3.számú melléklet

Portfolió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve:	**Generali Triumph Abszolút Származtatott Alap**
Lajstrom száma:	**1111-613**
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:		**5,931,372,196**

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

I. Kötelezettségek				**Összeg/Érték**	
I/1. Hitelállomány (összes):		Hitelező	Futamidő	**0.00**	0.000%
				0.00	0.000%
					0.000%
I/2. Költségek (összes):		Számítási alap		**11,277,579.00**	0.190%
Alapkezelői díj:		NE*1.75%		8,519,210.00	0.144%
Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás)		0.025% / év		506,884.00	0.009%
Forgalmazói díj		1.05%, 0.88%, 0.05%, 0.88%,		724,121.00	0.012%
Számviteli szolgáltatás díja		66,291 HUF / év		-2,055.00	0.000%
Könyvvizsgálói díj:		920,000.- / év*		294,496.00	0.005%
Egyéb díj: Különadó		0.05%		672,168.00	0.011%
Letétkezelői díj:		NE*0.1156% / év		562,755.00	0.009%
Egyéb díj: Sikerdíj		20.00%		0.00	0.000%
					0.000%
I/3 Egyéb kötelezettségek (összes):				**1,084,761.00**	0.018%
Értékpapír vételből származó kötelezettségek:					0.000%
Egyéb kötelezettségek:	FWD eredmény			379,240.00	0.006%
	Befektetési jegy Visszaváltás			705,521.00	0.012%
			Kötelez. össz.:	***12,362,340.00***	0.208%
II. Eszközök				**Összeg/Érték**	
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):			Névértéken	**731,895,563**	12.339%
ANGOL FONT		GBP		37,118	0.001%
CSEH KORONA		CZK		163,737	0.003%
DÁN KORONA		DKK		31,770	0.001%
EURO		EUR		263,080,277	4.435%
LENGYEL ZLOTY		PLN		399,447	0.007%
MAGYAR FORINT		HUF		327,495,641	5.521%
ROMÁN LEJ		RON		288,444	0.005%
TÖRÖK LÍRA		TRY		7	0.000%
USA DOLLÁR		USD		140,399,120	2.367%
II/2. Egyéb követelés (összes):				**8,860,809.00**	0.149%
					0.000%
Értékpapír eladásból származó követelések:				0.00	0.000%
Elhatárolt UNICREDIT számlakamat:				0.00	0.000%
Osztalék				0.00	0.000%
Egyéb követelés:	FWD eredmény			7,880,000.00	0.133%
	Befektetési jegy Értékesítés			980,809.00	0.017%
II/3. Lekötött bankbetétek		Bank	Futamidő	**0.00**	0.000%
II/3.1. Max 3 hó lekötésű (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/3.2. 3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%

II/4. Értékpapírok:	Megnev.	Devizanem	Névérték/darabszám *	5,158,346,024.00	86.967%
II/4.1. Állampapírok (összes):				**1,374,832,928.00**	23.179%
II/4.1.1. Kötvények (összes):				**1,374,832,928.00**	23.179%
	2025/C MÁK	HUF	200,000,000	153,943,200.00	2.595%
	2032/G ZÖLD MÁK	HUF	300,000,000	224,429,100.00	3.784%
	2034/A MÁK	HUF	100,000,000	56,858,100.00	0.959%
	2038/A MÁK	HUF	100,000,000	54,122,900.00	0.912%
	2041/A MÁK	HUF	200,000,000	104,737,600.00	1.766%
	2051/G ZÖLD	HUF	179,900,000	100,018,283.00	1.686%
	REPHUN 2023/11/22 - USD	USD	500,000	189,536,007.00	3.195%
	REPHUN 2027/02/22 GREEN	EUR	71,000	28,569,557.00	0.482%
	ROMANI 4.875 01/22/24	USD	500,000	191,182,801.00	3.223%
	2027/B MÁK	HUF	250,000,000	261,433,000.00	4.408%
	2029/B MÁK	HUF	10,000,000	10,002,380.00	0.169%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.1.3. Egyéb jegybankképes ép. (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:				**2,235,532,659.00**	37.690%
II/4.2.1. Tozsdére bevezetett (összes):				**1,861,383,801.00**	31.382%
	MFB 0.01 06/28/23	EUR	100,000	39,198,924.00	0.661%
	MFB 3.8 23/10/26	EUR	150,000	59,621,800.00	1.005%
	MFBEU2406/1	EUR	100,000	39,063,039.00	0.659%
	MOL 2.625 04/28/23	EUR	550,000	223,384,968.00	3.766%
	OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	EUR	300,000	120,574,032.00	2.033%
	OTP EUR 3.25nc2.25	EUR	188,000	75,009,219.00	1.265%
	Raiffeisen 5.875 2023	EUR	200,000	81,149,247.00	1.368%
	Raiffeisen Bank Senior	EUR	200,000	82,396,266.00	1.389%
	CORDIA 2026/I	HUF	100,000,000	82,670,800.00	1.394%
	EXIM 2023/4	HUF	100,000,000	102,989,600.00	1.736%
	EXIM 2023/7	HUF	50,000,000	50,859,900.00	0.857%
	INTL FINANCE CORP	HUF	200,000,000	181,188,000.00	3.055%
	KFW 2024/08	HUF	150,000,000	150,726,600.00	2.541%
	MAEXIM 2023/03/29	HUF	23,810,000	24,296,010.00	0.410%
	MAEXIM 2023/07/13	HUF	150,000,000	150,392,400.00	2.536%
	MAEXIM 2029/05/23	HUF	100,000,000	64,555,700.00	1.088%
	MFB 1% 11/24/2023	HUF	100,000,000	89,286,400.00	1.505%
	MFB 202301/1	HUF	100,000,000	101,574,500.00	1.712%
	MFB 202410/1	HUF	50,000,000	43,455,150.00	0.733%
	WINGHOLDING 2030/I kötvény	HUF	50,000,000	32,764,200.00	0.552%
	OTP 5.875 Float 11/49	EUR	200,000	66,227,046.00	1.117%
					0.000%
II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes):				**374,148,858.00**	6.308%
	CESKA SPORITELNA AS	EUR	300,000	123,781,475.00	2.087%
	Erste 04/02/26 EUR	EUR	300,000	107,977,084.00	1.820%
	NOVALJ 10NC5 28/11/32	EUR	100,000	40,746,451.00	0.687%
	NOVALJ 3.4 02/05/30	CZK	300,000	101,643,848.00	1.714%
II/4.2.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3. Részvények (összes):				**406,606,543.00**	6.855%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**306,319,338.00**	5.164%
	Allami Nyomda	HUF	20,000	30,000,000.00	0.506%
	Alteo	HUF	25,000	80,000,000.00	1.349%
	AutoWallis	HUF	170,569	16,408,738.00	0.277%
	Duna House	HUF	17,050	7,024,600.00	0.118%
	Graphisoft Park SE (230214-ig)	HUF	8,700	27,579,000	0.465%
	Masterplast	HUF	7,000	26,740,000	0.451%
	OTP	HUF	10,500	106,155,000	1.790%
	OTT-ONE	HUF	10,000	1,492,000	0.025%
	OXO Technologies Holding Nyrt. (230	HUF	3,900	10,920,000	0.184%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):				**100,287,205.00**	1.691%
	CEZ	CZK	2,500	31,916,500.00	0.538%
	ING Groep	EUR	15,000	68,370,705.00	1.153%
					0.000%
					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):				**382,857,205**	6.455%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**382,857,205**	6.455%
	OJB2031/I ZÖLD	HUF	80,000,000	48,615,680.00	0.820%
	TJ24NV01	HUF	325,440,000	334,241,525.00	5.635%
					0.000%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):				**758,516,689**	12.788%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**0**	0.000%
					0.000%

					0.000%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**412,804,702**	6.960%
	Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Ala	EUR	3	146,629,530	2.472%
	Erste Ingatlanbefeketetési Alap	HUF	41,266,042	120,063,549	2.024%
	Erste EURO Ingatlan Alap	EUR	247,845	146,111,623	2.463%
II/4.5.3. Külföldi befektetési jegyek (összes):				**345,711,987**	5.829%
	SPDR Gold Trust	USD	1,500	95,595,533	1.612%
	iShares DJ Select Dividend Index	USD	1,100	49,837,709	0.840%
	iShares Euro Stoxx Banks 30	EUR	30,000	111,645,735	1.882%
	iShares iBoxx $ High Yield Corporate	USD	1,200	33,193,582	0.560%
	L&G DAX Daily 2X short UCITS ETF	EUR	80,000	55,439,428	0.935%
II/4.6. Kárpótlási jegy (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%

II/5. Származékos ügyletek				**44,632,140.00**	0.752%
II.5.1. Határidős	Megnev	Tipus (S/L)	Névérték/darabszám	**44,632,140**	0.752%
II./5.1.1. Futures (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II./5.1.2. Forward (összes):				**44,632,140.00**	0.752%
	EUR/HUF	S		4,419,462	0.075%
	EUR/HUF	S		9,421,836	0.159%
	EUR/HUF	S		45,802,044	0.772%
	EUR/HUF	S		625,197	0.011%
	EUR/HUF	S		1,444,525	0.024%
	EUR/HUF	S		3,165,108	0.053%
	EUR/HUF	S		3,088,728	0.052%
	EUR/HUF	S		484,277	0.008%
	EUR/HUF	S		931,672	0.016%
	EUR/HUF	S		-63,181,800	-1.065%
	EUR/HUF	S		4,747,637	0.080%
	EUR/HUF	S		-24,025,400	-0.405%
	EUR/HUF	S		-39,651,118	-0.668%
	EUR/HUF	S		20,132,032	0.339%
	EUR/HUF	S		362,127	0.006%
	EUR/HUF	S		-1,822,611	-0.031%
	EUR/HUF	S		-897,239	-0.015%
	USD/HUF	S		28,330,548	0.478%
	USD/HUF	S		21,763,022	0.367%
	USD/HUF	S		35,272,295	0.595%
	USD/HUF	S		2,168,475	0.037%
	USD/HUF	S		-7,948,677	-0.134%
II.5.2. Opciós	Megnev	Típus	Névérték/darabszám	**0**	0.000%
II/5.2.1. Tőzsdei opciós (összes):				**0**	0.000%
				0	0.000%
					0.000%
II/5.2.2. OTC ill. OTC típusú (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
			Eszk. össz.:	***5,943,734,535.76***	100.208%

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