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):** | | **2024.12.31** |
| **Saját tőke:** | | **6,461,636,022** |

**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 | | **40,813,543.00** | 0.632% |
| Alapkezelői díj: | NE*1.75% | | 9,569,959.00 | 0.148% |
| Felügyeleti díj: (Kifizetett elhatárolás) | 0.035% / év | | 559,613.00 | 0.009% |
| Forgalmazói díj | 1.05%, 0.88%, 0.05%, 0.88%, | | 799,446.00 | 0.012% |
| Számviteli szolgáltatás díja | 916,230 HUF / év | | 247,982.00 | 0.004% |
| Könyvvizsgálói díj: | 985,605.- / év* | | 492,799.00 | 0.008% |
| Egyéb díj: Különadó | 0.05% | | 770,107.00 | 0.012% |
| Letétkezelői díj: | NE*0.1156% / év | | 632,164.00 | 0.010% |
| Egyéb díj: Sikerdíj | 20.00% | | 27,741,473.00 | 0.429% |
| | | | | 0.000% |
| **I/3 Egyéb kötelezettségek (összes):** | | | **164,790.00** | 0.003% |
| Értékpapír vételből származó kötelezettségek: | | | | 0.000% |
| Egyéb kötelezettségek: | FWD eredmény | | 164,790.00 | 0.003% |
| | | | | 0.000% |
| | | ***Kötelez. össz.:*** | ***40,978,333.00*** | 0.634% |
| **II. Eszközök** | | | **Összeg/Érték** | |
| **II/1. Folyószámla, készpénz (összes):** | | Névértéken | **564,722,621** | 8.740% |
| ANGOL FONT | GBP | | 437,534 | 0.007% |
| CSEH KORONA | CZK | | 26,194 | 0.000% |
| DÁN KORONA | DKK | | 32,455 | 0.001% |
| EURO | EUR | | 272,825,176 | 4.222% |
| LENGYEL ZLOTY | PLN | | 502,001 | 0.008% |
| MAGYAR FORINT | HUF | | 277,404,666 | 4.293% |
| ROMÁN LEJ | RON | | 293,936 | 0.005% |
| TÖRÖK LÍRA | TRY | | 4 | 0.000% |
| USA DOLLAR | USD | | 13,200,655 | 0.204% |
| **II/2. Egyéb követelés (összes):** | | | **8,862,000.00** | 0.137% |
| | | | | 0.000% |
| Értékpapír eladásból származó követelések: | | | 0.00 | 0.000% |
| Elhatárolt UNICREDIT számlakamat: | | | 0.00 | 0.000% |
| Osztalék | | | 0.00 | 0.000% |
| Egyéb követelés: | Befektetési jegy Értékesítés | | 8,862,000.00 | 0.137% |
| | | | | 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 * | 5,842,875,771.00 | 90.424% |
|---|---|---|---|---|---|
| **II/4.1. Állampapírok (összes):** | | | | **3,319,696,477.00** | 51.375% |
| II/4.1.1. Kötvények (összes): | | | | **2,916,592,893.00** | 45.137% |
| | 2026/D MÁK | HUF | 250,000,000 | 234,853,000.00 | 3.635% |
| | 2026/H MÁK | HUF | 310,000,000 | 332,978,130.00 | 5.153% |
| | 2032/G ZÖLD MÁK | HUF | 500,000,000 | 458,932,500.00 | 7.102% |
| | 2034/A MÁK | HUF | 100,000,000 | 72,481,200.00 | 1.122% |
| | 2035/A MÁK | HUF | 350,000,000 | 366,377,900.00 | 5.670% |
| | 2038/A MÁK | HUF | 300,000,000 | 199,558,500.00 | 3.088% |
| | 2041/A MÁK | HUF | 250,000,000 | 160,678,750.00 | 2.487% |
| | 2051/G ZÖLD | HUF | 579,900,000 | 393,316,015.00 | 6.087% |
| | REPHUN 2027/02/22 GREEN | EUR | 571,000 | 252,744,438.00 | 3.911% |
| | REPHUN 2031/06/16 - EUR | EUR | 450,000 | 192,910,334.00 | 2.985% |
| | REPHUN 2032/09/22 USD | USD | 455,000 | 184,355,694.00 | 2.853% |
| | REPHUN 2033/09/12 EUR | EUR | 150,000 | 67,406,432.00 | 1.043% |
| | | | | | 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): | | | | **403,103,584.00** | 6.238% |
| | ROMANI 2 2.124 07/16/31 | EUR | 500,000 | 170,387,474.00 | 2.637% |
| | ROMANI 2 3/4 04/14/41 | EUR | 400,000 | 108,421,891.00 | 1.678% |
| | ROMANI 5 1/8 09/24/31 | EUR | 200,000 | 81,506,208.00 | 1.261% |
| | ROMANI 7Y 03/22/31 | EUR | 100,000 | 42,788,011.00 | 0.662% |
| **II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:** | | | | **1,358,503,117.00** | 21.024% |
| II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | | **814,147,896.00** | 12.600% |
| | CORDIA 2026/I | HUF | 100,000,000 | 63,890,868.00 | 0.989% |
| | EXIM 6 EUR 05/16/29 | EUR | 105,000 | 47,840,944.00 | 0.740% |
| | MAEXIM 2029/05/23 | HUF | 100,000,000 | 86,516,800.00 | 1.339% |
| | MBH EUR MREL 2026/B | EUR | 250,000 | 109,487,571.00 | 1.694% |
| | MVM EURO BOND | EUR | 250,000 | 93,944,545.00 | 1.454% |
| | MVMHU 6 1/2 13/03/31 | USD | 200,000 | 80,898,891.00 | 1.252% |
| | OTP 10.25y USD | USD | 300,000 | 124,871,135.00 | 1.933% |
| | OTP 5.875 Float 11/49 | EUR | 200,000 | 82,153,166.00 | 1.271% |
| | OTP EUR 3.25nc2.25 | EUR | 188,000 | 82,170,976.00 | 1.272% |
| | WINGHOLDING 2030/I kötvény | HUF | 50,000,000 | 42,373,000.00 | 0.656% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| II/4.2.3. Külföldi kötvények (összes): | | | | **544,355,221.00** | 8.424% |
| | Banca Comerciala Romana | EUR | 200,000 | 89,888,611.00 | 1.391% |
| | Erste 04/02/26 EUR | EUR | 300,000 | 123,027,615.00 | 1.904% |
| | NOVAKR 06/29/2026 EUR 3NC2 | EUR | 100,000 | 43,128,345.00 | 0.667% |
| | NOVALJ 10NC5 28/11/32 | EUR | 100,000 | 47,710,650.00 | 0.738% |
| | PKO 3 nc2 EUR | EUR | 163,000 | 70,304,017.00 | 1.088% |
| | Raiffeisen EUR 4nc3 | EUR | 100,000 | 43,578,050.00 | 0.674% |
| | NOVALJ 3.4 02/05/30 | EUR | 300,000 | 126,717,933.00 | 1.961% |
| II/4.2.2. Tőzsdén kívüli (összes): | | | | **0.00** | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| **II/4.3. Részvények (összes):** | | | | **510,688,681.00** | 7.903% |
| II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | | **478,689,350.00** | 7.408% |
| | Állami Nyomda | HUF | 20,000 | 83,200,000.00 | 1.288% |
| | AutoWallis | HUF | 50,569 | 7,762,342.00 | 0.120% |
| | Duna House | HUF | 74,150 | 70,442,500.00 | 1.090% |
| | Graphisoft Park SE | EUR | 8,700 | 40,672,726.00 | 0.629% |
| | MTelekom (MATÁV) | HUF | 100,000 | 127,400,000 | 1.972% |
| | OTP | HUF | 6,400 | 138,816,000 | 2.148% |
| | OTT-ONE | HUF | 10,000 | 0 | 0.000% |
| | OXO Technologies Holding Nyrt. | EUR | 3,900 | 10,395,782 | 0.161% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| II/4.3.2. Külföldi részvények (összes): | | | | **31,999,331.00** | 0.495% |
| | WIZZ Air | GBP | 4,500 | 31,999,331.00 | 0.495% |
| | | | | | 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):** | | | | **62,167,600** | 0.962% |
| II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | | **62,167,600** | 0.962% |
| | OJB2031/I ZÖLD | HUF | 80,000,000 | 62,167,600.00 | 0.962% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| II/4.4.2. Tőzsdén kívüli (összes): | | | | **0** | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| **II/4.5. Befektetési jegyek (összes):** | | | | **591,819,896** | 9.159% |
| II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | | **0** | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 0.000% |
| II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes): | | | | **236,992,830** | 3.668% |
| | Accorde Spartan Görög Rvalap. I sor | HUF | 36,979,923 | 71,275,030 | 1.103% |
| | Adventum MAGIS Zártkörű Alapok Al | EUR | 3 | 165,717,800 | 2.565% |
| | | | | | 0.000% |
| II/4.5.3. Külföldi befektetési jegyek (összes): | | | | **354,827,066** | 5.491% |
| | ISHARES S&P 500 SWAP UCITS | USD | 60,000 | 230,194,598 | 3.562% |
| | iShares Euro Stoxx Banks 30 | EUR | 15,000 | 87,484,500 | 1.354% |
| | iShares iBoxx $ High Yield Corporate | USD | 1,200 | 37,147,968 | 0.575% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| **II/4.6. Kárpótlási jegy (összes):** | | | | **0** | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **II/5. Származékos ügyletek** | | | | **86,153,963.00** | 1.333% |
| **II.5.1. Határidős** | Megnev | Tipus (S/L) | Névérték/darabszám | **86,153,963** | 1.333% |
| II./5.1.1. Futures (összes): | | | | **0** | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| II./5.1.2. Forward (összes): | | | | **86,153,963.00** | 1.333% |
| | EUR/HUF | S | | 15,335 | 0.000% |
| | EUR/HUF | S | | -1,507,601 | -0.023% |
| | EUR/HUF | S | | -4,975,559 | -0.077% |
| | EUR/HUF | S | | -1,243,854 | -0.019% |
| | EUR/HUF | S | | -2,813,333 | -0.044% |
| | EUR/HUF | S | | -1,849,729 | -0.029% |
| | EUR/HUF | S | | -16,319,202 | -0.253% |
| | EUR/HUF | S | | -6,187,143 | -0.096% |
| | EUR/HUF | S | | -2,890,894 | -0.045% |
| | EUR/HUF | S | | -2,855,126 | -0.044% |
| | EUR/HUF | S | | -1,163,656 | -0.018% |
| | EUR/HUF | S | | 49,939,017 | 0.773% |
| | EUR/HUF | S | | 43,313,248 | 0.670% |
| | EUR/HUF | S | | 73,791,833 | 1.142% |
| | EUR/HUF | S | | -1,388,850 | -0.021% |
| | USD/HUF | S | | -23,954,832 | -0.371% |
| | USD/HUF | S | | -1,425,585 | -0.022% |
| | USD/HUF | S | | -7,762,079 | -0.120% |
| | USD/HUF | S | | -8,677,350 | -0.134% |
| | USD/HUF | S | | 4,109,323 | 0.064% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 0.000% |
| | | | | | 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.:*** | ***6,502,614,355.00*** | 100.634% |

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