGB1M3-JGB1	FUTURES	-13	-82 885 044
2023.05.31	NQM3-NASDAQ	FUTURES	14	153 226 924
2023.05.31	SJBM3-MINI JGB	FUTURES	-8	-5 299 371
2023.06.30	AAPL	CFD	-10 100	-118 335 194
2023.06.30	CBA XASX	CFD	-13 000	-67 511 912
2023.06.30	CM:XYNS	CFD	-8 000	5 226 153
2023.06.30	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-139 189 476
2023.06.30	MC:XPAR	CFD	-1 350	-89 797 724
2023.06.30	RY:XTSE	CFD	-10 250	-44 677 098
2023.06.30	TSLA:XNAS	CFD	-4 400	-51 709 351
2023.06.30	DAXOP231215P16000	EP OPCIO	68	56 833 364
2023.06.30	DAXOP231215P16600	EP OPCIO	108	133 232 701
2023.06.30	EURUSD	FOREX	-1 600 000	5 750 698
2023.06.30	EURHUFF230707E369.64	FORWARD	500 000	-1 195 614
2023.06.30	EURHUFF230707E382.3002	FORWARD	300 000	3 068 912
2023.06.30	EURHUFF230707E389.47	FORWARD	3 502 000	60 855 198
2023.06.30	EURHUFF230707E397.75	FORWARD	91 000	2 332 475
2023.06.30	EURHUFF230707E401.13	FORWARD	1 360 000	39 441 505
2023.06.30	EURHUFF230707V372.13	FORWARD	1 110 000	-101 064

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.06.30	EURHUFF230707V372.39	FORWARD	740 000	-259 180
2023.06.30	EURHUFF230707V375.93	FORWARD	130 000	-504 304
2023.06.30	EURHUFF230707V375.96	FORWARD	1 500 000	-5 863 756
2023.06.30	EURHUFF230707V377.97	FORWARD	40 000	-236 517
2023.06.30	EURHUFF230707V380.11	FORWARD	20 000	-160 926
2023.06.30	EURHUFF230707V389.34	FORWARD	1 100 000	-18 972 440
2023.06.30	EURHUFF230707V393.87	FORWARD	1 000 000	-21 763 623
2023.06.30	EURHUFF230713E461.14	FORWARD	10 000 000	878 160 476
2023.06.30	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	13 603 590
2023.06.30	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	29 576 003
2023.06.30	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	8 253 465
2023.06.30	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	5 507 536
2023.06.30	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	17 235 366
2023.06.30	EURUSDF230703E1.09412	FORWARD	2 100 000	7 232 213
2023.06.30	EURUSDF230703E1.09555	FORWARD	1 000 000	3 933 336
2023.06.30	EURUSDF230703E1.09615	FORWARD	500 000	2 069 345
2023.06.30	EURUSDF230703V1.09412	FORWARD	1 100 000	-3 788 302
2023.06.30	EURUSDF230703V1.09555	FORWARD	1 000 000	-3 933 336
2023.06.30	EURUSDF230703V1.09615	FORWARD	500 000	-2 069 345
2023.06.30	EURUSDF230703V1.10212	FORWARD	1 000 000	-6 181 956
2023.06.30	EURUSDF230804E1.107851	FORWARD	3 100 000	23 341 508
2023.06.30	EURUSDF230804E1.10795	FORWARD	1 030 000	7 790 145
2023.06.30	JPYHUFF230814E2.6025	FORWARD	92 580 000	17 069 502
2023.06.30	JPYHUFF230814E2.63563	FORWARD	97 000 000	21 035 504
2023.06.30	PLNHUFF230821E82.6	FORWARD	10 400 000	-19 092 242
2023.06.30	PLNHUFF230821V83.55	FORWARD	600 000	544 257
2023.06.30	PLNHUFF230821V84.51	FORWARD	2 166 000	-67 966
2023.06.30	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	40 050 581
2023.06.30	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	63 930 772
2023.06.30	RONHUFF230824E79	FORWARD	4 863 000	14 717 113
2023.06.30	RONHUFF230824E79.02084	FORWARD	2 586 100	7 879 047
2023.06.30	RONHUFF230824E79.08	FORWARD	7 785 000	24 168 139
2023.06.30	TRYHUFF230724E17.36	FORWARD	1 933 000	8 069 607
2023.06.30	TRYHUFF230821E17.50508	FORWARD	5 067 000	21 553 100
2023.06.30	TRYHUFF230821E17.57	FORWARD	5 588 000	24 123 875
2023.06.30	USDCNHF230817V6.7835	FORWARD	4 510 946	97 088 403
2023.06.30	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-3 363 558
2023.06.30	USDHUFF230713E347.96	FORWARD	500 000	2 092 807
2023.06.30	USDHUFF230713E352.5	FORWARD	367 600	3 197 948
2023.06.30	USDHUFF230713E353.77	FORWARD	708 000	7 053 264
2023.06.30	USDHUFF230713E355.08	FORWARD	2 130 000	23 993 836
2023.06.30	USDHUFF230713E355.53	FORWARD	400 000	4 684 851
2023.06.30	USDHUFF230713E421.28	FORWARD	6 791 000	523 480 298
2023.06.30	USDHUFF230713E431.1513	FORWARD	4 302 500	373 883 006
2023.06.30	USDHUFF230713V343.88	FORWARD	230 000	-29 682
2023.06.30	USDHUFF230713V345.08	FORWARD	150 000	-198 324
2023.06.30	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	410 313 220
2023.06.30	XAUUSDF230719V2017.178	FORWARD	1 000	-31 528 692
2023.06.30	ESU3-S&P 500	FUTURES	-8	-9 806 336
2023.06.30	FESXU3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-112	-10 183 807
2023.06.30	FSTTU3	FUTURES	105	2 738 939

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.06.30	GCQ3-COMEX GOLD	FUTURES	31	-40 399 776
2023.06.30	JGB1U3-JGB1	FUTURES	-13	-15 079 701
2023.06.30	MMEU3	FUTURES	118	-54 746 336
2023.06.30	NQU3-NASDAQ	FUTURES	14	22 755 219
2023.06.30	SJBU3-MINI JGB	FUTURES	-8	-871 166
2023.07.31	AAPL	CFD	-10 500	-130 465 630
2023.07.31	CBA XASX	CFD	-14 500	-88 521 004
2023.07.31	CM:XNYS	CFD	-8 000	1 446 590
2023.07.31	DNP:XWAR	CFD	-7 500	-127 011 772
2023.07.31	MC:XPAR	CFD	-1 350	-85 471 517
2023.07.31	RY:XTSE	CFD	-11 500	-58 587 593
2023.07.31	TSLA:XNAS	CFD	-4 800	-60 673 654
2023.07.31	DAXOP231215P16000	EP OPCIO	68	44 944 453
2023.07.31	DAXOP231215P16600	EP OPCIO	108	107 645 691
2023.07.31	EURHUFF230830E382.25	FORWARD	400 000	-2 631 566
2023.07.31	EURHUFF230830E382.89	FORWARD	4 000 000	-23 787 097
2023.07.31	EURHUFF230830E387.1	FORWARD	2 500 000	-4 471 190
2023.07.31	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	11 703 097
2023.07.31	EURHUFF231130E390.82	FORWARD	10 016 000	-76 979 992
2023.07.31	EURHUFF231130E393.31	FORWARD	110 000	-584 153
2023.07.31	EURHUFF231130E393.39	FORWARD	113 000	-591 462
2023.07.31	EURHUFF231130E394.02	FORWARD	500 000	-2 316 608
2023.07.31	EURHUFF231130E398.65	FORWARD	1 070 000	-231 814
2023.07.31	EURHUFF231130E399.1	FORWARD	250 000	53 152
2023.07.31	EURHUFF231130V386.8608	FORWARD	800 000	9 169 913
2023.07.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	21 958 188
2023.07.31	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	2 055 910
2023.07.31	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	-2 653 976
2023.07.31	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	-20 199
2023.07.31	EURUSDF230804E1.107851	FORWARD	3 100 000	4 441 073
2023.07.31	EURUSDF230804E1.10795	FORWARD	1 030 000	1 511 163
2023.07.31	EURUSDF230804E1.12242	FORWARD	1 200 000	7 819 478
2023.07.31	EURUSDF231003E1.10093	FORWARD	1 600 000	-3 227 823
2023.07.31	JPYHUFF230814E2.6025	FORWARD	92 580 000	12 595 383
2023.07.31	JPYHUFF230814E2.63563	FORWARD	97 000 000	16 391 691
2023.07.31	JPYHUFF230814V2.4315	FORWARD	92 580 000	3 143 984
2023.07.31	JPYHUFF230814V2.4328	FORWARD	97 000 000	3 168 717
2023.07.31	PLNHUFF230821E82.6	FORWARD	10 400 000	-52 441 324
2023.07.31	PLNHUFF230821E85.93	FORWARD	983 000	-1 711 567
2023.07.31	PLNHUFF230821E85.97	FORWARD	740 000	-1 259 119
2023.07.31	PLNHUFF230821E87.007	FORWARD	2 880 000	-1 939 564
2023.07.31	PLNHUFF230821V83.55	FORWARD	600 000	2 460 379
2023.07.31	PLNHUFF230821V84.51	FORWARD	2 166 000	6 820 550
2023.07.31	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	20 008 139
2023.07.31	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	33 610 929
2023.07.31	RONHUFF230824E79	FORWARD	4 863 000	2 148 360
2023.07.31	RONHUFF230824E79.02084	FORWARD	2 586 100	1 195 842
2023.07.31	RONHUFF230824E79.08	FORWARD	7 785 000	4 055 898
2023.07.31	TRYHUFF230821E12.4	FORWARD	1 933 000	-1 058 659
2023.07.31	TRYHUFF230821E17.50508	FORWARD	5 067 000	22 869 172
2023.07.31	TRYHUFF230821E17.57	FORWARD	5 588 000	25 580 273

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszköztérték
2023.07.31	USDCNHF230817V6.7835	FORWARD	4 510 946	79 106 999
2023.07.31	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-13 308 662
2023.07.31	USDHUFF231012E352.41	FORWARD	9 549 000	-27 344 808
2023.07.31	USDHUFF231012E353.097	FORWARD	4 702 500	-10 326 397
2023.07.31	USDHUFF231012E357.25	FORWARD	367 600	676 512
2023.07.31	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	404 535 867
2023.07.31	XAUUSDF231019V1977.038	FORWARD	1 000	4 154 690
2023.07.31	ESU3-S&P 500	FUTURES	-8	-27 630 940
2023.07.31	FESXU3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-112	-40 346 522
2023.07.31	FSTTU3	FUTURES	105	-1 606 618
2023.07.31	GCV3-COMEX GOLD	FUTURES	31	-865 867
2023.07.31	JGB1U3-JGB1	FUTURES	-13	40 152 294
2023.07.31	MMEU3	FUTURES	195	83 982 136
2023.07.31	NQU3-NASDAQ	FUTURES	10	52 919 150
2023.07.31	SJBU3-MINI JGB	FUTURES	-8	2 255 196
2023.08.31	AAPL	CFD	-10 500	-99 076 833
2023.08.31	CBA XASX	CFD	-14 500	-74 082 058
2023.08.31	CM:XNYS	CFD	-8 000	13 913 065
2023.08.31	MC:XPAP	CFD	-1 350	-50 500 132
2023.08.31	RY:XTSE	CFD	-11 500	-30 620 604
2023.08.31	TSLA:XNAS	CFD	-4 800	-45 033 898
2023.08.31	EURJPYOP240821P150	DEVIZA OPCIO	3 000 000	34 288 320
2023.08.31	USDJPYOP240821P135	DEVIZA OPCIO	3 300 000	28 111 324
2023.08.31	DAXOP231215P16000	EP OPCIO	145	114 623 080
2023.08.31	DAXOP231215P16600	EP OPCIO	108	142 119 698
2023.08.31	EURHUFF230905E449.0228	FORWARD	200 000	13 658 750
2023.08.31	EURHUFF230928E385.16	FORWARD	2 900 000	5 998 467
2023.08.31	EURHUFF230928E385.25	FORWARD	3 800 000	8 198 408
2023.08.31	EURHUFF230928E386.475	FORWARD	1 100 000	3 706 332
2023.08.31	EURHUFF231130E390.82	FORWARD	10 016 000	17 276 076
2023.08.31	EURHUFF231130E393.31	FORWARD	110 000	454 763
2023.08.31	EURHUFF231130E393.39	FORWARD	113 000	475 913
2023.08.31	EURHUFF231130E394.02	FORWARD	500 000	2 410 610
2023.08.31	EURHUFF231130E398.65	FORWARD	1 070 000	9 952 371
2023.08.31	EURHUFF231130E399.1	FORWARD	250 000	2 434 177
2023.08.31	EURHUFF231130E400.02	FORWARD	1 930 000	20 509 947
2023.08.31	EURHUFF231130V386.8608	FORWARD	800 000	1 684 910
2023.08.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	30 447 101
2023.08.31	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	7 581 635
2023.08.31	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	4 534 915
2023.08.31	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	15 325 421
2023.08.31	EURUSDF231003E1.10093	FORWARD	1 600 000	6 345 975
2023.08.31	EURUSDF231102E1.100987	FORWARD	3 100 000	10 831 965
2023.08.31	EURUSDF231102E1.101	FORWARD	1 200 000	4 198 418
2023.08.31	EURUSDF231102E1.101103	FORWARD	1 030 000	3 640 358
2023.08.31	PLNHUFF231019E86.24	FORWARD	287 000	105 381
2023.08.31	PLNHUFF231019E86.47	FORWARD	1 122 000	665 251
2023.08.31	PLNHUFF231019E86.57	FORWARD	666 000	460 247
2023.08.31	PLNHUFF231019E87.1925	FORWARD	11 864 000	15 447 154
2023.08.31	PLNHUFF231019E87.355	FORWARD	2 880 000	4 209 137
2023.08.31	PLNHUFF231019E87.41	FORWARD	3 538 000	5 361 790

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.08.31	PLNHUFF231019E87.42	FORWARD	1 982 000	3 023 146
2023.08.31	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	38 762 856
2023.08.31	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	62 068 558
2023.08.31	RONHUFF231116E78.48	FORWARD	7 524 000	3 110 755
2023.08.31	RONHUFF231116E78.52	FORWARD	4 863 000	2 199 743
2023.08.31	RONHUFF231116E78.53767	FORWARD	2 586 100	1 214 242
2023.08.31	USDCNHF240220V7.2031	FORWARD	4 248 171	752 740
2023.08.31	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-4 793 475
2023.08.31	USDHUFF231012E352.41	FORWARD	9 549 000	-3 886 249
2023.08.31	USDHUFF231012E353.097	FORWARD	4 702 500	1 265 315
2023.08.31	USDHUFF231012E357.25	FORWARD	367 600	1 601 226
2023.08.31	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	418 672 138
2023.08.31	USDHUFF231012V356.63	FORWARD	103 000	-385 815
2023.08.31	USDHUFF231012V357.4617	FORWARD	894 000	-4 080 413
2023.08.31	USDHUFF231012V358.26	FORWARD	367 600	-1 966 586
2023.08.31	XAUUSDF231019V1977.038	FORWARD	1 000	-7 904 330
2023.08.31	ESU3-S&P 500	FUTURES	-8	-13 883 964
2023.08.31	FESXU3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-112	38 096 212
2023.08.31	FSTTU3	FUTURES	105	-6 972 017
2023.08.31	GCV3-COMEX GOLD	FUTURES	31	-46 679 326
2023.08.31	JGB1U3-JGB1	FUTURES	-13	38 584 832
2023.08.31	SJBU3-MINI JGB	FUTURES	-8	2 163 814
2023.09.29	AAPL	CFD	-10 500	-40 068 400
2023.09.29	CBA XASX	CFD	-14 500	-70 641 563
2023.09.29	CM:XYNS	CFD	-8 000	17 635 319
2023.09.29	MC:XPAR	CFD	-1 350	-17 233 623
2023.09.29	RY:XTSE	CFD	-11 500	-22 954 336
2023.09.29	TSLA:XNAS	CFD	-4 800	-33 620 698
2023.09.29	EURJPYOP240821P150	DEVIZA OPCIO	6 000 000	68 433 133
2023.09.29	USDJPYOP240821P135	DEVIZA OPCIO	3 300 000	18 230 976
2023.09.29	XAUUSDOP240325C1975	DEVIZA OPCIO	3 700	41 480 444
2023.09.29	DAXOP231215P16000	EP OPCIO	145	188 773 234
2023.09.29	DAXOP231215P16600	EP OPCIO	108	236 501 235
2023.09.29	EURHUFF231030E393.54	FORWARD	2 300 000	-1 751 729
2023.09.29	EURHUFF231030E393.82	FORWARD	4 300 000	-2 084 260
2023.09.29	EURHUFF231130E390.462	FORWARD	200 000	-1 244 686
2023.09.29	EURHUFF231130E390.82	FORWARD	10 016 000	-58 822 340
2023.09.29	EURHUFF231130E393.31	FORWARD	110 000	-377 780
2023.09.29	EURHUFF231130E393.39	FORWARD	113 000	-379 230
2023.09.29	EURHUFF231130E394.02	FORWARD	500 000	-1 369 530
2023.09.29	EURHUFF231130E396.9	FORWARD	1 665 000	135 432
2023.09.29	EURHUFF231130E398.65	FORWARD	1 070 000	1 920 784
2023.09.29	EURHUFF231130E399.1	FORWARD	250 000	558 953
2023.09.29	EURHUFF231130E400.02	FORWARD	1 930 000	6 053 975
2023.09.29	EURHUFF231130V386.8608	FORWARD	800 000	7 800 083
2023.09.29	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	24 143 881
2023.09.29	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	4 135 809
2023.09.29	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	61 951
2023.09.29	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	5 918 389
2023.09.29	EURUSDF231003E1.10093	FORWARD	1 600 000	23 453 054
2023.09.29	EURUSDF231102E1.100987	FORWARD	3 100 000	43 799 022

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.09.29	EURUSDF231102E1.101	FORWARD	1 200 000	16 960 184
2023.09.29	EURUSDF231102E1.101103	FORWARD	1 030 000	14 596 417
2023.09.29	PLNHUFF231019E83.12	FORWARD	4 600 000	-7 390 126
2023.09.29	PLNHUFF231019E83.43	FORWARD	519 000	-674 059
2023.09.29	PLNHUFF231019E84.42	FORWARD	765 000	-241 619
2023.09.29	PLNHUFF231019E86.24	FORWARD	287 000	427 959
2023.09.29	PLNHUFF231019E86.47	FORWARD	1 122 000	1 929 283
2023.09.29	PLNHUFF231019E86.57	FORWARD	666 000	1 211 313
2023.09.29	PLNHUFF231019E87.1925	FORWARD	11 864 000	28 910 653
2023.09.29	PLNHUFF231019E87.355	FORWARD	2 880 000	7 482 750
2023.09.29	PLNHUFF231019E87.41	FORWARD	3 538 000	9 385 549
2023.09.29	PLNHUFF231019E87.42	FORWARD	1 982 000	5 277 496
2023.09.29	PLNHUFF231019E91.85	FORWARD	6 600 000	46 602 892
2023.09.29	PLNHUFF231019E92.19	FORWARD	10 000 000	73 986 138
2023.09.29	PLNHUFF231019V83.35	FORWARD	1 215 000	1 674 505
2023.09.29	RONHUFF231116E78.48	FORWARD	7 524 000	-6 867 788
2023.09.29	RONHUFF231116E78.52	FORWARD	4 863 000	-4 247 654
2023.09.29	RONHUFF231116E78.53767	FORWARD	2 586 100	-2 213 944
2023.09.29	USDCNH240220V7.2031	FORWARD	4 248 171	9 174 102
2023.09.29	USDHKDF231027V7.837	FORWARD	8 200 000	-2 831 541
2023.09.29	USDHUFF231012E352.41	FORWARD	9 549 000	-165 110 757
2023.09.29	USDHUFF231012E353.097	FORWARD	4 702 500	-78 094 912
2023.09.29	USDHUFF231012E357.25	FORWARD	367 600	-4 585 262
2023.09.29	USDHUFF231012E469.722	FORWARD	3 639 500	362 031 851
2023.09.29	USDHUFF231012V356.63	FORWARD	103 000	1 348 333
2023.09.29	USDHUFF231012V357.4617	FORWARD	894 000	10 962 942
2023.09.29	USDHUFF231012V358.26	FORWARD	367 600	4 215 721
2023.09.29	XAUUSDF231019V1977.038	FORWARD	1 000	-45 167 297
2023.09.29	ESZ3-S&P 500	FUTURES	-8	27 391 493
2023.09.29	FESXZ3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-112	37 027 900
2023.09.29	FSTTZ3	FUTURES	105	-10 062 950
2023.09.29	GCZ3-COMEX	FUTURES	11	-16 671 640
2023.09.29	JGB1Z3-JGB1	FUTURES	-13	35 694 048
2023.09.29	SJBZ3-MINI JGB	FUTURES	-8	2 038 246
2023.10.31	AAPL	CFD	-10 500	-37 300 429
2023.10.31	CBA XASX	CFD	-14 500	-56 201 874
2023.10.31	MC:XPAR	CFD	-1 000	3 543 119
2023.10.31	RY:XTSE	CFD	-11 500	1 967 392
2023.10.31	TSLA:XNAS	CFD	-4 800	52 292 210
2023.10.31	EURJPYOP240821P150	DEVIZA OPCIO	9 000 000	66 453 135
2023.10.31	USDJPYOP240821P135	DEVIZA OPCIO	3 300 000	11 655 049
2023.10.31	XAUUSDOP240325C1975	DEVIZA OPCIO	3 700	114 409 121
2023.10.31	DAXOP231215P16000	EP OPCIO	115	254 388 404
2023.10.31	DAXOP231215P16600	EP OPCIO	108	358 386 820
2023.10.31	XAUUSD	FOREX	1 000	4 044 033
2023.10.31	EURHUFF231129E385.65	FORWARD	2 300 000	1 403 834
2023.10.31	EURHUFF231129E385.9	FORWARD	4 880 000	4 186 705
2023.10.31	EURHUFF231129E387.06	FORWARD	500 000	1 003 326
2023.10.31	EURHUFF231130E390.462	FORWARD	200 000	1 057 375
2023.10.31	EURHUFF231130E390.82	FORWARD	10 016 000	56 503 029
2023.10.31	EURHUFF231130E393.31	FORWARD	110 000	891 686

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.10.31	EURHUFF231130E393.39	FORWARD	113 000	924 954
2023.10.31	EURHUFF231130E394.02	FORWARD	500 000	4 404 549
2023.10.31	EURHUFF231130E396.9	FORWARD	1 665 000	19 414 125
2023.10.31	EURHUFF231130E398.65	FORWARD	1 070 000	14 330 015
2023.10.31	EURHUFF231130E399.1	FORWARD	250 000	3 459 503
2023.10.31	EURHUFF231130E400.02	FORWARD	1 930 000	28 465 107
2023.10.31	EURHUFF231130V386.8608	FORWARD	800 000	-1 377 513
2023.10.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	34 850 564
2023.10.31	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	10 910 155
2023.10.31	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	8 879 416
2023.10.31	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	24 706 290
2023.10.31	EURUSDF231102E1.100987	FORWARD	3 100 000	37 888 351
2023.10.31	EURUSDF231102E1.101	FORWARD	1 200 000	14 672 050
2023.10.31	EURUSDF231102E1.101103	FORWARD	1 030 000	12 631 535
2023.10.31	EURUSDF231205E1.05107	FORWARD	1 600 000	-9 841 345
2023.10.31	EURUSDF240201E1.06372	FORWARD	1 200 000	-2 961 876
2023.10.31	EURUSDF240201E1.065479	FORWARD	4 130 000	-7 625 034
2023.10.31	PLNHUFF231219E86.72	FORWARD	900 000	-29 961
2023.10.31	PLNHUFF231219E87.695	FORWARD	11 864 000	10 983 658
2023.10.31	PLNHUFF231219E87.74	FORWARD	24 832 000	24 088 599
2023.10.31	PLNHUFF231219E87.77	FORWARD	9 480 000	9 475 953
2023.10.31	PLNHUFF231219V87.24	FORWARD	1 660 000	-793 851
2023.10.31	RONHUFF231116E78.48	FORWARD	7 524 000	9 329 018
2023.10.31	RONHUFF231116E78.52	FORWARD	4 863 000	6 223 112
2023.10.31	RONHUFF231116E78.53767	FORWARD	2 586 100	3 354 846
2023.10.31	RONHUFF231116V78.58	FORWARD	204 000	-273 230
2023.10.31	USDCNHF240220V7.2031	FORWARD	4 248 171	18 199 245
2023.10.31	USDHKDF240129V7.8119	FORWARD	8 226 347	3 638 887
2023.10.31	USDHUFF231212E369.26	FORWARD	9 446 000	73 419 765
2023.10.31	USDHUFF231212E369.397	FORWARD	7 448 000	58 896 223
2023.10.31	USDHUFF231212E369.71	FORWARD	75 000	616 220
2023.10.31	ESZ3-S&P 500	FUTURES	-8	42 873 017
2023.10.31	FESXZ3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-113	85 411 609
2023.10.31	FSTT3	FUTURES	105	-22 287 110
2023.10.31	GCZ3-COMEX	FUTURES	11	34 350 759
2023.10.31	JGB1Z3-JGB1	FUTURES	-13	71 759 688
2023.10.31	SJBZ3-MINI JGB	FUTURES	-8	4 016 258
2023.11.30	AAPL	CFD	-10 500	-106 099 273
2023.11.30	CBA XASX	CFD	-14 500	-83 512 248
2023.11.30	MC:XPAR	CFD	-1 000	-7 186 576
2023.11.30	RY:XTSE	CFD	-11 500	-32 882 390
2023.11.30	TSLA:XNAS	CFD	-4 800	-14 763 754
2023.11.30	EURJPYOP240821P150	DEVIZA OPCIO	9 000 000	55 665 708
2023.11.30	USDJPYOP240821P135	DEVIZA OPCIO	3 300 000	14 570 894
2023.11.30	XAUUSDOP240325C1975	DEVIZA OPCIO	3 700	143 740 526
2023.11.30	DAXOP231215P16000	EP OPCIO	115	13 420 422
2023.11.30	DAXOP231215P16600	EP OPCIO	108	75 047 343
2023.11.30	DAXOP240315P16100	EP OPCIO	33	20 438 891
2023.11.30	EMINIOP240315P4600	EP OPCIO	13	24 894 119
2023.11.30	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	39 598 605
2023.11.30	EURHUFF240229E385.47	FORWARD	4 880 000	-2 080 446

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.11.30	EURHUFF240229E385.65	FORWARD	3 490 000	-876 204
2023.11.30	EURHUFF240307E383.21	FORWARD	1 070 000	-3 311 223
2023.11.30	EURHUFF240307E383.52	FORWARD	11 869 000	-33 154 573
2023.11.30	EURHUFF240307E383.81	FORWARD	200 000	-502 317
2023.11.30	EURHUFF240307E384.745	FORWARD	1 915 000	-3 069 835
2023.11.30	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	14 005 511
2023.11.30	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	13 234 514
2023.11.30	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	34 015 773
2023.11.30	EURUSDF231205E1.05107	FORWARD	1 600 000	-23 125 437
2023.11.30	EURUSDF240201E1.06372	FORWARD	1 200 000	-12 979 782
2023.11.30	EURUSDF240201E1.065479	FORWARD	4 130 000	-42 171 949
2023.11.30	PLNHUFF231219E86.72	FORWARD	900 000	-732 721
2023.11.30	PLNHUFF231219E87.695	FORWARD	11 864 000	1 839 506
2023.11.30	PLNHUFF231219E87.74	FORWARD	24 832 000	4 960 962
2023.11.30	PLNHUFF231219E87.77	FORWARD	9 480 000	2 176 627
2023.11.30	PLNHUFF231219V87.24	FORWARD	1 660 000	493 413
2023.11.30	RONHUFF240216E76.652	FORWARD	2 245 100	-918 798
2023.11.30	RONHUFF240216E76.68	FORWARD	7 320 000	-2 795 366
2023.11.30	RONHUFF240216E76.705	FORWARD	4 863 000	-1 738 265
2023.11.30	RONHUFF240216V76.54	FORWARD	1 631 000	846 013
2023.11.30	USDCNHF240220V7.0872	FORWARD	2 400 000	2 893 267
2023.11.30	USDCNHF240220V7.2031	FORWARD	4 248 171	-18 733 694
2023.11.30	USDHKDF240129V7.8119	FORWARD	8 226 347	38 003
2023.11.30	USDHUFF231212E369.26	FORWARD	9 446 000	199 156 488
2023.11.30	USDHUFF231212E369.397	FORWARD	7 448 000	158 047 765
2023.11.30	USDHUFF231212E369.71	FORWARD	75 000	1 614 897
2023.11.30	XAUUSDF240226V2023.752	FORWARD	1 000	13 428 876
2023.11.30	ESZ3-S&P 500	FUTURES	-8	-9 108 304
2023.11.30	FESXZ3-DJ EURO STOXX	FUTURES	-113	-52 911 284
2023.11.30	FSTTZ3	FUTURES	105	-1 193 559
2023.11.30	GCG4-COMEX	FUTURES	11	15 819 685
2023.11.30	JGB1Z3-JGB1	FUTURES	-13	-11 946 948
2023.11.30	SJBZ3-MINI JGB	FUTURES	-8	-1 187 626
2023.12.31	AAPL	CFD	-10 500	-115 197 232
2023.12.31	CBA XASX	CFD	-14 500	-110 111 587
2023.12.31	MC:XPAR	CFD	-1 000	-19 076 400
2023.12.31	RY:XTSE	CFD	-11 500	-67 890 507
2023.12.31	TSLA:XNAS	CFD	-4 800	-28 692 265
2023.12.31	EURJPYOP240821P150	DEVIZA OPCIO	9 000 000	77 180 955
2023.12.31	USDCNHOP241211C7.2	DEVIZA OPCIO	14 500 000	68 753 078
2023.12.31	USDCNHOP241219C7.3	DEVIZA OPCIO	14 500 000	52 356 489
2023.12.31	USDJPYOP240821P135	DEVIZA OPCIO	3 300 000	24 884 482
2023.12.31	XAUUSDOP240325C1975	DEVIZA OPCIO	3 700	155 276 158
2023.12.31	XAUUSDOP240611C2000	DEVIZA OPCIO	1 500	71 453 354
2023.12.31	DAXOP240315P16100	EP OPCIO	50	15 808 814
2023.12.31	DAXOP240621P17100	EP OPCIO	16	19 102 253
2023.12.31	EMINIOP240315P4600	EP OPCIO	20	15 243 360
2023.12.31	EMINIOP240621P4700	EP OPCIO	7	14 156 405
2023.12.31	EMINIOP240920P4850	EP OPCIO	13	45 881 648
2023.12.31	EURHUFF240124E384.22	FORWARD	300 000	-19 344
2023.12.31	EURHUFF240124E431.23	FORWARD	850 000	39 623 299

VII. A származtatott ügyletek részletes leírása

adatok eFt-ban

Dátum	Instrumentum	Instrumentum	Mennyiség	Eszközérték
2023.12.31	EURHUFF240229E385.47	FORWARD	4 880 000	-6 613 744
2023.12.31	EURHUFF240229E385.65	FORWARD	3 490 000	-4 112 616
2023.12.31	EURHUFF240229E386.14	FORWARD	800 000	-557 525
2023.12.31	EURHUFF240229V386.97	FORWARD	40 000	-4 747
2023.12.31	EURHUFF240307E383.21	FORWARD	1 070 000	-3 844 166
2023.12.31	EURHUFF240307E383.52	FORWARD	11 869 000	-39 029 068
2023.12.31	EURHUFF240307E383.81	FORWARD	200 000	-600 720
2023.12.31	EURHUFF240307E384.745	FORWARD	1 915 000	-3 993 951
2023.12.31	EURHUFF240411E415.68	FORWARD	542 000	14 020 558
2023.12.31	EURHUFF240426E408.8722	FORWARD	707 000	12 907 195
2023.12.31	EURHUFF240426E413	FORWARD	1 500 000	33 381 989
2023.12.31	EURUSDF240201E1.06372	FORWARD	1 200 000	-17 584 581
2023.12.31	EURUSDF240201E1.065479	FORWARD	4 130 000	-58 015 375
2023.12.31	EURUSDF240201V1.09669	FORWARD	364 734	1 198 376
2023.12.31	EURUSDF240205E1.08834	FORWARD	1 600 000	-9 958 047
2023.12.31	PLNHUFF240419E89.13	FORWARD	24 072 000	342 807
2023.12.31	PLNHUFF240419E89.21	FORWARD	12 242 000	1 124 772
2023.12.31	PLNHUFF240419E89.23	FORWARD	9 480 000	1 055 005
2023.12.31	PLNHUFF240419V89.63	FORWARD	1 642 000	-820 136
2023.12.31	RONHUFF240216E76.652	FORWARD	2 245 100	-1 632 805
2023.12.31	RONHUFF240216E76.68	FORWARD	7 320 000	-5 121 492
2023.12.31	RONHUFF240216E76.705	FORWARD	4 863 000	-3 282 518
2023.12.31	RONHUFF240216V76.54	FORWARD	1 631 000	1 366 364
2023.12.31	USDCNHF240220V7.0872	FORWARD	2 400 000	2 384 283
2023.12.31	USDCNHF240220V7.2031	FORWARD	4 248 171	-19 572 852
2023.12.31	USDHKDF240129V7.8119	FORWARD	8 226 347	-285 176
2023.12.31	USDHUFF240312E349.6538	FORWARD	737 000	111 913
2023.12.31	USDHUFF240312E354.64214	FORWARD	109 000	549 661
2023.12.31	USDHUFF240312E355.87	FORWARD	204 000	1 274 315
2023.12.31	USDHUFF240312E356.6	FORWARD	75 000	522 179
2023.12.31	USDHUFF240312E357.49	FORWARD	9 446 000	74 009 419
2023.12.31	USDHUFF240312E357.584	FORWARD	7 448 000	59 041 525
2023.12.31	XAUUSDF240226V2023.752	FORWARD	1 000	19 109 509
2023.12.31	ESH4-S&P 500	FUTURES	-8	-16 982 489
2023.12.31	FESXH4-DJ EURO STOXX	FUTURES	-113	18 383 010
2023.12.31	FSTTH4	FUTURES	105	-4 220 150
2023.12.31	GCG4-COMEX	FUTURES	11	21 340 704
2023.12.31	JGB1H4-JGB1	FUTURES	-19	-47 851 440
-	-	-	-	-

VIII. A Befektetési Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, a befektetési politikára ható tényezők

Alapkezelő működésében bekövetkezett változások

A HOLD Alapkezelő Zrt. szervezeti felépítése és tulajdonosi szerkezete megváltozott a tárgyév során.

Részvényes	Tulajdoni hányad	Szavazati hányad
CA INVESTORS VAGYONKEZELŐ ZRT.	74,18%	74,38%
LATOBO CONSULT KFT.	12.76%	12.81%
INVESTSET CONTRACTOR KFT.	12.76%	12.81%
DOLGOZÓI RÉSZVÉNYEK	0.30%	0.00%

A HOLD Alapkezelő Zrt. az alábbi nyilvános befektetési jegy sorozatokat indította el a 2023. év során:

CREDITUM SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP A SOROZAT HUF
 CREDITUM SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP B SOROZAT EUR
 CREDITUM SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP C SOROZAT USD
 HOLD EXPEDÍCIÓ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP B SOROZAT EUR
 HOLD MOLTO FORTE ALAPOKBA FEKTETŐ RÉSZALAP B SOROZAT USD
 HOLD ORION SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP B SOROZAT EUR
 HOLD VK 100 ALAPOKBA FEKTETŐ RÉSZALAP C SOROZAT USD
 HOLD VK 200 ALAPOKBA FEKTETŐ RÉSZALAP C SOROZAT USD
 HOLD VK 300 ALAPOKBA FEKTETŐ RÉSZALAP C SOROZAT USD

A HOLD Alapkezelő Zrt. az alábbi nyilvános befektetési alapokat szüntette meg a 2023. év során:

HOLD FORTE EURO ALAPOKBA FEKTETŐ RÉSZALAP
 HOLD FORTE HUF ALAPOKBA FEKTETŐ RÉSZALAP

Befektetési alap vagy befektetési jegy sorozat beolvasására nem került sor.

Befektetési politikára ható tényezők

A 2023-as év parádésra sikeredett az év utolsó két hónapjának köszönhetően, mely főleg a kockázatot vállalni hajlandó befektetőknek kedvezett. Egy visszafogott, az „elkerülhetetlen” (de mégis elmaradó) globális recessziótól rettegő első félév után a harmadik negyedévben meglódultak a hozamok és a részvénytörzsek. Az utolsó negyedév során az amerikai munkaerőpiaci feszültség enyhülni látszott és ennek nyomán a Fed sokkal optimistább volt, mint azt várni lehetett, ezzel is új lendületet adva a részvényárak emelkedésének.

A részvényindexek többsége az egész évet tekintve jellemzően 20-25 százalékkal emelkedett, leszámítva a gyengélkedő kínai részvényeket. Leginkább azok a piacok és szektorok raliztak, amelyek 2022-ben a leggyengébben teljesítettek. 2023-ban már a globális kötvényekkel is lehetett – még ha csak visszafogottabb, jellemzően egyszámjegyű mértékben – pénzt keresni. Hiába gyengült az USD szinte minden devizával szemben, a 2022-ben szárnyaló nyersanyagoknak ezúttal ez nem jelentett segítséget.

Szerencsére a 2022-es évre jellemző inflációs sokk már múltóban van, főként a kínálati problémák és ellátási láncok akadozásából származó része. Ahol hagyják a piacot működni, ott a piac idővel korrigálja a kilengéseket.

Nem látni azonban, hogy az infláció másik komponense, a szűkös munkaerőpiacból, a béremelkedésből, valamint a laza költségvetésekből adódó többletkereslet is enyhül-e. Lazuló munkaerőpiac komolyabb gazdasági lassuláshoz vezethet, aminek kockázatát szintén nem árazzák még a tőkepiacok. Úgy érezzük a konszenzus túlzottan optimista, a soft landing (recesszió nélküli inflációcsökkenéssel járó forgatókönyv) scenárióval számolnak, miközben egyáltalán nem elhanyagolható a másik két kedvezőtlen forgatókönyv valószínűsége sem.

Érdemes még megemlíteni a kelet-európai piacokat, ahol a globális jó hangulatban 2023-ban szintén extra emelkedéseket láthattunk például a régiós bankszektor részvényeit illetően.

IX. Az ABAK – ide nem értve a 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-ot – által az adott időszakra kifizetett javadalmazás teljes összege az ABAK alkalmazottainak kifizetett rögzített és változó javadalmazás szerinti bontásban, a kedvezményezettek száma és a kifizetett nyereségrészesedés, valamint a javadalmazás teljes összege az ABAK ügyvezetői és azon munkavállalói szerinti bontásban, akik az ABA kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakorolnak

Az ABAK a javadalmazási politikája alapján, az ABA teljesítményéhez változó javadalmazás jogcímen ~38.7 M Ft került kifizetésre. Az ABAK alkalmazottainak kifizetett rögzített javadalmazás összege ~ 693 millió Ft volt, ennek 37,6%-a került kifizetésre azon munkavállalók részére, akik az ABA kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakorolnak

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

Nincs az Alapban olyan eszköz, amelynek likviditása miatt külön szabályozásra került volna sor.

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

Nincs az Alapban olyan eszköz, amelynek likviditása miatt külön szabályozásra került volna sor.

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

Az Alap összesített kockázati mutatója : 3

A befektetési alapok kockázati besorolását a Bizottság 2017. március 8-i (EU) 2017/653 felhatalmazáson alapuló rendelete előírásai alapján végzi el a HOLD Alapkezelő Zrt.

A kockázati besorolást minden alap esetében a Kiemelt Információkat tartalmazó Dokumentumok (KID – Key Information Document) nevű dokumentum tartalmazza. A KID a piaci kockázat mérésére, illetve az egyes alapok kockázati osztályba sorolására a kockázatotott értéknek (value-at-risk, VaR) megfelelő évesített volatilitás módszert használja, 97,5%-os megbízhatósági szinten az ajánlott tartási idő alatt. Az alapok kockázati besorolása 1-7 terjedő skálán történik, ahol az 1-es érték a legalacsonyabb a 7-es érték pedig a legmagasabb.

- XI. A tőkeáttételt alkalmazó uniós ABA-t kezelő, vagy a tőkeáttételt alkalmazó ABA-t az EGT-államokban forgalmazó ABAK által az ABA nevében alkalmazható tőkeáttétel mértékében bekövetkező változások, valamint a biztosíték vagy a tőkeáttételi megállapodás értelmében nyújtott garanciák újbóli felhasználási joga, és az adott ABA által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege**

Alap neve	Dátum	Nettó összesített kockázati kitettség (tőkeáttétel)
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.01.31	171,76
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.02.28	180,84
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.03.31	187,33
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.04.28	186,09
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.05.31	186,59
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.06.30	193,10
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.07.31	189,08
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.08.31	174,68
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.09.29	172,45
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.10.31	171,81
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.11.30	170,84
HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap	2023.12.31	177,49

A Fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2023 hó végi állapota alapján.

Az Alap Kezelési szabályzata alapján, az alap által felvehető maximális mértékű tőkeáttétel mértéke maximum 800%.

Az ABAK nem kötött biztosíték és tőkeáttételi garancia megállapodást, a tőkeáttétel fedezetére az alapon lévő rövid lejáratú likvid állampapírok szolgálnak.

XII. Az ÁÉKBV-alapkezelő

A HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap nem ÁÉKBV alap, ezért nincs közzétételi kötelezettsége.

XIII. Az Alap által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek bemutatása

A HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap 2023. évben értékpapír-finanszírozási és teljeshozam-csere ügyletet nem kötött.

XIV. Tényleges befektetésként szereplő más befektetési alapokat, egyéb kollektív befektetési formákat terhelő befektetési alapkezelési díjak mértéke

Az Alapnak nincs közzétételi kötelezettsége.

Budapest, 2024.04.17

.....
Szabó Balázs
vezérigazgató
HOLD Alapkezelő Zrt.

Jelen dokumentum sajátkezű aláírásképet biztonsági okokból nem tartalmaz.
Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással ellátott dokumentum tartalmával
mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűen aláírtnak és hitelesnek tekinthető.

HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
címe: 1123 Budapest, Alkotás u. 50.

Felügyeleti eng.: E-III/110.714-3/2008

ÉVES BESZÁMOLÓ
MÉRLEG

Fordulónap : 2023.12.31

adatok eFt-ban

Sor- szám	A tétel megnevezése	Előző év	Előző év(ek) módosításai	Tárgyév
a	b	c	d	e
A.	Befektetett eszközök	0		0
I.	Értékpapírok	0		0
1.	Értékpapírok	0		0
2.	Értékpapírok értékkülönbözete	0		0
	a) kamatokból, osztalékokból	0		0
	b) egyéb	0		0
B.	Forgóeszközök	25 014 317		35 180 181
I.	Követelések	2 379 810		1 896 080
1.	Követelések	2 401 120		1 902 555
2.	Követelések értékvesztése (-)	0		0
3.	Külföldi pénztértékre szóló követelések értékelési különbözete	-21 310		-6 475
4.	Forint követelések értékelési különbözete	0		0
II.	Értékpapírok	21 738 813		30 248 623
1.	Értékpapírok	18 265 090		23 945 955
2.	Értékpapírok értékkülönbözete	3 473 723		6 302 668
	a) kamatokból, osztalékokból	68 782		169 708
	b) egyéb	3 404 941		6 132 960
III.	Pénzeszközök	895 694		3 035 478
1.	Pénzeszközök	899 385		3 027 870
2.	Valuta, devizabetét értékelési különbözete	-3 691		7 608
C.	Aktív időbeli elhatárolások	44 956		13 412
	a) aktív időbeli elhatárolás	44 956		13 412
	b) aktív időbeli elhatárolás értékvesztése (-)	0		0
D.	Származtatott ügyletek értékelési különbözete	1 059 042		276 773
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN	26 118 315		35 470 366

Kelt: Budapest, 2024.04.17

.....
HOLD Alapkezelő Zrt.

HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
címe: 1123 Budapest, Alkotás u. 50.

Felügyeleti eng.: E-III/110.714-3/2008

ÉVES BESZÁMOLÓ
MÉRLEG

Fordulónap : 2023.12.31

adatok eFt-ban

Sor- szám	A tétel megnevezése	Előző év	Előző év(ek) módosításai	Tárgyév
a	b	c	d	e
E.	Saját tőke	25 201 247		35 208 733
I.	Induló tőke	3 809 011		4 223 413
1.	Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	5 036 776		4 765 083
2.	Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-1 227 765		-541 670
II.	Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	21 392 236		30 985 320
1.	Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	15 677 002		20 228 398
2.	Értékelési különbszet tartaléka	4 507 764		6 580 573
3.	Előző év(ek) eredménye	-633 383		-493 123
4.	Üzleti év eredménye	1 840 853		4 669 472
F.	Céltartalékok	0		0
G.	Kötelezettségek	785 937		80 697
I.	Hosszú lejáratú kötelezettségek	0		0
II.	Rövid lejáratú kötelezettségek	785 937		80 697
III.	Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0		0
H.	Passzív időbeli elhatárolások	131 131		180 936
	FORRÁSOK ÖSSZESEN	26 118 315		35 470 366

Kelt: Budapest, 2024.04.17

.....
HOLD Alapkezelő Zrt.

HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
címe: 1123 Budapest, Alkotás u. 50.

Felügyeleti eng.: E-III/110.714-3/2008

**ÉVES BESZÁMOLÓ
EREDMÉNYKIMUTATÁS**

Beszámolási időszak : **2023. év**

adatok eFt-ban

Sor- szám	A tétel megnevezése	Előző év	Előző év(ek) módosításai	Tárgyév
a	b	c	d	e
I.	Pénzügyi műveletek bevételei	7 705 805		9 112 101
II.	Pénzügyi műveletek ráfordításai	5 462 474		3 781 274
III.	Egyéb bevételek	146 532		6 049
IV.	Működési költségek	528 978		642 336
V.	Egyéb ráfordítások	20 032		25 068
VI.	Fizetett, fizetendő hozamok	0		0
VII.	TÁRGYÉVI EREDMÉNY	1 840 853		4 669 472

Kelt: Budapest, 2024.04.17

.....
HOLD Alapkezelő Zrt.

HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
címe: 1123 Budapest, Alkotás u. 50.

Felügyeleti eng.: E-III/110.714-3/2008

ÉVES BESZÁMOLÓ
CASH-FLOW KIMUTATÁS

Beszámolási időszak : 2023. év

adatok eFt-ban

Sor- szám	A tétel megnevezése	Előző év	Előző év(ek) módosításai	Tárgyév
a	b	c	d	e
I.	Szokásos tevékenységből származó pénzeszköz-változás	4 762 658		3 502 633
1.	Tárgyévi eredmény	1 126 436		3 616 661
2.	Elszámolt amortizáció	0		0
3.	Elszámolt értékvesztés és visszairás	0		0
4.	Elszámolt értékelési különbözet	2 290 132		2 072 809
5.	Céltartalék képzés és felhasználás különbözete	0		0
6.	Ingatlan befektetések értékesítésének eredménye	0		0
7.	Értékpapír befektetések értékesítésének, beváltásának eredménye	0		0
8.	Befektetett eszközök állományváltozása	0		0
9.	Forgóeszközök állományváltozása	847 971		-1 562 946
10.	Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása	432 467		-705 240
11.	Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása	0		0
12.	Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása	53 310		31 544
13.	Passzív időbeli elhatárolások változása	12 342		49 805
II.	Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás	-3 122 329		-4 628 054
14.	Ingatlanok beszerzése	0		0
15.	Ingatlanok eladása	0		0
16.	Befolyt bérleti díjak	0		0
17.	Értékpapírok beszerzése	-18 880 337		-19 678 326
18.	Értékpapírok eladása, beváltása	15 043 591		13 997 461
19.	Kapott hozamok	714 417		1 052 811
III.	Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás	-1 243 337		3 265 205
20.	Befektetési jegy kibocsátás	6 032 466		7 220 840
21.	Befektetési jegy kibocsátás során kapott apport	0		0
22.	Befektetési jegy visszavásárlása	-7 275 803		-3 955 635
23.	Befektetési jegyek után fizetett hozamok	0		0
24.	Hitel, illetve kölcsön felvétele	0		0
25.	Hitel, illetve kölcsön törlesztése	0		0
26.	Hitel, illetve kölcsön után fizetett kamat	0		0
IV.	Pénzeszközök változása összesen	396 992		2 139 784

Kelt: Budapest, 2024.04.17

.....
HOLD Alapkezelő Zrt.

KIEGÉSZÍTŐ MELLÉKLET a 2023. ÉVI BESZÁMOLÓHOZ

I. Általános rész

1.1 A Befektetési Alap

Az Alap elnevezése:	HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
Felügyeleti engedély száma:	E-III/110.714-3/2008
Lajstromozási száma:	1111-304
Az Alap székhelye:	1123 Budapest, Alkotás u. 50.
Az Alap alakulása:	2008.11.19
Alapkezelő:	HOLD Alapkezelő Zrt. (1123 Budapest, Alkotás u. 50.)
Letétkezelő:	UniCredit Bank Zrt. (1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)

1.2 Az Alap számviteli politikájának főbb elvei a hatályos 2000 évi C. törvény a számvitelről (továbbiakban: számviteli tv) és a Befektetési alapok beszámoló készítési és könyvvezetési kötelezettségének sajátosságairól szóló 215/2000 (XII.11.) sz. Kormányrendelet (Rendelet) szerint:

A mérlegkészítés időpontjának az Alap az üzleti évet követő év első hónapjának utolsó nettó eszközérték számítás napját határozza meg. A 2023. évi beszámoló esetében ez a nap 2024. január 31.

Az Alap beszámolója a Rendelet 1. számú melléklet I. pontja szerinti részletezettségű mérlegből, a Rendelet 2. számú melléklet I. pontja szerinti részletezettségű Eredménykimutatásból és Kiegészítő mellékletből áll, melynek része a Portfóliójelentés valamint részletes számszaki adatok, bemutatások. A bázis és tárgyévi adatok összehasonlíthatóak, a törvény által 2016.01.01-től kötelezően előírt mérleg-, és eredmény struktúraváltozás miatti módosítások végrehajtásra kerültek.

Az Alap kettős könyvvitelt vezet a Rendelet speciális elszámolási előírásainak alkalmazásával.

Az Alapban azon gazdasági események esetén, amelyeknél az ellenérték külföldi pénzürtékben kerül meghatározásra, a külföldi pénzürtékre szóló követelés, illetve kötelezettség forintértékének meghatározása a Magyar Nemzeti Bank által közzétett, hivatalos devizaárfolyamon történik.

Az értékpapírok minősítését az Alap a befektetés időtartama és a megszerzett részesedés aránya alapján együttesen végzi. Az értékpapírokat bekerülési értéken értékeli, míg az év végén meglévő állományt – a Rendelet előírásai szerint - az ismert piaci értéken mutatja ki. Az egyes értékpapírok állományának részenkénti értékesítése esetében az árfolyam különbözetet FIFO elv szerint számolja el az Alap.

Az értékvesztések összege évente a fordulónapon fennálló követelésállomány egyedi minősítése alapján kerül meghatározásra.

A passzív időbeli elhatárolások értéke a fordulónapig elszámolt, valamint a mérlegkészítésig ismertté vált tárgyévvel vonatkozó bevételek, költségek és ráfordítások alapján az elszámolt összegben, ennek hiányában szerződés szerinti összegben kerül meghatározásra.

A kötelezettségek leltárral alátámasztott, partnerrel egyeztetett összegben a könyv szerinti értéken kerülnek beállításra.

A főkönyvi könyvvezetés tételes elszámolásokat tartalmaz, amelynek egyes eszközökre és forrásokra jellemző sajátos csoportosítását az analitikus nyilvántartások tartalmazzák. Folyamatosan vezetett analitikus nyilvántartások: szállítók folyószámlái, értékpapírforgalmazó és egyéb partnerek követelése és kötelezettségei, értékpapírok állománya, befektetési jegyek állományváltozása.

Jelentős összegű hibának a mérlegfőösszeg 2%-ánál nagyobb és 1 millió Ft-ot meghaladó hibát tekinti.

A korábbi évek befektetési jegy elszámolási gyakorlata módosításra került. A saját tőke összege nem változott.

II. Speciális rész

Az Alapnál származékos ügyletek vannak év végén, a nettó eszközértéken belüli arányuk : 0,79%

Az Alapnál kölcsönbe vett értékpapírok, adott fedezetek, biztosítékok, óvadékok, garancia- és kezességvállalások az év végén nincsenek.

Az alap vagyoni, pénzügyi és jövedelmi helyzetének alakulását a csatolt kimutatások tartalmazzák.

Az Alap 2008.11.19.-n került bejegyzésre 200000 eFt induló tőkével. A 2023.12.31-én kimutatott tőkenövekmény (30977050 e Ft) az induló tőke és a további tőkebevonás névértéken számított értékének (4223413 e Ft) 733,46%-a.

A HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap 2023. december 31-i saját tőkéje (azaz nettó eszköz értéke):	35 200 463 eFt
Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközértéke:	8,336558 Ft
Az Alap Letétkezelő által kimutatott nettó eszközértéke:	35 212 670 eFt
Az Alap Letétkezelő által kimutatott egy befektetési jegyre jutó nettó eszközértéke:	8,337490 Ft

A Letétkezelő által közétett és a Beszámoló szerint kimutatott nettó eszközérték különbség 12207 e Ft, amelynek oka a következő:

A passzív időbeli elhatárolások között halasztott bevételként került kimutatásra az egyéb bevételként elszámolt térítés nélkül kapott értékpapírok piaci értéke.

A HOLD Alapkezelő Zrt. részéről az Alap éves beszámoló aláírására kötelezett tisztségviselő:

Szabó Balázs, vezérigazgató, állandó lakcíme: 1123 Budapest, Kapitány utca 1. 1.em.7.ajtó

Számviteli szolgáltatást végző felelős személy:

Az Alap a számviteli tv. 150. § (2) bekezdése szerinti könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításával, vezetésével, az éves beszámoló elkészítésével Zagyva Beáta (2330 Dunaharaszti, Felső-Duna utca 28.) számviteli szolgáltatást nyújtó egyéni vállalkozót bízta meg. A könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy: Zagyva Beáta (PM mérlegképes könyvelői regisztráció száma: 146464)

Könyvvizsgálatot végző felelős személy:

Az Alapkezelő által kijelölt könyvvizsgáló a HK Adócontroll Könyvelés és Könyvvizsgáló Kft. (6055 Felsőlajos, Hársfa utca 10., MKVK nyilvántartási szám: 002125). A könyvvizsgálati feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy: Dr Hegedűs Mihály (MKVK tagsági igazolvány száma: 006219). Az éves könyvvizsgálati munkáért felszámított díj: 660400 Ft.

Az Alap az Éves jelentését az Alapkezelő honlapján és a Felügyelet által üzemeltetett honlapon teszi közzé:

www.hold.hu
www.kozzetetelek.mnb.hu

Budapest, 2024.04.17

Szabó Balázs
vezérigazgató
HOLD Alapkezelő Zrt.

PORTFÓLIÓ JELENTÉS ÉRTÉKPAPÍRALAPRA

ALAPADATOK

Alap neve	: HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
Lajstromszáma	: 1111-304
Alapkezelő neve	: HOLD Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve	: UniCredit Bank Zrt.
NEÉ számítás típusa	: Számviteli
Tárgynap (T)	: 2023.12.31
Saját tőke	: 35 208 733 000
Egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	: 8,336558
Darabszám	: 4 223 413 786

A TÁRGYNAPI NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK MEGHATÁROZÁSA

	Darabszám	Összeg/ Deviza Érték nem	(%)
I. KÖTELEZETTSÉGEK			
I/1. Hitelállomány (összes):		0 Ft	
I/2. Egyéb kötelezettségek (összes):		80 696 781 Ft	30,84%
Felügyeleti díj		2 934 000 Ft	1,12%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		77 762 781 Ft	29,72%
I/3. Céltartalékok (összes):		0 Ft	
I/4. Passzív időbeli elhatárolások (összes):		180 935 795 Ft	69,16%
Alapkezelői díj		168 884 796 Ft	64,55%
Letétkezelői díj		1 849 628 Ft	0,71%
Bizományosi díj		234 674 Ft	0,09%
Könyvelési díj		625 000 Ft	0,24%
Könyvvizsgálói díj		660 400 Ft	0,25%
Különadó		4 188 000 Ft	1,60%
Borrowing cost		546 017 Ft	0,21%
Carrying Cost		251 249 Ft	0,10%
Térítés nélkül kapott értékpapír bekerülési értéke miatt		3 696 031 Ft	1,41%
Kötelezettségek összesen:		261 632 576 Ft	100,00%
II. ESZKÖZÖK			
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):		3 027 870 321 Ft	8,54%
Elszámolási betétszámla HUF		2 363 137 Ft	0,01%
Devizabetétszámla-USD		40 066 707 Ft	0,11%
Devizabetétszámla-EUR		2 471 294 594 Ft	6,97%
Devizabetétszámla-JPY		13 227 868 Ft	0,04%
Devizabetétszámla-CZK		18 584 Ft	0,00%
Devizabetétszámla-CAD		7 017 397 Ft	0,02%
Devizabetétszámla-CHF		207 289 Ft	0,00%
Devizabetétszámla-GBP		1 977 449 Ft	0,01%
Devizabetétszámla-PLN		164 890 Ft	0,00%
Devizabetétszámla-RON		470 649 835 Ft	1,33%
Devizabetétszámla-TRY		37 508 Ft	0,00%
Devizabetétszámla-RUB		1 169 Ft	0,00%
Devizabetétszámla-NOK		20 580 244 Ft	0,06%
Devizabetétszámla-DKK		222 985 Ft	0,00%
Devizabetétszámla-ARS		40 665 Ft	0,00%
Valuta, deviza betétek értékelési különbözete		7 608 132 Ft	0,02%
USD bank értékkülönbözete		-51 806 Ft	0,00%
EUR bank értékkülönbözete		3 630 990 Ft	0,01%
JPY bank értékkülönbözete		270 318 Ft	0,00%
CZK bank értékkülönbözete		1 094 Ft	0,00%
CAD bank értékkülönbözete		66 396 Ft	0,00%
CHF bank értékkülönbözete		61 930 Ft	0,00%
GBP bank értékkülönbözete		372 140 Ft	0,00%
PLN bank értékkülönbözete		-649 Ft	0,00%
RON bank értékkülönbözete		3 194 791 Ft	0,01%
TRY bank értékkülönbözete		-3 645 Ft	0,00%
RUB bank értékkülönbözete		-115 Ft	0,00%
NOK bank értékkülönbözete		101 081 Ft	0,00%
DKK bank értékkülönbözete		1 733 Ft	0,00%
ARS bank értékkülönbözete		-36 126 Ft	0,00%

PORTFÓLIÓ JELENTÉS ÉRTÉKPAPÍRALAPRA

ALAPADATOK

Alap neve	: HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
Lajstromszáma	: 1111-304
Alapkezelő neve	: HOLD Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve	: UniCredit Bank Zrt.
NEÉ számítás típusa	: Számviteli
Tárgynap (T)	: 2023.12.31
Saját tőke	: 35 208 733 000
Egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	: 8,336558
Darabszám	: 4 223 413 786

A TÁRGYNAPI NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK MEGHATÁROZÁSA

	Darabszám	Összeg/ Deviza Érték nem	(%)
II/2. Egyéb követelés (összes):		1 896 079 815 Ft	5,35%
Devizapénzszámla-USD		757 079 278 Ft	2,13%
Devizapénzszámla-EUR		497 759 947 Ft	1,40%
Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete		-6 475 331 Ft	-0,02%
USD Concorde értékkülönbözete		-8 936 652 Ft	-0,03%
EUR Concorde értékkülönbözete		2 461 321 Ft	0,01%
Követelések értékpapír eladásból		80 526 771 Ft	0,23%
Határidős ügyletek változó letét		567 189 150 Ft	1,60%
II/2.1. Származtatott ügyletek értékelési különbözete		276 772 946 Ft	0,78%
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):		0 Ft	
II/3.1. Max. 3 hó lekötésű (összes):		0 Ft	
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0 Ft	
II/4. Értékpapírok (összes):	16 748 096	30 248 623 026 Ft	85,28%
II/4.1. Állampapírok (összes):	148 250	2 203 088 354 Ft	6,21%
II/4.1.1. Kötvények (összes):	108 250	1 129 609 318 Ft	3,18%
MÁK 2027/B	108 250	1 129 609 318 Ft	3,18%
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):	0	0 Ft	
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes ép. (összes):	0	0 Ft	
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes):	40 000	1 073 479 036 Ft	3,03%
US TREASURY 0.125% 2052/02/15	30 000	708 833 867 Ft	2,00%
US TREASURY 0.625% 2043/02/15	10 000	364 645 169 Ft	1,03%
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	29 058	1 793 315 989 Ft	5,06%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0 Ft	
II/4.2.2. Külföldi kötvények (összes):	29 058	1 793 315 989 Ft	5,06%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	2 200	939 773 666 Ft	2,65%
NEW WORLD RES 4% 10/07/20	17 886	86 265 Ft	0,00%
NEW WORLD RES NWRR 10/07/20	6 572	0 Ft	0,00%
ROMANIA 2% 2032/01/28	2 150	653 218 242 Ft	1,84%
ROMANIA 7.625% 2053/01/17	250	200 237 816 Ft	0,56%
II/4.2.3. Tőzsdén kívüli (összes):	0	0 Ft	
II/4.3. Részvények (összes):	16 420 888	25 268 912 834 Ft	71,24%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):	1 975 269	2 154 373 943 Ft	6,07%
GRAPHISOFT PARK SE	155 410	522 303 233 Ft	1,47%
MAGYAR TELEKOM	1 771 405	1 208 098 210 Ft	3,41%
RICHTER GEDEON	48 454	423 972 500 Ft	1,20%
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):	14 445 619	23 114 538 891 Ft	65,17%
ADRIS GRUPA DD - PFD	40 385	874 955 079 Ft	2,47%
ALIBABA GROUP ADR	10 875	292 021 638 Ft	0,82%
ALPHA BANK	669 701	394 519 801 Ft	1,11%
AP MOLLER MAERSK B ORD	835	520 529 815 Ft	1,47%
BILFINGER BERGER AG	35 253	469 866 071 Ft	1,32%
CAIRO MEZZ ORD	1 355 653	94 442 868 Ft	0,27%
DAIWA INDUSTRIES	72 000	265 429 008 Ft	0,75%
DEEP VALUE DRILLER ORD	390 882	325 418 060 Ft	0,92%
DIGI	317 791	1 075 976 768 Ft	3,03%
ENEA SA	1 292 966	1 043 846 103 Ft	2,94%
ERSTE BANK STAMMAKT	60 700	853 412 221 Ft	2,41%
EUROBANK HOLDINGS SA	1 915 645	1 180 565 655 Ft	3,33%
EUROCASH	329 716	483 319 474 Ft	1,36%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	434 000	239 638 559 Ft	0,68%

PORTFÓLIÓ JELENTÉS ÉRTÉKPAPÍRALAPRA

ALAPADATOK

Alap neve	: HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap
Lajstromszáma	: 1111-304
Alapkezelő neve	: HOLD Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve	: UniCredit Bank Zrt.
NEÉ számítás típusa	: Számviteli
Tárgynap (T)	: 2023.12.31
Saját tőke	: 35 208 733 000
Egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	: 8,336558
Darabszám	: 4 223 413 786

A TÁRGYNAPI NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK MEGHATÁROZÁSA

	Darabszám	Összeg/ Deviza Érték nem	(%)
FOTEX HOLDING SE ORDINARY SHARES	332 092	386 439 254 Ft	1,09%
FOURLIS	393 728	602 844 815 Ft	1,70%
GALAXY COSMOS MEZZ PLC	534 994	102 802 072 Ft	0,29%
HELLENIC BANK PUBLIC COMPANY ORD	914 575	780 680 671 Ft	2,20%
HYUNDAI MOTOR AKTIE	3 142	95 038 431 Ft	0,27%
HYUNDAI MOTOR GDR	5 300	80 238 968 Ft	0,23%
JUMBO R	79 195	761 494 264 Ft	2,15%
LINAMAR CORP	35 400	592 503 564 Ft	1,67%
MAYR MELNHOF KARTON	13 081	633 904 580 Ft	1,79%
MPC CONTAINER SHIP	530 000	240 469 613 Ft	0,68%
MURAKAMI CORP	19 250	193 627 434 Ft	0,55%
NAK KAZA JOINT STOCK COMP NAT GDR	41 600	589 446 874 Ft	1,66%
NATL BANK OF GREECE SA	413 534	995 660 105 Ft	2,81%
NEW WORLD RES 10/07/20	8 762	0 Ft	0,00%
OHASHI TECHNICA	37 620	167 801 670 Ft	0,47%
ORANGE POLSKA	1 132 409	811 535 927 Ft	2,29%
ORIGIN ENTERPRISES ORD	556 613	732 927 515 Ft	2,07%
PEPCO GROUP ORD	333 700	765 615 385 Ft	2,16%
PKN ORLEN	178 299	1 028 182 579 Ft	2,90%
POSTNL	906 044	490 050 333 Ft	1,38%
PUBLIC POWER CORPORATION	128 860	550 467 344 Ft	1,55%
PZU	152 248	633 603 011 Ft	1,79%
SHELL ORD	41 234	466 747 680 Ft	1,32%
SUNRISEMEZZ PLC	396 127	31 766 379 Ft	0,09%
TRINITY INDUSTRIAL CORP	62 000	132 294 583 Ft	0,37%
VALARIS ORD	38 250	908 643 698 Ft	2,56%
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	64 000	687 558 682 Ft	1,94%
VANECK VECTORS RUSSIA ETF	48 700	0 Ft	0,00%
VIENNA INSURANCE GROUP	108 150	1 097 037 911 Ft	3,09%
VOLKSWAGEN ELS.	10 310	441 214 429 Ft	1,24%
II/4.3.3. Tőzsdén kívüli (összes):	0	0 Ft	
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes):	0	0 Ft	
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0 Ft	
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes):	0	0 Ft	
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):	149 900	983 305 849 Ft	2,77%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):	149 900	983 305 849 Ft	2,77%
CENTRAL EUROPE & RUSSIA FUND	51 200	172 942 848 Ft	0,49%
ISHARES MSCI POLAND INVESTABLE ETF	45 100	353 893 657 Ft	1,00%
KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF	48 800	456 469 344 Ft	1,29%
LYXOR ETF MSCI RUSSIA	4 800	0 Ft	0,00%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes):	0	0 Ft	
II/4.6. Kárpótlási jegy (összes):	0	0 Ft	
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):		13 411 668 Ft	0,04%
Esedékes bevételek		13 411 668 Ft	0,04%
ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	16 748 096	35 470 365 908 Ft	100,00%

1. Pénzügyi műveletek bevételei és ráfordításai

adatok Ft-ban

PÉNZÜGYI MŰVELETEK BEVÉTELEI	2023.12.31
Árfolyamnyereség értékpapír értékesítésből	2 151 704 484
ebből: Államkötvények, diszkont kincstárjegyek	18 839 948
Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	22 877 635
Részcvények	1 988 692 769
Jelzáloglevelek	0
Befektetési jegyek	121 294 132
Értékpapírok után kapott kamat, osztalék	853 769 911
Bankoktól kapott kamat	160 730 346
Értékpapír kölcsönzési díj	0
Adott óvadék kamata	0
Devizakészletek átváltásának árfolyamnyeresége	4 299 215 569
Külföldi pénzürt. eszközök, követelés - kötelezettség árfolyamnyeresége	78 028 548
Lezárt és lejárt határidős ügyletek árfolyamnyeresége	1 394 401 479
Opció díjbevétele	163 501 019
Forgalmazási jutalék, büntető jutalék bevétele	0
Saxo Corporate action	2 479 697
CYEP Income	8 269 890
Hozamfizető alap hozama	0
Összesen :	9 112 100 943

adatok Ft-ban

PÉNZÜGYI MŰVELETEK RÁFORDÍTÁSAI	3 781 273 754
Árfolyamvesztés értékpapír értékesítésből	206 709 820
ebből: Államkötvények, diszkont kincstárjegyek	58 645 036
Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	25 727 119
Részcvények	122 337 665
Jelzáloglevelek	0
Befektetési jegyek	0
Értékpapírok vételárában fizetett kamat, osztalék	0
Banki kamat	1 854 420
Értékpapír kölcsönzési díj	7 481 852
Short hitel kamat	0
Devizakészletek átváltásának árfolyamvesztése	1 299 067 938
Külföldi pénzürt. eszközök, követelés - kötelezettség árfolyamvesztése	85 532 816
Lezárt és lejárt határidős ügyletek árfolyamvesztése	1 144 927 708
Opció nyitási díj	989 168 717
Értékpapírok után kapott osztalék kamata	0
Saxo Corporate action	46 530 483
Összesen :	3 781 273 754

PÉNZÜGYI MŰVELETEK EREDMÉNYE :	5 330 827 189
---------------------------------------	----------------------

2. Egyéb bevételek és ráfordítások

adatok Ft-ban

EGYÉB BEVÉTELEK	2023.12.31
Céltartalék felhasználás	0
Egyéb bevétel	6 048 337
Értékvesztések (AIH)	0
Összesen :	6 048 337

adatok Ft-ban

EGYÉB RÁFORDÍTÁSOK	2023.12.31
Egyéb ráfordítás	25 067 521
Értékvesztések (AIH)	0
Céltartalék képzés	0
Összesen :	25 067 521

3. Működési költségek összetétele

adatok Ft-ban

MŰKÖDÉSI KÖLTSÉGEK	2023.12.31
Bizományosi díj	21 779 897
Forgalmazási díj	0
Sikerdíj	0
Könyvelési díj	2 500 000
Könyvvizsgálói díj	660 400
Bankköltség	6 691 573
Folyószla.felhamozott kamat	0
Bankköltség (negatív kamat)	3 000 658
Alapkezelői díj	589 145 457
Letétkezelői díj	18 558 090
Borrowing cost	0
Összesen :	642 336 075

4. Értékpapír-állomány összetétele és értékkülönbözete

adatok Ft-ban

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
MÁK 2027/B	108 250	1 092 491 774	37 117 544	1 129 609 318
Magyar államkötvény összesen	108 250	1 092 491 774	37 117 544	1 129 609 318

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
-	-	-	-	-
Diszkont kincstárjegy összesen	0	0	0	0

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
-	-	-	-	-
Jelzáloglevél összesen	0	0	0	0

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	2 200	827 863 485	111 910 181	939 773 666
NEW WORLD RES 4% 10/07/20	17 886	4 905 120	-4 818 855	86 265
NEW WORLD RES NWRR 10/07/20	6 572	2 102 286	-2 102 286	0
ROMANIA 2% 2032/01/28	2 150	579 305 559	73 912 683	653 218 242
ROMANIA 7.625% 2053/01/17	250	185 210 052	15 027 764	200 237 816
Gazdálkodói és egyéb hitelv.megtest. ép. összesen	29 058	1 599 386 502	193 929 487	1 793 315 989

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
US TREASURY 0.125% 2052/02/15	30 000	721 973 537	-13 139 670	708 833 867
US TREASURY 0.625% 2043/02/15	10 000	367 853 046	-3 207 877	364 645 169
Külföldi állampapír összesen	40 000	1 089 826 583	-16 347 547	1 073 479 036

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
GRAPHISOFT PARK SE	155 410	390 825 750	131 477 483	522 303 233
MAGYAR TELEKOM	1 771 405	683 587 015	524 511 195	1 208 098 210
RICHTER GEDEON	48 454	336 464 497	87 508 003	423 972 500
Belföldi részvény összesen	1 975 269	1 410 877 262	743 496 681	2 154 373 943

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
ADRI GRUPA DD - PFD	40 385	737 792 417	137 162 662	874 955 079
ALIBABA GROUP ADR	10 875	433 373 945	-141 352 307	292 021 638
ALPHA BANK	669 701	220 854 584	173 665 217	394 519 801
AP MOLLER MAERSK B ORD	835	534 537 915	-14 008 100	520 529 815
BILFINGER BERGER AG	35 253	397 536 730	72 329 341	469 866 071
CAIRO MEZZ ORD	1 355 653	82 234 976	12 207 892	94 442 868
DAIWA INDUSTRIES	72 000	149 299 346	116 129 662	265 429 008
DEEP VALUE DRILLER ORD	390 882	117 592 728	207 825 332	325 418 060
DIGI	317 791	706 338 378	369 638 390	1 075 976 768
ENEA SA	1 292 966	669 458 209	374 387 894	1 043 846 103
ERSTE BANK STAMMAKT	60 700	616 152 184	237 260 037	853 412 221

4. Értékpapír-állomány összetétele és értékkülönbözete

	adatok Ft-ban			
EUROBANK HOLDINGS SA	1 915 645	628 855 590	551 710 065	1 180 565 655
EUROCASH	329 716	395 862 686	87 456 788	483 319 474
FIX PRICE GROUP GDR REG S	434 000	70 338 487	169 300 072	239 638 559
FOTEX HOLDING SE ORDINARY SHARES	332 092	148 557 144	237 882 110	386 439 254
FOURLIS	393 728	610 264 044	-7 419 229	602 844 815
GALAXY COSMOS MEZZ PLC	534 994	105 737 615	-2 935 543	102 802 072
HELLENIC BANK PUBLIC COMPANY ORD	914 575	568 248 427	212 432 244	780 680 671
HYUNDAI MOTOR AKTIE	3 142	56 926 500	38 111 931	95 038 431
HYUNDAI MOTOR GDR	5 300	42 922 300	37 316 668	80 238 968
JUMBO R	79 195	417 536 499	343 957 765	761 494 264
LINAMAR CORP	35 400	525 482 164	67 021 400	592 503 564
MAYR MELNHOF KARTON	13 081	656 616 894	-22 712 314	633 904 580
MPC CONTAINER SHIP	530 000	340 300 451	-99 830 838	240 469 613
MURAKAMI CORP	19 250	113 151 382	80 476 052	193 627 434
NAK KAZA JOINT STOCK COMP NAT GDR	41 600	482 017 110	107 429 764	589 446 874
NATL BANK OF GREECE SA	413 534	489 570 455	506 089 650	995 660 105
NEW WORLD RES 10/07/20	8 762	2 802 834	-2 802 834	0
OHASHI TECHNICA	37 620	117 513 645	50 288 025	167 801 670
ORANGE POLSKA	1 132 409	687 387 575	124 148 352	811 535 927
ORIGIN ENTERPRISES ORD	556 613	683 116 758	49 810 757	732 927 515
PEPCO GROUP ORD	333 700	678 454 709	87 160 676	765 615 385
PKN ORLEN	178 299	868 318 358	159 864 221	1 028 182 579
POSTNL	906 044	627 746 614	-137 696 281	490 050 333
PUBLIC POWER CORPORATION	128 860	375 563 939	174 903 405	550 467 344
PZU	152 248	384 588 977	249 014 034	633 603 011
SHELL ORD	41 234	249 963 828	216 783 852	466 747 680
SUNRISEMEZZ PLC	396 127	42 412 520	-10 646 141	31 766 379
TRINITY INDUSTRIAL CORP	62 000	111 041 958	21 252 625	132 294 583
VALARIS ORD	38 250	488 375 889	420 267 809	908 643 698
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	64 000	392 581 663	294 977 019	687 558 682
VANECK VECTORS RUSSIA ETF	48 700	349 437 789	-349 437 789	0
VIENNA INSURANCE GROUP	108 150	828 305 418	268 732 493	1 097 037 911
VOLKSWAGEN ELS.	10 310	524 749 754	-83 535 325	441 214 429
Külföldi részvény összesen	14 445 619	17 729 921 388	5 384 617 503	23 114 538 891

Megnevezés	Darabszám	Beszerzési érték	Elszámolt érték-különbözet	Mérleg fordulónapi érték
CENTRAL EUROPE & RUSSIA FUND	51 200	173 299 292	-356 444	172 942 848
ISHARES MSCI POLAND INVESTABLE ETF	45 100	286 778 736	67 114 921	353 893 657
KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF	48 800	479 575 675	-23 106 331	456 469 344
LYXOR ETF MSCI RUSSIA	4 800	83 798 197	-83 798 197	0
Befektetési jegy összesen	149 900	1 023 451 900	-40 146 051	983 305 849

MINDÖSSZESEN	16 748 096	23 945 955 409	6 302 667 617	30 248 623 026
---------------------	-------------------	-----------------------	----------------------	-----------------------

5. Származtatott ügyletek összetétele és értékkülönbözete

adatok Ft-ban

Megnevezés	Tranzakció iránya	Névérték	Kötésnap	Lejárat napja	Kötési árfolyam	Fordulónapi értékelési különbözet	Tárgyévben realizált eredmény	Várható pénzáramlás	Tényleges pénzáramlás
EURHUFF240124E384.22	eladás	300 000,00	2023.12.22	2024.01.24	384,2200	-19 344,0	0,0	0,0	258 000,0
EURHUFF240124E431.23	eladás	850 000,00	2023.01.24	2024.01.24	431,2300	39 623 299,0	0,0	0,0	-39 227 500,0
EURHUFF240229E385.47	eladás	4 880 000,00	2023.11.28	2024.02.29	385,4700	-6 613 744,0	0,0	-6 654 907,0	0,0
EURHUFF240229E385.65	eladás	3 490 000,00	2023.11.28	2024.02.29	385,6500	-4 112 616,0	0,0	-4 136 154,0	0,0
EURHUFF240229E386.14	eladás	800 000,00	2023.12.01	2024.02.29	386,1400	-557 525,0	0,0	-559 239,0	0,0
EURHUFF240229V386.97	vétel	40 000,00	2023.12.19	2024.02.29	386,9700	-4 747,0	0,0	-4 974,0	0,0
EURHUFF240307E383.21	eladás	1 070 000,00	2023.11.28	2024.03.07	383,2100	-3 844 166,0	0,0	-4 330 891,0	0,0
EURHUFF240307E383.52	eladás	11 869 000,00	2023.11.28	2024.03.07	383,5200	-39 029 068,0	0,0	-44 397 441,0	0,0
EURHUFF240307E383.81	eladás	200 000,00	2023.11.28	2024.03.07	383,8100	-600 720,0	0,0	-690 697,0	0,0
EURHUFF240307E384.745	eladás	1 915 000,00	2023.11.28	2024.03.07	384,7450	-3 993 951,0	0,0	-4 840 573,0	0,0
EURHUFF240411E415.68	eladás	542 000,00	2023.04.11	2024.04.11	415,6800	14 020 558,0	0,0	14 210 930,0	0,0
EURHUFF240426E408.8722	eladás	707 000,00	2023.05.04	2024.04.26	408,8722	12 907 195,0	0,0	13 177 794,0	0,0
EURHUFF240426E413	eladás	1 500 000,00	2023.04.24	2024.04.26	413,0000	33 381 989,0	0,0	34 016 807,0	0,0
EURUSDF240201E1.06372	eladás	1 200 000,00	2023.10.30	2024.02.01	1,0637	-17 584 581,0	0,0	-7 871 713,0	0,0
EURUSDF240201E1.065479	eladás	4 130 000,00	2023.10.30	2024.02.01	1,0655	-58 015 375,0	0,0	-24 507 133,0	0,0
EURUSDF240201V1.09669	vétel	364 733,88	2023.12.21	2024.02.01	1,0967	1 198 376,0	0,0	-1 885 876,0	0,0
EURUSDF240205E1.08834	eladás	1 600 000,00	2023.12.01	2024.02.05	1,0883	-9 958 047,0	0,0	3 420 642,0	0,0
PLNHUFF240419E89.13	eladás	24 072 000,00	2023.12.15	2024.04.19	89,1300	342 807,0	0,0	-4 203 335,0	0,0
PLNHUFF240419E89.21	eladás	12 242 000,00	2023.12.15	2024.04.19	89,2100	1 124 772,0	0,0	-1 177 701,0	0,0
PLNHUFF240419E89.23	eladás	9 480 000,00	2023.12.15	2024.04.19	89,2300	1 055 005,0	0,0	-726 152,0	0,0
PLNHUFF240419V89.63	vétel	1 642 000,00	2023.12.18	2024.04.19	89,6300	-820 136,0	0,0	-518 000,0	0,0
RONHUFF240216E76.652	eladás	2 245 100,00	2023.11.14	2024.02.16	76,6520	-1 632 805,0	0,0	-1 905 029,0	0,0
RONHUFF240216E76.68	eladás	7 320 000,00	2023.11.14	2024.02.16	76,6800	-5 121 492,0	0,0	-6 007 167,0	0,0
RONHUFF240216E76.705	eladás	4 863 000,00	2023.11.14	2024.02.16	76,7050	-3 282 518,0	0,0	-3 869 790,0	0,0
RONHUFF240216V76.54	vétel	1 631 000,00	2023.11.16	2024.02.16	76,5400	1 366 364,0	0,0	1 565 812,0	0,0
USDCNHF240220V7.0872	vétel	2 400 000,00	2023.11.21	2024.02.20	7,0872	2 384 283,0	0,0	10 685 664,0	0,0
USDCNHF240220V7.2031	vétel	4 248 170,93	2023.08.15	2024.02.20	7,2031	-19 572 852,0	0,0	-5 271 301,0	0,0
USDHKDF240129V7.8119	vétel	8 226 346,98	2023.10.25	2024.01.29	7,8119	-285 176,0	0,0	0,0	6 499,9
USDHUFF240312E349.6538	eladás	737 000,00	2023.12.22	2024.03.12	349,6538	111 913,0	0,0	-5 803 461,0	0,0
USDHUFF240312E354.6421	eladás	109 000,00	2023.12.20	2024.03.12	354,6421	549 661,0	0,0	-320 689,0	0,0
USDHUFF240312E355.87	eladás	204 000,00	2023.12.13	2024.03.12	355,8700	1 274 315,0	0,0	-352 518,0	0,0
USDHUFF240312E356.6	eladás	75 000,00	2023.12.07	2024.03.12	356,6000	522 179,0	0,0	-75 467,0	0,0
USDHUFF240312E357.49	eladás	9 446 000,00	2023.12.08	2024.03.12	357,4900	74 009 419,0	0,0	-1 192 242,0	0,0
USDHUFF240312E357.584	eladás	7 448 000,00	2023.12.08	2024.03.12	357,5840	59 041 525,0	0,0	-247 810,0	0,0
XAUUSDF240226V2023.752	vétel	1 000,00	2023.11.22	2024.02.26	2 023,7520	19 109 509,0	0,0	8 080 977,0	0,0
Nyitott pozíciók értéke (FORWARD) összesen						86 974 306,0	0,0	-46 391 634,0	-38 963 000,1

Megnevezés	Tranzakció iránya	Névérték	Kötésnap	Lejárat napja	Kötési árfolyam	Fordulónapi értékelési különbözet	Tárgyévben realizált eredmény	Várható pénzáramlás	Tényleges pénzáramlás
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Nyitott pozíciók értéke (IRS) összesen						0,0	0,0	0,0	0,0

Megnevezés	Tranzakció iránya	Névérték	Kötésnap	Lejárat napja	Kötési árfolyam	Fordulónapi értékelési különbözet	Tárgyévben realizált eredmény	Várható pénzáramlás	Tényleges pénzáramlás
DAXOP240315P16100	vétel	33,00	2023.11.20	2024.03.15	454,0000	10 433 817,2	0,0	4 759 134,6	0,0
DAXOP240315P16100	vétel	17,00	2023.12.06	2024.03.15	241,5000	5 374 996,8	0,0	2 451 675,4	0,0
DAXOP240621P17100	vétel	16,00	2023.12.12	2024.06.21	610,0000	19 102 253,0	0,0	14 932 250,0	0,0
EMINIOP240315P4600	vétel	13,00	2023.11.30	2024.03.15	116,0000	9 908 184,0	0,0	4 857 216,0	0,0
EMINIOP240315P4600	vétel	7,00	2023.12.06	2024.03.15	107,0000	5 335 176,0	0,0	2 615 424,0	0,0
EMINIOP240621P4700	vétel	7,00	2023.12.12	2024.06.21	166,5000	14 156 405,0	0,0	10 866 464,0	0,0
EMINIOP240920P4850	vétel	13,00	2023.12.14	2024.09.20	218,5000	45 881 648,0	0,0	38 857 728,0	0,0
EURJPYOP240821P150	vétel	3 000 000,00	2023.08.21	2024.08.21	4,9660	25 726 985,0	0,0	14 585 139,3	0,0
EURJPYOP240821P150	vétel	3 000 000,00	2023.09.13	2024.08.21	4,9110	25 726 985,0	0,0	14 585 139,3	0,0
EURJPYOP240821P150	vétel	3 000 000,00	2023.10.18	2024.08.21	4,5980	25 726 985,0	0,0	14 585 139,3	0,0
USDCNHO241211C7.2	vétel	14 500 000,00	2023.12.11	2024.12.11	0,1014	68 753 078,0	0,0	81 270 832,0	0,0
USDCNHO241219C7.3	vétel	14 500 000,00	2023.12.19	2024.12.19	0,0689	52 356 489,0	0,0	61 506 108,0	0,0
USDJPYOP240821P135	vétel	3 300 000,00	2023.08.21	2024.08.21	3,9940	24 884 482,0	0,0	8 359 960,0	0,0
XAUUSDOP240325C1975	vétel	3 700,00	2023.09.25	2024.03.25	62,3900	155 276 158,0	0,0	116 650 811,0	0,0
XAUUSDOP240611C2000	vétel	1 500,00	2023.12.11	2024.06.11	102,3800	71 453 354,0	0,0	58 444 265,0	0,0
Nyitott pozíciók értéke (OPCIÓ) összesen						560 096 996,0	0,0	449 327 285,9	0,0

Megnevezés	Tranzakció iránya	Névérték	Kötésnap	Lejárat napja	Kötési árfolyam	Fordulónapi értékelési különbözet	Tárgyévben realizált eredmény	Várható pénzáramlás	Tényleges pénzáramlás
ESH4-S&P 500	eladás	-8,00	2023.12.13	-	4 697,4500	-16 982 489,0	0,0	-24 631 245,0	0,0
FESXH4-DJ EURO STOXX	eladás	-113,00	2023.12.13	-	4 585,5000	18 383 010,0	0,0	-34 594 560,0	0,0
FSTTH4	vétel	50,00	2023.12.13	-	199,8000	-2 009 595,2	0,0	1 925 450,0	0,0
FSTTH4	vétel	55,00	2023.12.13	-	199,8000	-2 210 554,8	0,0	2 117 995,0	0,0
GCG4-COMEX	vétel	11,00	2023.11.24	2024.01.25	2 015,8000	21 340 704,0	0,0	0,0	622 723,2
JGB1H4-JGB1	eladás	-13,00	2023.12.08	-	145,3100	-32 740 458,9	0,0	-17 893 450,4	0,0
JGB1H4-JGB1	eladás	-3,00	2023.12.25	-	146,4600	-7 555 490,5	0,0	-4 129 257,8	0,0
JGB1H4-JGB1	eladás	-1,00	2023.12.25	-	146,4600	-2 518 496,8	0,0	-1 376 419,3	0,0
JGB1H4-JGB1	eladás	-2,00	2023.12.25	-	146,5100	-5 036 993,7	0,0	-2 752 838,5	0,0
Származtatott ügyletek (FUTURES) összesen						-29 330 365,0	0,0	-81 334 326,0	622 723,2

Megnevezés	Tranzakció iránya	Névérték	Kötésnap	Lejárat napja	Kötési árfolyam	Fordulónapi értékelési különbözet	Tárgyévben realizált eredmény	Várható pénzáramlás	Tényleges pénzáramlás
AAPL	eladás	-2 950,00	2022.02.15	-	171,8039	-32 364 936,6	0,0	-24 708 809,8	0,0
AAPL	eladás	-950,00	2022.08.08	-	166,3900	-10 422 606,7	0,0	-7 957 074,3	0,0
AAPL	eladás	-6 200,00	2022.09.22	-	153,0000	-68 021 222,7	0,0	-51 930 379,8	0,0
AAPL	eladás	-400,00	2023.07.10	-	188,8900	-4 388 466,0	0,0	-3 350 347,1	0,0
CBA XASX	eladás	-13 000,00	2021.10.01	-	77,3520	-98 720 733,2	0,0	-115 541 888,6	0,0
CBA XASX	eladás	-1 500,00	2023.07.11	-	98,9700	-11 390 853,8	0,0	-13 331 756,4	0,0
MC:XPAR	eladás	-325,00	2022.12.21	-	683,7967	-6 199 830,0	0,0	-10 177 925,7	0,0
MC:XPAR	eladás	-675,00	2022.12.21	-	683,7476	-12 876 570,0	0,0	-21 138 768,8	0,0
RY:XTSE	eladás	-150,00	2015.01.06	-	78,4206	-885 528,4	0,0	-786 980,9	0,0
RY:XTSE	eladás	-200,00	2015.10.09	-	74,0500	-1 180 704,5	0,0	-1 049 307,8	0,0
RY:XTSE	eladás	-50,00	2015.10.13	-	73,8000	-295 176,1	0,0	-262 327,0	0,0
RY:XTSE	eladás	-50,00	2016.03.18	-	75,8100	-295 176,1	0,0	-262 327,0	0,0
RY:XTSE	eladás	-150,00	2016.04.15	-	77,2900	-885 528,4	0,0	-786 980,9	0,0
RY:XTSE	eladás	-140,00	2016.04.18	-	77,4100	-826 493,1	0,0	-734 515,5	0,0
RY:XTSE	eladás	-3 330,00	2017.03.06	-	98,1710	-19 658 729,4	0,0	-17 470 975,0	0,0
RY:XTSE	eladás	-1 330,00	2019.02.04	-	100,6662	-7 851 684,7	0,0	-6 977 896,9	0,0
RY:XTSE	eladás	-1 350,00	2021.02.25	-	110,7744	-7 969 755,2	0,0	-7 082 827,7	0,0
RY:XTSE	eladás	-3 500,00	2022.12.09	-	130,7760	-20 662 328,2	0,0	-18 362 886,7	0,0
RY:XTSE	eladás	-1 250,00	2023.07.10	-	125,4236	-7 379 402,9	0,0	-6 558 173,8	0,0
TSLA:XNAS	eladás	-3 600,00	2022.08.25	-	231,8755	-21 519 198,8	0,0	56 282 776,5	0,0
TSLA:XNAS	eladás	-800,00	2023.02.09	-	207,5200	-4 782 044,2	0,0	12 507 283,7	0,0
TSLA:XNAS	eladás	-400,00	2023.07.10	-	272,7900	-2 391 022,1	0,0	6 253 641,8	0,0
Származtatott ügyletek (Részvény CFD) összesen						-340 967 991,0	0,0	-233 428 447,5	0,0

Megnevezés	Tranzakció iránya	Névérték	Kötésnap	Lejárat napja	Kötési árfolyam	Fordulónapi értékelési különbözet	Tárgyévben realizált eredmény	Várható pénzáramlás	Tényleges pénzáramlás
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Származtatott ügyletek (FOREX) összesen						0,0	0,0	0,0	0,0

SZÁRMAZTATOTT ÜGYLETEK mindösszesen						276 772 946,0	0,0	88 172 878,4	-38 340 276,9
--	--	--	--	--	--	----------------------	------------	---------------------	----------------------

6. Kölcsönbe adott és vett értékpapírok összetétele és értékkülönbözete

adatok Ft-ban

Megnevezés	Darabszám	Szerződés szerinti érték	Elszámolt értékkülönbözet	Piaci érték
-	-	-	-	-
Kölcsönbe adott értékpapírok	0	0	0	0

adatok Ft-ban

Megnevezés	Darabszám	Szerződés szerinti érték	Elszámolt értékkülönbözet	Piaci érték
-	-	-	-	-
Kölcsönbe vett értékpapírok	0	0	0	0

7. Óvadékba kapott és adott értékpapírok összetétele

adatok Ft-ban

Megnevezés	Darabszám	Szerződés szerinti érték	Elszámolt értékkülönbözet	Piaci érték
-	-	-	-	-
Óvadékba kapott értékpapírok	0	-	-	0

Megnevezés	Darabszám	Szerződés szerinti érték	Elszámolt értékkülönbözet	Piaci érték
-	-	-	-	-
Óvadékba adott értékpapírok	0	-	-	0

ÜZLETI JELENTÉS 2023. DECEMBER 31.

I. Az Alapkezelő általános bemutatása

A HOLD Alapkezelő Befektetési Alapkezelő Zrt, Magyarországon bejegyzett társaság (Továbbiakban: Alapkezelő).

A Társaság tulajdonosi struktúrája:

Résztvényes neve	Tulajdoni hányad (%)	Szavazati hányad (%)
CA Investors Vagyonkezelő Zrt.	74,18%	74,38%
LATOBO Consult Kft.	12,76%	12,81%
Investset Contractor Kft.	12,76%	12,81%
Dolgozói részvények	0,30%	0,00%

II. Az Alap Megnevezése, típusa

Név: HOLD Rubicon Származtatott Befektetési Alap

ISIN azonosítója: HU0000707252

Típusa: nyilvános, nyílt végű származtatott ügyletekbe fektető, abszolút hozamú alap

III. Az Alap gazdálkodásának bemutatása

A mérleg lezárása után lényeges esemény az alap tárgyévi gazdálkodásával kapcsolatban nem merült fel.

Az alap nettó eszközértékének újraszámolásából fakadó kompenzációra a HOLD Kötvény Befektetési Alap, a Creditum Származtatott Befektetési Alap, a HOLD Columbus Globális Értékalapú Származtatott Befektetési Alap illetve a Palomar Származtatott Befektetési Alap esetében volt szükség a beszámoló készítésének időpontjáig.

Az Alap nem folytat kutatási-fejlesztési tevékenységet, telephelyei nincsenek. Az Alapkezelő a törvényi szabályozásnak és a Felügyeleti előírásoknak megfelelő foglalkoztatáspolitikát folytat, rendelkezik az ABAK rendeletben előírt javadalmazási politikával. Az Alap tevékenysége - pénzügyi befektetések- nem járt környezeti terheléssel.

Az alap portfóliójában kizárólag az alap kezelési szabályzatában bemutatott befektetési instrumentumok szerepelnek.

Az Alapkezelő a kockázatkezelési tevékenységének keretében méri és elemzi az alap kockázati kitettségét. Az Alapkezelő a kockázatkezelési és likviditási szabályzatának megfelelően jár el az alap kockázati profiljának kialakítása során. Az Alapkezelő a kockázatkezelési tevékenysége során limit rendszert alakít ki mind a befektetési, mind a likviditási profilnak megfelelően, azokat napi szinten ellenőrzi és beszámol az Alapkezelő Igazgatósága részére. A kezelt befektetési alap tekintetében negyedévente stressz tesztet készít.

Budapest, 2024.04.17

.....
HOLD Alapkezelő Zrt.