

VIG FEJLETT PIACI ÁLLAMKÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

2022. ÉVES JELENTÉSE

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény (a továbbiakban: Kbfv.) 131. § és 132. § alapján készítette az Alap 2022.évi működésének bemutatása céljából.

Az Alap általános működésével kapcsolatos további adatokat az Alap befektetési jegyeinek nyilvános forgalomba hozatalához készült MNB által jóváhagyott tájékoztató tartalmazza, mely megtalálható az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelőnél, az Alap befektetési jegyeinek forgalmazási helyein, valamint az Alapkezelő honlapján (www.aegonalapkezelo.hu).

Budapest, 2023.április 26.

Kadocsa Péter

elnök-vezérigazgató

Kocsis Bálint

adminisztrációs vezérigazgató-
helyettes

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

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL**Az Alap elnevezése**

VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap

Az Alap rövid neve

VIG Fejlett Piaci Államkötvény Alap

Az Alap lajstromszáma

1111-80

Az Alap fajtája

nyíltvégű

Az Alap típusa

nyilvános

A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa

Sorozat	Deviza	ISIN kód	Sorozat	Deviza	ISIN kód
A	HUF	HU0000702477			
I	HUF	HU0000724224			

Hozamfizetés

Az Alapok a tőkenövekmény terhére hozamot nem fizetnek, a teljes tőkenövekmény újra befektetésre kerül az Alapok befektetési politikájának megfelelően. A Befektetők a tőkenövekményt a tulajdonukban álló Befektetési jegyek vételi és visszavásárlási árának különbözeteként, mint árfolyamnyereséget realizálhatják.

A Befektetők köre

A Befektetési jegyeket egyaránt megvásárolhatják devizabelföldi és devizakülföldi természetes személyek, jogi személyek és jogi személyiség nélküli gazdasági társaságok.

Alapkezelő adatai AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt.
1091 Budapest, Üllői út 1.
Telefon: (06-1) 476-20-59

Letétkezelő adatai Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe
1051 Budapest, Szabadság tér 7.

A megbízott könyvvizsgáló társaság adatai: PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft.
1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.
Céggjegyzékszám: 01 09 063022
Nyilvántartásba vételi szám: 001464

A könyvvizsgáló munkatársának adatai: Barsi Éva
Kamarai tagsági szám: 002945

I. Vagyonkimutatás

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

Megnevezés	2021.12.31.		2022.12.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	591 525 150	18,23	83 921 060	3,39
Repo				
Átruházható értékpapírok	2 663 398 249	82,09	2 393 895 082	96,69
Származékos ügyletek		0,00		0,00
Egyéb eszközök	22 901	0,00	7 698 617	0,31
Összes eszköz	3 254 946 300	100,33	2 485 514 759	100,40
Kötelezettségek	-10 630 642	-0,33	-9 780 092	-0,40
Nettó eszközérték	3 244 315 658	100,00	2 475 734 667	100,00

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

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy				2021.12.31.	2022.12.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000702477	1 420 753 162	1 038 207 198
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000724224	4 029 588	182 133 396

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

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy				2021.12.31.	2022.12.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000702477	2.28057	2.207523
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000724224	1.039466	1.009526

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

IV. A befektetési alap összetétele

Megnevezés	2021.12.31.		2022.12.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen				
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	29 613 540	1,11	366 054 306	15,29
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	892 974 676	33,53	740 199 583	30,92
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	1 740 810 033	65,36	1 287 641 193	53,79
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	2 663 398 249	100,00	2 393 895 082	100,00
Értékpapírok összesen	2 663 398 249	100,00	2 393 895 082	100,00

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

V. Befektetési alap eszközeinek alakulása**Befektetésből származó jövedelem:**

Pénzügyi műveletek bevételei	2022
Pénzintézettől kapott kamatok	6 600
Diskont értékpapírok árfolyamnyeresége	10 423
Kamatozó értékpapírok árfolyamnyeresége	179 524
Deviza beértékeléssel kapcsolatos nyereség	80 541
Államkötvények árában felhalmozott kamat	-1 581
Származékos ügyletek nyeresége	126 148
Államkötvények kapott kamata	42 412
Összesen:	444 067

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

Pénzügyi műveletek ráfordításai	2022
Nemzetközi értékpapír árfolyamvesztesége	63 912
Származékos Ügyletek vesztesége	87 280
Fizetendő kamatok	418
Opció díjak	1 081
Összesen:	152 691

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alap 2022-ben **Egyéb bevételként 148 eFt** büntető jutalékot kapott, illetve **1 eFt** kerekítést számolt el. **Egyéb ráfordításként** a befektetési alap különadója merült fel, **1 440 eFt** értékben, továbbá **1 eFt** értékben kerekítést, **39 eFt** értékben értékpapírral kapcsolatos adórátfordítást fizetett.

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

Működési költségek	2022
Alapkezelői díj	15 695
Letétkezelői díj	1 099
Könyvvizsgálói díj	584
Felügyeleti díj	1 008
Bankköltség	246
Forgalmazói díjak	20 060
Vezető forgalmazói díjak	1 440
Összesen:	40 132

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

Tőkenövekmény:	
visszavásárolt befjegyek értékülönözötéből	-509 063
értékpapírok értékelési különbözötéből	-19 843
előző évek eredményből	1 534 945
üzleti év eredményéből	249 913
Összesen:	1 255 952

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Felosztott és újrabefektetett jövedelemmel az alap nem rendelkezett 2022-ban.

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

Alap neve Fund	Sorozat Serie	Deviza Currency	ISIN	Nettó eszközérték Net Asset Value	1 jegyre jutó eszközérték Unit price	Értéknap Value date
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000702477	2 729 759 499	2,064301	2019.12.31.
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000702477	4 335 469 753	2,230218	2020.12.31.
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000702477	3 240 127 039	2,280570	2021.12.31.
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000702477	2 291 866 268	2,207523	2022.12.30.
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000724224	4 188 620	1,039466	2021.12.31.
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000724224	183 868 399	1,009526	2022.12.30.

VII. Származtatott ügyletek

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
US 10YR NOTE (CBT) Mar22 Eladás	2022.03.22.	13	130,250	127,9688	9 503 642	HUF	2022.01.31.
LONG GILT FUTURE Mar22 Eladás	2022.03.29.	1	126,250	121,9600	1 848 389	HUF	2022.01.31.
US 5YR NOTE (CBT) Mar22 Vétel	2022.03.31.	1	121,234	119,2031	-650 934	HUF	2022.01.31.
US LONG BOND (CBT) Mar22 Eladás	2022.03.22.	1	160,758	155,6250	1 644 861	HUF	2022.01.31.
EURO-BUXL 30Y BND Mar22 Eladás	2022.03.08.	1	217,580	203,3000	5 113 811	HUF	2022.01.31.
Euro-BTP Future Mar22 Vétel	2022.03.08.	1	150,240	145,8800	-1 561 360	HUF	2022.01.31.
Euro-OAT Future Mar22 Vétel	2022.03.08.	1	166,290	161,0100	-1 890 821	HUF	2022.01.31.
EURO-BUND FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.08.	4	174,510	169,1100	-7 735 176	HUF	2022.01.31.
US 2YR NOTE (CBT) Mar22 Eladás	2022.03.31.	2	108,250	108,3281	-100 112	HUF	2022.01.31.
Összesen						HUF	2022.01.31.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	164,100	164,1100	3 698	HUF	2022.02.28.
LONG GILT FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.28.	1	123,110	123,0800	-13 274	HUF	2022.02.28.
US LONG BOND (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.21.	1	155,508	156,6875	-390 241	HUF	2022.02.28.
US 5YR NOTE (CBT) Jun22 Vétel	2022.06.30.	1	117,844	118,2813	144 725	HUF	2022.02.28.
US 10YR NOTE (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.21.	13	126,766	127,4375	-2 889 331	HUF	2022.02.28.
EURO-BUXL 30Y BND Mar22 Eladás	2022.03.08.	1	217,580	197,7800	7 322 040	HUF	2022.02.28.
Euro-BTP Future Mar22 Vétel	2022.03.08.	1	150,240	141,1500	-3 361 482	HUF	2022.02.28.
Euro-OAT Future Mar22 Vétel	2022.03.08.	1	166,290	158,2800	-2 962 098	HUF	2022.02.28.
EURO-BUND FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.08.	4	174,510	167,0400	-11 049 624	HUF	2022.02.28.
US 2YR NOTE (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.30.	2	107,441	107,6133	-227 425	HUF	2022.02.28.
EURO-SCHATZ FUT Jun22 Eladás	2022.06.08.	2	111,620	111,6300	-7 396	HUF	2022.02.28.
Összesen						HUF	2022.02.28.
EURO-BUXL 30Y BND Jun22 Eladás	2022.06.08.	1	206,460	186,2000	7 488 501	HUF	2022.03.31.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	4	167,120	158,6600	-12 507 941	HUF	2022.03.31.
US 10YR NOTE (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.21.	13	126,766	122,8750	16 796 490	HUF	2022.03.31.
US 2YR NOTE (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.30.	2	107,441	105,9609	1 966 594	HUF	2022.03.31.
US 5YR NOTE (CBT) Jun22 Vétel	2022.06.30.	1	117,844	114,6875	-1 048 159	HUF	2022.03.31.
US LONG BOND (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.21.	1	155,508	150,0625	1 808 334	HUF	2022.03.31.
LONG GILT FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.28.	1	123,110	121,2300	-819 248	HUF	2022.03.31.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	164,100	158,6600	-2 010 733	HUF	2022.03.31.
EURO-SCHATZ FUT Jun22 Eladás	2022.06.08.	2	111,620	110,7350	654 227	HUF	2022.03.31.
Euro-BTP Future Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	143,850	138,3100	-2 047 695	HUF	2022.03.31.
Euro-OAT Future Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	158,550	151,5100	-2 602 125	HUF	2022.03.31.
Összesen						HUF	2022.03.31.
US 10YR NOTE (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.21.	13	126,766	119,1563	35 293 347	HUF	2022.04.29.
US 2YR NOTE (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.30.	2	107,441	105,4063	2 904 412	HUF	2022.04.29.
US 5YR NOTE (CBT) Jun22 Vétel	2022.06.30.	1	117,844	112,6719	-1 845 222	HUF	2022.04.29.
US LONG BOND (CBT) Jun22 Eladás	2022.06.21.	1	155,508	140,6875	5 287 591	HUF	2022.04.29.
LONG GILT FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.28.	1	123,110	118,4400	-2 091 553	HUF	2022.04.29.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	164,100	153,5900	-3 963 531	HUF	2022.04.29.
EURO-SCHATZ FUT Jun22 Eladás	2022.06.08.	2	111,620	110,1450	1 112 504	HUF	2022.04.29.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	4	167,120	153,5900	-20 409 734	HUF	2022.04.29.
EURO-BUXL 30Y BND Jun22 Eladás	2022.06.08.	1	206,460	170,9800	13 380 218	HUF	2022.04.29.
Euro-BTP Future Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	143,850	130,3400	-5 094 891	HUF	2022.04.29.
Euro-OAT Future Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	158,550	145,8400	-4 793 195	HUF	2022.04.29.
Összesen						HUF	2022.04.29.
LONG GILT FUTURE Sep22 Vétel	2022.09.28.	1	118,160	115,9700	-1 014 605	HUF	2022.05.31.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	164,100	151,5700	-4 937 447	HUF	2022.05.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EURO-SCHATZ FUT Jun22 Eladás	2022.06.08.	2	111,620	110,1200	1 182 150	HUF	2022.05.31.
EURO-BUND FUTURE Jun22 Vétel	2022.06.08.	4	167,120	151,5700	-24 509 910	HUF	2022.05.31.
EURO-BUXL 30Y BND Jun22 Eladás	2022.06.08.	1	206,460	162,2000	17 440 653	HUF	2022.05.31.
Euro-BTP Future Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	143,850	126,8700	-6 690 969	HUF	2022.05.31.
Euro-OAT Future Jun22 Vétel	2022.06.08.	1	158,550	144,0900	-5 697 963	HUF	2022.05.31.
US LONG BOND(CBT) Sep22 Eladás	2022.09.21.	1	141,289	139,4375	680 097	HUF	2022.05.31.
US 5YR NOTE (CBT) Sep22 Vétel	2022.09.30.	1	113,469	112,9531	-189 394	HUF	2022.05.31.
US 2YR NOTE (CBT) Sep22 Eladás	2022.09.30.	2	105,711	105,5508	235 308	HUF	2022.05.31.
US 10YR NOTE (CBT) Sep22 Eladás	2022.09.21.	4	120,391	119,4531	1 377 413	HUF	2022.05.31.
Összesen						HUF	2022.05.31.
Euro-OAT Future Sep22 Vétel	2022.09.08.	1	140,250	138,5300	-682 410	HUF	2022.06.30.
EURO-SCHATZ FUT Sep22 Eladás	2022.09.08.	2	109,135	109,1450	-7 935	HUF	2022.06.30.
EURO-BUND FUTURE Sep22 Vétel	2022.09.08.	4	150,110	148,7800	-2 110 710	HUF	2022.06.30.
LONG GILT FUTURE Sep22 Vétel	2022.09.28.	1	118,160	113,9800	-1 928 736	HUF	2022.06.30.
US LONG BOND(CBT) Sep22 Eladás	2022.09.21.	1	141,289	138,6250	1 012 317	HUF	2022.06.30.
US 5YR NOTE (CBT) Sep22 Vétel	2022.09.30.	1	113,469	112,2500	-463 113	HUF	2022.06.30.
US 2YR NOTE (CBT) Sep22 Eladás	2022.09.30.	2	105,711	105,0078	1 068 720	HUF	2022.06.30.
US 10YR NOTE (CBT) Sep22 Eladás	2022.09.21.	4	120,391	118,5313	2 826 176	HUF	2022.06.30.
EURO-BUXL 30Y BND Sep22 Eladás	2022.09.08.	1	169,580	163,5600	2 388 435	HUF	2022.06.30.
Euro-BTP Future Sep22 Vétel	2022.09.08.	2	122,530	123,1200	468 165	HUF	2022.06.30.
Short Euro-BTP Fu Sep22 Eladás	2022.09.08.	2	108,400	108,8900	-388 815	HUF	2022.06.30.
US 5YR NOTE (CBT) Sep22 Vétel	2022.09.30.	1	112,391	112,2500	-53 436	HUF	2022.06.30.
Összesen						HUF	2022.06.30.
LONG GILT FUTURE Sep22 Vétel	2022.09.28.	1	118,160	118,1800	9 625	HUF	2022.07.29.
US LONG BOND(CBT) Sep22 Eladás	2022.09.21.	1	141,289	144,0000	-1 071 959	HUF	2022.07.29.
US 5YR NOTE (CBT) Sep22 Vétel	2022.09.30.	1	113,469	113,7266	101 944	HUF	2022.07.29.
US 2YR NOTE (CBT) Sep22 Eladás	2022.09.30.	2	105,711	105,2305	759 947	HUF	2022.07.29.
US 10YR NOTE (CBT) Sep22 Eladás	2022.09.21.	4	120,391	121,1406	-1 186 260	HUF	2022.07.29.
EURO-BUND FUTURE Sep22 Vétel	2022.09.08.	4	150,110	157,6400	12 174 504	HUF	2022.07.29.
EURO-SCHATZ FUT Sep22 Eladás	2022.09.08.	2	109,135	110,1350	-808 400	HUF	2022.07.29.
EURO-BUXL 30Y BND Sep22 Eladás	2022.09.08.	1	169,580	185,8000	-6 556 124	HUF	2022.07.29.
Euro-BTP Future Sep22 Vétel	2022.09.08.	2	122,530	126,3300	3 071 920	HUF	2022.07.29.
Short Euro-BTP Fu Sep22 Eladás	2022.09.08.	2	108,400	109,3300	-751 812	HUF	2022.07.29.
US 5YR NOTE (CBT) Sep22 Vétel	2022.09.30.	1	112,391	113,7266	528 257	HUF	2022.07.29.
Euro-OAT Future Sep22 Vétel	2022.09.08.	1	140,250	146,4700	2 514 124	HUF	2022.07.29.
Összesen						HUF	2022.07.29.
LONG GILT FUTURE Dec22 Vétel	2022.12.28.	1	109,800	107,9300	-883 631	HUF	2022.08.31.
EURO-BUND FUTURE Sep22 Vétel	2022.09.08.	4	150,110	147,9700	-3 467 742	HUF	2022.08.31.
EURO-SCHATZ FUT Sep22 Eladás	2022.09.08.	2	109,135	108,6100	425 366	HUF	2022.08.31.
EURO-BUXL 30Y BND Sep22 Eladás	2022.09.08.	1	169,580	164,6000	2 017 448	HUF	2022.08.31.
Euro-BTP Future Sep22 Vétel	2022.09.08.	2	122,530	119,5100	-2 446 864	HUF	2022.08.31.
Short Euro-BTP Fu Sep22 Eladás	2022.09.08.	2	108,400	107,9200	388 906	HUF	2022.08.31.
Euro-OAT Future Sep22 Vétel	2022.09.08.	1	140,250	138,0200	-903 395	HUF	2022.08.31.
US LONG BOND(CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	1	136,711	135,8438	351 974	HUF	2022.08.31.
US 5YR NOTE (CBT) Dec22 Vétel	2022.12.30.	2	111,102	110,8203	-228 308	HUF	2022.08.31.
US 2YR NOTE (CBT) Dec22 Eladás	2022.12.30.	2	104,250	104,1641	139 520	HUF	2022.08.31.
US 10YR NOTE (CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	4	117,461	116,9063	900 547	HUF	2022.08.31.
Összesen						HUF	2022.08.31.
US LONG BOND(CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	1	136,711	126,4063	4 416 280	HUF	2022.09.30.
US 5YR NOTE (CBT) Dec22 Vétel	2022.12.30.	2	111,102	107,5078	-3 080 347	HUF	2022.09.30.
US 2YR NOTE (CBT) Dec22 Eladás	2022.12.30.	1	104,250	102,6953	1 332 584	HUF	2022.09.30.
US 10YR NOTE (CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	1	117,461	112,0625	2 313 609	HUF	2022.09.30.
EURO-BUND FUTURE Dec22 Vétel	2022.12.08.	2	144,580	138,4900	-5 132 774	HUF	2022.09.30.
EURO-SCHATZ FUT Dec22 Eladás	2022.12.08.	1	108,280	107,1650	469 872	HUF	2022.09.30.
Euro-BTP Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	117,090	111,9800	-2 153 405	HUF	2022.09.30.
Euro-OAT Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	138,200	132,1200	-2 562 173	HUF	2022.09.30.
LONG GILT FUTURE Dec22 Eladás	2022.12.28.	1	105,480	96,4000	4 365 028	HUF	2022.09.30.
US LONG BOND(CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	4	132,625	126,4063	10 660 679	HUF	2022.09.30.
Összesen						HUF	2022.09.30.
US LONG BOND(CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	1	136,711	121,2500	6 407 940	HUF	2022.10.28.
US 5YR NOTE (CBT) Dec22 Vétel	2022.12.30.	2	111,102	106,8750	-3 503 483	HUF	2022.10.28.
US 2YR NOTE (CBT) Dec22 Eladás	2022.12.30.	1	104,250	102,3398	1 583 367	HUF	2022.10.28.
US 10YR NOTE (CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	1	117,461	111,0000	2 677 800	HUF	2022.10.28.
EURO-BUND FUTURE Dec22 Vétel	2022.12.08.	2	144,580	139,3300	-4 326 105	HUF	2022.10.28.
EURO-SCHATZ FUT Dec22 Eladás	2022.12.08.	1	108,280	107,0300	515 013	HUF	2022.10.28.
Euro-BTP Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	117,090	116,2900	-329 608	HUF	2022.10.28.
Euro-OAT Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	138,200	134,0900	-1 693 361	HUF	2022.10.28.
LONG GILT FUTURE Dec22 Eladás	2022.12.28.	1	105,480	103,3100	1 036 804	HUF	2022.10.28.
US LONG BOND(CBT) Dec22 Eladás	2022.12.20.	4	132,625	121,2500	18 857 930	HUF	2022.10.28.
Összesen						HUF	2022.10.28.
US LONG BOND(CBT) Mar23 Eladás	2023.03.22.	7	127,836	127,0000	2 302 825	HUF	2022.11.30.
US 5YR NOTE (CBT) Mar23 Vétel	2023.03.31.	5	108,359	108,5703	415 063	HUF	2022.11.30.
US 10YR NOTE (CBT) Mar23 Eladás	2023.03.22.	1	113,500	113,5000		HUF	2022.11.30.
EURO-BUND FUTURE Dec22 Vétel	2022.12.08.	2	144,580	140,8800	-3 016 758	HUF	2022.11.30.
EURO-SCHATZ FUT Dec22 Eladás	2022.12.08.	1	108,280	106,7800	611 505	HUF	2022.11.30.
Euro-BTP Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	117,090	119,3000	900 951	HUF	2022.11.30.
Euro-OAT Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	138,200	136,5500	-672 655	HUF	2022.11.30.
EURO-BUND FUTURE Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	137,010	140,8800	1 577 683	HUF	2022.11.30.
EURO-SCHATZ FUT Dec22 Eladás	2022.12.08.	2	106,650	106,7800	-105 994	HUF	2022.11.30.
Euro-BTP Future Dec22 Vétel	2022.12.08.	1	117,580	119,3000	701 192	HUF	2022.11.30.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
LONG GILT FUTURE Mar23 Vétel	2022.12.28.	1	105,430	104,9900	-208 067	HUF	2022.11.30.
Összesen						HUF	2022.11.30.
LONG GILT FUTURE Mar23 Vétel	2022.12.28.	1	105,430	99,9000	-2 499 449	HUF	2022.12.30.
US LONG BOND(CBT) Mar23 Eladás	2023.03.22.	7	127,836	125,3438	6 553 856	HUF	2022.12.30.
US 5YR NOTE (CBT) Mar23 Vétel	2023.03.31.	5	108,359	107,9297	-807 124	HUF	2022.12.30.
US 10YR NOTE (CBT)Mar23 Eladás	2023.03.22.	1	113,500	112,2969	451 990	HUF	2022.12.30.
EURO-BUND FUTURE Mar23 Vétel	2023.03.08.	3	141,500	132,9300	-10 290 427	HUF	2022.12.30.
EURO-SCHATZ FUT Mar23 Eladás	2023.03.08.	3	106,620	105,4200	1 440 900	HUF	2022.12.30.
Euro-BTP Future Mar23 Vétel	2023.03.08.	2	117,470	108,9200	-6 844 275	HUF	2022.12.30.
Euro-OAT Future Mar23 Vétel	2023.03.08.	1	136,600	127,3000	-3 722 325	HUF	2022.12.30.
Összesen						HUF	2022.12.30.

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

A Vienna Insurance Group (VIG) megvásárolta a holland Aegon magyarországi üzletágát, miután megkapta a magyar hatóságok jóváhagyását. A zárás két holland holding eladására vonatkozott (Aegon Hungary Holding B.V., Aegon Hungary Holding II B.V.), amelyek a magyar Aegon társaságok részvényeinek 100%-os tulajdonosai voltak. 2022. március 25-én VIG-csoport magyarországi üzletágában a Corvinus magyar állami holding 45 százalékos tulajdoni részesedést szerzett.

2022. március 23. napjával Jane Philippa Louise Daniel, Hindrik Eggens, Olaf Adriaan Wilhelmus Johannes van den Heuvel felügyelő bizottsági tagok tisztsége megszűnt, ezzel egyidejűleg kijelölésre került Gerhard Lahner, Lehel Gábor és Gerald Weber. A Felügyelet vonatkozó engedélye alapján 2022. március 25. napjával Dr. Andreas Grünbichler, 2022. március 29. napjával pedig Dr. Berta Adrienn és Mikešy Álmos a felügyelő bizottság tagjai. Az Igazgatóság 2022. március 29. napjától új taggal bővült Kovács Zsolt személyében, míg Réti Gábor igazgatósági tagsága 2022. szeptember 13. napjával megszűnt.

2022. januárjában az Alap hivatalos dokumentumaiban beépítésre kerültek az ESMA sikerdíj számítás módszertan irányelvnek való megfeleltetés. A fenti változás nem érintette az alap befektetési politikáját.

2022. október 12-én megváltozott az Alap neve, referenciaindex, az egyes portfólióelemek maximális, illetve minimális aránya. A hatálybalépést követően az Alap új neve: VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap.

Az Alap új referenciaindex: 80% Bloomberg Global Treasury Majors ex Japan Total Return Index Unhedged USD (Bloomberg ticker: I29012US Index)+20% ZMAX Index.

Az Alap befektetési politikájával összhangban, a portfólióba külföldi, elsősorban OECD országban kibocsátott, nyilvánosan forgalomba hozott kötvények kerültek. Az Alap a közvetlen kötvénybefektetések mellett tőzsdai határidős ügyleteken keresztül is felvett pozíciót. Az Alap összetételében történt változásokat a különböző piaci lehetőségek kiaknázásának célja, valamint a folyamatos tőkemozgások indokolták. Az alap a devizaárfolyam-kockázatot nem fedezte. Az Alap hozamára a fejlett piaci hozamemelkedés negatív, a forint gyengülése pedig pozitív hatással bírt.

IX. A befektetési alapkezelő által kifizetett javadalmazás

	Javadalmazás teljes összege	A teljes javadalmazásból az ABA kockázati profiljára lényeges hatást gyakorló személyek (ideértve ügyvezetők) javadalmazása
Létszámadatok (fő)	57	7
Rögzített	651 041 876	198 517 450
Változó	264 588 069	164 558 553
Nyereségrészesedés	0	0

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

a) az ABA olyan eszközeinek aránya, amelyekre nem likvid jellegüknél fogva különleges szabályok vonatkoznak;

Az Alap a tárgyidőszakban nem tartott az Alapkezelő Likviditási politikájában definiált nem likvid eszközt.

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

Az Alapkezelő a tárgyidőszakban nem kötött új megállapodást az Alap likviditáskezelésével kapcsolatban.

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

Az Alap alapdevizában denominált „A” sorozata az alábbi befektetői profillal rendelkezik:

Alap neve	Alap alapdevizája	javasolt minimális befektetési időtáv (A sorozat)	kockázati besorolás (A sorozat)
VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap	HUF	3 év	3 (közepes)

Az Alapot elsősorban olyan Befektetőknek szánjuk, akik legalább a javasolt minimális befektetési időre terveznek befektetni, és a kockázat/nyereség profil 1-től 7-ig terjedő skáláján a megjelölt értéket a kockázatviselési hajlandóságukhoz mérten elfogadhatónak tartják.

Az Alap célja, hogy olyan, kimondottan defenzív befektetési portfóliót hozzon létre Befektetői számára, amely jellemzően fejlett piaci államkötvényekbe és azokhoz kapcsolódó tőzsdei származékos ügyletekbe

fektet. Az Alapkezelő szándékai szerint az Alap portfóliójában külföldi államok, valamint devizakülföldi társaságok nyilvános forgalomba hozatal során kibocsátott kötvényei alkotják a döntő részt. Az Alap a külföldi értékpapírok között csakis a nyilvánosan forgalomba hozott és külföldi tőzsdén jegyzett papírokat vásárolja. A nem befektetési kategóriájú papírok tervezett arányát alacsonyan tartja. Az Alapban adott pillanatban tartható kötvények aránya elérheti a mindenkor törvényes maximumot. A likviditás biztosításának érdekében az Alap magyar állampapírokat (elsősorban diszkont kincstárjegyeket) és MNB kötvényeket vásárolhat. Az Alapkezelőnek saját döntése alapján lehetősége van a devizakockázatok egészét vagy egy részét határidős devizapozíciókkal fedezni a törvényi feltételek betartása mellett.

Az Alapkezelő a kockázatkezelési feladatok ellátására külön szervezeti részleget hoz létre, melynek működéséért a kockázatkezelési vezető felelős. A kockázatkezelési egység célja, hogy olyan kockázatkezelési gyakorlatot alakítson ki, amely alkalmas az Alap kockázatainak azonosítására, mérésére, folyamatos nyomon követésére és kezelésére. Az alkalmazott eljárások és szabályok biztosítják, hogy a befektetők tudomására hozott kockázati profil összhangban legyen az Alap kezelési szabályzatában meghatározott kockázati korlátokkal.

A kockázatkezelési egység a kockázatkezelési folyamat részeként limitrendszert működtet, melyben külön alrendszerekben figyeli az egyes tranzakciók megkötésére, az egyes partnerek felé irányuló kitettségre vonatkozó törvényi, szerződéses és belső limiteket, valamint azon befektetési korlátokat, melyeket az Alapkezelő az Alap kezelési szabályzatában felállított és befektetői irányába kommunikált.

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

XI. Tőkeáttétel alkalmazása

Az Alap tőkeáttételt csak a törvényben megengedett korlátokon belül vehet fel: A befektetési alap teljes nettósított kockázati kitettsége nem haladhatja meg a befektetési alap nettó eszközértékének a kétszeresét, azaz az Alap felvehető tőkeáttétel maximális értéke 2. Az Alap befektetési politikája további korlátozásokat nem tartalmaz.

Az Alap a tárgyidőszakban kizárólag a hatékony portfólió kialakítás céljából kötött származékos ügyleteket. Az Alap teljes nettósított kockázati kitettsége 2022.12.31-én a következő: 1,36.

XII. Eredménykimutatás**VIG Fejlett Piaci Államkötvény Befektetési Alap**

	Előző év	Tárgyév
	eFT	eFT
I. Pénzügyi műveletek bevételei	266 724	444 067
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	90 880	152 691
III. Egyéb bevételek	61	149
IV. Működési költségek	51 571	40 132
V. Egyéb ráfordítások	1 948	1 480
VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.-VI.)	122 386	249 913

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.