

Access BWM Hedge Fund Követő Származtatott Nyíltvégű Befektetési Alap PORTFOLIÓ JELENTÉS

2011. szeptember

Alapadatok

Letétkezelő: Erste Bank Hungary Zrt.
Könyvvizsgáló: HKH Consulting Kft.
Vezető Forgalmazó: Buda-Cash Brókerház Zrt.
Forgalmazók: Equilor Bef. Zrt., Codex Értéktár Zrt.
Kibocsátás időpontja: 2008.05.19
Nyilvántartásba vételi szám: 1111-278
ISIN kód: HU0000706437
NEÉ számítás típusa: T+2 napra számolt.
Az alap devizaneme: HUF

Befektetési Politika:

Az Alap az átlagosnál lényegesen magasabb kockázatot felvállalva, rövid- és középtávú pozíciókat vesz fel a lehető legszélesebb spektrumú piacokon. Ez magában foglalja a nemzetközi részvény, határidős, devizapiacokat. Az Alap elsődleges célpiacát olyan – külföldi kibocsátású – részvények, ETF-ek stb. jelentik, amelyek a legnagyobb forgalmú nemzetközi tőzsdék elektronikus piacain kiemelkedő forgalommal, likviditással rendelkeznek, azaz amelyekre nézve a hatékony tőkepiac feltételei leginkább teljesülnek. Amikor az Alapkezelő sehol sem lát jó hozam/kockázat lehetőséget, rövid hátralévő futamidejű állampapírokat is vásárolhat. Az Alap szokásosnál magasabb kockázatának oka, hogy a származtatott alapok a jogszabály által megengedett, saját tőkéjükre vetített maximum kétszeres tőkeáttételt is felvehetnek, amely lehetőséggel az Alapkezelő indokolt piaci helyzetekben – szigorú kockázatkezelési szabályokat betartva – élni is kíván.

Saját tőke / Nettó eszközérték (2011. 10. 04): 82 331 638

Egy jegyre jutó nettó eszközérték (2011. 10. 04): 0,734892

Befektetési jegyek darabszáma: 112 032 245

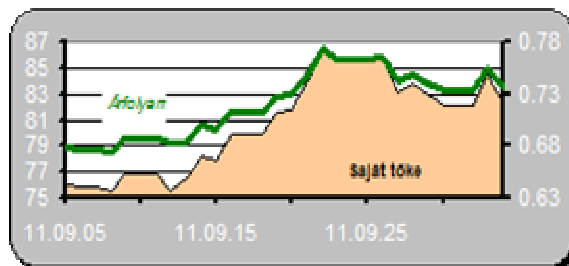
A portfólió összetétele T napon

Befektetési Eszközök	HUF	NEÉ százalékában
Folyószámla	7 154 632	8.69
Folyószámla USD	2 594 151	3.15
Külföldi részvények	70 801 238	85.99
Nyitott határidős ügyletek eredménye	5 838 920	7.09

Az alap teljesítménye:

Tárgyhavi hozam	Éves hozam
9.07	-36.29

Az alap nettó eszközérték és az egy jegyre jutó nettó eszközérték változása 2011. szeptember hónapban



Kötelezettségek halmozott	HUF	NEÉ százalékában
Alapkezelői díj	0	0
Letétkezelési díj	37 538	-0.04
Felügyeleti díj	5 361	0
Forgalmazói díj	235 940	-0.28
Egyéb díj költség	3 786 392	-4.59

Az alap hiteltartozása kamatokkal együtt: -

Az alap által óvadékba adott eszközök: -

Megjegyzés: A nettó eszközérték és a portfólió összetétel különbsége a megkötött de még el nem számolt ügyletek, és a forgalmazási számla egyenlege miatt jön létre.

A portfóliójelentés auditálatlan (a könyvvizsgáló által nem ellenőrzött) adatokat tartalmaz.

A múltbeli hozamok az Alap jövőbeli teljesítményére nem jelentenek garanciát.

Az alap részletes leírását, befektetési politikáját, a költségeket a Tájékoztató és a Kezelési szabályzat tartalmazzák, melyek elérhetők a forgalmazási helyeken és a www.access.hu internetes oldalon.

Budapest, 2011. október 10.