

Féléves jelentés 2009.

Alap megnevezése: Budapest Hozamvédett Származtatott Zártvégű
Befektetési Alap

Típusa: zártvégű értékpapír alap

Futamideje: 2007. február 23. - 2010. február 23.

Alapkezelő	
Budapest Alapkezelő Zrt.	1138 Budapest, Váci út 188.
Letétkezelő	
Citibank Zrt.*	1051 Budapest, Szabadság tér 7.
Forgalmazók	
főforgalmazó: Budapest Bank Nyrt.	1138 Budapest Váci út 188.
Citibank Zrt.*	1051 Budapest, Szabadság tér 7.
Könyvvizsgáló	
KPMG Hungária Kft.	1139 Budapest, Váci út 99.
Könyvvizsgáló neve/bejegyzési száma:	Henye István / 005674

* 2009. január 1-től Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe

Jegyzési időszak:	2007.01.02 - 2007.02.09
Lejegyzett mennyiség (db):	61,023
*Névérték 10.000.-Ft	

A nettó eszközérték és az árfolyam havi alakulása		
Dátum	Budapest Hozamvédett Alap	
	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)
09.01.30	619,709,417	10,155.3417
09.02.27	617,625,917	10,121.1988
09.03.31	618,149,916	10,129.7858
09.04.30	628,885,634	10,305.7148
09.05.29	632,892,239	10,371.3721
09.06.30	637,887,745	10,453.2348

Nettó eszközérték, árfolyam, és hozam alakulás			
Dátum	Budapest Hozamvédett Alap		
	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
2007.12.29*	634,642,176	10,400.0488	3.98%
2008.12.31	624,654,167	10,236.3726	-1.56%

Az alap 2007-ben indult.

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

*: tört év, nem annualizált hozam

Féléves jelentés 2009.

Származtatott ügyletre vonatkozó információk	
Típus:	nem tőzsdei származtatott termék
Mögöttes termék:	1/10 SX5E Index; 1/10 CECEEUR index; 1/10 HSCEI index; 1/10 NKY Index; 1/10 JPMGEMLC Index; 1/10 JPMTJPN Index; 1/5 DJAIG Index; 1/5 EPEU Index
Névérték:	610,230,000
Eszközérték:	22,151,349
Kötésnap:	2007.02.23
Lejárat:	2010.02.23
Árfolyam:	3.63

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

Az Alapkezelő működésében nem történt jelentős változás a 2009-es év folyamán.

Az Alap befektetési politikájában nem történt változás.

Egyéb információk

Az Alap az év folyamán nem vett igénybe hitelt.

A portfólió összetétele

Budapest Hozamvédett Alap	Nyitó állomány		Záró állomány	
	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly
Portfólió összetétel				
Számlapénz	373,041	0.06%	513,127	0.08%
Betét	617,643,277	98.72%	616,216,356	96.45%
Államkötvény	0	0.00%	0	0.00%
Diszkont kincstárjegy	0	0.00%	0	0.00%
Jegybanki kötvény	0	0.00%	0	0.00%
Jelzáloglevél	0	0.00%	0	0.00%
Befektetési jegy	0	0.00%	0	0.00%
Vállalati kötvény	0	0.00%	0	0.00%
Részvény, ETF	0	0.00%	0	0.00%
Derivatív ügyletek	7,627,875	1.22%	22,151,349	3.47%
Repo	0	0.00%	0	0.00%
Portfólió összesen	625,644,193	100.00%	638,880,832	100.00%
Nettó eszközérték:	624,654,167		637,887,745	

Budapest, 2009. augusztus 7.

Féléves jelentés 2009.

MELLÉKLETEK

Záró állomány		
Portfólió elem	Eszközérték	Súly
MAGYAR FORINT	513,127	0.08%
BETÉT	616,216,356	96.45%
HOZAMVÉDETT STRUKTÚRÁLT	22,151,349	3.47%
Portfólió összesen	638,880,832	100.00%

Nyitó állomány		
Portfólió elem	Eszközérték	Súly
MAGYAR FORINT	373,041	0.06%
BETÉT	617,643,277	98.72%
HOZAMVÉDETT STRUKTÚRÁLT	7,627,875	1.22%
Portfólió összesen	625,644,193	100.00%