3.számú melléklet

Portfolió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve:	**Generali Rövid Kötvény Alap**
Lajstrom száma:	**1111-239**
Alapkezelő neve:	**Generali Alapkezelő Zrt.**
Letétkezelő neve:	**Unicredit Bank Zrt.**

NEÉ számítás típusa: **T+1 napon számolt (T adatokból); T forgalmazási napra**

Tárgynap (T-nap):		**2022.12.30**
Saját tőke:		**6,598,413,158**

.

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

I. Kötelezettségek			**Összeg/Érték**	
I/1. Hitelállomány (összes):	**Hitelező**	**Futamidő**	**0**	0.000%
			0	0.000%
				0.000%
I/2. Költségek (összes):	**Számítási alap**		**4,866,609**	0.074%
Alapkezelői díj:	NE*0.75%; NE*0.25%		1,901,751	0.029%
Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás)	0.025% / év		565,295	0.009%
Forgalmazói díj	0.05%		807,565	0.012%
Számviteli szolgáltatás díja	711,200 HUF / év		-2,055	0.000%
Könyvvizsgálói díj:	980,000.- / év*		515,367	0.008%
Egyéb díj: Különadó	0.05%		807,565	0.012%
Letétkezelői díj:	NE*0.1156% / év		271,121	0.004%
				0.000%
				0.000%
I/3 Egyéb kötelezettségek (összes):			**0**	0.000%
Értékpapír vételből származó kötelezettségek:			**0**	0.000%
Egyéb kötelezettségek:			**0**	0.000%
				0.000%
		Kötelez. össz.:	***4,866,609***	0.074%
II. Eszközök			**Osszeg/Érték**	
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):		**Névértéken**	**186,326,805**	2.824%
EURO	EUR		10,465,547	0.159%
MAGYAR FORINT	HUF		172,791,859	2.619%
USA DOLLAR	USD		3,069,399	0.047%
				0.000%
II/2. Egyéb követelés (összes):			**0**	0.000%
				0.000%
Értékpapír eladásból származó követelések:			**0**	0.000%
Elhatárolt UNICREDIT számlakamat:			**0**	0.000%
Egyéb követelés:			**0**	0.000%
II/3. Lekötött bankbetétek	**Bank**	**Futamidő**	**0**	0.000%
II/3.1. Max 3 hó lekötésű (összes):			**0**	0.000%
				0.000%
				0.000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):			**0**	0.000%
				0.000%
				0.000%

II/4. Értékpapírok:	Megnev.	Devizanem	Névérték/darabszám *	6,368,026,310	96.508%
II/4.1. Állampapírok (összes):				**3,399,498,077**	51.520%
II/4.1.1. Kötvények (összes):				**3,399,498,077**	51.520%
	2023/C MAK	HUF	33,000,000	31,056,003	0.471%
	2024/B MAK	HUF	200,000,000	179,688,800	2.723%
	2024/C MAK	HUF	56,000,000	47,969,040	0.727%
	2025/B MAK	HUF	223,000,000	201,493,880	3.054%
	2025/C MAK	HUF	139,620,000	107,467,748	1.629%
	2026/E MAK	HUF	278,230,000	213,653,095	3.238%
	2026/F MAK	HUF	235,540,000	174,671,047	2.647%
	2028/B MAK	HUF	50,000,000	41,186,750	0.624%
	2032/G ZÖLD MÁK	HUF	100,000,000	74,809,700	1.134%
	REPHUN 2023/11/22 - USD	USD	208,000	78,846,978	1.195%
	2023/B MAK	HUF	2,950,000	3,054,386	0.046%
	2027/B MAK	HUF	1,030,630,000	1,077,762,771	16.334%
	2029/B MAK	HUF	1,167,560,000	1,167,837,879	17.699%
					0.000%
					0.000%
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes ép. (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:				**2,362,367,385**	35.802%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**2,362,367,385**	35.802%
	CORDIA 2026/I	HUF	100,000,000	82,670,800	1.253%
	Erste 04/02/26 EUR	EUR	300,000	107,977,084	1.636%
	EXIM 2023/4	HUF	100,000,000	102,989,600	1.561%
	EXIM 2023/5	HUF	100,000,000	102,688,700	1.556%
	EXIM 2023/7	HUF	50,000,000	50,859,900	0.771%
	EXIM 2023/8	HUF	50,000,000	49,274,900	0.747%
	FUTUREAL 2031/I ZOLD	HUF	50,000,000	31,387,450	0.476%
	INTL FINANCE CORP	HUF	200,000,000	181,188,000	2.746%
	KFW 2024/08	HUF	150,000,000	150,726,600	2.284%
	MAEXIM 2023/03/29	HUF	47,620,000	48,592,019	0.736%
	MAEXIM 2023/07/13	HUF	150,000,000	150,392,400	2.279%
	MFB 0.01 06/28/23	EUR	500,000	195,994,620	2.970%
	MFB 1% 11/24/2023	HUF	150,000,000	133,929,600	2.030%
	MFB 3.8 23/10/26	EUR	100,000	39,747,867	0.602%
	MOL 2.625 04/28/23	EUR	350,000	142,154,071	2.154%
	MOL 2.625 04/28/23	EUR	200,000	81,230,898	1.231%
	MVM EURO BOND	EUR	106,000	30,379,792	0.460%
	OTP Bank 10NC5 Tier2 07/15/29	EUR	227,000	83,936,464	1.272%
	OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	EUR	350,000	140,669,704	2.132%
	OTP EUR 3.25nc2.25	EUR	125,000	49,873,151	0.756%
	Raiffeisen 5.875 2023	EUR	200,000	81,149,247	1.230%
	Raiffeisen Bank H Zrt	HUF	100,000,000	95,881,200	1.453%
	Raiffeisen Bank Senior	EUR	100,000	41,198,133	0.624%
	Unicredit Spa HUF 2027	HUF	100,000,000	105,040,700	1.592%
	WINGHOLDING 2030/I kötvény	HUF	50,000,000	32,764,200	0.497%
	OTP 5.875 Float 11/49	EUR	150,000	49,670,285	0.753%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3. Részvények (összes):				**0**	0.000%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%

II/4.3.3. Tőzsdén kívüli (összes):			**0**	0.000%
				0.000%
				0.000%
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes):			**606,160,848**	9.186%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			**606,160,848**	9.186%

	OJB2031/I ZÖLD	HUF	160,000,000	97,231,360	1.474%
	TJ24NV01	HUF	297,500,000	305,545,888	4.631%
	TJ25NV01	HUF	200,000,000	203,383,600	3.082%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):				**0**	0.000%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%

II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.6. Kárpótlási jegy (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/5. Származékos ügyletek				**48,926,652**	0.741%
II.5.1. Határidős	Megnev	Tipus (S/L)	Névérték/darabszám	**48,926,652**	0.741%
II./5.1.1. Futures (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II./5.1.2. Forward (összes):				**48,926,652**	0.741%
	EUR/HUF			2,841,083	0.043%
	EUR/HUF			10,909,493	0.165%
	EUR/HUF			6,870,307	0.104%
	EUR/HUF			912,331	0.014%
	EUR/HUF			465,836	0.007%
	EUR/HUF			12,922,474	0.196%
	EUR/HUF			5,709,084	0.087%
	EUR/HUF			2,046,064	0.031%
	EUR/HUF			-1,822,611	-0.028%
	EUR/HUF			-1,078,167	-0.016%
	USD/HUF			9,150,758	0.139%
II.5.2. Opciós	Megnev	Típus	Névérték/darabszám	**0**	0.000%
II/5.2.1. Tőzsdei opciós (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/5.2.2. OTC ill. OTC típusu (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
			Eszk. össz.:	***6,603,279,767***	100.074%

*Megj.: A hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok névértéken, a részvények, befektetési jegyek darabszámban vannak nyilvántartva.