

2004. I. féléves jelentés¹ a Budapest (I.) Állampapír Befektetési Alapról

Alap megnevezése: Budapest (I.) Állampapír Befektetési Alap
Típusa: nyíltvégű értékpapír alap
Futamideje: nyilvántartásba vételtől határozatlan ideig tart

| Alapkezelő | |
|--------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|
| Budapest Alapkezelő Rt. | 1138 Budapest, Váci út 188. |
| Letétkezelő | |
| HVB Bank Hungary Rt. | 1054 Budapest, Akadémia u. 17. |
| Forgalmazók | |
| főforgalmazó | |
| Budapest Bank Rt. | 1138 Budapest Váci út 188. |
| forgalmazók | |
| BNP Paribas Hungária Bank Rt. | 1055 Budapest, Honvéd utca 20. |
| HVB Bank Hungary Rt. | 1054 Budapest, Akadémia u. 17. |
| Citibank Rt. | 1051 Budapest, Szabadság tér 7. |
| Concorde Értékpapír Rt. | 1123 Budapest, Alkotás u. 50. |
| ERSTE Bank Befektetési Rt | 1075 Budapest, Madách Imre út 13-15. |
| Magyar Takarékszövetkezeti Bank Rt. | 1122 Budapest, Pethényi köz 10. |
| Raiffeisen Bank Rt. | 1054 Budapest, Akadémia u. 6. |
| Könyvvizsgáló | |
| KPMG Hungária Könyvvizsgáló, Adó és Közgazdasági Tanácsadó Kft. | 1139 Budapest, Váci út 99. |
| Könyvvizsgáló neve/bejegyzési száma: | Kajtár László / 000269 |

| | |
|------------------------------------------------------------------|----------------|
| Értékesített befektetési jegyek darabszáma a 2004. I. félévében | 3,661,253,222 |
| Visszaváltott befektetési jegyek darabszáma a 2004. I. félévében | 7,588,599,266 |
| Forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma 2004.01.05-én | 14,962,998,306 |
| Forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma 2004.06.30-án | 11,085,442,216 |
| Összesített nettó eszközérték (Ft) 2004.06.30-án | 43,914,515,414 |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) 2004.06.30-án | 3.9615 |

Az Alap a félév folyamán nem vett igénybe hitelt.

| A nettó eszközérték és az árfolyam havi alakulása | | |
|----------------------------------------------------------|-------------------------------|----------|
| Dátum | Budapest (I.) Állampapír Alap | |
| | nettó eszközérték | árfolyam |
| 04.01.30 | 51,119,392,705 | 3.8151 |
| 04.02.27 | 46,000,047,147 | 3.8362 |
| 04.03.31 | 44,041,536,564 | 3.8878 |
| 04.04.30 | 44,712,608,169 | 3.9153 |
| 04.05.28 | 45,128,646,353 | 3.9428 |
| 04.06.30 | 43,914,515,414 | 3.9615 |

¹ a jelentés nem auditált adatokat tartalmaz

Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, befektetési politika változásai

Az Alapkezelő működésében bekövetkező változások: Módosultak a felügyelőbizottság tagjai, 2004. január 23-tól egy éves időtartamra Fodor Tamás helyett Szegedi Gabriella került az alapító által kinevezésre, 2004. május 10-től egy éves időtartamra Zsembery György helyett Dr. Batiz József lett kinevezve.

Az Alap befektetési politikájában bekövetkező főbb változások:

Az Alap befektetési eszközei kiegészültek az "Egyéb államilag garantált, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok"-kal. (Tájékoztató: I. melléklet 7.3. pont)

A Tájékoztató 5. pontjában az „Értékelésből eredő kockázat” kibővítésre került a következő bekezdéssel, valamint ehhez kapcsolódóan az I. melléklet 16. pontjában a nettó eszközértékelés megállapításába is belekerült egy bekezdés:

Értékelésből eredő kockázat

„... Az Alapok nettó eszközértékét a Letétkezelő állapítja meg. A Letétkezelő törekszik az értékelés pontosságára, de előfordulhat, hogy saját vagy más külső szolgáltató hibájából kifolyólag a nettó eszközérték hibásan kerül megállapításra. Amennyiben a hiba utólag megállapításra kerül és az eltérés nagyobb, mint a Kezelési Szabályzat 16. pontjában meghatározott hibahatárok, úgy az érintett napon tranzakciót lebonyolító ügyfelek és az Alap kompenzálásra kerülnek, amennyiben kár érte őket. A kompenzáció semmilyen esetben sem terheli az Alapot.”

Az I. melléklet 16. pontban:

„... Az Alapok nettó eszközértékének meghatározása az alábbi hibahatárok figyelembevételével történik:

| Alap típusa | hibahatár |
|----------------------------------------------------------------|-----------|
| Hazai Kötvény: Budapest (I.) Állampapír Befektetési Alap | ±0,1% |

Amennyiben az Alapok nettó eszközértékének megállapítása a fenti hibahatárt meghaladóan tévesen történik és ebből az ügyfelet vagy az Alapokat kár éri, úgy kompenzálásban részesülnek, mely kompenzáció semmilyen esetben sem terheli az Alapot.”

Az I. melléklet 16. pontjában a nettó eszközértékelésre vonatkozó szabályoknál:

„...A letétkezelő a T napi nettó eszközértéket (T a forgalmazás napja) T-1 munkanapon állapítja meg a következő adatok figyelembe vételével:

- e) T-1 napon forgalomban lévő befektetési jegy darabszám (a KELER-ben nyilvántartott befektetési jegyek mennyisége).”

Befektetési eszközök összetétele az időszak elején és végén

A befektetési eszközök összetétele nem tartalmazza az adott napra vonatkozó kötelezettségek és követelések egyenlegét.

| Budapest (I.) Állampapír Alap befektetési eszközeinek összetétele (eFt) | | | | | |
|--------------------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------|--------------------------------|
| Vagyonelem, ill. értékpapírfajta | | Időszak nyitó állománya 2004. január 05. | | Időszak záró állománya 2004. június 30. | |
| Bankbetétek | | 37,503 | | 110,352 | |
| HVB folyószámla | látraszóló | 37,503 | | 110,352 | |
| <i>Értékpapír neve</i> | | Tőzsdei értékpapírok | Tőzsdén kívüli értékpapírok | Tőzsdei értékpapírok | Tőzsdén kívüli értékpapírok |
| Jegybankképes értékpapírok | | 57,311,895 | | 42,931,587 | |
| Diszkont kincstárjegy | | 35,250,532 | | 19,958,286 | |
| D040121 | | 1,915,856 | | 0 | |
| D040317 | | 4,662,650 | | 0 | |
| D040414 | | 6,579,994 | | 0 | |
| D040512 | | 7,290,331 | | 0 | |
| D040707 | | 1,797,742 | | 1,898,676 | |
| D040901 | | 7,461,665 | | 7,852,292 | |
| D041027 | | 2,747,034 | | 2,891,058 | |
| D041222 | | 2,795,261 | | 2,845,104 | |
| D050216 | | 0 | | 933,513 | |
| D050413 | | 0 | | 3,537,643 | |
| Államkötvény | | 22,061,362 | | 22,973,301 | |
| A040324G97 | | 33,348 | | 0 | |
| A040412I01 | | 5,845,656 | | 0 | |
| A040512H99 | | 5,116,625 | | 0 | |
| A041012J01 | | 5,686,146 | | 4,719,403 | |
| A050412G02 | | 3,064,104 | | 3,517,105 | |
| A050512E00 | | 1,594,652 | | 1,594,892 | |
| A050812H02 | | 3,140 | | 1,763,773 | |
| A051012I02 | | 296,239 | | 781,404 | |
| A060412F03 | | 7,666 | | 2,862,697 | |
| A060512E01 | | 0 | | 1,457,918 | |
| A060824G03 | | 126,619 | | 2,877,474 | |
| A070412F04 | | 0 | | 3,111,766 | |
| A110212A00 | | 383 | | 372 | |
| A131220C93 | | 286,785 | | 286,498 | |
| MNB kötvény | | | | 0 | |
| Kamatkozó kincstárjegy | | 0 | | 0 | |
| Vállalati és egyéb kötvények | | 0 | | 0 | |
| Részvények | | 0 | | 0 | |
| Befektetési jegyek | | 0 | | 0 | |
| Kárpótlási jegy | | 0 | | 0 | |
| MINDÖSSZESEN | | 57,349,398 | | 43,041,938 | |