

FÉLÉVES JELENTÉS 2012

Alapadatok

Neve	Határtalan Európa Tőkevédett Származtatott Nyíltvégű Befektetési Alap	
Rövid neve	Határtalan Európa Alap	
Harmonizáció	nem ÁÉKBV alap	
Az alap típusa, fajtája	nyilvános, nyíltvégű, származtatott ügyletekbe fektető befektetési alap.	
Futamideje	határozott: 2009. december 7-től 2012. december 7-ig	
Indulás dátuma	2009. december 07. (PSZÁF engedély száma: EN-III/ÉA-178/2009)	
Az alapcímlet devizaneme	HUF	
Sorozatok adatai		
„HUF” sorozat;	névérték 10,000 HUF	ISIN kód HU0000708292

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	Dudás Csaba / 006112

Az Alap célja	<p>Az Alap az európai részvénytőzsdék eszközeiben rejlő befektetési lehetőséget kívánja kiaknázni: a befektetők az európai részvénytőzsdére egy dinamikusan kontrollált kockázatú indexen keresztül fektethetnek be, és mindezek mellett a befektetők tőkéje védelmet élvez az Alap lejáratakor. Emellett az Alap védelmet nyújt a befektetőknek arra az esetre is, ha a részvénytőzsdék a futamidő végén esnének drasztikusan – mivel a teljesítményt nem kizárólag az Alap lejáratának napján publikált indexárfolyam határozza meg, hanem az utolsó hat hónap meghatározott napjain rögzített indexárfolyamok átlaga.</p>
---------------	--

Forgalmazók

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

A múltbeli hozamok alakulása

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
2009.12.31*	1,440,393,088	9,836.1975	-1.76%
2010.12.31*	1,360,966,112	9,494.5383	-3.47%
2011.12.30*	1,238,729,553	9,519.0965	0.26%
2012.06.29	2,483,661,148	9862.3197	-

*: tört év, nem annualizált hozam

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

Derivatív ügyletek bemutatása:

Mögöttes termék: BNPIXEP Index

NÉV	ESZKÖZÉRTÉK	LEJÁRAT
Határtalan Európa Struktúrált	-36,253,152	2012.12.07
Határtalan Európa Struktúrált	-36,379,031	2012.12.07

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 befektetési politikájában nem történt változás.

Az Alap az év folyamán nem vett igénybe hitelt.

Az alap befektetései 2012-ben

Az alap statikus befektetési stratégiájának megfelelően a Budapest Banknál elhelyezett betétben és összetett opciós struktúrában tartja eszközeit. A tőkevédelmet a bankbetét, a tőkepiacok teljesítményéhez kötött kifizetést pedig az opciós struktúra biztosítja. Az opciós struktúra névértékét az Alap forgalmazásának megfelelően változtattuk a félév folyamán.

A portfólió összetétele

Az alap devizaneme: magyar forint

Határtalan Európa Alap					
Portfólió összetétel	Nyitó állomány 2011.12.30		Záró állomány 2012.06.29		
	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly	
Számlapénz	18,521,435	1.5%	38,149,453	3.1%	
Betét	1,301,301,840	104.9%	1,240,905,411	99.8%	
Jegybanki kötvény	0	0.0%	0	0.0%	
Diszkont kincstárjegy	0	0.0%	0	0.0%	
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%	0	0.0%	
Részvény, ETF	0	0.0%	0	0.0%	
Derivatív ügyletek	-79,640,172	-6.4%	-36,253,152	-2.9%	
Repo	0	0.0%	0	0.0%	
Forgalmazási számla egyenlege	0	0.0%	0	0.0%	
Követelések/Kötelezettségek	0	0.0%	0	0.0%	
Eszközök összesen (Bruttó eszközérték)	1,240,183,103	100.0%	1,242,801,712	100.0%	
Díjak	-1,453,550		-1,342,773		
Nettó eszközérték:	1,238,729,553		1,241,458,939		
Befektetési jegy darabszám	130,131		125,879		
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	9519.0965		9862.3197		

Legnagyobb súlyú értékpapírok a portfólióban

Az alapon június 29-én nem voltak értékpapírok.

A portfólió részletes összetétele

Értékpapírok

Az alapon június 29 -én nem voltak értékpapírok.

Folyószámla és betétek

Betét	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	1,301,301,840	2,482,884,533

Folyószámla	Kód	Nyitó	Záró
Magyar forint	HUF	18,521,434	76,327,883

Budapest, 2012. augusztus 1.

Budapest Alapkezelő Zrt.