

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

2023. éves jelentés

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

A jelen tájékoztatót a VIG Befektetési Alapkezelő Magyarország Zrt., mint a VIG BondMaxx Total Return Kötvény 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 2023. éves 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 a VIG Befektetési Alapkezelőnél, az Alap befektetési jegyeinek forgalmazási helyein, valamint az Alapkezelő honlapján (<https://www.vigam.hu/>).

Budapest, 2024.04.26.

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 aláírásával ellátott papír alapú dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK AZ ALAPRÓL

Az Alap elnevezése

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Az Alap rövid neve

VIG BondMaxx Kötvény Alap

Az Alap lajstromszáma

1111-431

Az Alap fajtája

nyíltvégű

Az Alap típusa

nyilvános

A tárgyidőszakban forgalmazott Befektetési jegyek sorozata és típusa

Sorozat	Deviza	ISIN kód
A	HUF	HU0000709597
I	HUF	HU0000709605
R	HUF	HU0000712260
P	PLN	HU0000712401
C	CZK	HU0000717400
PI	PLN	HU0000727391
EI	EUR	HU0000732730
UI	USD	HU0000732748
E	EUR	HU0000727037
U	USD	HU0000727045

Hozamfizetés

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

A Befektetők köre

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

Alapkezelő adatai

VIG Befektetési Alapkezelő Magyarország Zrt.
1091 Budapest, Üllői út 1.
Telefon: (06-1) 477-4814

Letétkezelő adatai

Raiffeisen Bank Zrt.
1133 Budapest, Váci út 116-118.

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

Szabados Szilvia
Kamarai tagsági szám: 005314

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

Megnevezés	2022.12.30.		2023.12.29.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	214 630 798	1,40	796 838 791	4,46
Repo				
Átruházható értékpapírok	14 188 458 740	92,64	16 999 509 421	94,98
Származékos ügyletek	814 406 588	5,32	150 220 316	0,84
Egyéb eszközök	122 635 559	0,80	51 206 568	0,28
Összes eszköz	15 340 131 685	100,16	17 997 775 096	100,56
Kötelezettségek	-23 899 305	-0,16	-100 858 043	-0,56
Nettó eszközérték	15 316 232 380	100,00	17 896 917 053	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2022.12.30.	2023.12.29.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000709597	1 229 690 251	1 099 911 082
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000709605	6 847 059 296	6 901 562 849
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712260	820 615 165	832 769 824
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712401	16 500 422	15 882 188
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	C	CZK	HU0000717400	100 000	100 000
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	PI	PLN	HU0000727391	18 233	19 152
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	E	EUR	HU0000727037	2 457 981	3 345 063
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	U	USD	HU0000727045	1 255 538	2 139 142

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

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2022.12.30.	2023.12.29.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000709597	1,373757	1,585637
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000709605	1,450464	1,686182
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712260	1,207777	1,390839
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712401	1,052016	1,134011
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	C	CZK	HU0000717400	0,86266	0,920677
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	PI	PLN	HU0000727391	0,860368	0,880497
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	E	EUR	HU0000727037	0,845511	0,870648
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	U	USD	HU0000727045	0,823119	0,882435

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2022.12.30.		2023.12.29.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
GMU nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	760 959 939	5,36	3 087 114 714	18,16
Egyéb külföld nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	193 572 908	1,36		
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	954 532 846	6,73	3 087 114 714	18,16
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	31 526 014	0,22	179 664 703	1,06
Egyéb átruházható értékpapírok	31 526 014	0,22	179 664 703	1,06
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	4 434 080 955	31,25		
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	2 470 605 532	17,41	1 348 447 700	7,93
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	2 219 146 249	15,64	1 515 000 088	8,91
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	1 752 371 568	12,35	3 989 606 388	23,47
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Egyéb pü. közvetítők és pü. kieg. tevékenységet végzők			184 281 775	1,08
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	2 326 195 575	16,39	6 695 394 053	39,39
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	13 202 399 878	93,05	13 732 730 004	80,78
Értékpapírok összesen	14 188 458 740	100,00	16 999 509 421 ¹	100,00

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

¹ Az Alap értékpapírjainak 1,41%-át ukrán államkötvények alkotják, melyeket piaci áron értékelünk, de felhalmozott kamatot nem számítottunk rájuk.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

V. Befektetési alap eszközeinek alakulása

Befektetésből származó jövedelem:

adatok eFt-ban

Pénzügyi műveletek bevételei	2023
Pénzintézettől kapott kamatok	5 414
Diszkont kincstárjegyek árnyeresége	172 508
Kamatozó kötvények ár- és árfolyamnyeresége	343 114
Értékpapírok felhalmozott kamata	76 641
Értékpapírok kapott kamata	167 613
Származékos ügyletek nyeresége	2 930 437
Részvények árfolyamnyeresége	9 252
Részvények osztaléka	38 803
Összesen:	3 743 782

Az Alap 2023.évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.
adatok eFt-ban

Pénzügyi műveletek ráfordításai	2023
Kötvények ár- és árfolyamvesztesége	640 784
Diszkont papírok ár- és árfolyamvesztesége	203 800
Részvények árfolyamvesztesége	45 024
Fizetendő opciós díj	4 591
Devizás eszközök és kötelezettségek pénzügyi rendezésének árfolyamvesztesége	43 242
Fizetendő kamatok	2 202
Származékos ügyletek vesztesége	613 067
Összesen:	1 552 710

Az Alap 2023.évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Egyéb bevétel és egyéb ráfordítás:

Az Alap 2023-ban **Egyéb bevételként 476 eFt** büntető jutalékot kapott, illetve **1 eFt** kerekítést, számolt el. **Egyéb ráfordításként a** befektetési alap különadója merült fel, **8 341 eFt** értékben.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Üzleti évben elszámolt költségek, díjak és adók:

adatok eFt-ban

Működési költségek	2023
Alapkezelői díj	127 255
Letétkezelői díj	3 185
Könyvvizsgálói díj	3 125
Felügyeleti díj	5 843
Bankköltség	249
Főforgalmazói jutalék	8 393
Forgalmazói jutalék	25 132
Sikerdíj	15 208
Ügynöki jutalékok	4 333
Megbízási díj	1 847
Összesen:	194 570

Az Alap 2023.évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Nettó jövedelem, tőkeszámla változásai és a befektetések értéknövekedése:

adatok eFt-ban

Tőkenövekmény	2023
Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékülönözete	-946 915
Értékelési különbözet tartaléka	-283 866
Előző évek eredményből	5 170 594
Üzleti év eredményéből	1 988 638
Összesen:	5 928 451

Az Alap 2023.évi számviteli nyilvántartásában szereplő adatok alapján készült.

Felosztott és újrabefektetett jövedelemmel az alap nem rendelkezett 2023. évben.

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

Alap neve	Sorozat	Deviza	ISIN	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó eszközérték	Értéknap
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000709597	2 988 657 786	1,596988	2020.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000709597	2 574 285 972	1,559572	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000709597	1 689 295 590	1,373757	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	A	HUF	HU0000709597	1 744 059 708	1,585637	2023.12.29.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000709605	26 999 399 888	1,666062	2020.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000709605	26 405 591 987	1,636830	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000709605	9 931 413 015	1,450464	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	I	HUF	HU0000709605	11 637 291 048	1,686182	2023.12.29.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Alap neve	Sorozat	Deviza	ISIN	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó eszközérték	Értéknap
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712260		1,218598	2020.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712260		1,218598	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712260	991 120 122	1,207777	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	R	HUF	HU0000712260	1 158 248 749	1,390839	2023.12.29.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712401	36 409 311	1,256942	2020.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712401	31 257 221	1,216662	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712401	17 358 708	1,052016	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	P	PLN	HU0000712401	18 010 576	1,134011	2023.12.29.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	C	CZK	HU0000717400	103 937	1,039365	2020.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	C	CZK	HU0000717400	100 788	1,007884	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	C	CZK	HU0000717400	86 266	0,862660	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	C	CZK	HU0000717400	92 068	0,920677	2023.12.29.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	L	PLN	HU0000727391	12 906	0,985177	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	L	PLN	HU0000727391	15 687	0,860368	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	L	PLN	HU0000727391	16 863	0,880497	2023.12.29.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	E	EUR	HU0000727037	3 784	0,978916	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	E	EUR	HU0000727037	2 078 250	0,845511	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	E	EUR	HU0000727037	2 912 372	0,870648	2023.12.29.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	U	USD	HU0000727045	3 337	0,981451	2021.12.31.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	U	USD	HU0000727045	1 033 457	0,823119	2022.12.30.
VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	U	USD	HU0000727045	1 887 654	0,882435	2023.12.29.

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

VII. Származtatott ügyletek

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	18 400	445,946	360,2566	-1 576 686	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.02.06 Forward Eladás	2023.02.06.	600 000	454,500	360,2822	56 530 708	HUF	2023.01.31.
CZK/HUF 23.02.21 Forward Vétel	2023.02.21.	3 000	17,051	16,4196	-1 893	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	13 300	421,364	392,9665	-377 681	HUF	2023.01.31.
	2023.02.23.	8 290	421,319	392,9660	-235 046	HUF	2023.01.31.
	2023.02.23.	31 500	420,700	392,9594	-873 829	HUF	2023.01.31.
	2023.02.23.	22 000	424,590	393,0011	-694 956	HUF	2023.01.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	6 500	400,455	360,1205	-262 176	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 500 000	399,595	375,3998	36 292 824	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	300 000	429,165	409,0835	6 024 349	HUF	2023.01.31.
AUD/HUF 23.03.09 Forward Eladás	2023.03.09.	785 000	259,517	255,4895	3 161 585	HUF	2023.01.31.
CAD/HUF 23.03.09 Forward Eladás	2023.03.09.	685 000	281,483	270,7110	7 378 842	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	200 000	404,970	392,7908	-2 435 846	HUF	2023.01.31.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	10 400	85,576	86,0716	5 154	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	373,830	373,9252	-128 547	HUF	2023.01.31.
	2023.06.20.	700 000	373,800	373,9235	-86 452	HUF	2023.01.31.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	6 211 000	85,790	86,0872	1 845 763	HUF	2023.01.31.
	2023.07.31.	8 683 000	85,794	86,0875	2 549 145	HUF	2023.01.31.
	2023.07.31.	5 100	85,698	86,0804	1 953	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 225 000	428,244	430,9852	-3 357 567	HUF	2023.01.31.
	2024.01.19.	1 200 000	438,960	432,3512	7 930 598	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	7 266 000	418,744	408,4871	74 524 232	HUF	2023.01.31.
	2023.06.20.	6 500 000	419,200	408,5132	69 463 905	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.02.06 Forward Eladás	2023.02.06.	155 000	373,310	360,0393	2 056 957	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 315 000	426,180	408,9127	39 973 754	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	3 625 000	396,380	375,2158	76 720 278	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	1 001 800	385,305	360,0752	-25 275 724	HUF	2023.01.31.
EUR/HUF 23.02.23 Forward Vétel	2023.02.23.	2 003 910	412,458	392,8710	-39 250 316	HUF	2023.01.31.
GBP/HUF 23.03.14 Forward Eladás	2023.03.14.	515 000	499,050	450,3970	25 056 294	HUF	2023.01.31.
CZK/HUF 23.02.21 Forward Vétel	2023.02.21.	84 000	17,257	16,4217	-70 206	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.02.06 Forward Vétel	2023.02.06.	10 000	410,126	360,1494	-499 762	HUF	2023.01.31.
	2023.02.06.	4 300	426,680	360,1989	-285 870	HUF	2023.01.31.
USD/HUF 23.02.06 Forward Eladás	2023.02.06.	1 600 000	446,070	360,2569	137 300 897	HUF	2023.01.31.
	2023.02.06.	670 000	446,130	360,2571	57 534 831	HUF	2023.01.31.
	2023.02.06.	2 950 000	446,166	360,2572	253 430 882	HUF	2023.01.31.
EURO-BOBL FUTURE Mar23 Eladás	2023.03.08.	9	117,550	117,3000	875 228	HUF	2023.01.31.
Euro-OAT Future Mar23 Eladás	2023.03.08.	3	132,130	131,5200	711 852	HUF	2023.01.31.
US 10YR NOTE (CBT)Mar23 Eladás	2023.03.22.	5	114,625	114,5156	196 427	HUF	2023.01.31.
US 5YR NOTE (CBT) Mar23 Eladás	2023.03.31.	5	109,344	109,2422	182 395	HUF	2023.01.31.
LONG GILT FUTURE Mar23 Eladás	2023.03.29.	2	104,500	104,5100	-8 854	HUF	2023.01.31.
Összesen					782 370 395	HUF	2023.01.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
GBP/HUF 23.03.14 Forward Eladás	2023.03.14.	515 000	499,050	435,3196	32 821 177	HUF	2023.02.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 500 000	399,595	372,0544	41 310 899	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	300 000	429,165	397,3731	9 537 477	HUF	2023.02.28.
	2023.06.20.	2 315 000	426,180	397,2292	67 021 045	HUF	2023.02.28.
AUD/HUF 23.03.09 Forward Eladás	2023.03.09.	785 000	259,517	241,6708	14 009 261	HUF	2023.02.28.
CAD/HUF 23.03.09 Forward Eladás	2023.03.09.	685 000	281,483	264,5410	11 605 243	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	6 500 000	419,200	396,8927	144 997 203	HUF	2023.02.28.
	2023.06.20.	7 266 000	418,744	396,8707	158 928 920	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	420,5071	22 143 535	HUF	2023.02.28.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	419,2140	11 062 034	HUF	2023.02.28.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	10 400	85,576	83,6909	-19 605	HUF	2023.02.28.
	2023.07.31.	5 100	85,698	83,6986	-10 194	HUF	2023.02.28.
	2023.07.31.	8 683 000	85,794	83,7048	-18 139 736	HUF	2023.02.28.
	2023.07.31.	6 211 000	85,790	83,7045	-12 952 893	HUF	2023.02.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	373,830	370,8123	4 073 840	HUF	2023.02.28.
	2023.06.20.	700 000	373,800	370,8109	2 092 374	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	408,780	396,3904	16 725 935	HUF	2023.02.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	670 000	365,360	370,4040	-3 379 497	HUF	2023.02.28.
	2023.06.20.	2 355 000	365,700	370,4204	-11 116 580	HUF	2023.02.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	89 000	367,628	370,5134	256 814	HUF	2023.02.28.
	2023.06.20.	1 035 000	366,763	370,4717	3 838 661	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	252 000	400,050	399,2605	-198 955	HUF	2023.02.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 950 000	367,900	370,5265	-5 121 621	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 650 000	393,040	395,6316	-4 276 200	HUF	2023.02.28.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	253 500	403,100	399,4462	-926 228	HUF	2023.02.28.
	2023.07.24.	8 290	402,869	399,4322	-28 491	HUF	2023.02.28.
	2023.07.24.	2 017 210	403,114	399,4471	-7 396 543	HUF	2023.02.28.
	2023.07.24.	138 000	404,240	399,5157	-651 958	HUF	2023.02.28.
CZK/HUF 23.05.22 Forward Vétel	2023.05.22.	87 000	16,531	16,4351	-8 373	HUF	2023.02.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 950 000	365,436	370,4077	-14 666 484	HUF	2023.02.28.
	2023.06.20.	3 625 000	396,380	371,8994	88 742 123	HUF	2023.02.28.
EURO-BUND FUTURE Jun23 Eladás	2023.06.08.	10	131,800	131,9500	-569 850	HUF	2023.02.28.
LONG GILT FUTURE Jun23 Eladás	2023.06.28.	2	100,470	99,9600	441 160	HUF	2023.02.28.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
US 10YR NOTE (CBT)Jun23 Eladás	2023.06.21.	5	111,547	111,6562	-195 885	HUF	2023.02.28.
US 5YR NOTE (CBT) Jun23 Eladás	2023.06.30.	4	107,180	107,0547	179 095	HUF	2023.02.28.
EURO-BOBL FUTURE Mar23 Eladás	2023.03.08.	7	117,450	115,1800	6 036 611	HUF	2023.02.28.
Euro-OAT Future Mar23 Eladás	2023.03.08.	3	131,760	127,7000	4 627 182	HUF	2023.02.28.
Összesen					550 273 181	HUF	2023.02.28.
AUD/HUF 23.05.09 Forward Eladás	2023.05.09.	805 000	241,547	237,4547	3 294 295	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.04.14 Forward Eladás	2023.04.14.	450 000	364,840	351,7248	5 901 837	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	144 000	417,911	398,0116	-2 865 520	HUF	2023.03.31.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	48 900	87,650	84,2355	-166 968	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 500 000	399,595	360,1468	59 172 354	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	300 000	429,165	393,5862	10 673 538	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	3 625 000	396,380	360,0330	131 757 783	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 315 000	426,180	393,4806	75 698 998	HUF	2023.03.31.
	2023.06.20.	6 390 000	419,200	393,2337	165 924 570	HUF	2023.03.31.
	2023.06.20.	7 266 000	418,744	393,2176	185 472 855	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	418,5167	24 531 965	HUF	2023.03.31.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	10 400	85,576	84,1269	-15 070	HUF	2023.03.31.
	2023.07.31.	8 478 000	85,794	84,1383	-14 035 586	HUF	2023.03.31.
	2023.07.31.	5 901 000	85,790	84,1381	-9 747 587	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	373,830	359,2353	19 702 896	HUF	2023.03.31.
	2023.06.20.	700 000	373,800	359,2342	10 196 060	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	408,780	392,8651	21 485 142	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 950 000	365,436	358,9383	19 168 206	HUF	2023.03.31.
	2023.06.20.	670 000	365,360	358,9356	4 304 338	HUF	2023.03.31.
	2023.06.20.	2 355 000	365,700	358,9476	15 901 801	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	89 000	367,628	359,0158	-766 464	HUF	2023.03.31.
	2023.06.20.	1 035 000	366,763	358,9852	-8 049 773	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	138 000	404,240	397,3349	-952 898	HUF	2023.03.31.
CZK/HUF 23.05.22 Forward Vétel	2023.05.22.	87 000	16,531	16,4259	-9 173	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	2 017 210	403,114	397,2792	-11 769 605	HUF	2023.03.31.
	2023.07.24.	8 290	402,869	397,2671	-46 440	HUF	2023.03.31.
	2023.07.24.	253 500	403,100	397,2785	-1 475 745	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	108 000	366,512	358,9764	-813 848	HUF	2023.03.31.
CAD/HUF 23.05.09 Forward Eladás	2023.05.09.	675 000	264,825	261,6640	2 133 698	HUF	2023.03.31.
GBP/HUF 23.04.14 Forward Eladás	2023.04.14.	549 000	436,690	434,9938	931 216	HUF	2023.03.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	252 000	400,050	397,1276	-736 453	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 950 000	367,900	359,0255	17 305 327	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 650 000	393,040	392,3082	1 207 408	HUF	2023.03.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 225 000	428,244	417,3334	13 365 824	HUF	2023.03.31.
Euro-OAT Future Jun23 Eladás	2023.06.08.	3	126,150	130,2300	-4 663 318	HUF	2023.03.31.
LONG GILT FUTURE Jun23 Eladás	2023.06.28.	2	100,470	103,3500	-2 492 122	HUF	2023.03.31.
Összesen					736 675 861	HUF	2023.03.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 500 000	399,595	346,6599	79 402 706	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	3 625 000	396,380	346,5810	180 521 528	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 315 000	426,180	381,7712	102 806 287	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	6 390 000	419,200	381,5999	240 264 458	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	7 266 000	418,744	381,5887	269 968 017	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	409,1390	35 785 154	HUF	2023.04.28.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	408,0175	24 777 747	HUF	2023.04.28.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	10 400	85,576	83,3019	-23 651	HUF	2023.04.28.
	2023.07.31.	8 141 000	85,794	83,3107	-20 215 310	HUF	2023.04.28.
	2023.07.31.	5 901 000	85,790	83,3106	-14 631 093	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	373,830	346,0275	37 533 350	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	700 000	373,800	346,0268	19 441 253	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	408,780	381,3442	37 038 340	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 950 000	365,436	345,8215	57 862 757	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	670 000	365,360	345,8196	13 092 041	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	2 355 000	365,700	345,8280	46 798 594	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	89 000	367,628	345,8753	-1 935 973	HUF	2023.04.28.
	2023.06.20.	1 035 000	366,763	345,8541	-21 640 536	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	138 000	404,240	385,3170	-2 611 373	HUF	2023.04.28.
CZK/HUF 23.05.22 Forward Vétel	2023.05.22.	87 000	16,531	15,9914	-46 980	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	2 017 210	403,114	385,2745	-35 985 611	HUF	2023.04.28.
	2023.07.24.	8 290	402,869	385,2653	-145 935	HUF	2023.04.28.
	2023.07.24.	253 500	403,100	385,2740	-4 518 896	HUF	2023.04.28.
AUD/HUF 23.05.09 Forward Eladás	2023.05.09.	805 000	241,547	224,4726	13 744 885	HUF	2023.04.28.
CAD/HUF 23.05.09 Forward Eladás	2023.05.09.	675 000	264,825	249,5175	10 332 568	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	144 000	417,911	385,8330	-4 619 235	HUF	2023.04.28.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	5 900	87,650	83,3862	-25 156	HUF	2023.04.28.
RON/HUF 23.05.08 Forward Eladás	2023.05.08.	2 425 000	77,009	75,8097	2 908 070	HUF	2023.04.28.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	259 000	391,330	384,8298	-1 683 563	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	61 000	351,800	345,4868	-385 103	HUF	2023.04.28.
GBP/HUF 23.06.14 Forward Eladás	2023.06.14.	550 000	436,310	429,8339	3 561 860	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	600 000	351,430	345,4778	3 571 344	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	252 000	400,050	385,1589	-3 752 565	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 950 000	367,900	345,8820	42 935 140	HUF	2023.04.28.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 650 000	393,040	380,9579	19 935 483	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	108 000	366,512	345,8479	-2 231 721	HUF	2023.04.28.
Euro-OAT Future Jun23 Eladás	2023.06.08.	3	126,150	129,9900	-4 296 730	HUF	2023.04.28.
US LONG BOND(CBT) Jun23 Vétel	2023.06.21.	15	131,875	131,6563	-1 113 492	HUF	2023.04.28.
LONG GILT FUTURE Jun23 Eladás	2023.06.28.	2	100,470	101,4600	-836 926	HUF	2023.04.28.
Összesen					1 127 828 879	HUF	2023.04.28.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 500 000	399,595	350,7189	73 314 102	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	3 625 000	396,380	350,6895	165 628 123	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	2 315 000	426,180	374,3030	120 095 315	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	6 390 000	419,200	374,2390	287 300 540	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	7 266 000	418,744	374,2349	323 401 235	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	401,7575	44 643 050	HUF	2023.05.31.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	400,7937	33 627 001	HUF	2023.05.31.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	10 400	85,576	83,0561	-26 207	HUF	2023.05.31.
	2023.07.31.	8 141 000	85,794	83,0618	-22 242 015	HUF	2023.05.31.
	2023.07.31.	5 901 000	85,790	83,0617	-16 099 811	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 350 000	373,830	350,4829	31 518 544	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	700 000	373,800	350,4827	16 322 141	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	2 950 000	365,436	350,4060	44 338 371	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	670 000	365,360	350,4053	10 019 617	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	2 355 000	365,700	350,4085	36 011 573	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	89 000	367,628	350,4261	-1 530 950	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	1 035 000	366,763	350,4182	-16 916 664	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	138 000	404,240	379,1255	-3 465 807	HUF	2023.05.31.
	2023.07.24.	2 017 210	403,114	379,0980	-48 444 844	HUF	2023.05.31.
	2023.07.24.	8 290	402,869	379,0921	-197 111	HUF	2023.05.31.
	2023.07.24.	253 500	403,100	379,0977	-6 084 584	HUF	2023.05.31.
	2023.07.24.	252 000	400,050	379,0234	-5 298 697	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 950 000	367,900	350,4286	34 069 204	HUF	2023.05.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
EUR/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	1 650 000	393,040	373,9994	31 416 958	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	108 000	366,512	350,4159	-1 738 379	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	144 000	417,911	379,4584	-5 537 178	HUF	2023.05.31.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	5 900	87,650	83,1099	-26 787	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	259 000	391,330	378,8111	-3 242 402	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Vétel	2023.06.20.	61 000	351,800	350,2811	-92 650	HUF	2023.05.31.
GBP/HUF 23.06.14 Forward Eladás	2023.06.14.	550 000	436,310	432,0765	2 328 431	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.06.20 Forward Eladás	2023.06.20.	600 000	351,430	350,2778	691 349	HUF	2023.05.31.
	2023.06.20.	1 500 000	344,280	350,2123	-8 898 389	HUF	2023.05.31.
RON/HUF 23.06.09 Forward Eladás	2023.06.09.	2 500 000	76,329	74,8930	3 589 370	HUF	2023.05.31.
AUD/HUF 23.07.10 Forward Eladás	2023.07.10.	835 000	231,951	228,7277	2 691 459	HUF	2023.05.31.
CAD/HUF 23.07.10 Forward Eladás	2023.07.10.	705 000	255,134	258,4328	-2 325 660	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	173 000	379,530	378,5237	-174 087	HUF	2023.05.31.
USD/HUF 23.07.20 Forward Vétel	2023.07.20.	74 000	343,204	353,3351	749 670	HUF	2023.05.31.
CZK/HUF 23.11.22 Forward Vétel	2023.11.22.	88 000	16,374	16,2522	-10 714	HUF	2023.05.31.
LONG GILT FUTURE Sep23 Vétel	2023.09.27.	25	94,910	96,7900	20 207 650	HUF	2023.05.31.
US LONG BOND(CBT) Sep23 Vétel	2023.09.20.	20	127,125	128,3438	8 483 719	HUF	2023.05.31.
Euro-OAT Future Jun23 Eladás	2023.06.08.	3	126,150	130,5400	-4 886 860	HUF	2023.05.31.
Összesen					1 119 403 117	HUF	2023.05.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	396,4702	50 987 757	HUF	2023.06.30.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	395,6567	39 919 842	HUF	2023.06.30.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	10 400	85,576	84,0618	-15 748	HUF	2023.06.30.
	2023.07.31.	8 141 000	85,794	84,0647	-14 076 888	HUF	2023.06.30.
	2023.07.31.	5 901 000	85,790	84,0647	-10 181 039	HUF	2023.06.30.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	138 000	404,240	374,5257	-4 100 577	HUF	2023.06.30.
	2023.07.24.	2 017 210	403,114	374,5139	-57 692 049	HUF	2023.06.30.
	2023.07.24.	8 290	402,869	374,5113	-235 085	HUF	2023.06.30.
	2023.07.24.	253 500	403,100	374,5137	-7 246 619	HUF	2023.06.30.
	2023.07.24.	252 000	400,050	374,4818	-6 443 191	HUF	2023.06.30.
	2023.07.24.	144 000	417,911	374,6689	-6 226 864	HUF	2023.06.30.
PLN/HUF 23.07.31 Forward Vétel	2023.07.31.	5 900	87,650	84,0898	-21 005	HUF	2023.06.30.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	259 000	391,330	374,3904	-4 387 348	HUF	2023.06.30.
AUD/HUF 23.07.10 Forward Eladás	2023.07.10.	835 000	231,951	227,3827	3 814 528	HUF	2023.06.30.
CAD/HUF 23.07.10 Forward Eladás	2023.07.10.	705 000	255,134	259,0422	-2 755 302	HUF	2023.06.30.
EUR/HUF 23.07.24 Forward Vétel	2023.07.24.	173 000	379,530	374,2668	-910 530	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.07.20 Forward Vétel	2023.07.20.	74 000	343,204	344,4238	90 239	HUF	2023.06.30.
CZK/HUF 23.11.22 Forward Vétel	2023.11.22.	88 000	16,374	16,1001	-24 104	HUF	2023.06.30.
RON/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	2 550 000	77,140	77,4436	-775 014	HUF	2023.06.30.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	570 000	442,370	444,4675	-1 195 598	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	52 000	356,050	357,0707	53 078	HUF	2023.06.30.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	935 000	449,460	444,7762	4 379 389	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	89 000	354,702	356,9825	202 983	HUF	2023.06.30.
	2023.12.20.	1 143 000	354,685	356,9814	2 624 799	HUF	2023.06.30.
	2023.12.20.	61 000	354,560	356,9732	147 207	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	4 450 000	355,319	357,0229	-7 581 100	HUF	2023.06.30.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Vétel	2023.12.15.	194 000	386,860	389,1255	439 500	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	112 000	351,900	356,7992	548 708	HUF	2023.06.30.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	970 000	388,450	389,2267	-753 390	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	2 850 000	353,100	356,8777	-10 766 437	HUF	2023.06.30.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	4 365 000	392,170	389,4635	11 813 775	HUF	2023.06.30.
	2023.12.15.	7 266 000	391,784	389,4389	17 039 148	HUF	2023.06.30.
	2023.12.15.	6 390 000	392,300	389,4718	18 072 206	HUF	2023.06.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	6 505 000	355,590	357,0406	-9 436 356	HUF	2023.06.30.
	2023.12.20.	6 245 000	355,705	357,0482	-8 388 011	HUF	2023.06.30.
LONG GILT FUTURE Sep23 Vétel	2023.09.27.	25	94,910	95,3000	4 211 415	HUF	2023.06.30.
US LONG BOND(CBT) Sep23 Vétel	2023.09.20.	20	127,125	126,9063	-1 498 000	HUF	2023.06.30.
Összesen					-3 079 097	HUF	2023.06.30.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	2 365 000	87,840	90,2553	5 712 223	HUF	2023.07.31.
	2024.01.31.	8 141 000	87,860	90,2567	19 509 103	HUF	2023.07.31.
	2024.01.31.	5 900	87,750	90,2494	14 746	HUF	2023.07.31.
CAD/HUF 23.10.10 Forward Eladás	2023.10.10.	680 000	271,406	268,5928	1 912 964	HUF	2023.07.31.
AUD/HUF 23.10.10 Forward Eladás	2023.10.10.	800 000	240,913	238,3543	2 046 991	HUF	2023.07.31.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	570 000	442,370	456,6795	-8 156 389	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	246 000	343,890	359,5648	3 856 012	HUF	2023.07.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 200	86,735	90,1825	4 137	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	74 000	344,976	359,6210	1 083 719	HUF	2023.07.31.
EUR/HUF 23.12.27 Forward Vétel	2023.12.27.	2 017 000	394,352	400,4366	12 273 241	HUF	2023.07.31.
	2023.12.27.	208 000	394,808	400,4613	1 175 880	HUF	2023.07.31.
	2023.12.27.	1 075 000	394,710	400,4560	6 176 919	HUF	2023.07.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	10 546 000	89,000	90,3318	14 045 120	HUF	2023.07.31.
RON/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	2 550 000	77,140	80,1826	-7 759 375	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	52 000	356,050	360,1930	215 437	HUF	2023.07.31.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	935 000	449,460	456,8893	-6 946 398	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	89 000	354,702	360,1234	482 520	HUF	2023.07.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
	2023.12.20.	1 143 000	354,685	360,1225	6 215 067	HUF	2023.07.31.
	2023.12.20.	61 000	354,560	360,1160	338 919	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	4 450 000	355,319	360,1553	-21 520 072	HUF	2023.07.31.
	2023.12.20.	6 245 000	355,705	360,1752	-27 916 374	HUF	2023.07.31.
	2023.12.20.	6 505 000	355,590	360,1693	-29 788 055	HUF	2023.07.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	6 390 000	392,300	399,1919	-44 039 230	HUF	2023.07.31.
	2023.12.15.	7 266 000	391,784	399,1661	-53 638 586	HUF	2023.07.31.
	2023.12.15.	4 365 000	392,170	399,1854	-30 622 253	HUF	2023.07.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Vétel	2023.12.15.	194 000	386,860	398,9203	2 339 693	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	112 000	351,900	359,9786	904 807	HUF	2023.07.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	395 000	388,450	398,9997	-4 167 118	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	2 850 000	353,100	360,0406	-19 780 781	HUF	2023.07.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	405,3511	40 330 621	HUF	2023.07.31.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	404,6879	28 856 593	HUF	2023.07.31.
CZK/HUF 23.11.22 Forward Vétel	2023.11.22.	88 000	16,374	16,4632	7 848	HUF	2023.07.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	1 500 000	390,260	399,0900	-13 245 060	HUF	2023.07.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	11 700	87,897	90,2591	27 636	HUF	2023.07.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	800 000	359,810	360,3873	-461 804	HUF	2023.07.31.
LONG GILT FUTURE Sep23 Vétel	2023.09.27.	25	94,910	96,1300	13 685 655	HUF	2023.07.31.
US LONG BOND(CBT) Sep23 Vétel	2023.09.20.	20	127,125	124,4375	-18 766 275	HUF	2023.07.31.
US 5YR NOTE (CBT) Sep23 Vétel	2023.09.29.	17	105,883	106,8203	5 564 419	HUF	2023.07.31.
	2023.09.29.	17	106,313	106,8203	3 014 063	HUF	2023.07.31.
	2023.09.29.	27	107,328	106,8203	-4 787 032	HUF	2023.07.31.
Összesen					-120 511 294	HUF	2023.07.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 200	86,735	87,2965	674	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	246 000	343,890	357,1141	3 253 140	HUF	2023.08.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	395,2871	52 407 420	HUF	2023.08.31.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	394,7725	41 002 884	HUF	2023.08.31.
CZK/HUF 23.11.22 Forward Vétel	2023.11.22.	88 000	16,374	16,0010	-32 824	HUF	2023.08.31.
RON/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	2 550 000	77,140	78,3707	-3 139 102	HUF	2023.08.31.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	570 000	442,370	448,3092	-3 385 324	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	52 000	356,050	357,5911	80 137	HUF	2023.08.31.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	935 000	449,460	448,4327	960 507	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	89 000	354,702	357,5382	252 440	HUF	2023.08.31.
	2023.12.20.	1 143 000	354,685	357,5375	3 260 464	HUF	2023.08.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
	2023.12.20.	61 000	354,560	357,5326	181 331	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	4 450 000	355,319	357,5624	-9 981 920	HUF	2023.08.31.
	2023.12.20.	6 245 000	355,705	357,5776	-11 694 112	HUF	2023.08.31.
	2023.12.20.	6 505 000	355,590	357,5730	-12 899 711	HUF	2023.08.31.
	2023.12.20.	6 505 000	355,590	357,5730	-12 899 711	HUF	2023.08.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	6 390 000	392,300	390,5699	11 055 050	HUF	2023.08.31.
	2023.12.15.	7 266 000	391,784	390,5506	8 962 000	HUF	2023.08.31.
	2023.12.15.	3 790 000	392,170	390,5651	6 082 695	HUF	2023.08.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Vétel	2023.12.15.	194 000	386,860	390,3658	680 130	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	112 000	351,900	357,4283	619 171	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	2 850 000	353,100	357,4754	-12 469 840	HUF	2023.08.31.
AUD/HUF 23.10.10 Forward Eladás	2023.10.10.	800 000	240,913	228,7934	9 695 671	HUF	2023.08.31.
CAD/HUF 23.10.10 Forward Eladás	2023.10.10.	680 000	271,406	260,6953	7 283 288	HUF	2023.08.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	10 270 000	89,000	87,4140	-16 288 048	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	74 000	344,976	357,1567	901 368	HUF	2023.08.31.
EUR/HUF 23.12.27 Forward Vétel	2023.12.27.	2 017 000	394,352	391,7828	-5 181 501	HUF	2023.08.31.
	2023.12.27.	208 000	394,808	391,8018	-625 297	HUF	2023.08.31.
	2023.12.27.	1 075 000	394,710	391,7977	-3 130 736	HUF	2023.08.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	1 500 000	390,260	390,4934	-350 101	HUF	2023.08.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	11 700	87,897	87,3568	-6 321	HUF	2023.08.31.
	2024.01.31.	5 900	87,750	87,3491	-2 365	HUF	2023.08.31.
	2024.01.31.	8 141 000	87,860	87,3549	-4 114 341	HUF	2023.08.31.
	2024.01.31.	2 365 000	87,840	87,3538	-1 149 830	HUF	2023.08.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	800 000	359,810	357,7386	1 657 150	HUF	2023.08.31.
	2023.12.20.	1 060 000	360,930	357,7825	3 336 359	HUF	2023.08.31.
LONG GILT FUTURE Dec23 Vétel	2023.12.27.	25	94,460	95,5700	12 308 790	HUF	2023.08.31.
US 5YR NOTE (CBT) Dec23 Vétel	2023.12.29.	61	106,258	106,9219	14 152 204	HUF	2023.08.31.
US 10YR NOTE (CBT)Dec23 Vétel	2023.12.19.	24	110,078	111,0313	7 991 839	HUF	2023.08.31.
US LONG BOND(CBT) Dec23 Vétel	2023.12.19.	20	120,078	121,6875	11 245 347	HUF	2023.08.31.
Összesen					67 220 506	HUF	2023.08.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	402,6384	43 585 901	HUF	2023.09.29.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	402,2444	31 849 851	HUF	2023.09.29.
CZK/HUF 23.11.22 Forward Vétel	2023.11.22.	88 000	16,374	16,1936	-15 873	HUF	2023.09.29.
RON/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	2 550 000	77,140	79,5680	-6 192 120	HUF	2023.09.29.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	570 000	442,370	452,7959	-5 942 759	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	52 000	356,050	373,9543	931 024	HUF	2023.09.29.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	935 000	449,460	452,8390	-3 159 384	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	89 000	354,702	373,9176	1 710 211	HUF	2023.09.29.
	2023.12.20.	1 143 000	354,685	373,9172	21 982 396	HUF	2023.09.29.
	2023.12.20.	61 000	354,560	373,9138	1 180 581	HUF	2023.09.29.
	2023.12.20.	4 450 000	355,319	373,9344	-82 837 364	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	6 245 000	355,705	373,9449	-113 908 329	HUF	2023.09.29.
	2023.12.20.	6 505 000	355,590	373,9418	-119 378 445	HUF	2023.09.29.
	2023.12.15.	6 390 000	392,300	398,0028	-36 441 108	HUF	2023.09.29.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	6 966 000	391,784	397,9896	-43 228 476	HUF	2023.09.29.
	2023.12.15.	3 790 000	392,170	397,9995	-22 093 841	HUF	2023.09.29.
	2023.12.15.	194 000	386,860	397,8637	2 134 721	HUF	2023.09.29.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Vétel	2023.12.15.	194 000	386,860	397,8637	2 134 721	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	112 000	351,900	373,8415	2 457 445	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	2 850 000	353,100	373,8741	-59 206 181	HUF	2023.09.29.
AUD/HUF 23.10.10 Forward Eladás	2023.10.10.	800 000	240,913	239,6943	974 927	HUF	2023.09.29.
CAD/HUF 23.10.10 Forward Eladás	2023.10.10.	680 000	271,406	274,8161	-2 318 837	HUF	2023.09.29.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	8 888 000	89,000	86,4020	-23 091 023	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	246 000	343,890	373,6237	7 314 488	HUF	2023.09.29.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 200	86,735	86,3102	-510	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	74 000	344,976	373,6532	2 122 107	HUF	2023.09.29.
EUR/HUF 23.12.27 Forward Vétel	2023.12.27.	2 017 000	394,352	399,0745	9 525 962	HUF	2023.09.29.
	2023.12.27.	208 000	394,808	399,0880	890 234	HUF	2023.09.29.
	2023.12.27.	1 075 000	394,710	399,0851	4 703 217	HUF	2023.09.29.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	290 000	390,260	397,9507	-2 230 293	HUF	2023.09.29.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	11 700	87,897	86,3573	-18 015	HUF	2023.09.29.
	2024.01.31.	5 900	87,750	86,3513	-8 252	HUF	2023.09.29.
	2024.01.31.	8 141 000	87,860	86,3558	-12 247 860	HUF	2023.09.29.
	2024.01.31.	2 365 000	87,840	86,3550	-3 512 113	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	800 000	359,810	374,0565	-11 397 227	HUF	2023.09.29.
	2023.12.20.	1 060 000	360,930	374,0870	-13 946 403	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	120 000	364,980	374,1971	1 106 052	HUF	2023.09.29.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	823 000	83,820	86,1920	1 952 118	HUF	2023.09.29.
GBP/HUF 23.10.16 Forward Eladás	2023.10.16.	1 050 000	448,630	452,8340	-4 414 170	HUF	2023.09.29.
LONG GILT FUTURE Dec23 Vétel	2023.12.27.	25	94,460	94,1600	-3 384 075	HUF	2023.09.29.
US 5YR NOTE (CBT) Dec23 Vétel	2023.12.29.	61	106,258	105,3594	-20 209 788	HUF	2023.09.29.
US 10YR NOTE (CBT)Dec23 Vétel	2023.12.19.	24	110,078	108,0625	-17 838 765	HUF	2023.09.29.
US LONG BOND(CBT) Dec23 Vétel	2023.12.19.	20	120,078	113,7813	-46 440 713	HUF	2023.09.29.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
Összesen					-431 167 349	HUF	2023.09.29.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	120 000	364,980	361,9662	-361 653	HUF	2023.10.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	823 000	83,820	87,1680	2 755 373	HUF	2023.10.31.
AUD/HUF 23.12.12 Forward Eladás	2023.12.12.	780 000	236,248	230,5923	4 411 420	HUF	2023.10.31.
CAD/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	650 000	270,748	261,7841	5 826 505	HUF	2023.10.31.
GBP/HUF 23.12.18 Forward Eladás	2023.12.18.	2 555 000	452,030	441,2945	27 429 234	HUF	2023.10.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 000	86,380	87,2404	860	HUF	2023.10.31.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	389,9791	58 777 139	HUF	2023.10.31.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	389,7143	47 199 234	HUF	2023.10.31.
CZK/HUF 23.11.22 Forward Vétel	2023.11.22.	88 000	16,374	15,6444	-64 201	HUF	2023.10.31.
RON/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	2 550 000	77,140	77,5587	-1 068 407	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	52 000	356,050	361,8176	299 913	HUF	2023.10.31.
	2023.12.20.	89 000	354,702	361,7951	631 304	HUF	2023.10.31.
	2023.12.20.	1 143 000	354,685	361,7948	8 126 532	HUF	2023.10.31.
	2023.12.20.	61 000	354,560	361,7927	441 197	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	4 450 000	355,319	361,8054	-28 863 087	HUF	2023.10.31.
	2023.12.20.	6 245 000	355,705	361,8118	-38 137 018	HUF	2023.10.31.
	2023.12.20.	6 505 000	355,590	361,8099	-40 460 409	HUF	2023.10.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	6 390 000	392,300	386,5238	36 909 825	HUF	2023.10.31.
	2023.12.15.	5 900 000	391,784	386,5161	31 080 787	HUF	2023.10.31.
	2023.12.15.	3 790 000	392,170	386,5219	21 406 437	HUF	2023.10.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Vétel	2023.12.15.	7 000	386,860	386,4422	-2 925	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	112 000	351,900	361,7485	1 103 028	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	2 850 000	353,100	361,7684	-24 705 050	HUF	2023.10.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	8 468 000	89,000	87,3146	-14 271 956	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	246 000	343,890	361,6151	4 360 376	HUF	2023.10.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 200	86,735	87,2505	619	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	74 000	344,976	361,6332	1 232 624	HUF	2023.10.31.
EUR/HUF 23.12.27 Forward Vétel	2023.12.27.	2 017 000	394,352	387,6142	-13 589 460	HUF	2023.10.31.
	2023.12.27.	208 000	394,808	387,6229	-1 494 505	HUF	2023.10.31.
	2023.12.27.	1 075 000	394,710	387,6210	-7 620 650	HUF	2023.10.31.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	90 000	390,260	386,4932	339 012	HUF	2023.10.31.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	11 700	87,897	87,2834	-7 179	HUF	2023.10.31.
	2024.01.31.	5 900	87,750	87,2792	-2 778	HUF	2023.10.31.
	2024.01.31.	8 141 000	87,860	87,2823	-4 704 793	HUF	2023.10.31.
	2024.01.31.	2 365 000	87,840	87,2818	-1 320 230	HUF	2023.10.31.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	140 000	359,810	361,8802	-289 821	HUF	2023.10.31.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
	2023.12.20.	1 060 000	360,930	361,8988	-1 026 926	HUF	2023.10.31.
LONG GILT FUTURE Dec23 Vétel	2023.12.27.	25	94,460	93,1600	-14 205 100	HUF	2023.10.31.
US 5YR NOTE (CBT) Dec23 Vétel	2023.12.29.	61	106,258	104,4766	-38 956 525	HUF	2023.10.31.
US 10YR NOTE (CBT)Dec23 Vétel	2023.12.19.	24	110,078	106,1719	-33 612 188	HUF	2023.10.31.
US LONG BOND(CBT) Dec23 Vétel	2023.12.19.	20	120,078	109,4375	-76 299 666	HUF	2023.10.31.
Összesen					74 340 372	HUF	2023.10.31.
CZK/HUF 24.05.22 Forward Vétel	2024.05.22.	88 000	15,738	15,8554	10 304	HUF	2023.11.30.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	384,3063	65 584 472	HUF	2023.11.30.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	384,1397	54 028 129	HUF	2023.11.30.
RON/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	2 550 000	77,140	76,4530	1 751 052	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	52 000	356,050	348,5862	-388 115	HUF	2023.11.30.
	2023.12.20.	31 000	354,702	348,5778	-189 845	HUF	2023.11.30.
	2023.12.20.	1 143 000	354,685	348,5777	-6 980 669	HUF	2023.11.30.
	2023.12.20.	61 000	354,560	348,5769	-364 970	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	4 450 000	355,319	348,5817	29 982 501	HUF	2023.11.30.
	2023.12.20.	6 245 000	355,705	348,5841	44 470 142	HUF	2023.11.30.
	2023.12.20.	6 505 000	355,590	348,5834	45 578 202	HUF	2023.11.30.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Eladás	2023.12.15.	6 180 000	392,300	380,7491	71 384 424	HUF	2023.11.30.
	2023.12.15.	5 900 000	391,784	380,7467	65 120 133	HUF	2023.11.30.
	2023.12.15.	3 790 000	392,170	380,7485	43 287 450	HUF	2023.11.30.
EUR/HUF 23.12.15 Forward Vétel	2023.12.15.	7 000	386,860	380,7235	-42 956	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	112 000	351,900	348,5602	-374 058	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	2 850 000	353,100	348,5677	12 916 973	HUF	2023.11.30.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	7 372 000	89,000	88,0375	-7 095 284	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	246 000	343,890	348,5099	1 136 500	HUF	2023.11.30.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 200	86,735	87,9966	1 514	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	74 000	344,976	348,5167	262 007	HUF	2023.11.30.
EUR/HUF 23.12.27 Forward Vétel	2023.12.27.	1 962 000	394,352	381,7466	-24 731 226	HUF	2023.11.30.
	2023.12.27.	208 000	394,808	381,7504	-2 715 971	HUF	2023.11.30.
	2023.12.27.	1 075 000	394,710	381,7496	-13 932 409	HUF	2023.11.30.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	11 700	87,897	88,0176	1 411	HUF	2023.11.30.
	2024.01.31.	5 900	87,750	88,0149	1 563	HUF	2023.11.30.
	2024.01.31.	7 955 000	87,860	88,0169	1 246 255	HUF	2023.11.30.
	2024.01.31.	2 365 000	87,840	88,0165	417 533	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Eladás	2023.12.20.	140 000	359,810	348,6098	1 568 021	HUF	2023.11.30.
	2023.12.20.	1 060 000	360,930	348,6169	13 051 909	HUF	2023.11.30.
USD/HUF 23.12.20 Forward Vétel	2023.12.20.	120 000	364,980	348,6423	-1 960 524	HUF	2023.11.30.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
AUD/HUF 23.12.12 Forward Eladás	2023.12.12.	780 000	236,248	230,2955	4 642 936	HUF	2023.11.30.
CAD/HUF 23.12.11 Forward Eladás	2023.12.11.	650 000	270,748	255,8462	9 686 194	HUF	2023.11.30.
GBP/HUF 23.12.18 Forward Eladás	2023.12.18.	2 555 000	452,030	440,8556	28 550 525	HUF	2023.11.30.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	1 000	86,380	87,9901	1 610	HUF	2023.11.30.
LONG GILT FUTURE Mar24 Vétel	2024.03.26.	25	96,320	96,6800	3 954 960	HUF	2023.11.30.
US 10YR NOTE (CBT)Mar24 Vétel	2024.03.19.	24	109,328	109,7969	3 908 025	HUF	2023.11.30.
US 5YR NOTE (CBT) Mar24 Vétel	2024.03.28.	61	106,406	106,8516	9 436 263	HUF	2023.11.30.
US LONG BOND(CBT) Mar24 Vétel	2024.03.19.	20	116,188	116,4375	1 736 900	HUF	2023.11.30.
Összesen					435 905 733	HUF	2023.11.30.
RON/HUF 24.02.12 Forward Eladás	2024.02.12.	2 550 000	76,978	77,3938	-1 059 839	HUF	2023.12.29.
AUD/HUF 24.02.12 Forward Eladás	2024.02.12.	780 000	233,925	237,5471	-2 825 244	HUF	2023.12.29.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	367 000	88,587	88,4349	-55 829	HUF	2023.12.29.
EUR/HUF 24.04.15 Forward Eladás	2024.04.15.	450 000	387,720	389,5922	-842 472	HUF	2023.12.29.
USD/HUF 24.03.21 Forward Eladás	2024.03.21.	1 060 000	353,880	350,1967	3 904 318	HUF	2023.12.29.
	2024.03.21.	4 450 000	353,815	350,1952	16 107 141	HUF	2023.12.29.
	2024.03.21.	6 385 000	353,850	350,1960	23 330 740	HUF	2023.12.29.
	2024.03.21.	9 355 000	353,740	350,1935	33 177 147	HUF	2023.12.29.
CZK/HUF 24.05.22 Forward Vétel	2024.05.22.	88 000	15,738	15,6746	-5 609	HUF	2023.12.29.
CAD/HUF 24.04.11 Forward Eladás	2024.04.11.	650 000	263,180	265,0672	-1 226 679	HUF	2023.12.29.
EUR/HUF 24.04.15 Forward Eladás	2024.04.15.	6 180 000	387,000	389,5713	-15 890 451	HUF	2023.12.29.
	2024.04.15.	5 900 000	386,793	389,5653	-16 356 362	HUF	2023.12.29.
	2024.04.15.	3 790 000	386,790	389,5652	-10 517 923	HUF	2023.12.29.
GBP/HUF 24.04.18 Forward Eladás	2024.04.18.	2 750 000	445,750	446,5169	-2 108 838	HUF	2023.12.29.
USD/HUF 24.09.19 Forward Vétel	2024.09.19.	112 000	356,750	357,3924	71 944	HUF	2023.12.29.
	2024.09.19.	1 143 000	356,789	357,3949	692 221	HUF	2023.12.29.
	2024.09.19.	120 000	356,890	357,4016	61 390	HUF	2023.12.29.
	2024.09.19.	359 000	356,990	357,4082	150 126	HUF	2023.12.29.
USD/HUF 24.06.21 Forward Vétel	2024.06.21.	105 000	355,890	353,8867	-210 317	HUF	2023.12.29.
EUR/HUF 24.06.17 Forward Vétel	2024.06.17.	1 763 000	391,992	392,9646	1 714 686	HUF	2023.12.29.
	2024.06.17.	208 000	392,132	392,9707	174 449	HUF	2023.12.29.
	2024.06.17.	944 000	391,790	392,9558	1 100 511	HUF	2023.12.29.
USD/HUF 24.09.19 Forward Vétel	2024.09.19.	46 000	349,770	356,9321	329 457	HUF	2023.12.29.
EUR/HUF 24.01.19 Forward Eladás	2024.01.19.	1 200 000	438,960	384,6209	65 206 924	HUF	2023.12.29.
	2024.01.19.	1 225 000	428,244	384,5550	53 519 313	HUF	2023.12.29.
PLN/HUF 24.01.31 Forward Vétel	2024.01.31.	7 372 000	89,000	88,4389	-4 136 779	HUF	2023.12.29.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Ügylet	Lejárat	Nyitott	Kötésár	Utolsó h.ár	Érték	Deviza	Nap
	2024.01.31.	1 200	86,735	88,4171	2 018	HUF	2023.12.29.
	2024.01.31.	11 700	87,897	88,4282	6 215	HUF	2023.12.29.
	2024.01.31.	3 900	87,750	88,4268	2 640	HUF	2023.12.29.
	2024.01.31.	7 955 000	87,860	88,4279	4 515 532	HUF	2023.12.29.
	2024.01.31.	2 365 000	87,840	88,4277	1 389 886	HUF	2023.12.29.
LONG GILT FUTURE Mar24 Vétel	2024.03.26.	25	96,320	102,6500	69 660 068	HUF	2023.12.29.
US 10YR NOTE (CBT)Mar24 Vétel	2024.03.19.	24	109,328	112,8906	29 620 620	HUF	2023.12.29.
US 5YR NOTE (CBT) Mar24 Vétel	2024.03.28.	61	106,406	108,7734	50 025 405	HUF	2023.12.29.
US LONG BOND(CBT) Mar24 Vétel	2024.03.19.	20	116,188	124,9375	60 627 000	HUF	2023.12.29.
Összesen					150 220 316	HUF	2023.12.29.

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

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.

A tulajdonosváltással összhangban az AEGON Magyarország Befektetés Alapkezelő Zrt. 2023. május 15-én nevet váltott, VIG Befektetési Alapkezelő Magyarország Zrt-re, majd 2023. augusztus 1-el a közvetlen anyavállalata is megváltoztatta a nevét Alfa Vienna Insurance Group Biztosító Zrt-re.

2023. novemberében az anyavállalatunk két tulajdonosa – a Vienna Insurance Group AG (VIG) és a Corvinus Nemzetközi Befektetési Zrt.-n keresztül a Magyar Állam – megállapodást írtak alá, amelynek értelmében a VIG csoport 55 százalékról 90 százalékra növelte a tulajdoni arányát a magyar vállalatcsoportban – beleértve a VIG csoport összes magyarországi vállalatát – tovább erősítve ezzel operatív irányító szerepét. A tranzakció 2023. november 30-án zárult le. A tranzakcióval az állam által delegált tagok mandátumai is megszűntek.

A Felügyelő Bizottságban bekövetkezett változások a következők voltak 2023-ban, Dr. Berta Adrienn mandátuma 2023. április 14-el megszűnt, helyét Huray Kinga vett át 2023. május 25-től 2023. november 30-ig, tisztsége megszűnt. Mikešy Álmos a Felügyelő Bizottság elnöki mandátuma a tulajdonosi struktúra megváltozásával megszűnt 2023. november 30. napjával. Felügyelő Bizottság új elnöki pozícióját 2023. december 1-jétől Gerhard Lahner tölti be.

Az Alapkezelő Igazgatóságában bekövetkezett változások a következők voltak 2023-ban:

Kadocsa Péter, elnök-vezérigazgató – határozott időtartamra újraválasztva, 2023. október 15. – 2026. december 31.

Kocsis Bálint, adminisztrációs vezérigazgató-helyettes - határozott időtartamra újraválasztva, 2023. október 15. – 2026. december 31.

Loncsák András - határozott időtartamra újraválasztva, 2023. október 15. – 2026. december 31.

Kovács László Gábor – határozott időre megválasztva, 2023. március 20. - 2026. december 31.

Kovács Zsolt, az állam által delegált igazgatósági tag 2022. március 29-én indult mandátuma a tulajdonosi struktúra változásával, 2023. november 30. napján megszűnt.

2023. március az Alap hivatalos dokumentumaiban beépítésre kerültek az ESMA sikerdíj számítás módszertan irányelvnek való megfeleltetés. A fenti változás nem érintette az alap befektetési politikáját.

Az Alap befektetési politikájába, jogszabályi változások miatt a következő módosítás került be: Az Alap eszközeinek legalább 80%-át külföldi eszközökbe fekteti.

Az Alap befektetési politikájában az új sorozatok hozamkorlátjainak meghatározása miatt történt kiegészítés, ez azonban nem érintette érdemben a befektetési politikát.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

Az alap az év során a befektetési politikájának megfelelően kiaknázta a kötvényszályon belüli tág lehetőségeit. A hatékony portfólió kialakításának érdekében az alap tőzsdei határidős ügyleteket is kötött, devizakitettséget csak a befektetési politikában engedélyezett mértéken belül vállalt.

A befektetési politikában 2022 őszén történt változtatás nyomán az alap a feltörekvő piacokra kisebb hangsúlyt fektet, kötvényallokációját a gazdasági ciklus mozgásával összhangban tágabb földrajzi és szektoriális keretek között alakítja.

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)	53	19
Rögzített	481 997 489	380 882 575
Változó	57 744 082	118 927 064
Nyereségrészesedés	0	0

c) javadalmazások és juttatások kiszámításának módja

A bónusz rendszer az Igazgatóság tagjai, a Kockázatkezelési vezető, a Compliance vezető, a Portfólió menedzserek (kivéve junior vagyongazdálkodók) és elemzők, az Értékesítési terület vezetői és szenior kollégái, a Befektetési alap kiválasztási és teljesítménymérési üzletág vezetője, valamint a Back office terület csoportvezetője 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 az MRT (lényeges kockázatot vállaló) munkavállalók esetén a Kockázatkezelési vezető is ellenőriz. Az Igazgatósági tagok és a Kockázatkezelési vezető feladatkiírását a Javadalmazási Bizottság 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.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

e) javadalmazási politika érdemi változásai

2023. évtől a Javadalmazási bizottság dönt az Alapkezelő által alkalmazott javadalmazási és bónusz konstrukciókról, azok kifizetéséről. Támogatást és útmutatást ad a javadalmazási politika kialakításában, működtetésében és nyomon követésében.

Az MRT (lényeges kockázatot vállaló) munkavállalók halasztott bónusz kifizetése esetén küszöbérték került bevezetésre. Amennyiben a munkavállaló tényleges változó javadalmazása eléri a küszöbértéket, úgy a 3 évre vonatkozó halasztási időszakban a halasztott rész az első évben 14 %, majd a következő években 13-13 %.

Amennyiben a munkavállaló tényleges változó javadalmazása nem éri el a küszöbértéket, úgy a teljes változó javadalmazás készpénzben kerül kifizetésre.

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 1,29 %.

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 BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap	HUF	4 év	2

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 egy teljes hozam (total return) típusú befektetési alap, amelynek célja, hogy aktív portfóliókezeléssel olyan kötvény típusú eszközökből álló portfóliót hozzon létre, amely 3 éves időtávon a befektetők számára a referenciamutatónál magasabb évesített tőkenövekedést ér el. E célját elsősorban a globális kötvénypiacokon történő eszkozzallokációval kívánja elérni.

Az alap kizárólag kötvény típusú eszközökbe fektet. Az alap befektetési univerzumának fókuszában fejlett piaci államkötvények, fejlett piaci vállalati kötvények, helyi devizás feltörekvő piaci állampapírok és keménydevizás feltörekvő piaci állam- és vállalati kötvények állnak. Az alap hozamának elsődleges forrása a kötvény típusú eszkozzosztályok közötti eszkozzallokáció. Az eszkozzallokáció alapja az „investment clock” megközelítés, amely a gazdasági adatok elemzésével a nagy régiók növekedési cikluson belüli helyzetét határozza meg. Ez egészíti ki a reálkamatok és inflációs várakozások várható mozgásának előrejelzése, amely szintén rendkívül fontos a kötvénypiacok közti allokáció szempontjából. A portfóliómenedzserek ezek alapján hozzák meg az allokációs döntéseket, az éppen aktuális gazdasági ciklusban a tapasztalatok és a várakozások alapján a legjobban teljesítő kötvény eszkozzosztályt felülsúlyozva. A befektetési folyamat során a portfóliókezelők a teljes alap és az egyes kötvénypiacokon felvett kitétségek kamat- és hitelkockázatát a befektetési cél elérése érdekében optimalizálják.

VIG BondMaxx Total Return Kötvény Befektetési Alap

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 alrendszerben figyeli az egyes tranzakciók megkötésére, az egyes partnerek felé irányuló kitétségre vonatkozó törvényi, szerződéses és belső limiteket, valamint azon befektetési korlátokat, melyeket az Alapkezelő az Alap kezelési szabályzatában felállított és befektetői irányába kommunikált. Az Alapkezelő az Alap vonatkozásában likviditáskezelési rendszert alkalmaz, hogy nyomon követhesse az Alap likviditási kockázatát, valamint, hogy az Alap befektetéseinek likviditási profilja megfeleljen az Alap kötelezettségeinek.

XI. Tőkeáttétel alkalmazása

Az Alap tőkeáttételt csak a törvényben megengedett korlátokon belül vehet fel: A befektetési alap teljes nettósított kockázati kitétsége 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 kitétsége 2023.12.29-én a következő: 1,3.

XII. Eredménykimutatás

	Előző év (eFt)	Tárgyév (eFt)
I. Pénzügyi műveletek bevételei	2 733 111	3 743 782
II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	3 714 378	1 552 710
III. Egyéb bevételek	105	477
IV. Működési költségek	170 560	194 570
V. Egyéb ráfordítások	8 341	8 341
VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
Tárgyévi eredmény (I.-II.+III.-IV.-V.-VI.)	-1 160 062	1 988 638