



**Féléves jelentés  
2023.**

**GENERALI SPIRIT ABSZOLÚT  
SZÁRMAZTATOTT ALAP**

# Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap

## I. Alapadatok

<b>Az Alap működési formája:</b>	nyilvános
<b>Az Alap fajtája:</b>	nyíltvégű
<b>Az Alap elsődleges eszközkategóriájának típusa:</b>	értékpapíralap
<b>Az Alap futamideje:</b>	határozatlan
<b>Az Alap harmonizációja:</b>	ÁÉKBV-irányelv alapján nem harmonizált
<b>Alapkezelő neve, székhelye:</b>	Generali Alapkezelő Zrt. (székhely: 1066. Budapest, Teréz krt. 42-44.)
<b>Letétkezelő neve, székhelye:</b>	UniCredit Bank Hungary Zrt. (székhely: 1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)
<b>Vezető forgalmazó neve, székhelye:</b>	UniCredit Bank Hungary Zrt. (székhely: 1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)
<b>Forgalmazók nevei, székhelyei:</b>	<b>Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap „A” sorozat forgalmazói:</b> Concorde Értékpapír Zrt. (székhely: 1123 Budapest, Alkotás u. 55-61.) Erste Befektetési Zrt. (székhely: 1138 Budapest, Népfürdő u. 24-26.) KBC Securities Magyarországi Fióktelepe (székhely:1095 Budapest, Lechner Ödön fasor 10.) MBH Bank Nyrt. (székhely: 1056 Budapest Váci utca 38.) MBH Befektetési Bank Zrt. (székhely: 1117 Budapest, Magyar Tudósok körútja 9. G. ép.) Raiffeisen Bank Zrt. (székhely: 1133 Budapest, Váci út 116-118.) SPB Befektetési Zrt. (székhely: 1051 Budapest, Vörösmarty tér 7-8.) <b>Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap „B” sorozat forgalmazói:</b> UniCredit Bank Hungary Zrt. (székhely: 1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.)
<b>Az Alap által kibocsátott befektetési jegyek ISIN kódja, névértéke:</b>	„A” sorozat: HU0000706833; névérték: 1,- Ft „B” sorozat: HU0000719992; névérték: 1,- Ft

## II. Vagyonkimutatás

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint az időszak elején és végén (2022.12.30-ra és 2023.06.30-ra érvényes nettó eszközértékek alapján).

### Vonatkozási dátum

2022.12.30

### Megnevezés

	Eszközérték	Deviza	Arány
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>8,022,081,634</b>	<b>HUF</b>	<b>100.00%</b>
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>8,032,357,462</b>	<b>HUF</b>	<b>100.13%</b>
<b>Pénzpiaci eszközök</b>	<b>660,768,808</b>	<b>HUF</b>	<b>8.22%</b>
Generali Spirit Absz. Hoz. - CZK	4,051,187	HUF	0.05%
Generali Spirit Absz. Hoz. - DKK	4,049	HUF	0.00%
Generali Spirit Absz. Hoz. - EUR	40,468,980	HUF	0.50%
Generali Spirit Absz. Hoz. - GBP	375,521	HUF	0.00%
Generali Spirit Absz. Hoz. - HKD	11,642	HUF	0.00%
Generali Spirit Absz. Hoz. - HUF	71,209,053	HUF	0.89%
Generali Spirit Absz. Hoz. - PLN	1,835,269	HUF	0.02%
Generali Spirit Absz. Hoz. - RON	33,254,360	HUF	0.41%
Generali Spirit Absz. Hoz. - TRY	6	HUF	0.00%
Generali Spirit Absz. Hoz. - USD	509,558,741	HUF	6.35%
<b>Állampapírok</b>	<b>2,089,984,608</b>	<b>HUF</b>	<b>26.05%</b>
<i>Államkötvény</i>	<i>1,897,240,408</i>	<i>HUF</i>	<i>23.65%</i>
2023/B MÁK	38,195,353	HUF	0.47%
2023/C MÁK	253,153,479	HUF	3.16%
2026/E MÁK	230,370,300	HUF	2.87%
2027/B MÁK	271,566,143	HUF	3.39%
2028/A MÁK	353,661,200	HUF	4.41%
2029/A MÁK	68,245,500	HUF	0.85%
2031/A MÁK	93,644,956	HUF	1.17%
2032/A MÁK	293,989,600	HUF	3.66%
2051/G ZÖLD	222,386,400	HUF	2.77%
REPHUN 2027/02/22 GREEN	72,027,477	HUF	0.90%
<i>Diszkont kincstárjegy</i>	<i>192,744,200</i>	<i>HUF</i>	<i>2.40%</i>
23/04/19 DKJ	192,744,200	HUF	2.40%
<b>Kollektív befektetési értékpapírok (Befektetési jegy)</b>	<b>1,023,448,995</b>	<b>HUF</b>	<b>12.76%</b>
Accorde Első Román Részvényalap I sorozat	82,537,200	HUF	1.03%
Accorde Spartan Görög Rvalap. I sorozat	86,941,903	HUF	1.08%
Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Alapja	244,382,548	HUF	3.05%
Erste Ingatlanbefektetési Alap	425,012,253	HUF	5.30%
Magyar Posta Ingatlan Alap A sorozat	184,575,091	HUF	2.30%
<b>Jelzáloglevél</b>	<b>295,727,337</b>	<b>HUF</b>	<b>3.69%</b>
TJ24NV01	295,727,337	HUF	3.69%
<b>Részvények</b>	<b>1,796,073,100</b>	<b>HUF</b>	<b>22.41%</b>
Adidas AG	25,507,933	HUF	0.31%
AKKO Invest	64,454,000	HUF	0.80%
Állami Nyomda	48,750,000	HUF	0.61%
Alteo	240,000,000	HUF	2.99%
AutoWallis	96,729,100	HUF	1.21%
Banca Transilvania SA	40,102,627	HUF	0.50%
Bank Pekao	22,148,325	HUF	0.28%

BRD-Groupe Societe Generale	29,440,320	HUF	0.37%
DM-KER	13,585,000	HUF	0.17%
Duna House	22,866,000	HUF	0.29%
Erste Bank	40,689,415	HUF	0.51%
Fondul Prop	164,995,200	HUF	2.06%
Graphisoft Park SE (230214-ig)	55,475,000	HUF	0.69%
HRVATSKI Telecom (221231-ig)	51,848,638	HUF	0.65%
Komercni Banka	22,805,790	HUF	0.28%
Krka	92,057,500	HUF	1.15%
Marinomed Biotech	8,126,676	HUF	0.10%
Masterplast	85,950,000	HUF	1.07%
MOL	104,080,000	HUF	1.30%
Moneta Money Bank	30,241,920	HUF	0.38%
MTelekom (MATÁV)	76,275,000	HUF	0.95%
OMV Petrom	63,708,524	HUF	0.79%
OTP	35,385,000	HUF	0.44%
OTP	161,760,000	HUF	2.02%
OXO Technologies Holding Nyrt. (230118-ig)	26,600,000	HUF	0.33%
Pannergy	26,957,500	HUF	0.34%
PKO Bank Polski	11,633,632	HUF	0.15%
Richter	107,900,000	HUF	1.35%
Waberers International Zrt.	26,000,000	HUF	0.32%
<b>Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>2,010,033,277</b>	<b>HUF</b>	<b>25.05%</b>
CESKA SPORITELNA AS	206,302,459	HUF	2.57%
CORDIA 2026/I	82,670,800	HUF	1.03%
Erste 04/02/26 EUR	143,969,445	HUF	1.79%
EXIM 2023/4	102,989,600	HUF	1.28%
FUTUREAL 2031/I ZÖLD	31,387,450	HUF	0.39%
INTL FINANCE CORP	90,594,000	HUF	1.13%
KFW 2024/08	200,968,800	HUF	2.51%
MAEXIM 2023/03/29	48,592,019	HUF	0.61%
MAEXIM 2023/07/13	100,261,600	HUF	1.25%
MFB 0.01 06/28/23	58,798,386	HUF	0.73%
MFB 202410/1	43,455,150	HUF	0.54%
MFB 3.8 23/10/26	59,621,800	HUF	0.74%
MFBEU2406/1	39,063,039	HUF	0.49%
MOL 2.625 04/28/23	182,769,520	HUF	2.28%
NOVALJ 10NC5 28/11/32	40,746,451	HUF	0.51%
NOVALJ 3.4 02/05/30	169,406,413	HUF	2.11%
OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	160,765,376	HUF	2.00%
OTP EUR 3.25nc2.25	99,746,303	HUF	1.24%
Raiffeisen Bank Senior	82,396,266	HUF	1.03%
WINGHOLDING 2030/I kötvény	65,528,400	HUF	0.82%
<b>Deviza fedezeti ügyletek</b>	<b>156,321,337</b>	<b>HUF</b>	<b>1.95%</b>
EUR/HUF	4,747,662	HUF	0.06%
EUR/HUF	931,672	HUF	0.01%
EUR/HUF	-1,822,611	HUF	-0.02%
EUR/HUF	4,419,462	HUF	0.06%
EUR/HUF	61,069,392	HUF	0.76%
EUR/HUF	11,033,443	HUF	0.14%
EUR/HUF	4,039,105	HUF	0.05%
EUR/HUF	7,612,111	HUF	0.09%
EUR/HUF	1,424,600	HUF	0.02%
EUR/HUF	582,733	HUF	0.01%
EUR/HUF	1,900,690	HUF	0.02%

EUR/HUF	484,277	HUF	0.01%
EUR/HUF	1,683,222	HUF	0.02%
EUR/HUF	-2,213,079	HUF	-0.03%
USD/HUF	60,428,658	HUF	0.75%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-10,275,828</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.13%</b>
<b>Díjak</b>	<b>-10,275,828</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.13%</b>
Alapkezelői díj	-6,435,794	HUF	-0.08%
Felügyeleti díj	-702,928	HUF	-0.01%
Forgalmazói díj	-1,004,182	HUF	-0.01%
Könyvelési díj	2,055	HUF	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-478,556	HUF	-0.01%
Különadó	-877,767	HUF	-0.01%
Letétkezelői díj	-778,656	HUF	-0.01%

#### Vonatkozási dátum

2023.06.30

#### Megnevezés

**Eszközérték Deviza Arány**

<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>8,537,362,037</b>	<b>HUF</b>	<b>100.00%</b>
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>8,583,787,436</b>	<b>HUF</b>	<b>100.53%</b>
<b>Pénzpiaci eszközök</b>	<b>453,285,815</b>	<b>HUF</b>	<b>5.34%</b>
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - CZK	7,031,797	HUF	0.09%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - DKK	3,748	HUF	0.00%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - EUR	233,771,234	HUF	2.75%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - GBP	365,640	HUF	0.00%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - HKD	10,564	HUF	0.00%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - HUF	200,399,972	HUF	2.36%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - PLN	1,849,285	HUF	0.02%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - RON	4,847,679	HUF	0.06%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - TRY	4	HUF	0.00%
Generali Spirit Abszolút Származtatott Alap - USD	5,005,892	HUF	0.06%
<b>Állampapírok</b>	<b>1,958,339,787</b>	<b>HUF</b>	<b>22.93%</b>
<i>Államkötvény</i>	<i>1,958,339,787</i>	<i>HUF</i>	<i>22.93%</i>
2023/B MÁK	7,121,594	HUF	0.09%
2023/C MÁK	268,988,164	HUF	3.15%
2026/E MÁK	247,710,900	HUF	2.90%
2026/H MÁK	106,439,100	HUF	1.25%
2027/B MÁK	10,050,206	HUF	0.12%
2028/A MÁK	403,303,200	HUF	4.72%
2029/A MÁK	76,343,500	HUF	0.89%
2031/A MÁK	111,946,316	HUF	1.31%
2032/A MÁK	175,673,400	HUF	2.06%
2038/A MÁK	133,546,800	HUF	1.56%
2041/A MÁK	61,857,100	HUF	0.72%
2051/G ZÖLD	130,177,400	HUF	1.52%
REPHUN 2027/02/22 GREEN	69,008,116	HUF	0.81%
REPHUN 2031/06/16 - EUR	156,173,991	HUF	1.83%
<b>Kollektív befektetési értékpapírok (Befektetési jegy)</b>	<b>1,337,864,745</b>	<b>HUF</b>	<b>15.68%</b>

Accorde Első Román Részvényalap I sorozat	84,440,560	HUF	0.99%
Accorde Spartan Görög Rvalap. I sorozat	112,356,432	HUF	1.32%
Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Alapja	226,488,110	HUF	2.65%
Erste Ingatlanbefektetési Alap	460,187,696	HUF	5.39%
Generali Gold A	255,708,529	HUF	3.00%
Magyar Posta Ingatlan Alap A sorozat	198,683,418	HUF	2.33%
<b>Kollektív befektetési értékpapírok (ETF)</b>	<b>141,009,231</b>	<b>HUF</b>	<b>1.65%</b>
iShares Euro Stoxx Banks 30	128,167,519	HUF	1.50%
iShares MSCI USA Momentum Fact ETF	12,841,712	HUF	0.15%
<b>Részvények</b>	<b>2,085,402,396</b>	<b>HUF</b>	<b>24.38%</b>
Accenture	15,531,695	HUF	0.18%
Adobe	15,571,006	HUF	0.18%
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,522,447	HUF	0.18%
AKKO Invest	50,264,500	HUF	0.59%
Állami Nyomda	56,550,000	HUF	0.66%
Alteo	89,780,000	HUF	1.05%
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,696,332	HUF	0.30%
Analog	16,809,142	HUF	0.20%
Apple	27,828,022	HUF	0.33%
Applied Materials	21,528,366	HUF	0.25%
AutoWallis	96,930,200	HUF	1.14%
Banca Transilvania SA	38,604,378	HUF	0.45%
Bank Pekao	27,718,836	HUF	0.32%
BRD-Groupe Societe Generale	27,680,565	HUF	0.32%
Broadcom Ltd.	28,512,771	HUF	0.33%
CAMPBELL SOUP CO	10,361,031	HUF	0.12%
Cisco Systems	10,204,287	HUF	0.12%
COPART INC	20,861,843	HUF	0.24%
Deere	20,533,084	HUF	0.24%
DM-KER	11,050,000	HUF	0.13%
DR Horton	21,958,328	HUF	0.26%
Duna House	31,080,000	HUF	0.36%
Erste Bank	40,492,510	HUF	0.47%
FAIR ISAAC CORP	21,888,807	HUF	0.26%
Gartner	21,110,521	HUF	0.25%
Graphisoft Park SE	54,036,528	HUF	0.63%
HEICO CORP	15,448,985	HUF	0.18%
HOLOGIC INC	15,553,236	HUF	0.18%
HRVATSKI Telecom	51,438,618	HUF	0.60%
Keysight Technologies IN	17,372,469	HUF	0.20%
Komercni Banka	21,810,884	HUF	0.26%
Marinomed Biotech	5,277,469	HUF	0.06%
Masco	11,277,327	HUF	0.13%
Masterplast	55,800,000	HUF	0.65%
MERCK & CO. INC.	15,053,133	HUF	0.18%
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	16,616,905	HUF	0.19%
Micron Technology	10,804,432	HUF	0.13%

MOL	119,520,000	HUF	1.40%
Moneta Money Bank	29,934,576	HUF	0.35%
MTelekom (MATÁV)	91,012,500	HUF	1.07%
OMV Petrom	70,123,337	HUF	0.82%
OTP	236,535,000	HUF	2.77%
OTP	194,080,000	HUF	2.27%
OXO Technologies Holding Nyrt.	24,680,145	HUF	0.29%
Pannergy	23,062,500	HUF	0.27%
PKO Bank Polski	13,565,468	HUF	0.16%
Qualcomm	13,776,642	HUF	0.16%
Richter	109,460,000	HUF	1.28%
SYNOPSYS INC	28,475,117	HUF	0.33%
TransDigm Group	16,532,846	HUF	0.19%
VISA INC.	12,278,286	HUF	0.14%
Waberers International Zrt.	26,250,000	HUF	0.31%
Walgreens Boots Alliance Inc	8,867,273	HUF	0.10%
WEYERHAEUSER CO	12,690,049	HUF	0.15%
<b>Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>2,122,777,681</b>	<b>HUF</b>	<b>24.86%</b>
CESKA SPORITELNA AS	195,574,747	HUF	2.29%
CORDIA 2026/I	85,355,300	HUF	1.00%
Erste 04/02/26 EUR	136,725,777	HUF	1.60%
EXIM 2023/4	110,353,200	HUF	1.29%
EXIM 2024/2	108,102,500	HUF	1.27%
FUTUREAL 2031/I ZÖLD	36,110,000	HUF	0.42%
INTL FINANCE CORP	96,006,500	HUF	1.12%
KFW 2024/08	218,837,200	HUF	2.56%
MAEXIM 2023/07/13	107,542,200	HUF	1.26%
MBH EUR MREL 2026/B	92,869,994	HUF	1.09%
MFB 2024/10/1	46,905,200	HUF	0.55%
MFB 3.8 23/10/26	56,770,865	HUF	0.66%
MFBEU2406/1	35,884,300	HUF	0.42%
NOVALJ 10NC5 28/11/32	41,756,838	HUF	0.49%
NOVALJ 3.4 02/05/30	152,814,076	HUF	1.79%
OTP 10.25y USD	70,999,585	HUF	0.83%
OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	155,525,886	HUF	1.82%
OTP EUR 3.25nc2.25	95,922,909	HUF	1.12%
PKO 3 nc2 EUR	46,852,390	HUF	0.55%
Raiffeisen 7.5 EUR	38,331,160	HUF	0.45%
Raiffeisen Bank Senior	79,862,722	HUF	0.94%
Raiffeisen EUR 4nc3	37,190,232	HUF	0.44%
WINGHOLDING 2030/I kötvény	76,484,100	HUF	0.90%
<b>Jelzáloglevél</b>	<b>298,266,968</b>	<b>HUF</b>	<b>3.49%</b>
TJ24NV01	298,266,968	HUF	3.49%
<b>Deviza fedezeti ügyletek</b>	<b>175,203,461</b>	<b>HUF</b>	<b>2.07%</b>
EUR/HUF	3,086,639	HUF	0.05%
EUR/HUF	23,087,793	HUF	0.27%
EUR/HUF	3,674,158	HUF	0.04%

EUR/HUF	5,995,664	HUF	0.07%
EUR/HUF	32,260,136	HUF	0.38%
EUR/HUF	15,176,387	HUF	0.18%
EUR/HUF	5,512,973	HUF	0.06%
EUR/HUF	10,989,082	HUF	0.13%
EUR/HUF	-3,793	HUF	0.00%
EUR/HUF	-6,453,360	HUF	-0.08%
EUR/HUF	2,356,169	HUF	0.03%
EUR/HUF	4,247,822	HUF	0.05%
EUR/HUF	10,835,666	HUF	0.13%
EUR/HUF	3,997,379	HUF	0.05%
EUR/HUF	11,008,902	HUF	0.13%
EUR/HUF	35,864,135	HUF	0.42%
EUR/HUF	11,972,771	HUF	0.14%
USD/HUF	-2,928,149	HUF	-0.03%
USD/HUF	4,210,254	HUF	0.05%
USD/EUR	312,833	HUF	0.00%
<b>Követelések</b>	<b>11,637,352</b>	<b>HUF</b>	<b>0.13%</b>
<i>Esedékesség</i>	<i>1,560,673</i>	<i>HUF</i>	<i>0.01%</i>
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,689	HUF	0.00%
Broadcom Ltd.	128,523	HUF	0.00%
Deere	53,842	HUF	0.00%
HEICO CORP	7,422	HUF	0.00%
MERCK & CO. INC.	80,947	HUF	0.00%
Waberers International Zrt.	1,265,250	HUF	0.01%
<i>Befektetési jegy értékesítés</i>	<i>2,352,135</i>	<i>HUF</i>	<i>0.03%</i>
Generali Spirit A	2,352,135	HUF	0.03%
<i>Utalás érkeztetés</i>	<i>7,724,544</i>	<i>HUF</i>	<i>0.09%</i>
USD	7,724,544	HUF	0.09%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-46,425,399</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.53%</b>
<b>Befektetési jegy visszaváltás</b>	<b>-550,825</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.01%</b>
Generali Spirit A	-550,825	HUF	-0.01%
<b>Díjak</b>	<b>-45,874,574</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.52%</b>
Alapkezelési díj	-6,379,155	HUF	-0.06%
Felügyeleti díj	-724,760	HUF	-0.01%
Forgalmazói díj	-1,035,372	HUF	-0.01%
Könyvelési díj	-186,335	HUF	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-478,333	HUF	-0.01%
Különadó	-873,939	HUF	-0.01%
Letétkezelői díj	-802,382	HUF	-0.01%
Sikerdíj	-35,394,298	HUF	-0.41%

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

Az Alap forgalomban lévő befektetési jegyeinek száma a tárgyidőszak végén, 2023.06.30-án:

„A” sorozat: 300 431 466 db  
„B” sorozat: 6 329 481 803 db



Az Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke 2023.06.30-i forgalmazási napra érvényes nettó eszközérték alapján:

„A” sorozat: 1.599143 Ft

„B” sorozat: 1.272921 Ft

#### IV. Az Alap összetétele

2022.12.30-ra és 2023.06.30-ra vonatkozó nettó eszközértékek alapján.

Megnevezés	2022.12.30		2023.06.30	
	Érték (Ft)	Arány	Érték (Ft)	Arány
<b>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>4,395,745,222</b>	<b>54.73%</b>	<b>4,379,384,436</b>	<b>51.02%</b>
Állampapírok	2,089,984,608	26.02%	1,958,339,787	22.81%
Jelzáloglevelek	295,727,337	3.68%	298,266,968	3.47%
Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	2,010,033,277	25.02%	2,122,777,681	24.73%
<b>Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok</b>	<b>1,796,073,100</b>	<b>22.36%</b>	<b>2,226,411,627</b>	<b>25.94%</b>
Kollektív befektetési értékpapírok (ETF)	0	0.00%	141,009,231	1.64%
Részvények	1,796,073,100	22.36%	2,085,402,396	24.29%
<b>Egyéb átruházható értékpapírok</b>	<b>1,023,448,995</b>	<b>12.74%</b>	<b>1,337,864,745</b>	<b>15.59%</b>
Kollektív befektetési értékpapírok (Befektetési jegyek)	1,023,448,995	12.74%	1,337,864,745	15.59%
<b>Pénzpiaci eszközök</b>	<b>660,768,808</b>	<b>8.23%</b>	<b>453,285,815</b>	<b>5.28%</b>
Deviza fedezeti ügyletek	156,321,337	1.95%	175,203,461	2.04%
Követelések	0	0.00%	11,637,352	0.14%
<b>ESZKÖZÖK</b>	<b>8,032,357,462</b>	<b>100.00%</b>	<b>8,583,787,436</b>	<b>100.00%</b>
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-10,275,828</b>		<b>-46,425,399</b>	
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>8,022,081,634</b>		<b>8,537,362,037</b>	

#### 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 várható hozam-kockázat profilja 3-as (közepes kockázatú) besorolásnak felel meg az 1-7 közötti skálán az Alap visszatekintő szintetikus mutatója alapján. Az 5 évre visszatekintő szintetikus mutató az Alap heti hozamainak ingadozásából került kiszámításra. 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.

Megjegyzés: a befektetési alapokra a kockázati besorolás módszertana 2023.01.01-el, a PRIIPS szabályozás hatályba lépésével megváltozott. Ennek alapján az előző időszaki jelentésben szereplő fenti, 1-7-es kockázati skálán vett kockázati mutatói és jelen jelentés mutatói között az összehasonlítás nem lehetséges.

#### VI. Tőkeáttétellel kapcsolatos tájékoztatás

Az Alap befektetéseinek tőkeáttételes pozíciókat is felvehet. Az Alap a tárgyidőszakban tőkeáttételt nem alkalmazott.

## **VII. Értékpapír-finanszírozási ügyletek és a teljes hozam-csereügyletek alkalmazási módjai**

Az Alap nem alkalmaz az értékpapír-finanszírozási ügyletek és az újrafelhasználás átláthatóságáról, valamint a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló 2015. november 25-i 2015/2365 európai parlamenti és a tanácsi rendelet szerinti értékpapír-finanszírozási ügyleteket és teljes hozam-csereügyleteket.

Budapest, 2023. augusztus 11.

Generali Alapkezelő Zrt.