

FÉLÉVES JELENTÉS 2012

Alapadatok

Neve	Budapest 2016 Alapok Alapja
Elnevezés angolul	Budapest 2016 Fund of Funds
Rövid neve	Budapest 2016 Alapok Alapja
Rövid név angolul	Budapest 2016 Fund of Funds

Harmonizáció	nem ÁÉKBV alap	
Az alap típusa, fajtája	nyilvános, nyíltvégű, értékpapír befektetési alap	
Futamideje	határozatlan	
Indulás dátuma	2008. január 18. (PSZÁF engedély száma: E-III/110.588-1/2008)	
Az alapcímlet devizaneme	HUF	
A sorozatok adatai		
„HUF” sorozat	névérték 10,000 HUF	ISIN kód: HU0000706056

Alapkezelő	Budapest Alapkezelő Zrt.
Székhely	1138 Budapest, Váci út 193.
Letétkezelő	UniCredit Bank Hungary Zrt.
Székhely	1054 Budapest, Szabadság tér 5-6.
Könyvvizsgáló	KPMG Hungária Kft.
Székhely	1139 Budapest, Váci út 99.
Könyvvizsgáló személy	Juhász Attila / 006065

Az Alap célja	Az Alap célja, hogy ügyfelei számára kockázatos (jellemzően részvénytőkepiaci kitétséget biztosító) és biztonságos, pénzügyi kitétséget jelentő befektetések megfelelő kombinációjával vonzó hozamú, de a tiszta részvényalapoknál kisebb kockázatot hordozó befektetési alternatívát nyújtson. Az Alapkezelő az Alap eszközeinek befektetésénél elsősorban a biztonságot és az értékmegőrzést, illetve a korlátozott kockázatvállalás mellett történő minél nagyobb hozam elérését tartja szem előtt.
---------------	--

Az Alap jellemző eszköz összetétele

Jellemző eszközösszetétel (értékpapírokból és származtatott ügyletekből)	Egyéb jellemzők
Részvény: Max 50%	Tőkevesztés elleni korlátozott védelem

Forgalmazók

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

A múltbeli hozamok alakulása

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
2008.12.31*	2,759,080,649	8,848.2269	-11.43%
2009.12.31	2,882,469,394	9,571.1908	8.17%
2010.12.31	2,909,313,608	10,039.9055	4.90%
2011.12.30*	785,117,113	10,506.6123	4.65%
2012.06.29	780,352,374	10,822.5132	-

*: tört év, nem annualizált hozam

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

Derivatív ügyletek bemutatása

NÉV	ESZKÖZÉRTÉK	LEJÁRAT
HUF/USD	8,172,163	2012.07.18
HUF/USD	722,323	2012.07.11
HUF/USD	1,006,812	2012.07.11
HUF/USD	7,265,122	2012.07.18
USD/HUF	-423,963	2012.07.18

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

2012.01.09-től a PSZÁF KE-III-50110/2011. számú határozatával módosult a befektetési politika, az alapkezelői díj mértéke és az Alap elnevezése.

Az Alap az év folyamán nem vett igénybe hitelt.

Az alap befektetései 2012-ben

Az Alap tőkepiaci periódusa 2012. január 1-én indult. A portfólió ekkortól átalakításra került, bekerültek a részvénypiaci eszközök a portfólióba. Az év első felében a részvény típusú eszközök súlya 30% körül mozgott. A befektetési döntéseket meghatározza az ígért tőkevédelem, a részvény eszközök súlyának változtatása összhangban történt a tőkevédelmet biztosító modell iránymutatásával. A befektetési politika, a részvény eszközök aktív, modell alapú kezelése által biztosítja az Alap tájékoztatójában megfogalmazott tőkevédelmet.

A portfólió összetétele

Az alap devizaneme: magyar forint

Az Alapba csak tőzsdére bevezetett részvények és ETF-ek vásárolhatóak.

Budapest 2016 Alap				
Portfólió összetétel Eszköztípus	Nyitó állomány 2011.12.30		Záró állomány 2012.06.29	
	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly
Számlapénz	1,697,362	0.2%	9,158,428	1.2%
Betét	474,573,666	60.3%	0	0.0%
Jegybanki kötvény	227,645,626	28.9%	27,972,812	3.6%
Diszkont kincstárjegy	84,761,860	10.8%	59,583,740	7.6%
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%	411,856,416	52.7%
Részvény, ETF	0	0.0%	254,644,550	32.6%
Derivatív ügyletek	0	0.0%	16,742,457	2.1%
Repo	0	0.0%	0	0.0%
Forgalmazási számla egyenlege	-1,751,539	-0.2%	1,713,467	0.2%
Követelések/Kötelezettségek	0	0.0%	0	0.0%
Eszközök összesen (Bruttó eszközérték)	786,926,975	100.0%	781,671,870	100.0%
Díjak	-1,809,861		-1,319,496	
Nettó eszközérték:	785,117,114		780,352,374	
Befektetési jegy darabszám	74,726		71,707	
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	10506.6123		10882.5132	

Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban

Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban			
Értékpapír neve	Értékpapír típusa	NEÉ	súly*
BUDAPEST BONITAS BEF.JEGY	Befektetési jegy	411,856,416	54.6%
SPDR S&P DIVIDEND ETF	ETF	254,644,550	33.8%
MNB120704	Jegybanki kötvény	27,972,812	3.7%
D120718	Diszkont kincstárjegy	19,923,360	2.6%
D120808	Diszkont kincstárjegy	19,842,800	2.6%
*: Értékpapír összesenhez viszonyítva	Értékpapírok összesen:	754,057,518	

A portfólió részletes összetétele

Az alap devizaneme: magyar forint

Értékpapírok

nyitó állomány

ISIN	NÉV	Eszközérték	Arány
HU0000518253	D120111	44,889,300	14.37%
HU0000518618	D120118	39,872,560	12.76%
HU0000623855	MNB120111	97,771,856	31.30%
HU0000623848	MNB120104	129,873,770	41.57%
			100.00%

záró állomány

ISIN	NÉV	Eszközérték	Arány
HU0000702725	BUDAPEST BONITAS BEF.JEGY	411,856,416	54.62%
HU0000518881	D120718	19,923,360	2.64%
HU0000518923	D120808	19,842,800	2.63%
HU0000624119	MNB120704	27,972,812	3.71%
HU0000518931	D120815	19,817,580	2.63%
US78464A7634	SPDR S&P DIVIDEND ETF	254,644,550	33.77%
			100.00%

Folyószámla és betétek

Betét	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	474,573,666	0

Folyószámla	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	1,697,362	1,121,705
USA dollár	USD	0	8,036,723
Összesen		1,697,362	9,158,428

Budapest, 2012. augusztus 1.

Budapest Alapkezelő Zrt.