3.számú melléklet

Portfolió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve:	**Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap**
Lajstrom száma:	**1111-284**
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:		**8,022,081,631**

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		**10,275,828**	0.128%
Alapkezelői díj:	NE*1.75%		6,435,794	0.080%
Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás)	0.025% / év		702,928	0.009%
Forgalmazói díj	1.05%, 0.88%, 0.05%, 0.88%,		1,004,182	0.013%
Számviteli szolgáltatás díja	711,200 HUF / év		-2,055	0.000%
Könyvvizsgálói díj:	980,000.- / év*		478,556	0.006%
Egyéb díj: Különadó	0%		877,767	0.011%
Letétkezelői díj:	NE*0.1156% / év		778,656	0.010%
Egyéb díj: Sikerdíj	20%		0	0.000%
				0.000%
I/3 Egyéb kötelezettségek (összes):			**0**	0.000%
Értékpapír vételből származó kötelezettségek:				0.000%
Egyéb kötelezettségek:				0.000%
				0.000%
		Kötelez. össz.:	***10,275,828***	0.128%
II. Eszközök			**Összeg/Érték**	
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):		Névértéken	**660,768,805**	8.237%
ANGOL FONT	GBP		375,521	0.005%
CSEH KORONA	CZK		4,051,187	0.051%
DÁN KORONA	DKK		4,049	0.000%
EURO	EUR		40,468,980	0.504%
HONG KONGI DOLLÁR	HKD		11,642	0.000%
LENGYEL ZLOTY	PLN		1,835,268	0.023%
MAGYAR FORINT	HUF		71,209,053	0.888%
ROMÁN LEJ	RON		33,254,359	0.415%
TÖRÖK LÍRA	TRY		6	0.000%
USA DOLLÁR	USD		509,558,740	6.352%
II/2. Egyéb követelés (összes):			**0**	0.000%
			0	0.000%
Értékpapír eladásból származó követelések:			0	0.000%
Elhatárolt UNICREDIT számlakamat:			0	0.000%
Osztalék			0	0.000%
				0.000%
Egyéb követelés:				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 ***	**7,215,267,317**	89.943%
II/4.1. Állampapírok (összes):			**2,089,984,608**	26.053%
II/4.1.1. Kötvények (összes):			**1,897,240,408**	23.650%
2023/C MÁK	HUF	269,000,000	253,153,479	3.156%
2026/E MÁK	HUF	300,000,000	230,370,300	2.872%
2028/A MÁK	HUF	400,000,000	353,661,200	4.409%
2029/A MÁK	HUF	100,000,000	68,245,500	0.851%
2031/A MÁK	HUF	140,060,000	93,644,956	1.167%
2032/A MÁK	HUF	400,000,000	293,989,600	3.665%
2051/G ZÖLD	HUF	400,000,000	222,386,400	2.772%
REPHUN 2027/02/22 GREEN	EUR	179,000	72,027,477	0.898%
2023/B MÁK	HUF	36,890,000	38,195,353	0.476%
2027/B MÁK	HUF	259,690,000	271,566,143	3.385%
				0.000%
				0.000%
				0.000%
				0.000%
				0.000%
				0.000%
				0.000%
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):			**192,744,200**	2.403%
23/04/19 DKJ	HUF	200,000,000	192,744,200	2.403%

					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 megtestesíto ép.:				**2,010,033,277**	25.056%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,449,608,509**	18.070%
	MFB 0.01 06/28/23	EUR	150,000	58,798,386	0.733%
	MFB 3.8 23/10/26	EUR	150,000	59,621,800	0.743%
	MFBEU2406/1	EUR	100,000	39,063,039	0.487%
	MOL 2.625 04/28/23	EUR	450,000	182,769,520	2.278%
	OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	EUR	400,000	160,765,376	2.004%
	OTP EUR 3.25nc2.25	EUR	250,000	99,746,303	1.243%
	Raiffeisen Bank Senior	EUR	200,000	82,396,266	1.027%
	CORDIA 2026/I	HUF	100,000,000	82,670,800	1.031%
	EXIM 2023/4	HUF	100,000,000	102,989,600	1.284%
	FUTUREAL 2031/I ZÖLD	HUF	50,000,000	31,387,450	0.391%
	INTL FINANCE CORP	HUF	100,000,000	90,594,000	1.129%
	KFW 2024/08	HUF	200,000,000	200,968,800	2.505%
	MAEXIM 2023/03/29	HUF	47,620,000	48,592,019	0.606%
	MAEXIM 2023/07/13	HUF	100,000,000	100,261,600	1.250%
	MFB 202410/1	HUF	50,000,000	43,455,150	0.542%
	WINGHOLDING 2030/I kötvény	HUF	100,000,000	65,528,400	0.817%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes):				**560,424,768**	6.986%
	CESKA SPORITELNA AS	EUR	500,000	206,302,459	2.572%
	Erste 04/02/26 EUR	EUR	400,000	143,969,445	1.795%
	NOVALJ 10NC5 28/11/32	EUR	100,000	40,746,451	0.508%
	NOVALJ 3.4 02/05/30	EUR	500,000	169,406,413	2.112%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3. Részvények (összes):				**1,796,073,100**	22.389%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,192,766,600**	14.869%
	AKKO Invest	HUF	240,500	64,454,000	0.803%
	Állami Nyomda	HUF	32,500	48,750,000	0.608%
	Alteo	HUF	75,000	240,000,000	2.992%
	AutoWallis	HUF	1,005,500	96,729,100	1.206%
	DM-KER	HUF	325,000	13,585,000	0.169%
	Duna House	HUF	55,500	22,866,000	0.285%
	Graphisoft Park SE (230214-ig)	HUF	17,500	55,475,000	0.692%
	Masterplast	HUF	22500	85,950,000	1.071%
	MOL	HUF	40,000	104,080,000	1.297%
	MTelekom (MATÁV)	HUF	225,000	76,275,000	0.951%
	OTP	HUF	19,500	197,145,000	2.458%
	OXO Technologies Holding Nyrt. (230118-ig)	HUF	9,500	26,600,000	0.332%
	Pannergy	HUF	20,500	26,957,500	0.336%
	Richter	HUF	13,000	107,900,000	1.345%
	Waberers International Zrt.	HUF	12,500	26,000,000	0.324%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):				**603,306,500**	7.521%
	Komercni Banka	CZK	2,100	22,805,790	0.284%
	Moneta Money Bank	CZK	24,000	30,241,920	0.377%
	Adidas AG	EUR	500	25,507,933	0.318%
	Erste Bank	EUR	3,400	40,689,415	0.507%
	Krka	EUR	2,500	92,057,500	1.148%
	Marinomed Biotech	EUR	360	8,126,676	0.101%
	HRVATSKI Telecom (221231-ig)	HRK	5,500	51,848,638	0.646%
	Bank Pekao	PLN	3,000	22,148,325	0.276%
	PKO Bank Polski	PLN	4,500	11,633,632	0.145%
	Banca Transilvania SA	RON	24,891	40,102,627	0.500%
	BRD-Groupe Societe Generale	RON	28,000	29,440,320	0.367%
	Fondul Prop	RON	1,000,000	164,995,200	2.057%
	OMV Petrom	RON	1,875,457	63,708,524	0.794%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.3. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes):				**295,727,337**	3.686%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**295,727,337**	3.686%
	TJ24NV01	HUF	287,940,000	295,727,337	3.686%
					0.000%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):				**1,023,448,995**	12.758%

II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,023,448,995**	12.758%
	Accorde Első Román Részvényalap I sorozat	HUF	40,000,000	82,537,200	1.029%
	Accorde Spartan Görög Rvalap. I sorozat	HUF	76,553,245	86,941,903	1.084%
	Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Alapja	EUR	5	244,382,548	3.046%
	Erste Ingatlanbefeketetési Alap	HUF	146,077,420	425,012,253	5.298%
	Magyar Posta Ingatlan Alap A sorozat	HUF	129,750,826	184,575,091	2.301%
	NAP Ingatlanfejlesztő Befektetési Alap B soroza	HUF	10,000	0	0.000%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
II/4.5.3. Külföldi befektetési jegyek (összes):				**0**	0.000%

					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.6. Kárpótlási jegy (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/5. Származékos ügyletek				**156,321,337**	1.949%
II.5.1. Határidős	Megnev	Típus (S/L)	Névérték/darabszám	**156,321,337**	1.949%
II./5.1.1. Futures (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II./5.1.2. Forward (összes):				**156,321,337**	1.949%
	EUR/HUF	S		4,419,462	0.055%
	EUR/HUF	S		1,424,600	0.018%
	EUR/HUF	S		11,033,443	0.138%
	EUR/HUF	S		61,069,392	0.761%
	EUR/HUF	S		1,683,222	0.021%
	EUR/HUF	S		1,900,690	0.024%
	EUR/HUF	S		4,747,662	0.059%
	EUR/HUF	S		4,039,105	0.050%
	EUR/HUF	S		484,277	0.006%
	EUR/HUF	S		931,672	0.012%
	EUR/HUF	S		7,612,111	0.095%
	EUR/HUF	S		582,733	0.007%
	EUR/HUF	S		-1,822,611	-0.023%
	EUR/HUF	S		-2,213,079	-0.028%
	USD/HUF	S		60,428,658	0.753%
					0.000%
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 típusú (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
			Eszk. össz.:	***8,032,357,459***	100.128%

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