



**Féléves jelentés  
2016.**

**SBERBANK PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI  
ALAP**

# Sberbank Pénzpiaci Befektetési 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>	Sberbank Magyarország Zrt. (székhely: 1088 Budapest, Rákóczi út 7.)
<b>Forgalmazó neve, székhelye:</b>	Sberbank Magyarország Zrt. (székhely: 1088 Budapest, Rákóczi út 7.)
<b>Az Alap által kibocsátott befektetési jegyek ISIN kódja, névértéke:</b>	HU0000703285; névérték: 1,- Ft

## II. Vagyonkimutatás

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint az időszak elején és végén (2016.01.04-re és 2016.06.30-ra érvényes nettó eszközértékek alapján).

Az Alap kezelését a Generali Alapkezelő Zrt. 2016.01.01-jén vette át, azt megelőzően az Alap alapkezelője a Budapest Alapkezelő Zrt. volt.

### Vonatkozási dátum

2016.01.04

Megnevezés	Eszközérték	Deviza	Arány
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>1,049,287,032</b>	<b>HUF</b>	<b>100.00%</b>
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>1,049,432,825</b>	<b>HUF</b>	<b>100.01%</b>
<b>Pénzpiaci eszközök</b>	<b>1,049,432,825</b>	<b>HUF</b>	<b>100.01%</b>
Sberbank Pénzpiaci Befektetési Alap - HUF	1,049,432,825	HUF	100.01%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-145,793</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.01%</b>
<b>Díjak</b>	<b>-145,793</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.01%</b>
Alapkezelési díj	-114,692	HUF	-0.01%
Befektetési alapok különadója	-5,734	HUF	0.00%
Felügyeleti díj	-2,867	HUF	0.00%
Könyvelési díj	-7,772	HUF	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-5,552	HUF	0.00%
Letétkezelési díj	-9,176	HUF	0.00%

Vonatkozási dátum			
2016.06.30			
Megnevezés	Eszközérték	Deviza	Arány
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>749,784,139</b>	<b>HUF</b>	<b>100.00%</b>
<b>ÖSSZES ESZKÖZ</b>	<b>750,911,353</b>	<b>HUF</b>	<b>100.15%</b>
<b>Pénzpiaci eszközök</b>	<b>20,784,225</b>	<b>HUF</b>	<b>2.77%</b>
Sberbank Pénzpiaci Befektetési Alap - HUF	20,784,225	HUF	2.77%
<b>Lekötött betét</b>	<b>280,760,278</b>	<b>HUF</b>	<b>37.45%</b>
HUF betét	280,760,278	HUF	37.45%
<b>Állampapírok</b>	<b>449,366,850</b>	<b>HUF</b>	<b>59.93%</b>
<i>Diszkont kincstárjegy</i>	<i>449,366,850</i>	<i>HUF</i>	<i>59.93%</i>
16/08/17 DKJ	99,886,800	HUF	13.32%
16/08/24 DKJ	149,805,450	HUF	19.98%
16/09/07 DKJ	199,674,600	HUF	26.63%
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-1,127,214</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.15%</b>
<b>Díjak</b>	<b>-1,127,214</b>	<b>HUF</b>	<b>-0.15%</b>
Alapkezelési díj	-316,738	HUF	-0.04%
Befektetési alapok különadója	-102,353	HUF	-0.01%
Felügyeleti díj	-51,178	HUF	-0.01%
Könyvelési díj	-353,652	HUF	-0.05%
Könyvizsgálói díj	-252,615	HUF	-0.03%
Letétkezelési díj	-50,678	HUF	-0.01%

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

Az Alap forgalomban lévő befektetési jegyeinek száma a tárgyidőszak végén, 2016.06.30-án:

453 240 591 db

Az Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke 2016.06.30-i forgalmazási napra érvényes nettó eszközérték alapján:

1.654274 Ft

### IV. Az Alap összetétele

2016.01.04-re és 2016.06.30-ra érvényes nettó eszközértékek alapján.

Az Alap kezelését a Generali Alapkezelő Zrt. 2016.01.01-jén vette át, azt megelőzően az Alap alapkezelője a Budapest Alapkezelő Zrt. volt.

Megnevezés	2016.01.04		2016.06.30	
	Érték (Ft)	Arány	Érték (Ft)	Arány
<b>Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>449,366,850</b>	<b>59.84%</b>
<i>Állampapírok</i>	0	0.00%	449,366,850	59.84%
<i>Jelzáloglevelek</i>	0	0.00%	0	0.00%
<i>Egyéb hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok</i>	0	0.00%	0	0.00%
<b>Pénzpiaci eszközök, lekötött betét</b>	<b>1,049,432,825</b>	<b>100.00%</b>	<b>301,544,503</b>	<b>40.16%</b>
<b>Követelések</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>
<b>ESZKÖZÖK</b>	<b>1,049,432,825</b>	<b>100.00%</b>	<b>750,911,353</b>	<b>100.00%</b>
<b>KÖTELEZETTSÉGEK</b>	<b>-145,793</b>		<b>-1,127,214</b>	
<b>NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK</b>	<b>1,049,287,032</b>		<b>749,784,139</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 az 1-es (alacsony kockázatú) besorolásnak felel meg az 1-7 közötti skálán az Alap 5 évre 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.

## **VI. Tőkeáttétellel kapcsolatos tájékoztatás**

Az Alap a Kezelési Szabályzatában rögzítetteknek megfelelően tőkeáttételt nem alkalmaz.

Budapest, 2016. augusztus 25.

Generali Alapkezelő Zrt.