

# FÉLÉVES JELENTÉS 2012

## 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

Harmonizáció	nem ÁÉKBV alap	
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, illetve a hozzá tartozó Budapest Befektetési Kártya, egy, a kártyaszámlák kényelmét biztosító, de annak kamatát meghaladó hozamot elérni kívánó, elsősorban megtakarítási eszköz. A befektetések kialakításánál a biztonság és a kiszámíthatóság kap kiemelt fontosságot, ezért az Alapkezelő az összegyűjtött tőkét rövid lejáratú és alacsony hitelkockázatot hordozó kamatozó eszközökbe, diszkontkincstárjegyekbe, államkötvényekbe, egyéb repo képes értékpapírokba, hitelintézeti betétekbe és repo konstrukciókba fekteti.
---------------	--

## Forgalmazók

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

## A múltbeli hozamok alakulása

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
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%
2011.12.30*	42,422,014,207	1.322815	3.75%
2012.06.29	39,343,838,184	1.356389	-

\*: 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 az év végén.

## **Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások**

A felügyelő bizottság elnöke Ákos Tamás.

Az Alapkezelő működésében nem történt jelentős változás a 2012-es év folyamán.

## **Az Alapra ható fontosabb tényezők, befektetési politika változás, egyéb információk**

Az Alap az év folyamán nem vett igénybe hitelt.

## **Az alap befektetései 2012-ben**

Az alap az év folyamán alapvetően alacsony kamatérzékenységű diszkontkincstárjegyekbe, változó kamatozású államkötvényekbe és pénzügyi eszközökbe (különböző lejáratú bankbetét, repo) fektette a vagyonát, ennek köszönhetően az alap teljesítette a 30 napos tőkegaranciát, amelyet a befektetési politika garantál. Az év elején a bizonytalan gazdasági és politikai körülmények közt az emelkedő kamatkörnyezetben fokozatosan kerültek vissza a diszkontkincstárjegyek az alap portfóliójába az addig két hetes MNB papírban parkoló pénzekből. Majd a második negyedévben a felerősödő kamatcsökkentési várakozásokkal párhuzamosan folytatódott a hosszabb lejáratú betétek elhelyezése és a diszkontkincstárjegyek vásárlása. A portfólió kis mértékben tartalmazott és tartalmaz banki kötvényt, amely a biztonság megtartása mellett az elérhető magasabb hozam érdekében került az alap vagyonelemei közé.

## A portfólió összetétele

Az alap devizaneme: magyar forint

Budapest Pénzpiaci Alap				
Portfólió összetétel	Nyitó állomány 2011.12.30		Záró állomány 2012.06.29	
Eszköztípus	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly
Számlapénz	2,323,974	0.0%	1,126,250	0.0%
Betét	11,590,605,940	27.3%	10,799,158,497	27.4%
Jegybanki kötvény	17,346,232,945	40.8%	5,302,138,409	13.5%
Diszkont kincstárjegy	7,676,529,160	18.1%	16,970,750,326	43.1%
Államkötvény	1,542,013,334	3.6%	1,536,947,537	3.9%
Jelzáloglevél	0	0.0%	0	0.0%
Vállalati kötvény	1,514,917,500	3.6%	1,517,022,000	3.8%
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	2,846,090,275	6.7%	3,293,949,800	8.4%
Forgalmazási számla egyenlege	-9,659,358	0.0%	-1,066,500	0.0%
Követelések/Kötelezettségek	0	0.0%	0	0.0%
<b>Eszközök összesen (Bruttó eszközérték)</b>	<b>42,509,053,770</b>	<b>100.0%</b>	<b>39,420,026,319</b>	<b>100.0%</b>
Díjak	-87,039,564		-76,188,135	
<b>Nettó eszközérték:</b>	<b>42,422,014,206</b>		<b>39,343,838,184</b>	
<b>Befektetési jegy darabszám</b>	<b>32,069,492,949</b>		<b>29,006,315,524</b>	
<b>Egy jegyre jutó nettó eszközérték:</b>	<b>1.322815</b>		<b>1.356389</b>	

## Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban

Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban			
Értékpapír neve	Értékpapír típusa	NEÉ	súly*
D120808	Diszkont kincstárjegy	6,944,980,000	27.4%
D120815	Diszkont kincstárjegy	3,468,076,500	13.7%
MNB120711	Jegybanki kötvény	2,723,644,560	10.8%
MNB120704	Jegybanki kötvény	2,578,493,849	10.2%
D120704	Diszkont kincstárjegy	1,636,135,832	6.5%
*: Értékpapír összesenhez viszonyítva	<b>Értékpapírok összesen:</b>	25,326,858,272	

## A portfólió részletes összetétele

### Értékpapírok

nyitó állomány

ISIN	NÉV	Eszközérték	Arány
HU0000346218	CIB CLASSIC 2012/A	1,514,917,500	5.40%
HU0000401831	A130320A93	263,025,220	0.94%
HU0000401849	A140502A94	695,470,044	2.48%
HU0000402482	A151222B10	583,518,070	2.08%
HU0000518253	D120111	1,296,802,000	4.62%
HU0000518618	D120118	498,407,000	1.77%
HU0000518659	D120208	1,290,822,000	4.60%
HU0000518303	D120307	1,184,562,000	4.22%
HU0000623855	MNB120111	6,429,996,040	22.90%
HU0000623848	MNB120104	10,916,236,905	38.88%
HU0000518642	D120201	1,292,807,100	4.60%
HU0000518675	D120222	2,113,129,060	7.53%
			100.00%

záró állomány

ISIN	NÉV	Eszközérték	Arány
HU0000402482	A151222B10	583,857,840	2.31%
HU0000518626	D121017	254,490,600	1.00%
HU0000401831	A130320A93	256,024,097	1.01%
HU0000401849	A140502A94	697,065,600	2.75%
HU0000346218	CIB CLASSIC 2012/A	1,517,022,000	5.99%
HU0000518881	D120718	996,168,000	3.93%
HU0000518923	D120808	6,944,980,000	27.42%
HU0000624119	MNB120704	2,578,493,849	10.18%
HU0000518931	D120815	3,468,076,500	13.69%
HU0000518857	D120704	1,636,135,832	6.46%
HU0000624127	MNB120711	2,723,644,560	10.75%
HU0000518915	D120801	993,335,000	3.92%
HU0000518543	D120822	998,557,986	3.94%
HU0000518972	D120912	1,093,898,648	4.32%
HU0000518980	D120919	585,107,760	2.31%
			100.00%

### Folyószámla és betétek

Betét	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	11,590,605,940	10,799,158,497

Folyószámla	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	2,323,974	1,126,250

Budapest, 2012. augusztus 1.

Budapest Alapkezelő Zrt.