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):		**2023.12.29**
Saját tőke:		**14,601,503,042**

.

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**		**9,570,819**	0.066%
Alapkezelői díj:	NE*0.75%; NE*0.25%		3,451,421	0.024%
Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás)	0.035% / év		1,223,943	0.008%
Forgalmazói díj	0.05%		1,748,489	0.012%
Számviteli szolgáltatás díja	840,537 HUF / év		205,312	0.001%
Könyvvizsgálói díj:	1,256,310.- / év*		617,979	0.004%
Egyéb díj: Különadó	0.05%		1,748,489	0.012%
Letétkezelői díj:	NE*0.1156% / év		575,186	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.:	***9,570,819***	0.066%
II. Eszközök			**Összeg/Érték**	
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):		**Névértéken**	**676,984,964**	4.636%
EURO	EUR		40,006,429	0.274%
MAGYAR FORINT	HUF		554,773,184	3.799%
USA DOLLÁR	USD		82,205,351	0.563%
				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 *	13,879,615,690	95.056%
II/4.1. Állampapírok (összes):				**10,958,874,574**	75.053%
II/4.1.1. Kötvények (összes):				**8,322,137,174**	56.995%
	2024/B MÁK	HUF	280,000,000	279,267,240	1.913%
	2024/C MÁK	HUF	1,706,000,000	1,652,646,556	11.318%
	2024/C MÁK	HUF	530,000,000	513,424,780	3.516%
	2025/B MÁK	HUF	223,000,000	226,785,202	1.553%
	2025/C MÁK	HUF	139,620,000	127,130,293	0.871%
	2026/D MÁK	HUF	1,150,000,000	1,047,391,250	7.173%
	2026/E MÁK	HUF	278,230,000	253,780,261	1.738%
	2026/F MÁK	HUF	235,540,000	210,949,860	1.445%
	2026/H MÁK	HUF	2,400,000,000	2,645,172,000	18.116%
	2028/B MÁK	HUF	50,000,000	49,397,600	0.338%
	2032/G ZÖLD MÁK	HUF	100,000,000	93,805,300	0.642%
	REPHUN 2027/02/22 GREEN	EUR	400,000	167,819,173	1.149%
	2027/B MÁK	HUF	368,630,000	384,427,270	2.633%
	2029/B MÁK	HUF	460,560,000	469,696,589	3.217%
	2032/B MÁK	HUF	200,000,000	200,443,800	1.373%
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):				**2,636,737,400**	18.058%
	24/02/21 DKJ	HUF	200,000,000	198,148,400	1.357%
	24/02/21 DKJ	HUF	100,000,000	99,074,200	0.679%
	24/04/30 DKJ	HUF	800,000,000	783,339,200	5.365%
	24/04/30 DKJ	HUF	500,000,000	489,587,000	3.353%
	24/06/26 DKJ	HUF	700,000,000	678,738,200	4.648%
	24/06/26 DKJ	HUF	400,000,000	387,850,400	2.656%
					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.:				**2,284,196,961**	15.644%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**2,173,169,364**	14.883%
	CORDIA 2026/I	HUF	100,000,000	92,007,300	0.630%
	ERSTE Hun. 2025.09.24	HUF	150,000,000	169,827,300	1.163%
	EXIM 2024/2	HUF	50,000,000	57,691,900	0.395%
	EXIM 2024/5	HUF	100,000,000	113,314,800	0.776%
	EXIM 2024/9	HUF	100,000,000	105,051,700	0.719%
	EXIM 2025/3	HUF	200,000,000	217,066,800	1.487%
	EXIM 6 EUR 05/16/29	HUF	105,000	42,902,805	0.294%
	FUTUREAL 2031/I ZÖLD	HUF	50,000,000	40,810,250	0.279%
	KFW 2024/08	HUF	150,000,000	158,987,850	1.089%
	MBH EUR MREL 2026/B	HUF	300,000	124,962,014	0.856%
	MFBEU2409/1	EUR	500,000	194,266,974	1.330%
	MFBEU2706/1	HUF	300,000	119,578,826	0.819%
	MVM EURO BOND	EUR	106,000	34,781,833	0.238%
	OTP Bank 10NC5 Tier2 07/15/29	EUR	227,000	85,054,011	0.583%
	OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	EUR	350,000	138,382,855	0.948%
	OTP EUR 3.25nc2.25	EUR	125,000	51,926,308	0.356%
	Raiffeisen Bank H Zrt	EUR	100,000,000	113,965,200	0.781%
	Raiffeisen Bank Senior	EUR	100,000	39,814,709	0.273%
	Unicredit Spa HUF 2027	EUR	100,000,000	105,024,400	0.719%
	WINGHOLDING 2030/I kötvény	EUR	50,000,000	43,193,000	0.296%
	OTP 5.875 Float 11/49	HUF	150,000	52,555,617	0.360%
	OTP Bank 4NC3 05/25/27	EUR	200,000	72,002,912	0.493%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes):				**111,027,597**	0.760%
	Erste 04/02/26 EUR	EUR	300,000	111,027,597	0.760%
					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):			**636,544,155**	4.359%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			**636,544,155**	4.359%

	OJB2031/I ZÖLD	HUF	160,000,000	125,626,400	0.860%
	TJ24NV01	HUF	297,500,000	306,811,155	2.101%
	TJ25NV01	HUF	200,000,000	204,106,600	1.398%
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				**54,473,207**	0.373%
II.5.1. Határidős	Megnev	Tipus (S/L)	Névérték/darabszám	**54,473,207**	0.373%
II./5.1.1. Futures (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II./5.1.2. Forward (összes):				**54,473,207**	0.373%
	EUR/HUF			17,876,996	0.122%
	EUR/HUF			736,403	0.005%
	EUR/HUF			2,753,017	0.019%
	EUR/HUF			769,675	0.005%
	EUR/HUF			3,231,908	0.022%
	EUR/HUF			-1,938,810	-0.013%
	EUR/HUF			-635,384	-0.004%
	EUR/HUF			12,418,635	0.085%
	EUR/HUF			6,774,605	0.046%
	EUR/HUF			4,389,092	0.030%
	EUR/HUF			2,088,583	0.014%
	USD/HUF			3,795,503	0.026%
	USD/HUF			2,212,984	0.015%
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.:	***14,611,073,861***	100.066%

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