

# FÉLÉVES JELENTÉS 2011

## Alapadatok

Neve	Budapest Pénzpiaci Tőkevédett Alap*
Elnevezés angolul	Budapest Money Market Capital Protected Investment Fund
Rövid neve	Budapest Pénzpiaci Alap
Rövid név angolul	Budapest Money Market Capital Protected Investment Fund

Az alap típusa, fajtája	nyilvános, nyíltvégű értékpapír alap	
Futamideje	határozatlan	
Indulás dátuma	1995. október 4. (ÁÉTF engedély száma: 110.046-1/95)	
Az alapcímlet devizaneme	HUF	
A sorozatok adatai		
„HUF” sorozat:	névérték 1 HUF	ISIN kód HU0000702733

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	Nagy Zsuzsanna / 005421

Az Alap célja	Az Alap célja, hogy a legnagyobb biztonság elve mellett, a bankkártya konstrukciókkal összevetve versenyképes hozamot biztosítson a befektetési jegyek vásárlóinak. Az Alapkezelő az Alap eszközeinek befektetésénél elsősorban a biztonságot és az értékmegőrzést tartja szem előtt, ezért kizárólag alacsony kockázatú, elsősorban kamatozó eszközökbe fekteti tőkét. Az Alapkezelő az Alap szabad pénzeszközeinek azonnali befektetésére törekszik.
---------------	--

\*: 2011. január 25-ig Budapest Pénzpiaci Befektetési Alap

## Forgalmazók

Forgalmazó: Budapest Bank Nyrt.	1138 Budapest, Váci út 193.
---------------------------------	-----------------------------

## A forgalom, a nettó eszközérték és az árfolyam alakulása

Nyitó állomány (db)	33,965,786,232
Vétel (db)	66,039,985,709
Visszaváltás (db)	68,709,115,045
Záró Állomány (db)	31,296,656,896

	nettó eszközérték	árfolyam
2011.01.31	42,693,088,102	1.278716
2011.02.28	41,584,415,127	1.282100
2011.03.31	41,098,683,831	1.285972
2011.04.29	40,529,680,479	1.289670
2011.05.31	40,437,571,725	1.293886
2011.06.30	40,755,176,961	1.297829

## A múltbeli hozamok alakulása

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
2006.12.31*	40,153,528,034	1.024527	4.07%
2007.12.31	42,234,205,128	1.080269	5.44%
2008.12.31	33,811,535,513	1.147145	6.14%
2009.12.31	39,024,398,499	1.232171	7.41%
2010.12.31	42,949,521,873	1.275189	3.49%

\*: tört év, nem annualizált hozam

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

## Derivatív ügyletek bemutatása

Az Alapban nem voltak derivatív ügyletek a félév végén.

## 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.

2010.08.02-től módosult az Alap tájékoztatójában az egyes elemek értékelési módszere rész.

2010.10.01-től módosult az Alap befektetési politikája.

2011.01.26-től módosult az Alap megnevezése, befektetési politikája, értékelése és a Kezelési Szabályzat további pontjai.

2011.03.07-től módosult a Kezelési Szabályzat egyes elemek értékelési módszerei fejezet "Devizák, illetve nem a bázisdevizában denominált eszközök" pontja.

Az Alap az év folyamán nem vett igénybe hitelt.

## A portfólió összetétele

Az alap devizaneme: magyar forint

Budapest Pénzpiaci Alap				
Portfólió összetétel	Nyitó állomány		Záró állomány	
	2010.12.31		2011.06.30	
Eszköztípus	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly
Számlapénz	3,356,460,908	7.6%	45,516,791	0.1%
Betét	4,393,807,012	9.9%	8,014,794,791	19.6%
Jegybanki kötvény	24,162,397,092	54.6%	23,583,522,200	57.7%
Diszkont kincstárjegy	9,358,406,900	21.1%	3,758,631,300	9.2%
Államkötvény	1,551,643,613	3.5%	1,541,914,927	3.8%
Jelzáloglevél	0	0.0%	0	0.0%
Vállalati kötvény	1,513,324,500	3.4%	1,514,950,500	3.7%
Befektetési jegy	0	0.0%	0	0.0%
Részvény, ETF	0	0.0%	0	0.0%
Derivatív ügyletek	0	0.0%	0	0.0%
Repo	0	0.0%	2,853,394,430	7.0%
Forgalmazási számla egyenlege	-59,496,650	-0.1%	-474,996,943	-1.2%
<b>Portfólió összesen</b>	<b>44,276,543,375</b>	<b>100.0%</b>	<b>40,837,727,996</b>	<b>100.0%</b>
<b>Nettó eszközérték:</b>	<b>42,949,521,873</b>		<b>40,755,176,961</b>	
<b>Egy jegyre jutó nettó eszközérték:</b>	<b>1.275189</b>		<b>1.297829</b>	

## Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban

### Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban

Értékpapír neve	Értékpapír típusa	NEÉ	súly*
MNB110713	Jegybanki kötvény	12,766,339,372	42.0%
MNB110706	Jegybanki kötvény	10,817,182,828	35.6%
D110810	Diszkont kincstárjegy	1,986,584,000	6.5%
CIB CLASSIC 2012/A	Vállalati kötvény	1,514,950,500	5.0%
D110921	Diszkont kincstárjegy	789,460,800	2.6%
*: Értékpapír összesenhez viszonyítva	<b>Értékpapírok összesen:</b>	<b>30,399,018,927</b>	

Budapest, 2011. augusztus 2.

Budapest Alapkezelő Zrt.

## MELLÉKLETEK

### A portfólió részletes összetétele

#### Értékpapírok

Nytó állomány			Záró állomány		
Értékpapír összesen: 36,585,772,105 100.0%			Értékpapír összesen: 30,399,018,927 100.0%		
Portfólió elem	Eszközérték	Súly	Portfólió elem	Eszközérték	Súly
CIB CLASSIC 2012/A	1,513,324,500	4.1%	CIB CLASSIC 2012/A	1,514,950,500	5.0%
A130320A93	262,844,809	0.7%	A130320A93	255,056,088	0.8%
A140502A94	695,004,674	1.9%	A140502A94	695,584,619	2.3%
A151222B10	593,794,130	1.6%	A151222B10	591,274,220	1.9%
D110126	1,772,702,000	4.8%	D110727	497,816,000	1.6%
D110406	344,759,800	0.9%	D110810	1,986,584,000	6.5%
D110601	487,898,000	1.3%	D120111	484,770,500	1.6%
D110727	482,911,000	1.3%	MNB110706	10,817,182,828	35.6%
D110105	699,446,300	1.9%	MNB110713	12,766,339,372	42.0%
D110112	998,104,000	2.7%	D110921	789,460,800	2.6%
D110202	1,989,604,000	5.4%			
D110209	1,987,414,000	5.4%			
D110216	595,567,800	1.6%			
MNB110105	929,264,370	25.4%			
MNB110112	1,486,975,339	40.6%			

#### Folyószámla és betétek

Betét	Kód	Nytó	Záró
Magyar forint	HUF	4,393,807,012	8,014,794,791
Összesen		4,393,807,012	8,014,794,791

Folyószámla	Kód	Nytó	Záró
Magyar forint	HUF	3,356,460,908	45,516,791
Összesen		3,356,460,908	45,516,791