

Féléves jelentés 2009.

Alap megnevezése: Budapest Klíma Tőkevédett Származtatott Nyíltvégű Befektetési Alap
Típusa: nyíltvégű értékpapír alap
Futamideje: 2008. január 18. – 2011. január 18-ig

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.
Könyvvizsgáló	
KPMG Hungária Kft.	1139 Budapest, Váci út 99.
Könyvvizsgáló neve/bejegyzési száma:	Juhász Attila / 006065

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

Jegyzési időszak:	2007.11.12.-	2008.01.04	
Forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma 2009.01.05-én (nyitó állomány)			311,823
Értékesített befektetési jegyek darabszáma a 2009. évben			324
Visszaváltott befektetési jegyek darabszáma a 2009. évben			8,587
Forgalomban lévő befektetési jegyek darabszáma 2009.06.30-án (záró állomány)			303,560

*Névérték 10.000.-Ft

A nettó eszközérték és az árfolyam havi alakulása		
Dátum	Budapest Klíma Alap	
	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)
09.01.30	2,721,556,379	8,764.3430
09.02.27	2,654,983,929	8,609.6511
09.03.31	2,627,180,619	8,598.0613
09.04.30	2,707,714,128	8,866.0655
09.05.29	2,750,934,266	9,021.5863
09.06.30	2,738,804,492	9,022.2839

Nettó eszközérték, árfolyam, és hozam alakulás			
Dátum	Budapest Klíma Alap		
	nettó eszközérték (Ft)	árfolyam (Ft/db)	hozam (%)
2008.12.31*	2,759,080,649	8,848.2269	-11.43%

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:	1/15 REC NO Equity; 1/15 FPL UN Equity; 1/15 STP UN Equity; 1/15 VWS DC Equity; 1/15 GAM SM Equity; 1/15 6370 JP Equity; 1/15 9503 JT Equity; 1/15 APD UN Equity; 1/15 WMI UN Equity; 1/15 GEVN VX Equity; 1/3 DCIBAGER INDEX
Névérték:	3,036,600,000
Eszközérték:	-353,460,240
Kötésnap:	2008.01.18
Lejárat:	2011.01.18
Árfolyam:	-11.64

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.

Budapest Klíma Alap	Nyitó állomány		Záró állomány	
	Eszközérték	Súly	Eszközérték	Súly
Portfólió összetétel				
Számlapénz	74,668,779	2.70%	55,614,651	2.02%
Betét	3,102,970,355	112.04%	3,046,322,196	110.84%
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	-408,241,757	-14.74%	-353,460,240	-12.86%
Repo	0	0.00%	0	0.00%
Portfólió összesen	2,769,397,377	100.00%	2,748,476,607	100.00%
Nettó eszközérték:	2,759,080,649		2,738,804,492	

A portfólió összetétele

Budapest, 2009. augusztus 7.

Féléves jelentés 2009.

MELLÉKLETEK

Záró állomány		
Portfólió elem	Eszközérték	Súly
MAGYAR FORINT	1,031,680	0.04%
MAGYAR FORINT	54,582,971	1.99%
BETÉT	1,973,874,363	71.82%
BETÉT	1,000,951,311	36.42%
BETÉT	71,496,522	2.60%
KLÍMA STRUKTÚRÁLT	-353,460,240	-12.86%
Portfólió összesen	2,748,476,607	100.00%

Nytó állomány		
Portfólió elem	Eszközérték	Súly
MAGYAR FORINT	74,333,185	2.68%
MAGYAR FORINT	335,594	0.01%
BETÉT	998,150,144	36.04%
BETÉT	1,972,365,811	71.22%
BETÉT	132,454,400	4.78%
KLÍMA STRUKTÚRÁLT	-408,241,757	-14.74%
Portfólió összesen	2,769,397,377	100.00%