

VIG MARATON ESG MULTI ASSET BEFEKTETÉSI ALAP

VIG Maraton Total Return Befektetési Alap

2022. ÉVES JELENTÉSE

A jelen tájékoztatót az AEGON Magyarország Befektetési Alapkezelő Zrt., mint az VIG Maraton ESG Multi Asset 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: Kbtv.) 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 Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap

Az Alap rövid neve

VIG Maraton Alap

Az Alap lajstromszáma

1111-616

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	HU0000714886	P	PLN	HU0000714910
I	HUF	HU0000714928	R	HUF	HU0000714936
E	EUR	HU0000714894	U	USD	HU0000714902
C	CZK	HU0000716055	EI	EUR	HU0000729579
UI	USD	HU0000729587			

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 Raiffeisen Bank Zrt.
1054 Budapest, Akadémia u. 6.

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

A könyvvizsgáló munkatársának adatai: Könczöl Enikő
Kamarai tagsági szám: 007367

I. Vagyonkimutatás

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

Megnevezés	2021.12.31.		2022.12.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	7 591 504 118	35,69	639 905 103	3,91
Repo				
Átruházható értékpapírok	13 980 824 031	65,72	15 613 748 645	95,49
Származékos ügyletek	69 228 212	0,33	58 774 021	0,36
Egyéb eszközök	12 841 513	0,06	94 049 737	0,58
Összes eszköz	21 654 397 874	101,79	16 406 477 506	100,34
Kötelezettségek	-381 428 707	-1,79	-55 936 873	-0,34
Nettó eszközérték	21 272 969 167	100,00	16 350 540 633	100,00

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

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

Befektetési jegy	sorozat	deviza	ISIN	2021.12.31.	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714886	2 381 406 208	1 753 137 823
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714928	8 368 057 301	8 047 995 869
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714894	4 022 907	3 594 350
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714910	28 815 767	23 247 360
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714936	1 776 746 907	1 343 785 340
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	U	USD	HU0000714902	3 501 365	2 904 462
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716055		
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	F	EUR	HU0000729579		13 347
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	V	USD	HU0000729587		15 419

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

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

Befektetési jegy	sorozat	deviza	ISIN	2021.12.31.	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714886	1.189616	1.021995
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714928	1.242101	1.079938
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714894	1.121399	0.901253
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714910	1.190748	1.007538
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714936	1.243452	1.082744
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	U	USD	HU0000714902	1.242335	1.013264
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716055	1.070491	1.070491
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	F	EUR	HU0000729579		1.001758
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	V	USD	HU0000729587		1.011898

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 (%)
Részvény - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	161 650 800	1,16	331 608 000	2,12
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	1 045 281 250	7,48	833 601 830	5,34
Részvény - GMU	705 729 872	5,05	817 187 812	5,23
Részvény - Egyéb külföld	193 468 396	1,38	12 294 745	0,08
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 255 065 871	8,98		
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 539 251 294	11,01	1 537 996 953	9,85
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	4 900 447 483	35,05	3 532 689 340	22,63
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 836 998 473	13,14	1 495 412 309	9,58
Egyéb átruházható értékpapírok	1 836 998 473	13,14	1 495 412 309	9,58
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	2 031 955 255	14,53	6 788 613 974	43,48
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	1 141 552 148	8,17	1 951 910 615	12,50
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	1 485 748 138	10,63	1 557 267 509	9,97
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	2 584 122 534	18,48	287 854 896	1,84
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	7 243 378 075	51,81	10 585 646 994	67,80
Értékpapírok összesen	13 980 824 031	100,00	15 613 748 643	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	33 139
Diszkont kincstárjegyek árnyeresége	21 947
Részvények osztaléka	130 820
Részvények árfolyamnyeresége	1 510 996
Kamatozó kötvények árfolyamnyeresége	184 370
Kamatozó papírok felhalmozott kamata	-74 852
Devizaeszközök árfolyamnyeresége	300 145
Értékpapírok kapott kamata	320 293
Származékos ügyletek árfolyamnyeresége	1 612 913
Összesen:	4 039 771

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

Pénzügyi műveletek ráfordításai	2022
Kamatozó kötvények árfolyamvesztesége	470 908
Részvények árfolyamvesztesége	1 152 740
Származékos ügyletek árfolyamvesztesége	2 382 838
Fizetendő kamatok	6 114
Opció díjak	3 416
Összesen:	4 016 016

Az Alap 2022. évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alap 2022-ben **87eFt** értékben értékpapírral kapcsolatos bevételt számolt el. **Egyéb ráfordításként** a befektetési alap különadója merült fel, **8 943eFt** értékben.

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

Működési költségek	2022
Letétkezelői díj	5 830
Főforgalmazói jutalék	8 973
Felügyeleti díj	6 284
Forgalmazói díjak	71 100
Megbízási díjak	20 135
Alapkezelői díjak	141 028
Keler díjak	796
Sikerdíj	6
Ügynöki jutalékok	6 140
Bankköltség	416
Tranzakciós díjak	422
Könyvvizsgálói díj	3 446
Összesen:	264 576

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

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

Tőkenövekmény:	
Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	1 160 778
Értékpapírok értékelési különbözetéből	-903 355
Előző évek eredményből	2 026 409
Üzleti év eredményéből	-249 677
Összesen:	2 034 155

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

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

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

Alap neve Fund	Sorozat Serie	Deviza Currency	ISIN	Nettó eszközérték Net Asset Value	1 jegyre jutó eszközérték Unit price	Értéknap Value date
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714886	8 083 743 275	1,129921	2019.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714886	5 559 796 399	1,137998	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714886	2 832 958 928	1,189616	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	A	HUF	HU0000714886	1 791 698 089	1,021995	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714928	4 210 814 149	1,176882	2019.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714928	9 838 602 845	1,176185	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714928	10 393 972 342	1,242101	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	I	HUF	HU0000714928	8 691 336 563	1,079938	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714894	7 424 819	1,087206	2019.12.31.

VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714894	6 279 180	1,083088	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714894	4 511 284	1,121399	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	E	EUR	HU0000714894	3 239 419	0,901253	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714910	27 010 038	1,151338	2019.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714910	31 804 044	1,147563	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714910	34 312 317	1,190748	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	P	PLN	HU0000714910	23 422 599	1,007538	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714936	892 545 725	1,162577	2019.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714936	808 000 234	1,176642	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714936	2 209 299 495	1,243452	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	R	HUF	HU0000714936	1 454 975 514	1,082744	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	U	USD	HU0000714902	6 495 812	1,175415	2019.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	U	USD	HU0000714902	4 491 920	1,195108	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	U	USD	HU0000714902	4 349 868	1,242335	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	U	USD	HU0000714902	2 942 987	1,013264	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716055		1,070491	2019.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716055		1,070491	2020.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716055		1,070491	2021.12.31.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	C	CZK	HU0000716055		1,070491	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	F	EUR	HU0000729579	13 370	1,001758	2022.12.30.
VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap	V	USD	HU0000729587	15 602	1,011898	2022.12.30.

VII. Származtatott ügyletek

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
PLN/HUF 22.02.28 Forward Vétel	2022.02.28.	12 718 000	78,390	78,0089	-4 847 115	HUF	2022.01.31.
USD/HUF 22.02.28 Forward Eladás	2022.02.28.	1 750 000	328,480	321,5369	12 150 469	HUF	2022.01.31.
USD/HUF 22.02.28 Forward Eladás	2022.02.28.	1 350 000	328,490	321,5369	9 386 674	HUF	2022.01.31.
USD/HUF 22.02.03 Forward Eladás	2022.02.03.	4 500 000	322,340	320,5457	8 074 420	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.02.07 Forward Eladás	2022.02.07.	1 900 000	365,990	358,3808	14 457 492	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.02.14 Forward Eladás	2022.02.14.	1 000 000	368,060	358,6539	9 406 148	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.02.17 Forward Eladás	2022.02.17.	6 000 000	371,500	358,9625	75 224 896	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.02.22 Forward Eladás	2022.02.22.	1 220 000	370,520	359,2101	13 798 091	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.03.31 Forward Vétel	2022.03.31.	209 000	360,310	360,9773	139 463	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.03.31 Forward Vétel	2022.03.31.	3 450 000	360,400	360,9779	1 993 816	HUF	2022.01.31.
USD/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	5 000 000	322,030	322,8364	-4 031 820	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	1 700 000	360,680	361,2833	-1 025 542	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	7 200 000	360,690	361,2833	-4 272 033	HUF	2022.01.31.
PLN/HUF 22.04.19 Forward Vétel	2022.04.19.	6 832 000	78,840	78,1698	-4 578 672	HUF	2022.01.31.
USD/HUF 22.02.22 Forward Vétel	2022.02.22.	200 000	312,380	321,2645	1 776 900	HUF	2022.01.31.
USD/HUF 22.02.22 Forward Vétel	2022.02.22.	4 142 000	312,370	321,2645	36 840 907	HUF	2022.01.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 22.04.19 Forward Eladás	2022.04.19.	1 700 000	358,660	362,0130	-5 700 068	HUF	2022.01.31.
EUR/HUF 22.02.22 Forward Vétel	2022.02.22.	900 000	357,350	359,1755	1 642 943	HUF	2022.01.31.
PLN/HUF 22.02.14 Forward Vétel	2022.02.14.	11 829 000	78,713	77,9422	-9 124 040	HUF	2022.01.31.
PLN/HUF 22.02.14 Forward Vétel	2022.02.14.	3 169 000	78,793	77,9423	-2 694 375	HUF	2022.01.31.
COPPER FUTURE Mar22 Vétel	2022.03.29.	8	457,669	432,4500	-16 163 233	HUF	2022.01.31.
RDX USD Index Mar22 Vétel	2022.03.18.	41	1 632,161	1 762,0000	17 059 362	HUF	2022.01.31.
MSCI EmgMkt Mar22 Vétel	2022.03.18.	33	1 208,244	1 224,8000	8 754 036	HUF	2022.01.31.
US ULTRA BOND CBT Mar22 Eladás	2022.03.22.	9	188,300	188,9375	-1 837 197	HUF	2022.01.31.
Összesen					148 618 556	HUF	2022.01.31.
PLN/HUF 22.04.19 Forward Vétel	2022.04.19.	6 832 000	78,840	78,9945	1 055 559	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.04.19 Forward Eladás	2022.04.19.	1 700 000	358,660	372,3976	-23 353 883	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.03.31 Forward Vétel	2022.03.31.	209 000	360,310	371,4205	2 322 097	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.03.31 Forward Vétel	2022.03.31.	3 450 000	360,400	371,4209	38 022 004	HUF	2022.02.28.
USD/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	5 000 000	322,030	332,1740	-50 720 202	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	1 700 000	360,680	371,6305	-18 615 841	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	7 200 000	360,690	371,6305	-78 771 885	HUF	2022.02.28.
USD/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	4 500 000	317,110	332,1519	-67 688 541	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.05.09 Forward Eladás	2022.05.09.	1 900 000	358,210	373,6097	-29 259 385	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.08.08 Forward Eladás	2022.08.08.	5 350 000	363,050	378,8311	-84 428 703	HUF	2022.02.28.
PLN/HUF 22.05.16 Forward Vétel	2022.05.16.	11 829 000	79,092	79,0496	-501 009	HUF	2022.02.28.
PLN/HUF 22.05.16 Forward Vétel	2022.05.16.	3 169 000	79,130	79,0500	-253 389	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.08.15 Forward Eladás	2022.08.15.	1 000 000	362,670	379,2069	-16 536 894	HUF	2022.02.28.
USD/HUF 22.05.17 Forward Eladás	2022.05.17.	3 400 000	315,050	333,8420	-63 892 724	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.05.18 Forward Eladás	2022.05.18.	6 000 000	358,775	374,1009	-91 955 586	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	390,6853	-18 343 116	HUF	2022.02.28.
EUR/HUF 22.03.23 Forward Vétel	2022.03.23.	900 000	357,590	370,9954	12 064 837	HUF	2022.02.28.
USD/HUF 22.04.25 Forward Vétel	2022.04.25.	200 000	317,620	332,9605	3 068 107	HUF	2022.02.28.
USD/HUF 22.04.25 Forward Vétel	2022.04.25.	3 942 000	317,850	332,9622	59 572 247	HUF	2022.02.28.
USD/HUF 22.09.01 Forward Eladás	2022.09.01.	3 100 000	336,580	338,3127	-5 371 303	HUF	2022.02.28.
PLN/HUF 22.04.01 Forward Vétel	2022.04.01.	12 718 000	79,050	78,9330	-1 488 214	HUF	2022.02.28.
WTI CRUDE FUTURE Jun22 Eladás	2022.05.20.	15	87,580	90,9800	-16 870 800	HUF	2022.02.28.
RDX USD Index Mar22 Vétel	2022.03.18.	41	1 632,161	556,5000	-145 889 752	HUF	2022.02.28.
MSCI EmgMkt Mar22 Vétel	2022.03.18.	33	1 208,244	1 175,5000	-17 872 432	HUF	2022.02.28.
Összesen					-435 075 824	HUF	2022.02.28.
PLN/HUF 22.04.19 Forward Vétel	2022.04.19.	6 832 000	78,840	79,4891	4 434 488	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.04.19 Forward Eladás	2022.04.19.	1 700 000	358,660	370,9025	-20 812 317	HUF	2022.03.31.
USD/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	1 800 000	322,030	332,2438	-18 384 844	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	1 700 000	360,680	369,8278	-15 551 336	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	3 500 000	360,690	369,8278	-31 982 474	HUF	2022.03.31.
USD/HUF 22.04.04 Forward Eladás	2022.04.04.	4 500 000	317,110	332,2413	-68 090 849	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.05.09 Forward Eladás	2022.05.09.	1 900 000	358,210	372,2416	-26 659 954	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.08.08 Forward Eladás	2022.08.08.	5 350 000	363,050	378,6935	-83 692 945	HUF	2022.03.31.
PLN/HUF 22.05.16 Forward Vétel	2022.05.16.	11 829 000	79,092	79,6158	6 196 621	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.08.15 Forward Eladás	2022.08.15.	1 000 000	362,670	379,5788	-16 908 837	HUF	2022.03.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
USD/HUF 22.05.17 Forward Eladás	2022.05.17.	3 400 000	315,050	334,4719	-66 034 428	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.05.18 Forward Eladás	2022.05.18.	6 000 000	358,775	372,8467	-84 430 045	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	394,1704	-22 594 907	HUF	2022.03.31.
USD/HUF 22.04.25 Forward Vétel	2022.04.25.	3 566 000	317,850	333,3741	55 358 799	HUF	2022.03.31.
USD/HUF 22.09.01 Forward Eladás	2022.09.01.	3 100 000	336,580	340,0193	-10 661 693	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.04.25 Forward Vétel	2022.04.25.	824 000	373,260	371,3686	-1 558 478	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.05.02 Forward Vétel	2022.05.02.	209 000	370,110	371,8386	361 272	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.05.02 Forward Vétel	2022.05.02.	2 950 000	370,300	371,8396	4 541 864	HUF	2022.03.31.
PLN/HUF 22.08.01 Forward Vétel	2022.08.01.	11 259 000	79,356	79,8719	5 808 275	HUF	2022.03.31.
MSCI EmgMkt Jun22 Vétel	2022.06.17.	33	1 074,864	1 125,5000	27 746 120	HUF	2022.03.31.
Összesen					-390 661 789	HUF	2022.03.31.
EUR/HUF 22.05.09 Forward Eladás	2022.05.09.	1 900 000	358,210	377,8121	-37 244 036	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.08.08 Forward Eladás	2022.08.08.	5 350 000	363,050	384,4909	-114 708 612	HUF	2022.04.29.
PLN/HUF 22.05.16 Forward Vétel	2022.05.16.	11 829 000	79,092	80,9945	22 504 417	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.08.15 Forward Eladás	2022.08.15.	1 000 000	362,670	384,9850	-22 314 953	HUF	2022.04.29.
USD/HUF 22.05.17 Forward Eladás	2022.05.17.	3 400 000	315,050	357,6519	-144 846 358	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.05.18 Forward Eladás	2022.05.18.	6 000 000	358,775	378,4590	-118 103 885	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	400,9644	-30 883 532	HUF	2022.04.29.
USD/HUF 22.09.01 Forward Eladás	2022.09.01.	3 100 000	336,580	363,0334	-82 005 479	HUF	2022.04.29.
PLN/HUF 22.08.01 Forward Vétel	2022.08.01.	11 259 000	79,356	81,0880	19 500 901	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.07.05 Forward Eladás	2022.07.05.	3 400 000	374,460	382,1794	-26 245 897	HUF	2022.04.29.
USD/HUF 22.07.05 Forward Eladás	2022.07.05.	1 500 000	337,750	360,1894	-33 659 081	HUF	2022.04.29.
PLN/HUF 22.06.21 Forward Vétel	2022.06.21.	6 832 000	81,605	81,1108	-3 376 275	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.06.21 Forward Eladás	2022.06.21.	1 700 000	380,850	381,0433	-328 536	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.05.25 Forward Vétel	2022.05.25.	761 000	372,325	379,0134	5 089 871	HUF	2022.04.29.
USD/HUF 22.06.27 Forward Vétel	2022.06.27.	3 599 000	345,070	359,9294	53 478 956	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.06.03 Forward Vétel	2022.06.03.	209 000	379,813	379,7119	-21 060	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.06.03 Forward Vétel	2022.06.03.	2 750 000	379,820	379,7120	-297 054	HUF	2022.04.29.
MSCI EmgMkt Jun22 Vétel	2022.06.17.	33	1 074,864	1 057,4000	-10 280 615	HUF	2022.04.29.
Összesen					-513 460 613	HUF	2022.04.29.
EUR/HUF 22.08.08 Forward Eladás	2022.08.08.	5 350 000	363,050	399,2219	-193 519 770	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.08.15 Forward Eladás	2022.08.15.	1 000 000	362,670	399,7344	-37 064 378	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	414,8667	-47 844 356	HUF	2022.05.31.
USD/HUF 22.09.01 Forward Eladás	2022.09.01.	3 100 000	336,580	371,8204	-109 245 393	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.11.21 Forward Eladás	2022.11.21.	6 000 000	400,630	408,6291	-47 994 782	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	639 000	389,035	400,8982	7 580 609	HUF	2022.05.31.
PLN/HUF 22.08.01 Forward Vétel	2022.08.01.	11 259 000	79,356	86,0987	75 915 952	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.07.05 Forward Eladás	2022.07.05.	3 400 000	374,460	396,6401	-75 412 244	HUF	2022.05.31.
USD/HUF 22.07.05 Forward Eladás	2022.07.05.	1 500 000	337,750	369,0434	-46 940 139	HUF	2022.05.31.
PLN/HUF 22.06.21 Forward Vétel	2022.06.21.	6 832 000	81,605	86,1403	30 985 155	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.06.21 Forward Eladás	2022.06.21.	550 000	380,850	395,6319	-8 130 049	HUF	2022.05.31.
USD/HUF 22.06.27 Forward Vétel	2022.06.27.	3 599 000	345,070	368,6853	84 991 346	HUF	2022.05.31.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 22.06.03 Forward Vétel	2022.06.03.	209 000	379,813	394,2465	3 016 657	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.06.03 Forward Vétel	2022.06.03.	2 750 000	379,820	394,2465	39 672 786	HUF	2022.05.31.
EUR/HUF 22.07.11 Forward Eladás	2022.07.11.	1 900 000	382,753	397,1424	-27 339 903	HUF	2022.05.31.
PLN/HUF 22.07.18 Forward Vétel	2022.07.18.	10 344 000	82,260	86,1714	40 459 446	HUF	2022.05.31.
USD/HUF 22.08.18 Forward Eladás	2022.08.18.	3 400 000	373,570	371,7049	6 341 341	HUF	2022.05.31.
USD/HUF 22.11.30 Forward Eladás	2022.11.30.	2 700 000	378,790	377,2731	4 095 582	HUF	2022.05.31.
USD/HUF 22.07.29 Forward Eladás	2022.07.29.	300 000	367,500	370,5326	-909 779	HUF	2022.05.31.
NASDAQ 100 E-MINI Jun22 Vétel	2022.06.17.	4	12 178,763	12 646,5000	13 744 354	HUF	2022.05.31.
NASDAQ 100 E-MINI Jun22 Vétel	2022.06.17.	8	12 454,000	12 646,5000	11 313 148	HUF	2022.05.31.
MSCI EmgMkt Jun22 Vétel	2022.06.17.	16	1 017,813	1 063,3000	13 366 411	HUF	2022.05.31.
MSCI EmgMkt Jun22 Vétel	2022.06.17.	33	1 074,864	1 063,3000	-7 008 275	HUF	2022.05.31.
Összesen					-301 341 920	HUF	2022.05.31.
PLN/HUF 22.10.05 Forward Eladás	2022.10.05.	2 400 000	85,820	85,0817	1 771 896	HUF	2022.06.30.
PLN/HUF 22.08.01 Forward Vétel	2022.08.01.	5 156 000	85,775	84,8454	-4 793 256	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.08.29 Forward Vétel	2022.08.29.	3 413 000	383,390	383,8024	1 407 629	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.12.30 Forward Eladás	2022.12.30.	2 500 000	389,177	391,9974	-7 051 087	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.08.08 Forward Eladás	2022.08.08.	4 390 000	363,050	400,0463	-162 413 672	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.08.15 Forward Eladás	2022.08.15.	1 000 000	362,670	400,6288	-37 958 792	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	419,4394	-53 423 121	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.09.01 Forward Eladás	2022.09.01.	3 100 000	336,580	383,4207	-145 206 297	HUF	2022.06.30.
PLN/HUF 22.08.01 Forward Vétel	2022.08.01.	11 259 000	79,356	84,8011	61 306 369	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.07.05 Forward Eladás	2022.07.05.	1 400 000	374,460	397,1608	-31 781 186	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.07.05 Forward Eladás	2022.07.05.	1 500 000	337,750	380,2515	-63 752 289	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.07.11 Forward Eladás	2022.07.11.	1 900 000	382,753	397,6712	-28 344 609	HUF	2022.06.30.
PLN/HUF 22.07.18 Forward Vétel	2022.07.18.	10 344 000	82,260	84,7858	26 127 254	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.08.18 Forward Eladás	2022.08.18.	3 400 000	373,570	383,0093	-32 093 477	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.11.21 Forward Eladás	2022.11.21.	6 000 000	400,630	411,6389	-66 053 160	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	639 000	389,035	401,7792	8 143 526	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.11.30 Forward Eladás	2022.11.30.	2 700 000	378,790	389,7393	-29 563 092	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.07.29 Forward Eladás	2022.07.29.	300 000	367,500	381,7485	-4 274 537	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	209 000	401,000	401,9228	192 966	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	2 750 000	400,985	401,9226	2 578 425	HUF	2022.06.30.
USD/HUF 22.09.19 Forward Eladás	2022.09.19.	1 000 000	385,050	385,2762	-226 224	HUF	2022.06.30.
NASDAQ 100 E-MINI Sep22 Eladás	2022.09.16.	2	11 191,500	11 529,5000	-5 137 465	HUF	2022.06.30.
Összesen					-565 406 736	HUF	2022.06.30.
EUR/HUF 22.08.08 Forward Eladás	2022.08.08.	4 390 000	363,050	405,2460	-185 240 320	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.08.15 Forward Eladás	2022.08.15.	1 000 000	362,670	406,1822	-43 512 168	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	431,1971	-67 767 439	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.09.01 Forward Eladás	2022.09.01.	3 100 000	336,580	398,0161	-190 451 869	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.08.18 Forward Eladás	2022.08.18.	3 400 000	373,570	397,1805	-80 275 535	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.11.21 Forward Eladás	2022.11.21.	6 000 000	400,630	419,7180	-114 528 018	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	584 000	389,035	407,5552	10 815 814	HUF	2022.07.29.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
USD/HUF 22.11.30 Forward Eladás	2022.11.30.	2 700 000	378,790	406,9350	-75 991 611	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	2 750 000	400,985	407,6532	18 337 515	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.09.19 Forward Eladás	2022.09.19.	1 000 000	385,050	400,1228	-15 072 775	HUF	2022.07.29.
PLN/HUF 22.10.05 Forward Eladás	2022.10.05.	2 400 000	85,820	86,0917	-652 189	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.08.29 Forward Vétel	2022.08.29.	3 234 000	383,390	398,2298	47 991 844	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.12.30 Forward Eladás	2022.12.30.	2 500 000	389,177	410,4375	-53 151 345	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 400 000	413,210	418,2967	-7 121 367	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 500 000	391,300	405,2922	-20 988 332	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.10.12 Forward Eladás	2022.10.12.	1 560 000	417,925	414,8669	4 770 653	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.10.14 Forward Eladás	2022.10.14.	1 500 000	425,170	415,3258	14 766 363	HUF	2022.07.29.
PLN/HUF 22.08.26 Forward Vétel	2022.08.26.	8 800 000	85,137	85,5746	3 851 310	HUF	2022.07.29.
USD/HUF 22.08.29 Forward Vétel	2022.08.29.	2 450	395,460	398,3432	7 064	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 22.08.25 Forward Vétel	2022.08.25.	2 450	402,410	407,6649	12 874	HUF	2022.07.29.
PLN/HUF 22.08.26 Forward Vétel	2022.08.26.	16 415 000	85,294	85,5760	4 628 752	HUF	2022.07.29.
NASDAQ 100 E-MINI Sep22 Eladás	2022.09.16.	2	11 191,500	12 971,5000	-28 153 904	HUF	2022.07.29.
Összesen					-749 570 777	HUF	2022.07.29.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	429,3508	-65 515 001	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.11.21 Forward Eladás	2022.11.21.	6 000 000	400,630	416,7878	-96 946 698	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 22.11.30 Forward Eladás	2022.11.30.	2 700 000	378,790	414,6325	-96 774 803	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 22.09.19 Forward Eladás	2022.09.19.	1 000 000	385,050	407,7178	-22 667 771	HUF	2022.08.31.
PLN/HUF 22.10.05 Forward Eladás	2022.10.05.	2 400 000	85,820	86,0443	-538 368	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 22.12.30 Forward Eladás	2022.12.30.	2 500 000	389,177	417,7949	-71 544 850	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 400 000	413,210	415,1355	-2 695 688	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 500 000	391,300	412,7808	-32 221 149	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.10.12 Forward Eladás	2022.10.12.	1 560 000	417,925	410,8397	11 053 085	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.10.14 Forward Eladás	2022.10.14.	1 500 000	425,170	411,2120	20 936 975	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.12.09 Forward Eladás	2022.12.09.	4 390 000	409,210	419,5600	-45 436 288	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.11.16 Forward Eladás	2022.11.16.	1 000 000	404,430	416,1950	-11 765 007	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.09.26 Forward Vétel	2022.09.26.	336 000	412,700	408,6311	-1 367 162	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.09.26 Forward Vétel	2022.09.26.	584 000	416,970	408,6672	-4 848 813	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.09.26 Forward Vétel	2022.09.26.	2 750 000	416,860	408,6663	-22 532 658	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.09.26 Forward Vétel	2022.09.26.	5 050	417,155	408,6688	-42 855	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 22.09.26 Forward Vétel	2022.09.26.	2 450	416,970	408,6672	-20 342	HUF	2022.08.31.
PLN/HUF 22.09.30 Forward Vétel	2022.09.30.	25 215 000	86,460	85,9937	-11 757 831	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 22.10.04 Forward Vétel	2022.10.04.	3 234 000	415,150	409,4814	-18 332 144	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 22.10.04 Forward Vétel	2022.10.04.	8 500	414,910	409,4788	-46 165	HUF	2022.08.31.
USD/HUF 23.09.05 Forward Eladás	2023.09.05.	3 100 000	443,800	446,8217	-9 367 271	HUF	2022.08.31.
DAX INDEX FUTURE Sep22 Eladás	2022.09.16.	4	13 669,000	12 847,0000	33 300 042	HUF	2022.08.31.
Összesen					-482 430 805	HUF	2022.08.31.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	441,7682	-80 664 203	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.21 Forward Eladás	2022.11.21.	6 000 000	400,630	428,6394	-168 056 534	HUF	2022.09.30.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
USD/HUF 22.11.30 Forward Eladás	2022.11.30.	2 700 000	378,790	434,2787	-149 819 491	HUF	2022.09.30.
PLN/HUF 22.10.05 Forward Eladás	2022.10.05.	2 400 000	85,820	86,5889	-1 845 264	HUF	2022.09.30.
USD/HUF 22.12.30 Forward Eladás	2022.12.30.	2 500 000	389,177	437,3024	-120 313 623	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 400 000	413,210	426,8911	-19 153 599	HUF	2022.09.30.
USD/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 370 000	391,300	432,4854	-56 423 959	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.10.14 Forward Eladás	2022.10.14.	500 000	425,170	423,3698	900 107	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.12.09 Forward Eladás	2022.12.09.	4 390 000	409,210	431,8086	-99 207 747	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.16 Forward Eladás	2022.11.16.	1 000 000	404,430	428,0199	-23 589 887	HUF	2022.09.30.
USD/HUF 23.09.05 Forward Eladás	2023.09.05.	3 100 000	443,800	463,9161	-62 359 928	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	920 000	412,675	429,1433	15 150 866	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	2 606 000	412,440	429,1388	43 517 126	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	5 050	412,263	429,1354	85 207	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	2 450	412,675	429,1433	40 347	HUF	2022.09.30.
PLN/HUF 23.01.31 Forward Vétel	2023.01.31.	23 746 000	86,915	88,2459	31 604 044	HUF	2022.09.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	3 049 000	447,300	443,3738	-11 970 937	HUF	2022.09.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	8 100	446,630	443,3433	-26 622	HUF	2022.09.30.
Összesen					-702 134 097	HUF	2022.09.30.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	2 400	419,185	416,8372	-5 636	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	431,2075	-67 780 171	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.21 Forward Eladás	2022.11.21.	6 000 000	400,630	416,2648	-93 808 767	HUF	2022.10.28.
USD/HUF 22.11.30 Forward Eladás	2022.11.30.	1 000 000	378,790	418,7693	-39 979 285	HUF	2022.10.28.
USD/HUF 22.12.30 Forward Eladás	2022.12.30.	2 500 000	389,177	422,5670	-83 474 930	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 400 000	413,210	413,9907	-1 092 975	HUF	2022.10.28.
USD/HUF 22.11.07 Forward Eladás	2022.11.07.	1 370 000	391,300	416,0559	-33 915 611	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.12.09 Forward Eladás	2022.12.09.	4 390 000	409,210	419,5569	-45 422 983	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.16 Forward Eladás	2022.11.16.	1 000 000	404,430	415,4198	-10 989 815	HUF	2022.10.28.
USD/HUF 23.09.05 Forward Eladás	2023.09.05.	3 100 000	443,800	453,3278	-29 536 061	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	732 000	412,675	416,7592	2 989 616	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	2 606 000	412,440	416,7564	11 248 432	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	5 050	412,263	416,7542	22 683	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 22.11.23 Forward Vétel	2022.11.23.	2 450	412,675	416,7592	10 006	HUF	2022.10.28.
PLN/HUF 23.01.31 Forward Vétel	2023.01.31.	23 746 000	86,915	89,3332	57 421 404	HUF	2022.10.28.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	3 049 000	447,300	429,7875	-53 395 737	HUF	2022.10.28.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	8 100	446,630	429,7574	-136 668	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 23.04.06 Forward Eladás	2023.04.06.	240 000	444,070	443,0383	247 617	HUF	2022.10.28.
PLN/HUF 23.01.09 Forward Eladás	2023.01.09.	2 400 000	88,437	88,9393	-1 205 587	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 23.04.18 Forward Eladás	2023.04.18.	500 000	453,900	445,9226	3 988 685	HUF	2022.10.28.
DAX INDEX FUTURE Dec22 Eladás	2022.12.16.	3	12 503,000	13 262,0000	-23 453 669	HUF	2022.10.28.
NASDAQ 100 E-MINI Dec22 Vétel	2022.12.16.	4	11 721,023	11 587,0000	-4 443 765	HUF	2022.10.28.
Összesen					-384 815 785	HUF	2022.10.28.
EUR/HUF 23.03.08 Forward Eladás	2023.03.08.	1 400 000	420,960	422,3241	-1 909 720	HUF	2022.11.30.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	418,8769	-52 736 851	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 22.12.30 Forward Eladás	2022.12.30.	2 500 000	389,177	397,2254	-20 120 913	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 22.12.09 Forward Eladás	2022.12.09.	4 390 000	409,210	409,3615	-665 165	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 23.09.05 Forward Eladás	2023.09.05.	3 100 000	443,800	425,5705	56 511 507	HUF	2022.11.30.
PLN/HUF 23.01.31 Forward Vétel	2023.01.31.	23 746 000	86,915	88,4848	37 277 298	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	2 831 000	447,300	402,8502	-125 837 386	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	8 100	446,630	402,8314	-354 769	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.04.06 Forward Eladás	2023.04.06.	240 000	444,070	427,5933	3 954 401	HUF	2022.11.30.
PLN/HUF 23.01.09 Forward Eladás	2023.01.09.	2 400 000	88,437	88,1824	611 145	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.04.18 Forward Eladás	2023.04.18.	500 000	453,900	428,9580	12 471 011	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.05.17 Forward Eladás	2023.05.17.	1 000 000	429,050	431,4245	-2 374 542	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	158 000	419,171	420,3943	193 267	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	600	419,171	420,3943	734	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	3 000	423,450	420,5435	-8 720	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 23.03.20 Forward Vétel	2023.03.20.	210 000	412,210	406,7136	-1 154 253	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.05.22 Forward Eladás	2023.05.22.	6 000 000	437,430	432,6440	28 716 108	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	732 000	421,200	420,4651	-537 983	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	2 730 000	421,550	420,4773	-2 928 599	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	7 450	421,319	420,4692	-6 331	HUF	2022.11.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	2 450	421,200	420,4651	-1 801	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 23.06.01 Forward Eladás	2023.06.01.	1 000 000	407,700	413,5236	-5 823 602	HUF	2022.11.30.
DAX INDEX FUTURE Dec22 Eladás	2022.12.16.	3	12 503,000	14 418,0000	-58 551 604	HUF	2022.11.30.
NASDAQ 100 E-MINI Dec22 Vétel	2022.12.16.	4	11 721,023	12 042,2500	10 113 262	HUF	2022.11.30.
NASDAQ 100 E-MINI Dec22 Vétel	2022.12.16.	5	11 314,023	12 042,2500	28 658 656	HUF	2022.11.30.
MSCI EmgMkt Dec22 Vétel	2022.12.16.	17	923,429	982,5000	19 759 643	HUF	2022.11.30.
MSCI EmgMkt Dec22 Vétel	2022.12.16.	25	947,196	982,5000	17 366 920	HUF	2022.11.30.
Összesen					-74 725 162	HUF	2022.11.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	7 500	386,250	380,7080	-41 565	HUF	2022.12.30.
USD/HUF 23.04.03 Forward Eladás	2023.04.03.	2 500 000	386,249	386,8693	-1 550 255	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Eladás	2023.02.23.	1 220 000	375,650	408,5398	-40 125 569	HUF	2022.12.30.
USD/HUF 23.09.05 Forward Eladás	2023.09.05.	3 100 000	443,800	407,1639	113 571 784	HUF	2022.12.30.
PLN/HUF 23.01.31 Forward Vétel	2023.01.31.	23 746 000	86,915	86,1190	-18 900 963	HUF	2022.12.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	2 831 000	447,300	381,7761	-185 498 165	HUF	2022.12.30.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	8 100	446,630	381,7644	-525 412	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.04.06 Forward Eladás	2023.04.06.	240 000	444,070	416,5149	6 613 225	HUF	2022.12.30.
PLN/HUF 23.01.09 Forward Eladás	2023.01.09.	2 400 000	88,437	85,6539	6 679 403	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.04.18 Forward Eladás	2023.04.18.	500 000	453,900	418,8807	17 509 661	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.03.08 Forward Eladás	2023.03.08.	1 400 000	420,960	411,1286	13 764 002	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.05.17 Forward Eladás	2023.05.17.	1 000 000	429,050	420,5894	8 460 592	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	158 000	419,171	409,6333	-1 506 969	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	600	419,171	409,6333	-5 723	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	3 000	423,450	409,7408	-41 127	HUF	2022.12.30.
USD/HUF 23.03.20 Forward Vétel	2023.03.20.	210 000	412,210	386,1780	-5 466 721	HUF	2022.12.30.

Ügylet	lejárat	nyitott	kötésár	utolsó h.ár	érték	deviza	nap
EUR/HUF 23.05.22 Forward Eladás	2023.05.22.	6 000 000	437,430	421,7692	93 964 920	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	441 000	421,200	409,6843	-5 078 423	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	2 730 000	421,550	409,6931	-32 369 350	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	7 450	421,319	409,6873	-86 656	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	2 450	421,200	409,6843	-28 213	HUF	2022.12.30.
USD/HUF 23.06.01 Forward Eladás	2023.06.01.	1 000 000	407,700	393,7216	13 978 420	HUF	2022.12.30.
EUR/HUF 23.06.13 Forward Eladás	2023.06.13.	4 390 000	442,340	425,1516	75 457 127	HUF	2022.12.30.
WIG20 INDEX FUT Mar23 Vétel	2023.03.17.	100	1 812,490	1 816,0000	599 157	HUF	2022.12.30.
DAX INDEX FUTURE Mar23 Eladás	2023.03.17.	3	250,000	988,0000	7 864 913	HUF	2022.12.30.
Összesen					58 774 021	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 Mikesy 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. Az elvárások szerint a befektetési politika módosításra került a minimum hozamkorlát bevezetésével.

Az Alap különböző eszközökben levő közép és hosszú távú trendek kombinációit használva részvényeket, kötvényeket és egyéb értékpapírokat vásárolhat, vagy kölcsönvétel után adhat el rövide, tőzsdei vagy tőzsdén kívüli határidős ügyletek segítségével vehet fel vételi, illetve eladási pozíciókat, valamint opciós ügyleteket köthet. Az Alap összetételében történt változásokat a különböző piaci lehetőségek kiaknázásának célja indokolta.

IX. A befektetési alapkezelő által kifizetett javadalmazás

a)- b) a javadalmazás teljes összege, az alkalmazottak számára kifizetett rögzített és változó javadalmazás szerinti, valamint munkavállalói kategóriánkénti bontásban, a kedvezményezettek számának megjelölésével

	Javadalmazás teljes összege	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

c) javadalmazások és juttatások kiszámításának módja

A bónusz rendszer az Igazgatóság tagjai, a nem junior vagyongazdálkodók és elemzők, az értékesítési terület szenior kollégái, valamint az Adminisztrációs igazgatóság csoportvezetői számára személyre szabott feltételek szerint kívánja díjazni a kiváló teljesítményeket. A fenti területeken dolgozó Munkavállalók besorolása alapján a maximális kifizethető bónusz az éves jövedelem 45 és 100 százaléka között mozoghat. Az egyéni célok meghatározása a közvetlen vezető, míg jóváhagyása az elnök-vezérigazgató feladata, amit a Kockázatkezelési Vezető is ellenőriz. A Vezérigazgató és a Kockázatkezelési Vezető feladatkiírását a Felügyelő Bizottság és/vagy a tulajdonos cégcsoport képviselője hagyja jóvá. A célok teljesülésének megítélése, ellenőrzése és jóváhagyása a fentiekkel összhangban történik.

A bónuszként kifizethető összegek meghatározásakor az egyéni célok elérése mellett további kontrollt jelent a tulajdonos cégcsoport javadalmazási bizottsága által meghatározott feltételrendszer alapján kiszámított és általuk jóváhagyott bónusz keret mennyisége.

d) javadalmazási politika felülvizsgálatának eredménye

A belső ellenőrzés a Javadalmazási politika végrehajtásának legutóbbi éves felülvizsgálata mindössze egy alacsony súlyú megállapítást tett. Az ellenőri jelentésről az Alapkezelő Felügyelő Bizottságát is tájékoztatták.

e) javadalmazási politika érdemi változásai

Tekintettel a 2022. március 23-i hatállyal megtörtént tulajdonosváltásra a Javadalmazási politika tulajdonost érintő és említő, valamint a tulajdonosra hivatkozó rendelkezései módosításra kerültek.

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

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

Az Alapban az Alapkezelő Likviditási politikájában definiált nem likvid eszközök aránya 13,39%.

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
VIG Maraton ESG Multi Asset 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 aktív portfóliókezeléssel olyan befektetési portfóliót hozzon létre, amely 3 éves időtávon a befektetők számára a referenciamutatónál magasabb évesített tőkenövekedést ér el az Alap Fenntarthatósági céljainak megvalósítása mellett. Az Alap e célok elérésére különböző eszközökbe fektethet, elsősorban részvény és kötvény típusú eszközöket tart, de a befektetési limitek betartása mellett kollektív értékpapírokba is fektethet, illetve derivatív ügyleteket is köthet. Az Alap földrajzi specifikációval nem rendelkezik. A befektetési célok megvalósítása érdekében az Alap portfóliójába tartozó eszközcsoportok szabadon változtathatók egy előre meghatározott kockázati profil követése nélkül. Az Alap befektetési stratégiája a fenntartható értékteremtésre épül, célja egy olyan aktívan kezelt, jól diverzifikált portfólió kialakítása, amely mind a fenntarthatósági kritériumokat, mind pedig a benne lévő eszközök fundamentumait figyelembe veszi. Az Alap eszközallokációs stratégiája az Alapkezelő által alkalmazott eszközallokációs modellre, a Befektetési órára épül, aminek segítségével az Alap kezelője meghatározza a

gazdasági ciklus adott pontján legjobb kockázat hozam potenciállal rendelkező eszköz összetételt. Az eszközallokáció mellett az Alap kezelője aktív részvény- és kötvénykiválasztás segítségével kívánja elérni az Alap pénzügyi és fenntarthatósági céljait. A részvénykiválasztás alapja a fenntartható növekedés, olyan vállalatok részvényeinek kiválasztása, melyek mind pénzügyileg, mind az ESG kockázatok tekintetében kiemelkedő teljesítményre képesek, ezzel tartósan részvényesi értéket teremtve. A kötvénykiválasztás során az Alap kezelője a zöld kötvény kibocsátásokat preferálva, azok arányának maximalizálására törekszik a piaci korlátok figyelembe vétele mellett. A fenti eszközök aránya, illetve azok összetétele az Alap hozamcéljának elérése érdekében dinamikusan változhat, a 14. pontban meghatározott arányok figyelembe vételével.

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 fedezeti céllal, illetve a hatékony portfólió kialakítás céljából is kötött származékos ügyleteket. Az Alap egyes sorozatainak az alapdevizával szembeni devizakockázatának csökkentése céljából is kötött fedezeti ügyleteket. Az Alap teljes nettósított kockázati kitettsége 2022.12.31-én a következő: 1,06.

XII. Eredménykimutatás

VIG Maraton ESG Multi Asset Befektetési Alap

2022. év

	Előző év eFT	Tárgyév eFT
I. Pénzügyi műveletek bevételei	5 786 642	4 039 771
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	2 937 100	4 016 016
III. Egyéb bevételek	453	87
IV. Működési költségek	643 343	264 576
V. Egyéb ráfordítások	11 178	8 943
VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	-
Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.-VI.)	2 195 474	- 249 677

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