



**Féléves jelentés
2015.**

**GENERALI TRIUMPH EURÓ ABSZOLÚT
SZÁRMAZTATOTT ALAP**

Generali Triumph Euró Abszolút Származtatott Alap

I. Alapadatok

Nyilvántartásba vétel dátuma	2015. június 23.
Lajstromszáma	1111/613
Típusa	Nyilvános, nyíltvégű származtatott értékpapír befektetési alap
Alapkezelő neve, székhelye	Generali Alapkezelő Zrt. 1066. Bp. Teréz krt. 42-44
Letétkezelő neve, székhelye	UniCredit Bank Hungary Zrt. 1054 Bp. Szabadság tér 5-6.
Vezető forgalmazó neve, székhelye	UniCredit Bank Hungary Zrt. (székhelye: 1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)
Forgalmazó neve, székhelye	Concorde Értékpapír Zrt. (székhely: 1123 Budapest, Alkotás u. 50).
Induló saját tőke	1.450.668,- EUR, amelyet 145.066.800 db 0.01 EUR névértékű bemutatóra szóló dematerializált befektetési jegy testesített meg
ISIN kód	HU0000714977
Előállítási mód	Dematerializált
Befektetési jegyek névértéke	0.01 EUR

II. Vagyonkimutatás

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint.

Vonatkozási dátum			
2015.06.30			
Megnevezés	Eszközérték	Deviza	Arány
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	1,591,462.76	EUR	100.00%
ÖSSZES ESZKÖZ	1,591,982.99	EUR	100.03%
Pénzpiaci eszközök	1,450,668.00	EUR	91.15%
Generali Triumph Euró - EUR számla	1,450,668.00	EUR	91.15%
Követelések	141,314.99	EUR	8.88%
<i>Befektetési jegy Értékesítés</i>	<i>141,314.99</i>	<i>EUR</i>	<i>8.88%</i>
Generali Triumph Euró befektetési jegy	14,900.00	EUR	0.94%
Generali Triumph Euró befektetési jegy	126,414.99	EUR	7.94%
KÖTELEZETTSÉGEK	-520.23	EUR	-0.03%
Díjak	-520.23	EUR	-0.03%
Alapkezelői díj	-417.27	EUR	-0.03%
Befektetési alapok különadója	-11.92	EUR	0.00%
Felügyeleti díj	-5.96	EUR	0.00%
Forgalmazói díj	-11.92	EUR	0.00%
Könyvelési díj	-6.66	EUR	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-51.00	EUR	0.00%
Letétkezelői díj	-15.50	EUR	0.00%
Sikerdíj	0.00	EUR	0.00%

III. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma és az egy jegyre jutó nettó eszközérték

Az Alap forgalomban lévő befektetési jegyeinek száma a tárgyidőszak végén, 2015.06.30-án:

159 201 126 db

Az Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke 2015.06.30-i forgalmazási napra érvényes nettó eszközérték alapján:

0.009997 EUR

IV. Az Alap összetétele

2015.06.30-i forgalmazási napra érvényes nettó eszközértékek alapján.

Megnevezés	2015.06.30	
	Érték (EUR)	Arány
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0.00	0.00%
<i>Allampapírok</i>	0.00	0.00%
<i>Jelzáloglevelek</i>	0.00	0.00%
<i>Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</i>	0.00	0.00%
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	0.00	0.00%
<i>Kollektív befektetési értékpapírok (ETF)</i>	0.00	0.00%
<i>Részvények</i>	0.00	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	0.00	0.00%
<i>Kollektív befektetési értékpapírok (Befektetési jegyek)</i>	0.00	0.00%
Pénzpiaci eszközök	1,450,668.00	91.12%
Követelések	141,314.99	8.88%
ESZKÖZÖK	1,591,982.99	100.00%
KÖTELEZETTSÉGEK	-520.23	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	1,591,462.76	

V.

Az Alap olyan eszközeinek aránya, amelyekre nem likvid jellegüknél fogva különleges szabályok vonatkoznak:

Az Alap a tárgyidőszakban nem tartalmazott illikvid eszközöket.

Az Alap likviditáskezelésével kapcsolatos minden, az adott időszakban kötött új megállapodás:

Az Alap a tárgyidőszakban nem kötött likviditáskezeléssel kapcsolatos új megállapodást.

Az Alap aktuális kockázati profilja és az Alapkezelő által e kockázatok kezelése érdekében alkalmazott kockázatkezelési rendszerek.

Az Alap 2015-ben indul, ezért a kockázati mutató kiszámításához referenciaindexek múltbeli teljesítményét alkalmaztuk a jogszabályi előírásnak megfelelően. Az Alap a 4-es kockázati kategóriába került besorolásra, mert várhatóan tőkéjének több mint 50%-át kötvény jellegű termékekbe és a maradék részét részvényekbe, befektetési alapokba, ETF-ekbe vagy származtatott termékekbe fogja fektetni. A feltüntetett kockázat/nyereség profil idővel változhat.

A Generali Alapkezelő Zrt. a Kbtv.-ben (2014. évi XVI. törvény) és az ABAK-rendeletben (a Bizottság 2012. december 19-i 231/2013/EU felhatalmazáson alapuló rendelete) meghatározott megfelelő kockázatkezelési rendszereket működtet és tart fenn, amely alkalmas az Alap befektetési stratégiája szempontjából releváns kockázatok azonosítására, mérésére és nyomon követésére. Az Alapkezelő évente egyszer felülvizsgálja, és szükség esetén kiigazítja a kockázatkezelési rendszerét.

VI. Az Alap a tárgyidőszakban tőkeáttételt nem alkalmazott.

Budapest, 2015. augusztus 26.

Generali Alapkezelő Zrt.

Generali Alapkezelő Zrt.

