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):		**2023.12.29**
Saját tőke:		**6,196,263,223**

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		**94,784,916.00**	1.530%
Alapkezelői díj:	NE*1.75%		8,506,948.00	0.137%
Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás)	0.035% / év		525,155.00	0.008%
Forgalmazói díj	1.05%, 0.88%, 0.05%, 0.88%,		750,221.00	0.012%
Számviteli szolgáltatás díja	840,537 HUF / év		205,312.00	0.003%
Könyvvizsgálói díj:	717,892.- / év*		353,130.00	0.006%
Egyéb díj: Különadó	0.05%		733,307.00	0.012%
Letétkezelői díj:	NE*0.1156% / év		561,945.00	0.009%
Egyéb díj: Sikerdíj	20.00%		83,148,898.00	1.342%
				0.000%
I/3 Egyéb kötelezettségek (összes):			**869,000.00**	0.014%
Értékpapír vételből származó kötelezettségek:				0.000%
Egyéb kötelezettségek:	FWD eredmény		869,000.00	0.014%
				0.000%
		Kötelez. össz.:	***95,653,916.00***	1.544%
II. Eszközök			**Összeg/Érték**	
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):		Névértéken	**620,885,008**	10.020%
CSEH KORONA	CZK		25,180	0.000%
DÁN KORONA	DKK		30,306	0.000%
EURO	EUR		13,519,291	0.218%
ANGOL FONT	GBP		371,609	0.006%
MAGYAR FORINT	HUF		354,973,211	5.729%
LENGYEL ZLOTY	PLN		437,022	0.007%
ROMÁN LEJ	RON		274,428	0.004%
TÖRÖK LÍRA	TRY		4	0.000%
USA DOLLÁR	USD		251,253,957	4.055%
II/2. Egyéb követelés (összes):			**0.00**	0.000%
				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		0.00	0.000%
				0.000%
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 *	**5,765,888,098.00**	93.054%
II/4.1. Állampapírok (összes):				**3,126,712,148.00**	50.461%
II/4.1.1. Kötvények (összes):				**2,673,621,426.00**	43.149%
	2024/C MÁK	HUF	453,000,000	438,832,878.00	7.082%
	2026/D MÁK	HUF	250,000,000	227,693,750.00	3.675%
	2026/H MÁK	HUF	310,000,000	341,668,050.00	5.514%
	2032/G ZÖLD MÁK	HUF	300,000,000	281,415,900.00	4.542%
	2034/A MÁK	HUF	100,000,000	74,060,300.00	1.195%
	2035/A MÁK	HUF	200,000,000	215,724,400.00	3.482%
	2038/A MÁK	HUF	200,000,000	141,568,800.00	2.285%
	2041/A MÁK	HUF	250,000,000	174,295,000.00	2.813%
	2051/G ZÖLD	HUF	179,900,000	130,131,205.00	2.100%
	REPHUN 2027/02/22 GREEN	EUR	571,000	239,561,872.00	3.866%
	REPHUN 2031/06/16 - EUR	EUR	450,000	175,310,178.00	2.829%
	REPHUN 2032/09/22 USD	USD	455,000	170,972,020.00	2.759%
	REPHUN 2033/09/12 EUR	EUR	150,000	62,387,073.00	1.007%
					0.000%
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):				**14,687,610.00**	0.237%
	24/04/30 DKJ	0	0	14,687,610.00	0.237%
					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):				**438,403,112.00**	7.075%
	ROMANI 2 2.124 07/16/31	EUR	500,000	154,802,548.00	2.498%
	ROMANI 2 3/4 04/14/41	EUR	400,000	106,682,317.00	1.722%
	ROMANI 4.875 01/22/24	USD	500,000	176,918,247.00	2.855%
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:				**1,921,630,712.00**	31.013%
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**1,423,190,481.00**	22.969%
	CORDIA 2026/I	HUF	100,000,000	92,007,300.00	1.485%
	ERSTE Hun. 2025.09.24	HUF	50,000,000	56,609,100.00	0.914%
	EXIM 2024/2	HUF	100,000,000	115,383,800.00	1.862%
	EXIM 6 EUR 05/16/29	EUR	105,000	42,902,805.00	0.692%
	KFW 2024/08	HUF	150,000,000	158,987,850.00	2.566%
	MAEXIM 2029/05/23	HUF	100,000,000	79,872,700.00	1.289%
	MBH EUR MREL 2026/B	EUR	250,000	104,135,012.00	1.681%
	MFB 202410/1	HUF	50,000,000	48,715,200.00	0.786%
	MFBEU2406/1	EUR	100,000	38,460,395.00	0.621%
	MVM EURO BOND	EUR	250,000	82,032,625.00	1.324%
	OTP 10.25y USD	USD	300,000	108,164,527.00	1.746%
	OTP Bank 3NC2 2 07/13/25	EUR	300,000	118,613,876.00	1.914%
	OTP EUR 3.25nc2.25	EUR	188,000	78,097,168.00	1.260%
	PKO 3 nc2 EUR	EUR	163,000	66,015,686.00	1.065%
	Raiffeisen Bank Senior	EUR	200,000	79,629,417.00	1.285%
	Raiffeisen EUR 4nc3	EUR	100,000	40,295,863.00	0.650%
	WINGHOLDING 2030/I kötvény	HUF	50,000,000	43,193,000.00	0.697%
	OTP 5.875 Float 11/49	EUR	200,000	70,074,157.00	1.131%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes):				**498,440,231.00**	8.044%
	Banca Comerciala Romana	EUR	200,000	84,176,155.00	1.358%
	CESKA SPORITELNA AS	EUR	300,000	117,949,332.00	1.904%
	Erste 04/02/26 EUR	EUR	300,000	111,027,597.00	1.792%
	NOVAKR 06/29/2026 EUR 3NC2	EUR	100,000	40,864,636.00	0.660%
	NOVALJ 10NC5 28/11/32	EUR	100,000	41,485,888.00	0.670%
	NOVALJ 3.4 02/05/30	EUR	300,000	102,936,623.00	1.661%
II/4.2.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0.00**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3. Részvények (összes):				**403,195,393.00**	6.507%
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**359,398,689.00**	5.800%
	Állami Nyomda	HUF	20,000	49,800,000.00	0.804%
	AutoWallis	HUF	50,569	5,866,004.00	0.095%
	Duna House	HUF	92,050	59,280,200.00	0.957%
	Graphisoft Park SE	EUR	8,700	29,239,033.00	0.472%
	MTelekom (MATÁV)	HUF	150,000	102,300,000	1.651%
	OTP	HUF	6,400	101,120,000	1.632%
	OTT-ONE	HUF	10,000	0	0.000%
	OXO Technologies Holding Nyrt.	EUR	3,900	11,793,452	0.190%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):				**43,796,704.00**	0.707%
	WIZZ Air	GBP	4,500	43,796,704.00	0.707%
					0.000%

					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):				**62,813,200**	1.014%
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**62,813,200**	1.014%
	OJB2031/I ZÖLD	HUF	80,000,000	62,813,200.00	1.014%
					0.000%
					0.000%
II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):				**251,536,645**	4.059%
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				**0**	0.000%
					0.000%

					0.000%
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes):				**153,184,621**	2.472%
	Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Al	EUR	3	153,184,621	2.472%
					0.000%
					0.000%
II/4.5.3. Külföldi befektetési jegyek (összes):				**98,352,024**	1.587%
	iShares Euro Stoxx Banks 30	EUR	15,000	66,178,834	1.068%
	iShares iBoxx $ High Yield Corporate	USD	1,200	32,173,190	0.519%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
II/4.6. Kárpótlási jegy (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%

II/5. Származékos ügyletek				**-94,855,967.00**	-1.531%
II.5.1. Határidős	Megnev	Tipus (S/L)	Névérték/darabszám	**-94,855,967**	-1.531%
II./5.1.1. Futures (összes):				**0**	0.000%
					0.000%
					0.000%
II./5.1.2. Forward (összes):				**-94,855,967.00**	-1.531%
	EUR/HUF	S		7,097,940	0.115%
	EUR/HUF	S		4,159,879	0.067%
	EUR/HUF	S		15,921,327	0.257%
	EUR/HUF	S		9,539,750	0.154%
	EUR/HUF	S		2,223,358	0.036%
	EUR/HUF	S		-77,596,061	-1.252%
	EUR/HUF	S		-40,848,080	-0.659%
	EUR/HUF	S		-70,339,025	-1.135%
	EUR/HUF	S		1,145,516	0.018%
	EUR/HUF	S		4,858,525	0.078%
	EUR/HUF	S		1,296,927	0.021%
	EUR/HUF	S		9,708,007	0.157%
	EUR/HUF	S		1,075,458	0.017%
	EUR/HUF	S		2,698,926	0.044%
	EUR/HUF	S		1,114,503	0.018%
	EUR/HUF	S		-6,721,173	-0.108%
	EUR/HUF	S		623,615	0.010%
	EUR/HUF	S		-1,324,047	-0.021%
	EUR/HUF	S		-501,811	-0.008%
	EUR/HUF	S		-685,379	-0.011%
	EUR/HUF	S		-632,843	-0.010%
	EUR/HUF	S		-434,561	-0.007%
	EUR/HUF	S		-1,270,769	-0.021%
	USD/HUF	S		23,435,139	0.378%
	USD/HUF	S		10,272,457	0.166%
	USD/HUF	S		-5,105,746	-0.082%
	USD/HUF	S		6,341,436	0.102%
	USD/HUF	S		9,756,554	0.157%
	USD/HUF	S		975,053	0.016%
	USD/HUF	S		-1,640,842	-0.026%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
					0.000%
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.:	***6,291,917,139.22***	101.544%

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