

248 908,97								
322 278,08								
324 552,99								
61 428 399,56	3 415,64	0,00	7 793,61	4 390 184,63	4 299 870,04	8 742,69	0,00	33 309,73

* A SÁRGÁVAL JELÖLT HOZAM AZ ÁLLAMKÖTVÉNY ELADÁSÁBÓL SZÁRMAZÓ ALAP ÉS TÖBBLETHOZAM, VALAMINT A DKJ HOZAMA. (LÁSD RÉSZLETEZVE A 2.SZ. MELLÉKLETBEN)

** A PIROS SZÍNNEL JELÖLT ÖSSZEGEK A PRÉMIUM BETÉTEK (CHF, HUF) ALAP ÉS TÖBBLETHOZAM MEGOSZLÁSÁT JELÖLIK. (LÁSD RÉSZLETEZVE A 2. SZ. MELLÉKLETBEN)

Nyereségek össz:	70 118 454,22 HUF	70 118 454 HUF
	12 158,33 CHF	2 216 949 HUF
	0,00 USD	0 HUF
	41 103,34 EUR	11 132 428 HUF
Összesen:		83 467 832 HUF

Alaphozam össz:	61 428 399,56 HUF	61 428 400 HUF
	3 415,64 CHF	622 808 HUF *
	0,00 USD	0 HUF *
	7 793,61 EUR	2 110 821 HUF *
Összesen:		64 162 029 HUF

Többlethozam össz:	8 690 054,66 HUF	8 690 055 HUF
	8 742,69 CHF	1 594 141 HUF *
	0,00 USD	0 HUF *
	33 309,73 EUR	9 021 607 HUF *
Összesen:		19 305 803 HUF

Többlethozam 35%-a:	6 757 031 HUF
	6 757 031 HUF
A prémium nettó összege:	5 405 625 HUF
ÁFA (25%):	1 351 406 HUF
A prémium bruttó összege:	6 757 031 HUF

*2009.12.31-i MNB középárfolyamon átszámolva

MNB közép CHF/HUF 182,34

MNB közép USD/HUF

MNB közép EUR/HUF 270,84

Elszámolás kezdőnap	Elszámolás zárónap
2009.07.01	2009.12.31
183,00 nap összesen	

OPCIÓHOZ KÖTÖTT BETÉTEK AZ ELSZÁMOLÁSI IDŐSZAK ALATT, RAIFFEISEN BANK											
No.	Kezdet	Lejárat	Betét megnevezése	realizált kamat	Prémium	betéti kamat	HUF	EUR/CHF	Betéti kamat	Prémium kamat	Szumma
151.	2009.06.10	2009.07.10	EUR (288,25) prémium betét. Strike: 289	12,00%	11,08%	0,92%		150 600,00	113,88	1 371,49	1 485,37
152.	2009.06.17	2009.07.14	EUR (288,25) prémium betét. Strike: 289	13,25%	12,31%	0,94%		161 800,00	112,51	1 473,36	1 585,86
153.	2009.06.17	2009.07.09	CHF (189,5) prémium betét. Strike: 191	15,00%	14,88%	0,12%		166 000,00	12,01	1 488,82	1 500,82
154.	2009.06.18	2009.07.10	HUF prémium betét. Strike: 277,0	15,00%	5,31%	9,69%	92 930 000,00		542 762,12	297 426,92	840 189,04
155.	2009.06.19	2009.07.14	CHF (189,5) prémium betét. Strike: 189,75	15,00%	14,86%	0,14%		337 600,00	32,37	3 436,12	3 468,49
156.	2009.06.23	2009.07.15	EUR (289) prémium betét. Strike: 289	13,00%	12,10%	0,90%		219 600,00	119,13	1 601,58	1 720,70
157.	2009.06.24	2009.07.23	CHF (189,5) prémium betét. Strike: 190	14,00%	13,85%	0,15%		167 700,00	19,99	1 845,39	1 865,38
158.	2009.06.25	2009.07.10	EUR (289) prémium betét. Strike: 289	5,00%	4,15%	0,85%		220 100,00	76,88	375,38	452,26
164.	2009.07.10	2009.08.11	EUR (átlag 280,76) prémium betét. Strike: 281	13,75%	13,26%	0,49%		762 600,00	327,60	8 865,38	9 192,99
165.	2009.07.10	2009.08.11	EUR (átlag 280,76) prémium betét. Strike: 282	12,25%	11,76%	0,49%		500 000,00	214,79	5 155,07	5 369,86
167.	2009.08.03	2009.08.25	HUF prémium betét. Strike: 261,5	13,75%	5,13%	8,62%	110 000 000,00		571 517,81	340 126,03	911 643,84
168.	2009.08.03	2009.09.03	HUF prémium betét. Strike: 261	13,50%	4,87%	8,63%	110 310 000,00		808 526,97	456 260,29	1 264 787,26
169.	2009.08.11	2009.09.25	EUR (280,76) prémium betét. Strike: 282	7,00%	6,58%	0,42%		600 000,00	310,68	4 867,40	5 178,08

170.	2009.08.11	2009.09.18	EUR (280,76) prémium betét. Strike: 281	7,50%	7,09%	0,41%		677 100,00	289,02	4 997,93	5 286,95
171.	2009.08.25	2009.09.25	HUF prémium betét. Strike: 262,75	13,50%	5,40%	8,10%	110 910 000,00		763 000,03	508 666,68	1 271 666,71
172.	2009.09.03	2009.09.17	HUF prémium betét. Strike: 271,25	13,00%	4,88%	8,12%	111 570 000,00		352 313,27	211 735,07	564 048,33
173.	2009.09.10	2009.09.24	HUF prémium betét. Strike: 269	12,50%	4,39%	8,11%	77 380 000,00		240 704,80	130 295,20	371 000,00
174.	2009.09.10	2009.10.01	HUF prémium betét. Strike: 268,25	12,00%	3,89%	8,11%	77 380 000,00		361 057,20	173 182,80	534 240,00
175.	2009.09.17	2009.09.24	EUR (271,25) prémium betét. Strike: 273,25	7,75%	7,47%	0,28%		411 300,00	22,09	589,23	611,32
179.	2009.09.24	2009.10.27	EUR (271,25) prémium betét. Strike: 277	5,75%	5,40%	0,35%		411 900,00	130,34	2 010,97	2 141,32
181.	2009.09.25	2009.10.09	HUF prémium betét. Strike: 268,5	12,00%	3,89%	8,11%	90 500 000,00		281 516,99	135 030,96	416 547,95
182.	2009.09.25	2009.10.16	HUF prémium betét. Strike: 268,5	12,00%	3,89%	8,11%	100 000 000,00		466 602,74	223 808,22	690 410,96
183.	2009.10.01	2009.10.15	HUF prémium betét. Strike: 267,9	12,25%	4,65%	7,60%	77 910 000,00		227 112,99	138 957,29	366 070,27
184.	2009.10.09	2009.11.03	HUF prémium betét. Strike: 268,5	12,00%	4,40%	7,60%	90 920 000,00		473 282,19	274 005,48	747 287,67
185.	2009.10.16	2009.10.29	EUR (átl. 268,24) prémium betét. Strike: 271,5	5,00%	4,67%	0,33%		663 250,00	77,95	1 103,18	1 181,13
187.	2009.10.27	2009.11.10	EUR (271,25) prémium betét. Strike: 271,75	6,00%	5,66%	0,34%		414 000,00	53,99	898,78	952,77
191.	2009.11.05	2009.11.27	HUF prémium betét. Strike: 272,75	10,50%	3,39%	7,11%	100 520 000,00		430 776,39	205 391,28	636 167,67
193.	2009.11.06	2009.11.27	HUF prémium betét. Strike: 178,4	10,50%	3,40%	7,10%	69 020 000,00		281 941,97	135 014,47	416 956,44
194.	2009.11.10	2009.11.24	HUF prémium betét. Strike: 177,85	10,50%	3,40%	7,10%	112 500 000,00		306 369,86	146 712,33	453 082,19

195.	2009.11.16	2009.12.09	HUF prémium betét. Strike: 264,75	10,50%	3,40%	7,10%	181 740 000,00		813 099,78	389 371,73	1 202 471,51
196.	2009.11.24	2009.12.09	HUF prémium betét. Strike: 265,75	10,50%	3,95%	6,55%	92 470 000,00		248 908,97	150 105,41	399 014,38
197.	2009.11.24	2009.12.15	CHF (177,85) prémium betét. Strike: 181,5	5,50%	5,42%	0,08%		632 500,00	29,11	1 972,36	2 001,47
200.	2009.11.27	2009.12.18	HUF prémium betét. Strike: 269	10,50%	3,91%	6,59%	85 000 000,00		322 278,08	191 215,07	513 493,15
201.	2009.11.27	2009.12.18	HUF prémium betét. Strike: 178,20	10,50%	3,91%	6,59%	85 600 000,00		324 552,99	192 564,82	517 117,81
205.	2009.12.14	2010.01.15	HUF prémium betét. Strike: 176,75	10,50%	3,91%	6,59%	150 000 000,00		866 630,14	514 191,78	1 380 821,92
212.	2009.12.29	2010.01.13	HUF prémium betét. Strike: 268,5	10,50%	4,16%	6,34%	192 470 000,00		501 476,63	329 044,60	830 521,23

Ezekkel a tételekkel az előző elszámolásban nem számoltunk, mivel 2009.07.01-ig nem realizálódott a nyereségük.

A 172. tételnél a bank tévedésből 360-as bázison számolta a kamatot (365 helyett). A többlet kamatot bank utólag nem korrigálta.

Ezekkel a tételekkel a lejáratuk dátuma miatt a következő elszámolásban számolunk csak.

ÁLLAMKÖTVÉNYEK ELSZÁMOLÁSA A TÁRGYIDŐSZAK ALATT RAIFFEISEN BANK (2009.07.01 - 2009.12.31)										
No.	Kezdet	Lejárat	Betét megnevezése	Betéti kamat	Prémium	Össz.	VÉTELI/ELADÁSI ÁR HUF	Betéti kamat (ALAPHOZAM)	ELADÁSI ÁR ÉS VÉTELI ÁR KÜLÖNBÖZETE	TÖBBLET
80.	2008.10.07	2009.07.10	2011/C MÁK állampapír vásárlás. Névérték: 124.740.000	9,92%			120 004 620,00			
129.	2009.04.22		80. 2011/C MÁK kupon fizetés. NÉ: 124.740.000 Ft	6,75%			8 419 950,00	9 001 727,38	9 707 516,00	705 788,62

161.	2009.07.10	80. 2011/C MÁK állampapír eladás. Névérték: 124.740.000 Ft. Bruttó árf: 97,2360% (04.22- én fizetett kupon)				121 292 186,00			
95.	2008.11.05 2009.08.03	D090923 Diszkontkincstárjegy vétel. NÉ: 222.980.000 Ft Nettó árf.: 89,6912%	12,85%			199 993 438,00			
166.	2009.08.03	95. D090923 Diszkontkincstárjegy eladás. NÉ: 222.980.000 Ft Bttó árf.: 98,8032% Köztes Hozam: 13,5%, vételi hozam: 8,55%				220 311 375,00	19 080 743,80	20 317 937,00	1 237 193,20
ÖSSZESEN							28 082 471,18	30 025 453,00	1 942 981,82

A 80. sorszámú 2011/C MÁK kuponfizetésével az előző elszámolásban nem számoltunk. Ha a szumma HUF nyereségből kivonjuk a kuponfizetés összegét, akkor megkapjuk a szumma HUF nyereségek összegét (61.698.504 HUF). Bár a 2009. év 2. negyedévének tájékoztatóban már jelöltük a nyereségeknél az akkor realizálódott kuponfizetés összegét, az első félévi elszámolásban nem számolhattunk vele, hiszen az államkötvény még nem került értékesítésre.

70 118 454,22

-8 419 950,00

61 698 504,22