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):		**2023.12.29**
Saját tőke:		**9,248,708,984**

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		**299,952,710**	3.243%
Alapkezelői díj:	NE*1.75%		6,544,022	0.071%
Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás)	0.035% / év		770,082	0.008%
Forgalmazói díj	1.05%, 0.88%, 0.05%, 0.88%,		1,100,116	0.012%
Számviteli szolgáltatás díja	840,537 HUF / év		205,312	0.002%
Könyvvizsgálói díj:	1.166.574.- / év*		573,834	0.006%
Egyéb díj: Különadó	0%		908,353	0.010%
Letétkezelői díj:	NE*0.1156% / év		840,604	0.009%
Egyéb díj: Sikerdíj	20%		289,010,387	3.125%
				0.000%
I/3 Egyéb kötelezettségek (összes):			**0**	0.000%
Értékpapír vételből származó kötelezettségek:				0.000%
Egyéb kötelezettségek:				0.000%
				0.000%
		Kötelez. össz.:	***299,952,710***	3.243%
II. Eszközök			**Összeg/Érték**	
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):		Névértéken	**437,822,324**	4.734%
CSEH KORONA	CZK		6,922,704	0.075%
DÁN KORONA	DKK		3,862	0.000%
EURO	EUR		11,145,889	0.121%
ANGOL FONT	GBP		381,676	0.004%
HONG KONGI DOLLÁR	HKD		10,721	0.000%
MAGYAR FORINT	HUF		372,021,013	4.022%
LENGYEL ZLOTY	PLN		3,196,982	0.035%
ROMÁN LEJ	RON		13,210,194	0.143%
TÖRÖK LÍRA	TRY		3	0.000%
USA DOLLÁR	USD		30,929,280	0.334%
II/2. Egyéb követelés (összes):			**193,587**	0.002%
			0	0.000%
Értékpapír eladásból származó követelések:			0	0.000%
Elhatárolt UNICREDIT számlakamat:			0	0.000%
Osztalék AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD		26,199	0.000%
Deere	USD		64,066	0.001%
MERCK & CO. INC.	USD		86,390	0.001%
Micron Technology	USD		16,932	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 ***	**9,048,014,149**	97.830%
II/4.1. Állampapírok (összes):			**2,466,925,698**	26.673%
II/4.1.1. Kötvények (összes):			**2,219,312,435**	23.996%
2026/E MÁK	HUF	300,000,000	273,637,200	2.959%
2026/H MÁK	HUF	100,000,000	110,215,500	1.192%
2028/A MÁK	HUF	400,000,000	420,935,600	4.551%
2029/A MÁK	HUF	100,000,000	84,760,300	0.916%
2031/A MÁK	HUF	140,060,000	120,064,474	1.298%
2032/A MÁK	HUF	200,000,000	185,897,600	2.010%
2038/A MÁK	HUF	300,000,000	212,353,200	2.296%
2041/A MÁK	HUF	300,000,000	209,154,000	2.261%
2051/G ZÖLD	HUF	300,000,000	217,005,900	2.346%
REPHUN 2027/02/22 GREEN	EUR	179,000	75,099,082	0.812%
REPHUN 2031/06/16 - EUR	EUR	450,000	175,310,178	1.896%
REPHUN 2033/09/12 EUR	EUR	300,000	124,774,146	1.349%
2027/B MÁK	HUF	9,690,000	10,105,255	0.109%
				0.000%
				0.000%
				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):				**247,613,263**	2.677%
	ROMANI 2 04/14/33	EUR	200,000	58,577,053	0.633%
	ROMANI 2 2.124 07/16/31	EUR	100,000	30,960,510	0.335%
	ROMANI 2 3/4 04/14/41	EUR	400,000	106,682,317	1.153%
	ROMANI 3 3/4 02/07/34	EUR	150,000	51,393,383	0.556%

II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesíto ép.:				**1,992,024,090**	21.538%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,434,358,147**	15.509%
	CORDIA 2026/I	HUF	100,000,000	92,007,300	0.995%
	EXIM 2024/2	HUF	100,000,000	115,383,800	1.248%
	EXIM 2025/3	HUF	100,000,000	108,533,400	1.173%
	EXIM 6 EUR 05/16/29	EUR	105,000	42,902,805	0.464%
	FUTUREAL 2031/I ZŐLD	HUF	50,000,000	40,810,250	0.441%
	KFW 2024/08	HUF	200,000,000	211,983,800	2.292%
	MBH EUR MREL 2026/B	EUR	250,000	104,135,012	1.126%
	MFB 202410/1	HUF	50,000,000	48,715,200	0.527%
	MFBEU2406/1	EUR	100,000	38,460,395	0.416%
	OTP 10.25y USD	USD	200,000	72,109,685	0.780%
	OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	EUR	400,000	158,151,835	1.710%
	OTP EUR 3.25nc2.25	EUR	250,000	103,852,616	1.123%
	PKO 3 nc2 EUR	EUR	123,000	49,815,517	0.539%
	Raiffeisen 7.5 EUR	EUR	100,000	41,185,252	0.445%
	Raiffeisen Bank Senior	EUR	200,000	79,629,417	0.861%
	Raiffeisen EUR 4nc3	EUR	100,000	40,295,863	0.436%
	WINGHOLDING 2030/I kötvény	HUF	100,000,000	86,386,000	0.934%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes):				**557,665,943**	6.030%
	CESKA SPORITELNA AS	EUR	500,000	196,582,219	2.126%
	Erste 04/02/26 EUR	EUR	400,000	148,036,797	1.601%
	NOVALJ 10NC5 28/11/32	EUR	100,000	41,485,888	0.449%
	NOVALJ 3.4 02/05/30	EUR	500,000	171,561,039	1.855%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3. Részvények (összes):				**2,508,546,328**	27.123%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,557,219,286**	16.837%
	AKKO Invest	HUF	240,500	57,720,000	0.624%
	Állami Nyomda	HUF	32,500	80,925,000	0.875%
	Alteo	HUF	33,500	95,475,000	1.032%
	AutoWallis	HUF	1,005,500	116,638,000	1.261%
	DM-KER	HUF	325,000	9,912,500	0.107%
	Duna House	HUF	55,500	35,742,000	0.386%
	Masterplast	HUF	22,500	58,500,000	0.633%
	MOL	HUF	40000	113,040,000	1.222%
	MTelekom (MATÁV)	HUF	225,000	153,450,000	1.659%
	OTP	HUF	19,500	308,100,000	3.331%
	OTP	HUF	16,000	252,800,000	2.733%
	Pannergy	HUF	20,500	25,625,000	0.277%
	Richter	HUF	13,000	113,750,000	1.230%
	Waberers International Zrt.	HUF	12,500	48,000,000	0.519%
	Graphisoft Park SE	EUR	17,500	58,814,147	0.636%
	OXO Technologies Holding Nyrt.	EUR	9,500	28,727,639	0.311%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):				**951,327,042**	10.286%
	Komercni Banka	CZK	2,100	23,552,046	0.255%
	Moneta Money Bank	CZK	24,000	34,774,272	0.376%
	Erste Bank	EUR	3,400	47,802,332	0.517%
	HRVATSKI Telecom	EUR	5,500	57,474,417	0.621%
	Marinomed Biotech	EUR	360	4,023,783	0.044%
	Bank Pekao	PLN	3,000	40,159,446	0.434%
	PKO Bank Polski	PLN	4,500	19,935,778	0.216%
	Banca Transilvania SA	RON	28,091	52,440,475	0.567%
	BRD-Groupe Societe Generale	RON	28,000	38,610,432	0.417%
	OMV Petrom	RON	1,875,457	82,909,781	0.896%
	Accenture	USD	147	17,870,681	0.193%
	Adobe	USD	93	19,221,808	0.208%
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	377	18,158,414	0.196%
	Analog	USD	252	17,334,860	0.187%
	Apple	USD	419	27,947,339	0.302%
	Applied Materials	USD	435	24,424,176	0.264%
	Broadcom Ltd.	USD	96	37,124,510	0.401%
	CAMPBELL SOUP CO	USD	662	9,914,510	0.107%
	CENCORA INC.	USD	390	27,749,220	0.300%
	Cisco Systems	USD	576	10,081,238	0.109%
	COPART INC	USD	1,336	22,679,348	0.245%
	Deere	USD	148	20,502,582	0.222%
	DR Horton	USD	527	27,747,578	0.300%
	FAIR ISAAC CORP	USD	79	31,857,510	0.344%
	Gartner	USD	176	27,505,729	0.297%
	HEICO CORP	USD	255	15,801,769	0.171%
	HOLOGIC INC	USD	561	13,886,510	0.150%

	Keysight Technologies IN	USD	303	16,699,887	0.181%
	Masco	USD	574	13,319,412	0.144%
	MERCK & CO. INC.	USD	381	14,389,947	0.156%
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	USD	37	15,548,061	0.168%
	Micron Technology	USD	500	14,782,595	0.160%
	Qualcomm	USD	338	16,935,699	0.183%
	SYNOPSYS INC	USD	191	34,071,615	0.368%
	TransDigm Group	USD	54	18,924,770	0.205%
	VISA INC.	USD	151	13,619,544	0.147%
	Walgreens Boots Alliance Inc	USD	909	8,222,403	0.089%
	WEYERHAEUSER CO	USD	1,106	13,322,565	0.144%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.3. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes):				**296,951,946**	3.211%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**296,951,946**	3.211%
	TJ24NV01	HUF	287,940,000	296,951,946	3.211%
					0.000%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):				**1,783,566,087**	19.284%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,628,252,801**	17.605%
	Accorde Első Román Részvényalap I sorozat	HUF	40,000,000	104,280,200	1.128%
	Accorde Spartan Görög Rvalap. I sorozat	HUF	76,553,245	119,435,693	1.291%
	Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Alapja	EUR	5	255,307,703	2.760%
	Erste Ingatlanbefeketetési Alap		146,077,420	487,840,152	5.275%
	Generali Gold A	HUF	91,361,975	453,119,125	4.899%
	Magyar Posta Ingatlan Alap A sorozat	HUF	129,750,826	208,269,928	2.252%
	NAP Ingatlanfejlesztő Befektetési Alap B sorozat	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):				**155,313,286**	1.679%

	iShares MSCI USA Momentum Fact ETF	USD	260	14,131,773	0.153%
	iShares Euro Stoxx Banks 30	EUR	32,000	141,181,513	1.526%
					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				**62,631,634**	0.677%
II.5.1. Határidős	Megnev	Típus (S/L)	Névérték/darabszám	**62,631,634**	0.677%
II./5.1.1. Futures (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II./5.1.2. Forward (összes):				**62,631,634**	0.677%
	EUR/HUF	S		4,769,197	0.052%
	EUR/HUF	S		5,357,800	0.058%
	EUR/HUF	S		4,159,879	0.045%
	EUR/HUF	S		6,774,605	0.073%
	EUR/HUF	S		4,287,091	0.046%
	EUR/HUF	S		1,145,516	0.012%
	EUR/HUF	S		1,255,266	0.014%
	EUR/HUF	S		2,561,524	0.028%
	EUR/HUF	S		3,441,455	0.037%
	EUR/HUF	S		3,670,689	0.040%
	EUR/HUF	S		567,259	0.006%
	EUR/HUF	S		2,698,926	0.029%
	EUR/HUF	S		12,705,246	0.137%
	EUR/HUF	S		-1,986,070	-0.021%
	EUR/HUF	S		-1,179,475	-0.013%
	EUR/HUF	S		-501,811	-0.005%
	EUR/HUF	S		-533,914	-0.006%
	EUR/HUF	S		-326,010	-0.004%
	EUR/HUF	S		-1,169,972	-0.013%
	EUR/HUF	S		-1,270,769	-0.014%
	USD/HUF	S		6,970,596	0.075%
	USD/HUF	S		9,234,606	0.100%
					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.:	***9,548,661,694***	103.243%

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