

FÉLÉVES JELENTÉS 2011

Alapadatok

Neve	Budapest Energia Tőkevédett Származtatott Nyíltvégű Befektetési Alap	
Rövid neve	Budapest Energia Alap	
Az alap típusa, fajtája	nyilvános, nyíltvégű, származtatott ügyletekbe fektető befektetési alap	
Futamideje	határozott: 2008. október 27. - 2011. október 27.	
Indulás dátuma	2008. október 27. (PSZÁF engedély száma: E-III/110.708-1/2008)	
Az alapcímlet devizaneme	HUF	
Sorozatok adatai		
„HUF” sorozat;	névérték 10,000 HUF	ISIN kód HU0000707294

Alapkezelő	Budapest Alapkezelő Zrt.
Székhely	1138 Budapest, Váci út 193.
Letétkezelő	Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe
Székhely	1051 Budapest, Szabadság tér 7.
Könyvvizsgáló	KPMG Hungária Kft.
Székhely	1139 Budapest, Váci út 99.
Könyvvizsgáló személy	Dienes Péter / 006199

Az Alap célja	Az Alap célja, hogy alacsony kockázatú, a tőke megővését előtérbe helyező, de magas hozampotenciállal rendelkező tőkepiaci befektetési lehetőséget nyújtson a befektetési jegyek tulajdonosainak. Az alacsony kockázat kizárólag a teljes futamidő tekintetében valósul meg.
---------------	--

Forgalmazók

Budapest Bank Nyrt.	1138 Budapest Váci út 193.
---------------------	----------------------------

A forgalom, a nettó eszközérték és az árfolyam alakulása

Nyitó állomány (db)	43,430
Vétel (db)	1,505
Visszaváltás (db)	180
Záró Állomány (db)	44,755

	nettó eszközérték	árfolyam
2011.01.31	517,841,175	11,962.9721
2011.02.28	526,824,120	12,141.0426
2011.03.31	529,154,034	12,094.3965
2011.04.29	545,998,601	12,256.6862
2011.05.31	544,990,308	12,228.0129
2011.06.30	544,650,845	12,169.6089

A múltbeli hozamok alakulása

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
2008.12.31*	441,911,178	9,907.6559	-0.97%
2009.12.31	484,077,742	10,908.0567	9.86%
2010.12.31	513,744,856	11,829.2622	8.45%

*: tört év, nem annualizált hozam

Az alap múltbeli teljesítménye, hozama nem jelent garanciát a jövőbeni teljesítményre, hozamra.

Derivatív ügyletek bemutatása:

NÉV	E_ÉRT
Energia Struktúrált	83,916,777

Mögöttes termék: SPGCAGP Index, SPGCENP Index, SPGTAQD Index

Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, valamint a befektetési politika alakulására ható fontosabb tényezők, egyéb információk

Az Alapkezelő működésében nem történt jelentős változás a 2011-es év folyamán.
Az Alap befektetési politikájában nem történt változás.

Az Alap az év folyamán nem vett igénybe hitelt.

A portfólió összetétele

Az alap devizaneme: magyar forint

Budapest Energia Alap				
Portfólió összetétel	Nyitó állomány		Záró állomány	
	2010.12.31		2011.06.30	
Eszköztípus	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly
Számlapénz	8,279,482	1.6%	22,772,554	4.2%
Betét	439,837,083	85.3%	440,342,667	80.5%
Jegybanki kötvény	0	0.0%	0	0.0%
Diszkont kincstárjegy	0	0.0%	0	0.0%
Államkötvény	0	0.0%	0	0.0%
Jelzáloglevél	0	0.0%	0	0.0%
Vállalati kötvény	0	0.0%	0	0.0%
Befektetési jegy	0	0.0%	0	0.0%
Részvény, ETF	0	0.0%	0	0.0%
Derivatív ügyletek	67,429,614	13.1%	83,916,777	15.3%
Repo	0	0.0%	0	0.0%
Forgalmazási számla egyenlege	0	0.0%	0	0.0%
Portfólió összesen	515,546,179	100.0%	547,031,998	100.0%
Nettó eszközérték:	513,744,856		544,650,845	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	11829.2622		12169.6089	

Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban

Az alapban június 30-án nem voltak értékpapírok.

Budapest, 2011. augusztus 2.

Budapest Alapkezelő Zrt.

MELLÉKLETEK

A portfólió részletes összetétele

Értékpapírok

Az alapon június 30-án nem voltak értékpapírok.

Folyószámla és betétek

Betét	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	439,837,083	440,342,667
Összesen		439,837,083	440,342,667

Folyószámla	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	8,279,482	22,772,554
Összesen		8,279,482	22,772,554