

Budapest Országos Önkéntes Kölcsönös Nyugdíjpénztár 2011. év

1. A pénztár 2011. év eleji és végi taglétszáma

Megnevezés	2011. január 1.	2011. december 31.
Taglétszám (fő)	23 197	21 707

2. A tagdíjbevételek pénztári tartalékok közötti megosztása 2011. évben

Tartalékok közötti megosztás 2011.01.01.-2011.12.31	Tagdíj
Fedezeti tartalék	95%
Működési tartalék	4,8%
Likviditási tartalék	0,2%

3. A pénztár teljes vagyonának 2011. évi nyitó és záró értéke

Megnevezés	2011. január 1.	2011. december 31.
Pénztár vagyona piaci értéken (ezer Ft)	19 616 778	18 529 278

4. A pénztár teljes vagyonának 2011. évi eszközcsoportonkénti százalékos megoszlása az év elején és végén

Eszközcsoport	%-os megoszlás 2011. január 1-én	%-os megoszlás 2011. december 31-én
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok (kötvények)	42,28%	54,15%
Hazai részvények	0,13%	0,01%
Külföldi részvények	29,17%	23,12%
Befektetési jegyek	14,33%	9,63%
Jelzáloglevél	4,56	1,05%
Egyéb (bankszámla, értékpapír ügyletből származó követelések kötelezettségei)	9,53%	12,04%

5. A választható portfóliók hozamának, valamint a referenciaindexek hozamrátájának alakulása:

Portfólió	Aktív				Bebiztosító			
	Nettó hozam- ráta %	Bruttó hozam- ráta %	Referen- cia index hozam- rátája %	Záró piaci érték (ezer Ft)	Nettó hozam- ráta %	Bruttó hozam- ráta %	Referen- cia index hozam- rátája %	Záró piaci érték (ezer Ft)
2002	5,32	-	10,02	-	5,32	-	10,02	-

Budapest Önkéntes Nyugdíjpénztár

2003	6,93	8,05	6,85	-	-0,63	0,47	-0,31	-
2004	19,13	20,39	23,89	-	13,16	14,11	13,44	-
2005	14,48	15,57	16,65	-	8,6	9,38	8,42	-
2006	7,32	8,32	10,35	-	5,57	6,32	6,69	-
2007	6,62	7,56	7,4	-	6,33	7,1	7,36	-
2008	-18,45	-17,72	-19,38	-	4,08	4,72	7,03	-
2009	17,85	18,76	25,36	12 448 409	10,82	11,54	8,44	5 051 815
2010	17	17,8	14,27	14 235 322	6,24	6,91	5,79	5 128 701
2011	-0,99	-0,38	-0,18	13 342 459	5,99	6,51	4,48	4 913 838

Megnevezés			Nettó hozamráta %
Aktív portfólió	10 éves átlagos pénztári hozamráta* (2002-2011)		6,94
	10 éves vagyonnövekedési mutató** (2002-2011)		6,31

Megnevezés			Nettó hozamráta %
Bebiztosító portfólió	10 éves átlagos pénztári hozamráta* (2002-2011)		6,49
	10 éves vagyonnövekedési mutató** (2002-2011)		6,65

* a vagyonkezelői teljesítményt mutatja

** a pénztártagok egyéni számlájának átlagos hozamát jellemzi

Megnevezés	%
A 2011. évi december/december infláció	4,10
Átlagos éves december/december infláció az elmúlt 10 évben: (az átlaghozamokkal azonos módon, a 2002-2011. évekre számítva)	5,10

6. A választható portfóliók 2011. évi nyitó és záró értékei

portfólió megnevezése, értéke (ezer Ft)	2011. január 1.	2011. december 31.
Aktív	14 235 322	13 342 459
Bebiztosító	5 128 701	4 913 838

7. A választható portfóliók 2011. évi eszközcsoportonkénti százalékos megoszlása az év elején és végén:

Eszközcsoporth	Aktív portfólió		Bebiztosító portfólió	
	Jan. 1.	Dec. 31.	Jan. 1.	Dec. 31.
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	33,73%	49,59%	67,44%	69,01%
Hazai részvények	0,19%	0,01%	0%	0%
Külföldi részvények	40,19%	32,09%	0%	0%
Befektetési jegyek	19,75%	13,37%	0%	0%
Jelzáloglevél	3,75%	0%	7,05%	3,96%
Egyéb (bankszámla, értékpapír ügyletből származó követelések kötelezettségei)	2,39%	4,94%	25,51%	27,03%

8. A választható portfóliók 2011. évi befektetési politikában meghatározott eszközcsoportonkénti megengedett minimális és maximális %-os megoszlása és a referencia index

Eszközök	Aktív portfólió		Bebiztosító portfólió	
	Min.	Max.	Min.	Max.
Állampapírok, jegybankképes értékpapírok, vagy jellemzően ilyen eszközöket tartalmazó befektetési alapok jegyei	0%	100%	50%	100%
Hitelintézeteknél elhelyezett betétek, kihelyezési célú (fordított) repoügyletek, számlapénz	0%	40%	0%	50%
1. és 2. együtt	10%	100%	80%	100%
Külföldi devizában kibocsátott állampapírok	0%	25%	0%	20%
Vállalati kötvények	0%	20%	0%	20%
Jelzáloglevelek	0%	20%	0%	20%
Ingatlanalapok, illetve ingatlanalapokat tartalmazó befektetési alapok jegyei, beleértve az exchange traded fundokat (ETF), valamint a real estate investment trustokat (REIT) is.	0%	20%	0%	0%
Részvények vagy ilyen eszközöket tartalmazó befektetési alapok jegyei, beleértve az ún. exchange traded fundokat (ETF) is.*	0%	60%	0%	10%
Kockázati tőkealapjegyek	0%	5%	0%	0%
Egyéb befektetési alapok jegyei**	0%	15%	0%	0%
Értékpapír kölcsönzési ügyletből származó követelések	0%	30%	0%	30%
Határidős, opciós és egyéb származékos ügyletek***	0%	50%	0%	20%
Swap ügyletek mögöttes eszközértéke (notional, underlying value)	0%	50%	0%	20%
Swap ügyletek piaci értéke	0%	10%	0%	10%
Egyéb, tőzsdén vagy szabályozott piacon jegyzett értékpapír	0%	10%	0%	0%

Az egyes portfóliók referenciaindex:	
Aktív	25% Bloomberg World Index (BWORLD Index) saját devizában számolt értéke 25% Bloomberg World Index (BWORLD Index) saját devizában számolt értéke 50% MAX (MAX IDX Index)
Bebiztosító	75% RMAX 25% MAX Composite

9. A választható portfóliók 2012. évi befektetési politikában meghatározott eszközcsoportonkénti megengedett minimális és maximális %-os megoszlása és a referencia index

A befektetési politika 2012. évre vonatkozóan nem módosult, megegyezik a 2011. évi befektetési politikában foglaltakkal.