

**OTP Klímaváltozás 130/30
Részvény Alap**

*Éves jelentés
és
független könyvvizsgálói jelentés*

2020. december 31.

FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

Az OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük az OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap (az „Alap”) 2020. évi éves jelentésének I - XV. pontjaiban található számviteli információinak (a „számviteli információk”) könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap mellékelt 2020. december 31-ével végződő üzleti évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a Magyarországon hatályos, a számvitelről szóló 2000. évi C. törvénnyel (a „számviteli törvény”), valamint a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek összeállításra. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban szereplő eszközök és kötelezettségek leltárral alátámasztottak. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

A vélemény alapja

Könyvvizsgálatunkat a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal összhangban és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok alapján hajtottuk végre. Ezen standardok értelmében fennálló felelősségünk bővebb leírását jelentésünk „A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége” szakasza tartalmazza.

Függetlenek vagyunk az Alaptól és annak kezelőjétől, az OTP Alapkezelő Zrt.-től a vonatkozó, Magyarországon hatályos jogszabályokban és a Magyar Könyvvizsgálói Kamara „A könyvvizsgálói hivatás magatartási (etikai) szabályairól és a fegyelmi eljárásról szóló szabályzata”-ban, valamint az ezekben nem rendezett kérdések tekintetében a Könyvvizsgálók Nemzetközi Etikai Standardok Testülete által kiadott „Nemzetközi etikai kódex kamarai tag könyvvizsgálóknak (a nemzetközi függetlenségi standardokkal egybefoglalva)” című kézikönyvében (az IESBA Kódex-ben) foglaltak szerint, és megfelelünk az ugyanezen normákban szereplő további etikai előírásoknak is.

Meggyőződésünk, hogy az általunk megszerzett könyvvizsgálati bizonyíték elegendő és megfelelő alapot nyújt véleményünkhöz.

Egyéb információk

Az egyéb információk az éves jelentésben foglalt nem számviteli információkból állnak. Az OTP Alapkezelő Zrt. vezetése (a „vezetés”) felelős az egyéb információk elkészítéséért. Az éves jelentésben közölt számviteli információkra a független könyvvizsgálói jelentésünk „Vélemény” szakaszában adott véleményünk nem vonatkozik az egyéb információkra, és az egyéb információkra vonatkozóan nem bocsátunk ki semmilyen formájú bizonyosságot nyújtó következtetést.

Az éves jelentés általunk végzett könyvvizsgálatával kapcsolatban a mi felelőségünk az egyéb információk átolvasása és ennek során annak mérlegelése, hogy az éves jelentésben foglalt egyéb információk lényegesen ellentmondanak-e az éves jelentésben közölt számviteli információknak vagy a könyvvizsgálat során szerzett ismereteinknek, vagy egyébként úgy tűnik-e, hogy azok lényeges hibás állítást tartalmaznak. Ha az elvégzett munkánk alapján arra a következtetésre jutunk, hogy az egyéb információk lényegesen hibás állítást tartalmaznak, kötelességünk erről és a hibás állítás jellegéről jelentést tenni.

Az egyéb információkban lényeges ellentmondás vagy lényeges hibás állítás nem jutott a tudomásunkra, így e tekintetben nincs jelenteni valónk.

A vezetés és az irányítással megbízott személyek felelőssége az éves jelentésben közölt számviteli információkért

A vezetés felelős az éves jelentésben közölt számviteli információknak a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel és a számviteli törvénnyel összhangban történő elkészítéséért, különös tekintettel az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által megadott értékelése alapján történő elszámolásáért, valamint az olyan belső kontrollérről, amelyet a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő lényegesen hibás állítástól mentes éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése során a vezetés felelős azért, hogy felmérje az Alapnak a vállalkozás folytatására való képességét és az adott helyzetnek megfelelően közzétegye a vállalkozás folytatásával kapcsolatos információkat, valamint a vezetés felel a vállalkozás folytatásának elvén alapuló, éves jelentésben közölt számviteli információk összeállításáért. A vezetésnek a vállalkozás folytatásának elvéből kell kiindulnia, ha ennek az elvnek az érvényesülését eltérő rendelkezés nem akadályozza, illetve a vállalkozási tevékenység folytatásának ellentmondó tényező, körülmény nem áll fenn.

Az irányítással megbízott személyek felelősek az Alap pénzügyi beszámolási folyamatának felügyeletéért.

A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége

A könyvvizsgálat során célunk kellő bizonyosságot szerezni arról, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk egésze nem tartalmaz akár csalásból, akár hibából eredő lényegesen hibás állítást, valamint az, hogy ennek alapján a véleményünket tartalmazó független könyvvizsgálói jelentést bocsássunk ki. A kellő bizonyosság magas fokú bizonyosság, de nem garancia arra, hogy a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvényekkel és egyéb jogszabályokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálat mindig feltárja az egyébként létező lényegesen hibás állítást. A hibás állítások eredhetnek csalásból vagy hibából, és lényegesen minősülnek, ha észszerű lehet az a várakozás, hogy ezek önmagukban vagy együttesen befolyásolhatják a felhasználók adott éves jelentésben közölt számviteli információk alapján meghozott gazdasági döntéseit.

A Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardok és a könyvvizgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok szerinti könyvvizgálat egésze során szakmai megítélést alkalmazunk és szakmai szkepticizmust tartunk fenn.

Továbbá:

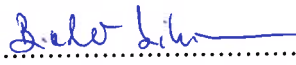
- Azonosítjuk és felmérjük az éves jelentésben közölt számviteli információk akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állításainak a kockázatait, kialakítjuk és végrehajtjuk az ezen kockázatok kezelésére alkalmas könyvvizsgálati eljárásokat, valamint elegendő és megfelelő könyvvizsgálati bizonyítékot szerzünk a véleményünk megalapozásához. A csalásból eredő lényeges hibás állítás fel nem tárásának a kockázata nagyobb, mint a hibából eredőé, mivel a csalás magában foglalhat összejátszást, hamisítást, szándékos kihagyásokat, téves nyilatkozatokat, vagy a belső kontroll felülírását.
- Megismerjük a könyvvizgálat szempontjából releváns belső kontrollt annak érdekében, hogy olyan könyvvizsgálati eljárásokat tervezzünk meg, amelyek az adott körülmények között megfelelőek, de nem azért, hogy a belső kontroll hatékonyságára vonatkozóan véleményt nyilvánítsunk.
- Értékeljük a vezetés által alkalmazott számviteli politika megfelelőségét és a vezetés által készített számviteli becslések és kapcsolódó közzétételek észszerűségét.
- Következtetést vonunk le arról, hogy helyénvaló-e a vezetés részéről a vállalkozás folytatásának elvén alapuló számvitel alkalmazása, valamint a megszerzett könyvvizsgálati bizonyíték alapján arról, hogy fennáll-e lényeges bizonytalanság olyan eseményekkel vagy feltételekkel kapcsolatban, amelyek jelentős kétséget vethetnek fel az Alap vállalkozás folytatására való képességét illetően. Amennyiben azt a következtetést vonjuk le, hogy lényeges bizonytalanság áll fenn, független könyvvizsgálói jelentésünkben fel kell hívnunk a figyelmet az éves jelentésben közölt számviteli információkban lévő kapcsolódó közzétételekre, vagy ha a közzétételek e tekintetben nem megfelelőek, minősítenünk kell véleményünket. Következtetéseink a független könyvvizsgálói jelentésünk dátumáig megszerzett könyvvizsgálati bizonyítékon alapulnak. Jövőbeli események vagy feltételek azonban okozhatják azt, hogy az Alap nem tudja a vállalkozást folytatni.
- Megvizsgáljuk az éves jelentésben közölt számviteli információkat, különös tekintettel az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárára, valamint az adott időszakban elszámolt kezelési költségekre. Megvizsgáljuk, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek-e összeállításra.

Az irányítással megbízott személyek tudomására hozzuk - egyéb kérdések mellett - a könyvvizgálat tervezett hatókörét és ütemezését, a könyvvizgálat jelentős megállapításait, beleértve az Alapkezelő által alkalmazott belső kontrollnak a könyvvizgálatunk során általunk azonosított jelentős hiányosságait is, ha voltak ilyenek.

Budapest, 2021. április 27.



Molnár Gábor
Deloitte Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft.
1068 Budapest Dózsa György út 84/C.
Nyilvántartási szám: 000083



Binder Szilvia
Kamarai tag könyvvizsgáló
Tagszám: 003801



OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Éves jelentés a 2020. december 31-én zárult üzleti évről

Pénzügyi év: 2020. január 1-től
2020. december 31-ig

Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Székhelye:	1026 Budapest, Riadó u.1-3.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Székhelye:	1051 Budapest, Nádor u.16.

OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Mérleg

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Előző év 2019. december 31.	Tárgyév 2020. december 31.
a.	b.	c.	d.
01.	A) Befektetett eszközök	0	0
02.	I. Értékpapírok	0	0
03.	1. Értékpapírok	0	0
04.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	0	0
05.	a) kamatokból, osztalékból	0	0
06.	b) egyéb piaci megítélésből	0	0
07.	II. Hosszú lejáratú bankbetétek	0	0
08.	B. Forgóeszközök	8.086.366	38.096.358
09.	I. Követelések	0	7.812.926
10.	1. Követelések	0	7.812.926
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	0	0
14.	II. Értékpapírok	7.247.797	24.801.606
15.	1. Értékpapírok	6.526.027	22.938.675
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	721.770	1.862.931
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	36
18.	b) egyéb piaci megítélésből	721.770	1.862.895
19.	III. Pénzeszközök	838.569	5.481.826
20.	1. Pénzeszközök	838.569	5.481.826
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	7.365	791
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	7.365	791
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származékos ügyletek értékelési különbözete	0	0
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	8.093.731	38.097.149
27.	E. Saját tőke	7.889.075	31.307.645
28.	I. Induló tőke	5.958.599	13.655.997
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	22.171.596	35.288.787
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-16.212.997	-21.632.790
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	1.930.476	17.651.648
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	2.070.893	-1.401.251
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	-2.140.041	8.069.481
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	721.770	1.862.931
35.	3. Előző év(ek) eredménye	294.269	1.277.854
36.	4. Üzleti év eredménye	983.585	7.842.633
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	204.656	6.096.878
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	204.656	6.096.878
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	692.626
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	8.093.731	38.097.149

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Előző év 2019.01.01-2019.12.31.	Tárgyév 2020.01.01-2020.12.31.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei	2.339.795	11.243.790
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	1.203.793	2.401.677
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	148.901	992.292
05.	V. Egyéb ráfordítások	3.516	7.188
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	983.585	7.842.633

A kiegészítő melléklet a mérleg és az eredménykimutatás elválaszthatatlan részét képezi.

Kelt: BUDAPEST, 2021. március 12.

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.



Köves Benedek Balázs
vezérigazgató

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Tájékoztató adatok:

Az Alap neve: OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Az Alap felügyeleti nyilvántartásba vételének száma (lajstromszám) és dátuma: 1111-257, 2008. január 8.

Az Alap típusa: nyilvános

Az Alap fajtája: nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az Alap futamideje: 2008. január 8-tól határozatlan ideig.

Az Alap üzleti éve: megegyezik a naptári évvel.

Az Alap harmonizációja: nem ÁÉKBV irányelv szerint harmonizált (alternatív befektetési alap, "ABA")

A mérlegkészítés időpontja: a tárgyévet követő január 31-e.

Alapkezelő neve: OTP Alapkezelő Zrt. székhelye: 1026 Budapest, Riadó u.1-3.

Letétkezelő neve: OTP Bank Nyrt. székhelye: 1051 Budapest, Nádor u.16.

Fő forgalmazó neve: OTP Bank Nyrt. székhelye: 1051 Budapest, Nádor u.16.

Az Alap képviselőjére jogosult személy Köves Benedek Balázs, lakóhelye 1029 Budapest, Uzsoki utca 3. A könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy Garamvölgyi Zoltán Mihály, lakóhelye 2000 Szentendre, Körte köz 7. mérlegképes igazolvány száma: MK 129785.

Az Alap esetében a könyvvizsgálat kötelező. A könyvvizsgáló neve: Deloitte Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft. székhelye: 1068 Budapest, Dózsa György út 84/C. A könyvvizsgálatért felelős személy Binder Szilvia, kamarai tagsági száma: 003801.

Az Alap 2020. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFÁ-val növelt bruttó könyvvizsgálati díja 1.149 eFt.

Az Alappal kapcsolatos további információkat ld. az Alapkezelő honlapján:

<https://www.otpbank.hu/otpalapkezelo/hu/fooldal>

A számviteli politika fő vonásai és az alkalmazott számviteli alapelvek

Az Alap számviteli politikája a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint az egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény ("KBFTV."), a számvitelről szóló 2000. évi C. törvény ("Számviteli Törvény"), a befektetési alapok éves beszámoló készítési és könyvvezetési kötelezettségének sajátosságairól szóló 215/2000. (XII.11.) kormányrendelet ("Kormányrendelet"), valamint az egyéb vonatkozó jogszabályok alapján került kialakításra.

Az Alapkezelő részletes analitikus nyilvántartást vezet az Alap eszközeiről és kötelezettségeiről.

Az eszközök és kötelezettségek értékelési és elszámolási szabályai a Kormányrendelet 7. § előírásai szerint kerültek kialakításra.

Értékpapírok értékelése és elszámolása

- A Kormányrendelet előírásainak megfelelően az értékpapírok nettó beszerzési értéken kerülnek nyilvántartásba vételre. Az értékpapírok eladása során az értékesítésre jutó könyv szerinti érték FIFO módszerrel kerül meghatározásra.

- Az értékpapírok a KBFTV., a Kormányrendelet, valamint az Alap kibocsátási tájékoztatója által előírt rendszerességgel piaci értéken kerülnek értékelésre.

- A Kormányrendelet előírásainak megfelelően az értékpapírok után tárgyévben járó időarányos kamatok és osztalékok az értékpapírok értékkülönböként kerülnek elszámolásra.

Származékos ügyletek értékelése és elszámolása

A származékos ügyletek piaci értékének az ügylet jövőben várható nyereségét vagy veszteségét kell tekinteni, amely értéken a le nem zárt ügylet – mint pozíció – továbbértékesíthető. A származékos ügyletek értékelése egyes ügylettípusokra az értékelésekre általánosan elfogadott értékelési módszerek alapján (jellemzően a szerződésből eredő tényleges vagy becsült jövőbeni cash flow-k jelenre diszkontált értékein (DCF) alapuló modell) kerül meghatározásra.

Az Alap opciós ügyletek után fizetett opciós díjat a felmerüléskor a pénzügyi műveletek ráfordításaként számolja el, a Kormányrendelet 9/B. § (12) szerinti időbeli elhatárolás lehetőségével nem él.

Külföldi pénzürtékre szóló követelések és kötelezettségek

A külföldi pénzürtékre szóló követelések és kötelezettségek, valamint a valutakészletek és devizabetétek piaci értékének meghatározásánál az adott devizanemre vonatkozóan rögzített, a Magyar Nemzeti Bank által közzétett hivatalos devizaárfolyam értékelés napján érvényes értéke kerül alkalmazásra.

Immateriális javak és tárgyi eszközök

Az Alap sem immateriális javakkal, sem tárgyi eszközökkel nem rendelkezik.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

A mérleg egyes tételeinek magyarázata:

Eszközök:

A mérleg 15. sorában az értékpapírok beszerzési áron, ezen belül a kamatozó értékpapírok a nettó (felhalmozott kamatok nélküli) beszerzési áron szerepelnek. A 17. sorban a fordulónapon állományban lévő értékpapírok tárgyév végi felhalmozott kamatai, a 18. sorban pedig a fordulónapi (nettó) forgalmi érték és a (nettó) beszerzési ár különbözete szerepel. Az elszámolt értékkülönbözeteket értékpapír sorozatonként külön táblázat mutatja be.

Források:

Az induló tőke a forgalomban lévő befektetési jegyek névértékét mutatja. A 28. sor az első kereskedési naptól kezdve kumuláltan mutatja a kibocsátott ill. visszaváltott befektetési jegyek darabszámát. Az előző évek felhalmozott eredményét a 35. sor, a tárgyévi eredményt a 36. sor tartalmazza. A portfólió értékpapírjain és egyéb eszközein elért, még realizálatlan árfolyamnyereség és időarányos kamat a 34. sorban, a befektetési jegyek adásvételéből származó realizált árfolyam különbözet a 32-33. sorban szerepel.

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye 8.842.113 eFt, amely 11.243.790 eFt bevétel és 2.401.677 eFt ráfordítás különbözete. 992.292 eFt működési költség és 7.188 eFt egyéb ráfordítás után a nyereség 7.842.633 eFt.

A működési költségeket a likviditási jelentés II. táblázata részletezi, amelyben a "pénzügyileg realizált oszlop" tartalmazza az 2020. évi költségek azon részét, amelyet a futamidő végéig kifizetett. Az Alappal kapcsolatos azon költségeket, amelyek a fent említett táblázatban nem szerepelnek (pl.: forgalmazási díj, reklám költségek) az Alap tájékoztatójának megfelelően az Alapkezelő viseli.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

adatok ezer Ft-ban

I. Vagyonkimutatás

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01		Időszak záró állománya 2020.12.31		Megosztás (%)
Készpénzállomány - banki egyenlegek					
Bank	Lekötési idő				
OTP Bank Nyrt. HUF	folyószámla	210.646	3.737.555	9,81%	
OTP Bank Nyrt. EUR	folyószámla	281.272	865.227	2,27%	
OTP Bank Nyrt. USD	folyószámla	44	628.908	1,65%	
OTP Bank Nyrt. DKK	folyószámla	6	12.355	0,03%	
OTP Bank Nyrt. NOK	folyószámla	17	48.439	0,13%	
OTP Bank Nyrt. SEK	folyószámla	9.696	189.342	0,50%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.18 - 2020.01.02	147.370	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.18 - 2020.01.02	147.370	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.18 - 2020.01.02	42.148	0	0,00%	
Banki egyenlegek összesen:		838.569	5.481.826	14,39%	
Átruházható értékpapírok					
Értékpapír neve	Futamidő	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír
Államkötvények:		0		199.174	0,52%
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	0		199.174	0,52%
Diszkont kincstárjegyek:		235.008		100	0,00%
D200429	2019.05.08 - 2020.04.29	235.008		0	0,00%
D210630	2020.07.01 - 2021.06.30	0		100	0,00%
Belföldi részvények:		349.460		961.942	2,53%
ALTEO		124.710		137.418	0,36%
CYBER - A		78.050		174.023	0,46%
MASTERPLAST		146.700		650.501	1,71%
Külföldi részvények:		6.588.706		22.941.416	60,22%
ADOBE SYSTEMS INC		0		624.606	1,64%
AGILENT		0		1.260.679	3,31%
AMERICAN WATER WORKS CO INC		0		642.097	1,69%
APPLE INC		199.931		0	0,00%
ARCADIS		246.362		399.733	1,05%
BWX TECHNOLOGIES INC		0		1.250.797	3,28%
CIA PARANAENSE DE ENERGIA		206.007		0	0,00%
COSAN LTD		466.114		0	0,00%
DANAHER CORP		189.542		625.546	1,64%
DARLING INTERNATIONAL INC		211.956		0	0,00%
DONALDSON CO		0		1.232.943	3,24%
EATON CORP PLC		0		634.830	1,67%
EDP RENOVAVEIS SA		0		776.969	2,04%
ENPHASE ENERGY INC		213.102		0	0,00%
EUROFINS SCIENTIFIC		231.947		0	0,00%
EXELON		0		629.861	1,65%
GENERAC HOLDINGS INC		371.192		0	0,00%
GREEN PLAINS RENEWABLE ENERGY		184.051		0	0,00%
ITRON		188.792		0	0,00%
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL		0		1.265.979	3,32%
KONINKLIJKE DSM NV		221.798		0	0,00%
MUELLER WATER PRODUCTS INC		191.839		0	0,00%
NEXTERA ENERGY INC		0		1.284.256	3,37%
NIBE INDUSTRIER AB-B		213.398		0	0,00%
NORDEX SE		207.659		777.976	2,04%
OSRAM LICHT AG		248.656		0	0,00%
PENTAIR PLC		188.465		0	0,00%
PERKINELMER INC		0		640.921	1,68%
POOL CORP		185.287		0	0,00%
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		0		1.615.625	4,24%
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG		249.930		761.594	2,00%
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		236.211		0	0,00%
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC		418.721		0	0,00%
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE SA		0		1.569.410	4,12%
STERICYCLE INC		181.115		0	0,00%
TESLA MOTORS INC		224.404		0	0,00%
THERMO FISHER SCIENTIFIC		0		634.350	1,67%

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

adatok ezer Ft-ban

I. Vagyongkimutatás - folytatás

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01	Időszak záró állománya 2020.12.31	Megosztás (%)
TORO CO	366.787	1.260.612	3,31%
VEECO INSTRUMENTS INC	201.307	0	0,00%
VESTAS	0	783.516	2,06%
VIVINT SOLAR INC	180.729	0	0,00%
WACKER CHEMIE AG	0	1.121.524	2,94%
WASTE CONNECTIONS INC	0	1.261.489	3,31%
WASTE MANAGEMENT	0	1.258.229	3,30%
WATTS WATER TECHNOLOGIES INC	186.416	627.874	1,65%
WESTPORT FUEL SYSTEMS INC	176.988	0	0,00%
Befektetési jegyek:	74.623	698.974	1,83%
IPATH SERIES B S&P 500 VIX	0	698.974	1,83%
IPATH BLOOMBERG COCOA SUBIND	74.623	0	0,00%
Átruházható értékpapírok összesen:	7.247.797	24.801.606	0 65,10%
Egyéb eszközök			
Követelések	0	7.812.926	20,51%
Aktív időbeli elhatárolások	7.365	791	0,00%
Származékos ügyletek értékelési különbözete	0	0	0,00%
Egyéb eszközök összesen:	7.365	7.813.717	20,51%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:	8.093.731	38.097.149	100,00%
Kötelezettségek			
1. Hitelállomány:	0	0	0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:			
Alapkezelői díj	13.047	47.302	0,70%
Letétkezelői díj	732	2.273	0,03%
Költségként elszámolt egyéb tétel	1.448	3.127	0,05%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség	189.429	6.044.176	89,02%
3. Céltartalékok:	0	0	0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:	0	692.626	10,20%
Kötelezettségek összesen:	204.656	6.789.504	100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:	7.889.075	31.307.645	

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	5.958.599.272	13.655.996.779
---	---------------	----------------

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy):

	2019.12.31	2020.12.31
Jelen dokumentum alapján:	1,323982	2,292593
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	1,349956	2,304923 *

*Az Alap több kibocsátott befektetési jegy sorozatot is tartalmaz. A fenti információk portfólióra vonatkozó összértéket (nettó eszközérték és forgalomban lévő befektetési jegyek száma), illetve súlyozott átlagértéket (egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték) mutatnak. Az információk további részletezését ld. VI. pont.

A kismértékű eltérés oka, hogy a hivatalosan közzétett egy jegyre jutó nettó eszközérték az Alapkezelési Szabályzat rendelkezéseinek megfelelő módon, míg a jelen dokumentumban szereplő érték a Számviteli Törvény és Kormányrendelet előírásai szerint kerül meghatározásra.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

IV. Az Alap értékpapír portfóliójának összetétele

Megnevezés	2020.01.01	Megoszl.(%)	2020.12.31	Megoszl.(%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	7.247.797	89,55%	24.801.606	65,09%
b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
<i>a fentiekből:</i>				
c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok:	235.008	2,90%	100	0,00%
d) egyéb átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok:	235.008	2,90%	199.274	0,52%

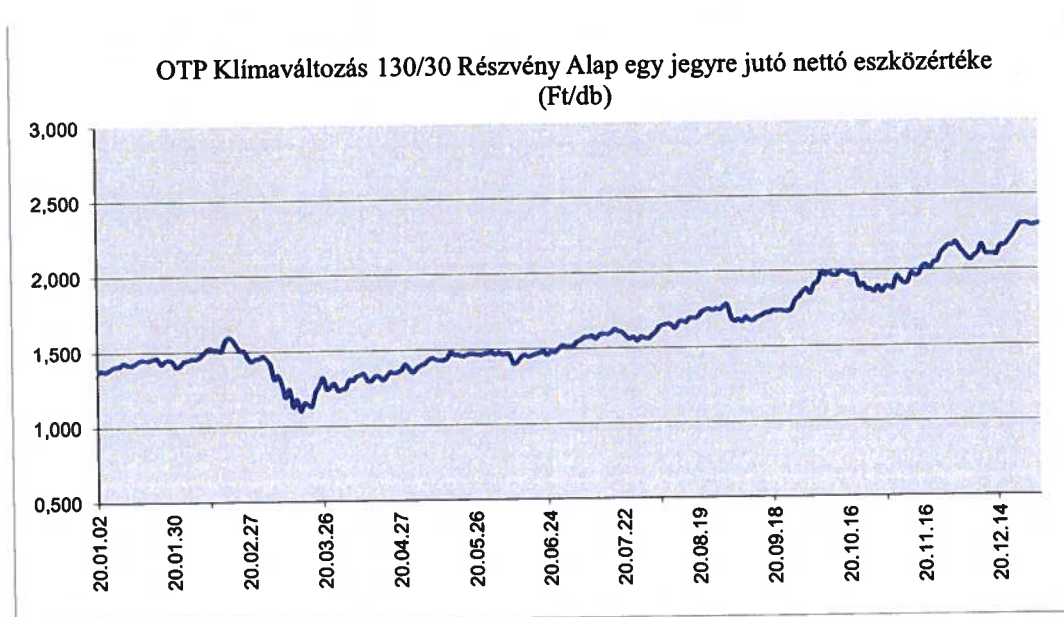
A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

A portfólió összetételében bekövetkezett egyes változások tételes bontását ld. I.

V. Az Alap eszközeinek alakulása

Megnevezés	2019. december 31- el zárult üzleti év	2020. december 31- el zárult üzleti év
a) befektetésekből származó jövedelem:	1.136.002	8.842.113
b) egyéb bevétel:	0	0
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-139.729	-972.418
d) a letétkezelő díjai:	-2.803	-5.621
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	-3.389	-7.993
bankköltség:	-241	-244
felügyeleti díj:	-1.741	-4.866
egyéb költség és ráfordítás:	-4.514	-8.338
f) nettó jövedelem:	983.585	7.842.633
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	983.585	7.842.633
h) a tőkeszámla változása:	122.142	14.434.776
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése:	959.445	1.141.161
j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (*)	0	0

*Tárgyidőszakban, illetve megelőző időszakban ilyen tételek nem merültek fel.



Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

VI. Összehasonlító táblázat a nettó eszközértékek és egy befektetési jegyre jutó nettó eszközértékek alakulására

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma és nettó eszközértéke:

	Elért hozamok éves bontásban	Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	Fordulónapi nettó eszközérték (Ft)	Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db)
2016. december 31.		2.731.760.619	2.674.911.986	0,979190
2017. december 31.	4,98%	3.106.218.938	3.192.899.777	1,027906
2018. december 31.	-3,69%	5.882.667.324	5.823.902.475	0,990011
2019. december 31.	33,73%	5.958.599.272	7.889.075.633	1,323982
2020. január 31.		6.535.590.898		1,401490
2020. február 28.		6.821.368.135		1,433050
2020. március 31.		6.432.121.790		1,244400
2020. április 30.		6.734.071.503		1,370086
2020. május 29.		7.115.726.100		1,470878
2020. június 30.		7.391.419.380		1,474894
2020. július 31.		7.538.427.194		1,572866
2020. augusztus 31.		8.137.787.079		1,754525
2020. szeptember 30.		8.450.849.832		1,805227
2020. október 30.		8.918.553.895		1,892853
2020. november 30.		10.755.973.128		2,160848
2020. december 31.	73,16%	13.655.996.779	31.307.646.033	2,292593

Az OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap 2020. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után 73,16 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

'A' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	830.099.160	253.107.534
2020. február	818.506.673	532.729.436
2020. március	474.580.310	863.826.655
2020. április	424.590.009	122.640.296
2020. május	535.641.220	153.986.623
2020. június	482.814.795	207.121.515
2020. július	518.558.658	371.550.844
2020. augusztus	854.028.751	254.668.866
2020. szeptember	936.718.261	623.655.508
2020. október	1.173.401.421	705.697.358
2020. november	2.136.540.833	299.121.600
2020. december	1.901.858.683	507.892.472
Összesen:	11.087.338.774	4.895.998.707

'B' sorozat (névérték 1 EUR)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	1.012.647	110.532
2020. február	572.328	158.193
2020. március	170.920	413.024
2020. április	227.134	11.949
2020. május	284.016	69.266
2020. június	268.356	118.167
2020. július	237.352	228.101
2020. július	1.078.706	111.587
2020. augusztus	340.936	209.668
2020. szeptember	462.203	237.938
2020. október	1.499.309	67.868
2020. november	1.837.636	325.890
2020. december	7.991.543	2.062.183
Összesen:	7.991.543	2.062.183

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.
A nettó eszközérték napi alakulását bemutató grafikon a 7. oldalon található.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

VII. A származékos ügyletek és a kapcsolódó kötelezettségvállalások bemutatása

A származékos ügyletek és kapcsolódó kötelezettségvállalások a XIII. pontban az értékpapírok értékkülönbözötének részletezésével együtt kerülnek bemutatásra.

VIII. Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, valamint a befektetési politika alakulására ható fontosabb tényezők bemutatása

Az Alapkezelő működésére vonatkozó belső szabályzatok a KBFTV., valamint egyéb vonatkozó jogszabályok előírásai szerint kerültek kialakításra, illetve módosításra. Az Alapkezelő működésében ugyanakkor tárgyidőszak folyamán jelentős változás nem történt.

Az Alapkezelő által végzett tevékenységeket és működésre vonatkozó további részleteket ld.

https://www.otpbank.hu/OTP_ALAPKEZELO/hu/bemutatkozas.jsp

Az Alap kibocsátási tájékoztatója és kezelési szabályzata szintén a KBFTV. és egyéb vonatkozó jogszabályok előírásai szerint kerültek kialakításra, illetve módosításra.

Az ennek keretében is részletezett, az Alap működését befolyásoló befektetési politika tekintetében jelentős változás nem történt.

IX. Az Alapkezelő által fizetett javadalmazások az Alapkezelő egészére és az Alap kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakoroló személyek kapcsán:

Az Alapkezelő által 2020. évben kifizetett összes: eFt.

Megnevezés	Összeg
Rögzített javadalmazás	638.978
Változó javadalmazás	867.956
Összesen	1.506.934

Az Alap kockázati profiljára lényeges hatást gyakorlók körében 2020. évben kifizetett összes: eFt.

Megnevezés	Ügyvezetők	Egyéb munkavállalók	Összesen
Kedvezményezett száma	5	12	17
Nyereségrészesedés	0	0	0
Teljes javadalmazás *	246.528	267.707	514.235

*A fenti számok az alapkezelő által kifizetett összes (nem csak az adott alapra vonatkozó) javadalmazást tartalmazzák.

X. Kockázatkezelésre vonatkozó információk

a) nem likvid jellegűknél fogva különleges szabályok alá tartozó eszközök:

Az Alap portfóliója sem tárgyidőszakban, sem előző időszakban nem tartalmazott nem likvid jellegűknél fogva különleges kezelési szabály alá tartozó eszközöket.

b) likviditáskezeléssel kapcsolatos megállapodások bemutatása

Az Alapkezelő az Alap nevében sem tárgyidőszakban, sem a megelőző időszakban nem kötött új, az Alap portfóliójával kapcsolatos likviditáskezelési feladatok ellátására vonatkozó szerződéses megállapodást.

Az Alapkezelő alapvetően éven belül lejáratú likvid magyar állampapírokban illetve feltörhető lekötött betétben tartja az alap likviditását a kezelési szabályzatban meghatározott limitek betartásával.

A likviditáskezelés során a tranzakciós költségek csökkentése érdekében az Alapkezelő megvizsgálja a likviditási többlettel, illetve a likviditás hiánnyal rendelkező alapokat, és azok magyar állampapír állományának javára, illetve terhére, az alapok között köt piaci áras adásvételi ügyleteket. Így a likviditáskezelés során első körben az OTP Alapkezelő által kezelt alapok között kerül sor tranzakciókra, elsősorban diszkontkincstárjegyekkel. Amennyiben ezek után nettó kitétsége marad az alapoknak, további likviditáskezeléshez kapcsolódó ügyleteket az Alapkezelő külső partnerekkel köt piaci áras tranzakciók keretében.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

c) az Alap aktuális kockázati profilja és az Alapkezelő által e kockázatok kezelése érdekében alkalmazott kockázatkezelési rendszerek

Az Alap kockázati profiljára vonatkozó információkat az Alap Tájékoztatójának "Az Alap kockázati profilja" c., a Kezelési Szabályzatának "A kockázati tényezők bemutatása" c. fejezetei, valamint a Kiemelt Befektetői Információjának "Hozam és kockázat profit" c., illetve "Jelentős kockázati tényezők" pontjai tartalmazzák.

A Társaság likviditási politikája a Bizottság 2012. december 19-i, a 2011/61/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek a mentességek, az általános működési feltételek, a letétkezelők, a tőkeáttétel, az átláthatóság és a felügyelet tekintetében történő kiegészítéséről szóló 231/2013/EU felhatalmazáson alapuló rendelete („ABAK-rendelet”) 46-48. cikkének megfelelően lett kialakítva.

A Társaság likviditási politikája az ÁÉKBV-alapkezelőre vonatkozó szervezeti, összeférhetlenségi, tiszletviteli és kockázatkezelési követelményekről szóló 79/2014. (III. 14.) Korm. rendelet („79/2014. Korm. rendelet”) 24. paragrafusának megfelelően lett kialakítva.

XI. Tőkeáttétel mértékében bekövetkezett változások

	2019.12.31	2020.12.31	Változás 2020/2019
Tőkeáttétel *	8.016.179.885	32.087.955.870	300,2899%

* A tőkeáttétel kiszámítása az ABAK-rendelet 6-11. cikkével összhangban történt.

XII. Egyéb információk

a) Az Alap illikviddé vált eszközeinek bemutatása

Az Alapkezelő részéről az Alap vonatkozásában sem a tárgyidőszakban, sem az előző időszakban nem történt a KBFTV. szerinti illikviddé vált eszközök elkülönítése.

b) Az Alap által tőzsdén nem jegyzett társaság felett történő ellenőrzésből befolyást biztosító részesedésszerzések

Az Alap részéről sem tárgyidőszakban, sem megelőző időszakban nem történt tőzsdén nem jegyzett társaságban ellenőrző befolyást biztosító részesedésszerzés.

c) A megváltozott üzleti és gazdasági környezet hatása (COVID-19)

Hozamemelkedéssel indították a 2021-es évet a hazai állampapírok, és ez február folyamán sem változott. Az éven belüli lejáratok esetében 10-30, a hozamgörbe közepén és hosszú végén 30-70 bázispont volt az emelkedés mértéke. Ennek oka az euró- és dollárhozamok emelkedésének beszívargása mellett elsősorban az volt, hogy az MNB kötvényvásárlási programjában elkezdett elfogyni a kvóta a tíz éven túli papírok vásárlására, amely az állomány 50%-a. A jegybank bejelentette, hogy a hosszú papírok mellett elkezdte vásárolni az 5-10 év közötti lejáratú állampapírokat is. Emellett a koronavírus elleni oltások felgyorsulásával erősödtek a várakozások, hogy a korlátozások hamarosan feloldhatók lesznek, és az élet visszatérhet a normális kerékvágásba. A pozitív várakozások a kereslet élénkülését hozták magukkal, ez feljebb hajtotta a nyersanyagárakat és az inflációs várakozásokat is. A MAX index értéke év eleje óta 2,62%-kal csökkent.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Az amerikai és európai állampapírcsúcsokon a politikai és járványhelyzet befolyásolta az eseményeket. Az USA-ban a Biden-kormányzat már az első napján rekordszámú, 17 elnöki rendeletet kiadva módosította Trump elnök számos nagy visszhangot kiváltó intézkedését. A kötvényhozamok az amerikai demokrata sikerek hatására az erősebb költségvetési költések és az ezzel járó magasabb infláció várakozása miatt felfelé tendáltak. Talán éppen azért, mert a Fed megszólaló döntéshozói hangsúlyozták, hogy a kamatemelés vagy akár a kötvényvásárlások lassítása még távoli kilátás. Mindezt a Joe Biden amerikai elnök által azóta már aláírt 1 900 milliárd dolláros fiskális élénkítő-csomag várakozása is fűtötte. Ugyanakkor távolabbi tekintetben a megugró növekedés inflációs hatására számítanak a piacok. Az EKB számára erősebb fejtörést okozhat a monetáris kondícióknak a hozamemelkedés hatására előálló szigorodása. A hozamgörbék meredeksége világszerte visszatért a tavaly márciusi lezárások előtt jellemző szintekre, a nulla közeli irányadó kamatok mellett a 2-10 éves hozamgörbe-meredekségek rég látott inflációs prémiumokat áraznak.

A közép-kelet európai régió részvénypiacai vegyesen teljesítettek az év első két hónapjában. A hazai BUX index ki tudta venni a részét a feltörekvő piaci jó hangulatból, így januárban és februárban is emelkedett, év eleje óta összesen 4,14%-kal. A cseh és a lengyel index nem tudtak az éve elejétől kiegyensúlyozott teljesítményt nyújtani, a cseh index forintban számítva 2,45%-kal nőtt, a lengyel index forintban számítva 3,15%-kal csökkent év eleje óta. A közép-európai CETOP20 index forintban számítva 0,53%-kal emelkedett az év eleji értékéhez képest.

Az idei január még úgy zajlott a globális feltörekvő részvénypiacokon, ahogyan a 2020-as év zárult, jó hangulatban, emelkedéssel. A február már felemásra sikeredett, a hónap első felében még hatott a vakcina-optimizmus, azonban a hónap végére felerősödtek az inflációs aggodalmak és az amerikai hosszú hozamok meginduló emelkedése megakasztotta a fejlődő piacokra irányuló pénzáramlást. A nyersanyagpiaci eszközök áremelkedése ugyanakkor összességében kedvezően hatott a feltörekvő piacokra. Az eszközösztályt reprezentáló MSCI Emerging Market Index forintban számítva közel 4%-ot tudott emelkedni év eleje óta.

Nehezen indult be az év elején a fejlett piacokon az oltási kampány, emiatt januárban a fejlett piacok részvényárfolyamai valamelyest csökkentek. Februárban azonban fordult a helyzet: A vártnál kedvezőbb amerikai munkaerőpiaci adatok, a jó gyorsjelentések és az oltási program felpörgetése mind hozzájárult ahhoz, hogy az amerikai indexek új csúcstra tudtak emelkedni. Európában a lelkesedés sokkal visszafogottabb volt, vélhetően a vírus harmadik hulláma miatt bevezetett újabb korlátozó intézkedések miatt. Február közepén aztán a kötvénypiacokon bontakozott ki eladási hullám, párhuzamosan az inflációs várakozások fokozódásával. A kötvénypiaci volatilitás február végére áterjedt a részvénypiacokra is. Különösen a spekulatív részvények sínylették meg a hozamemelkedést, hiszen itt a befektetői fantáziára épülő árfolyamokat a jövőbeni lehetőségek jelenértéke - és ezen keresztül a kötvényhozamok - sokkal jobban befolyásolja, mint a már most is pozitív cash-flow-val rendelkező, unalmas old-economy részvényeket. Az MSCI World index év eleje óta forintban kifejezve 1,67%-ot emelkedett.

Az Alap portfoliójának összetétele továbbra is a benchmarkot tükrözi, a befektetési politika hosszú távra került kialakításra. Az Alapkezelő taktikai súlyozással törekszik a különleges piaci helyzetben rejlő lehetőségek kihasználására, illetve az esetleges veszteségek mérséklésére. Nehezen becsülhető a koronavírus okozta további közép- és hosszú távú pénzügyi hatás, de az Alapkezelő továbbra is elkötelezett az Alap további működtetése mellett.

A fordulónap utáni eseményekre vonatkozó leírás a február végéig rendelkezésre álló információk alapján készült.

Az alábbi táblázatban bemutatásra kerül az Alap nettó eszközértékének és egy jegyre jutó árfolyamának a változása a fordulónapot követően:

Dátum	Sorozat	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó nettó eszközérték
2020.12.31.	'A' (Ft)	25.963.749.135	2,304923
	'B' (EUR)	14.721.348	1,603403
2021.03.12.	'A' (Ft)	31.410.399.452	2,311049
	'B' (EUR)	17.870.288	1,602180

Éves jelentés - OTP Klimaváltozás 130/30 Részvény Alap

XIII. Értékpapírok értékkülönbségének részletezése, valamint a származékos ügyletek és a kapcsolódó kötelezettségvállalások bemutatása

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése	Értékpapír futamideje	Beszerzési ár	Értékülönbség		Piaci érték
			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:		198.999	36	139	199.174
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	198.999	36	139	199.174
Díszkont kincstárjegyek:		100	0	0	100
D210630	2020.07.01 - 2021.06.30	100	0	0	100
Belföldi részvények:		487.838	0	474.104	961.942
ALTEO		99.000	0	38.418	137.418
CYBER - A		169.632	0	4.391	174.023
MASTERPLAST		219.206	0	431.295	650.501
Külföldi részvények:		21.524.136	0	1.417.280	22.941.416
ADOBE SYSTEMS INC		622.056	0	2.550	624.606
AGILENT		1.245.835	0	14.844	1.260.679
AMERICAN WATER WORKS CO INC		628.940	0	13.157	642.097
ARCADIS		374.161	0	25.572	399.733
BWX TECHNOLOGIES INC		1.250.725	0	72	1.250.797
DANAHER CORP		640.795	0	-15.249	625.546
DONALDSON CO		1.238.750	0	-5.807	1.232.943
EATON CORP PLC		617.495	0	17.335	634.830
EDP RENOVAVEIS SA		781.931	0	-4.962	776.969
EXELON		623.483	0	6.378	629.861
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL		1.246.030	0	19.949	1.265.979
NEXTERA ENERGY INC		1.253.024	0	31.232	1.284.256
NORDEX SE		437.148	0	340.828	777.976
PERKINELMER INC		625.262	0	15.659	640.921
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		1.208.480	0	407.145	1.615.625
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG		653.530	0	108.064	761.594
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE SA		1.575.278	0	-5.868	1.569.410
THERMO FISHER SCIENTIFIC		630.731	0	3.619	634.350
TORO CO		1.249.528	0	11.084	1.260.612
VESTAS		607.324	0	176.192	783.516
WACKER CHEMIE AG		891.695	0	229.829	1.121.524
WASTE CONNECTIONS INC		1.247.598	0	13.891	1.261.489
WASTE MANAGEMENT		1.253.226	0	5.003	1.258.229
WATTS WATER TECHNOLOGIES INC		621.111	0	6.763	627.874
Befektetési jegyek:		727.602	0	-28.628	698.974
IPATH SERIES B S&P 500 VIX		727.602	0	-28.628	698.974
MINDÖSSZESEN:		22.938.675	36	1.862.895	24.801.606

XIV. Értékpapír-finanszírozási és a teljeshozam-csereügyletek bemutatása:**Fordulónapon nyitott szállítós repo, fordított repo, sell & buy back és buy & sell back ügyletek bemutatása:****Nyitott 'sell & buy back' ügyletek:**

Értékpapír adatai		Devi- za	Eladás dátuma	Eladási érték	Vétel dátuma	Vételi érték	Ügylet ráfordítása
Megnevezése	Névértéke						
2019.12.31-én:							
POLAND 1.375 10/22/27	674.000	EUR	2018.12.28	699.452	2019.01.03	699.452	0
2020.12.31-én:							
DIAMONDBACK ENERG	3.001	USD	2020.12.28	14.479.970	2020.12.28	14.479.970	0

Az ügyletekhez kapcsolódó óvadék nem került meghatározásra.

Az ügyleti kamat megállapítása az ügyletkötéskor érvényes, keretjellegű megállapodás szerinti referenciakamat (BUBOR) figyelembe vételével történt.

A fenti ügyleteken felül a fordulónapon az Alap nem rendelkezett egyéb nyitott értékpapír finanszírozási, illetve teljes hozamcsereügylettel.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Kiegészítő melléklet az éves jelentéshez

XV. A mérleghez és eredménykimutatáshoz kapcsolódó kiegészítő megjegyzések

Saját tőke mozgástábla

adatok eFt-ban

Megnevezés	Nyitó egyenleg	Növekedés	Csökkenés	Záró egyenleg
Induló tőke változása:	5.958.599	13.117.191	-5.419.793	13.655.997
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözete:	-69.148	10.209.522	-3.472.144	6.668.230
Értékelési különbözet:	721.770	1.862.931	-721.770	1.862.931
Eredménytartalék:	294.269	983.585	0	1.277.854
Tárgyévi eredmény:	983.585	7.842.633	-983.585	7.842.633
Tőkenövekmény összesen:	1.930.476	20.898.671	-5.177.499	17.651.648
Saját tőke összesen:	7.889.075	34.015.862	-10.597.292	31.307.645

Likviditási jelentés

I. Hitelállomány összetétele

Felvétel időpontja	Hitelező	Hitel összege	Lejárat ideje	Hátralékos összeg
-	-	-	-	-

II. Költségek összetétele

adatok Ft-ban

Költségelem megnevezése	2019. évi költség	2019. évben pénzügyileg realizált	2020. évi költség	2020. évben pénzügyileg realizált
Alapkezelési díj	139.729.319	126.682.632	972.418.422	925.116.775
Letétkezelői díj	2.803.329	2.071.365	5.621.451	3.348.192
Bizományosi díj	3.388.730	3.388.730	7.992.951	7.992.951
Bankköltség	241.213	241.213	243.610	243.610
Felügyeleti díj	1.741.000	1.290.000	4.866.000	2.888.000
Könyvvizsgálat díja	996.950	0	1.149.350	0
Összesen:	148.900.541	133.673.940	992.291.784	939.589.528

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap

Cash flow kimutatás	adatok ezer Ft-ban	
	2019.01.01- 2019.12.31.	2020.01.01- 2020.12.31.
I. Működési cash flow	-929.327	-3.934.748
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)	939.913	7.572.642
3. Elszámolt értékvesztés és visszairás	0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet	959.445	1.141.161
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete	0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye	-2.070.123	-10.285.886
8. Befektetett eszközök állományváltozása	0	0
9.1. Követelések változása	224.881	-7.812.926
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása	-959.445	-1.141.161
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása	-16.942	5.892.222
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása	0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása	-7.056	6.574
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása	0	692.626
Származékos ügyletek állományváltozása	0	0
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás	687.661	-5.856.771
17. Értékpapírok beszerzése -	-27.455.828	-105.954.574
18. Értékpapírok eladása, beváltása +	28.099.817	99.827.812
19. Kapott hozamok +	43.672	269.991
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás	122.142	14.434.776
20. Befektetési jegy kibocsátás +	2.981.129	23.326.713
22. Befektetési jegy visszavásárlása -	-2.858.987	-8.891.937
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -	0	0
IV. Pénzeszközök változása	-119.524	4.643.257
Pénzeszközök nyitó értéke	958.093	838.569
Pénzeszközök záró értéke	838.569	5.481.826

Megjegyzések:

1. A részletező sorok számozása a Kormányrendelet 4. sz. melléklete szerint.
2. A 9. Forgóeszközök állományváltozása sor további bontásra került.
3. További részletező sor került beiktatására "Származékos ügyletek állományváltozása" megnevezéssel sorszámozás nélkül.

Portfólió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve:	OTP Klímaváltozás 130/30 Részvény Alap
Alap lajstromszáma:	1111-257
Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Nettó Eszközérték számítás típusa:	T

Ft

Tárgynap (T):	2020.12.31
Saját tőke:	31.307.646.033
Egy jegyre jutó NEÉ:	2,292593
Darabszám:	13.655.996.779

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

adatok eFt-ban

I. KÖTELEZETTSÉGEK				Összeg	%
I/1. Hítelállomány:		Futamidó		0	0,00
I/2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:				6.096.878	89,80
Alapkezelői díj				47.302	0,70
Letétkezelői díj				2.273	0,03
Költségként elszámolt egyéb tétel				3.127	0,05
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség				6.044.176	89,02
I/3. Céltartalékok:				0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:				692.626	10,20
Kötelezettségek összesen:				6.789.504	100,00
II. ESZKÖZÖK				Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):				5.481.826	14,39
II/2. Egyéb követelés:				7.812.926	20,51
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):	Bank	Devizanem	Futamidó	0	0,00
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:				0	0,00
II/4. Értékpapírok (összes):		Devizanem	Névérték devizában	24.801.606	65,10
II/4.1. Állampapírok (összes):				199.274	0,52
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):				199.174	0,52
2021/A államkötvény		HUF	198.800	199.174	0,52
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):				100	0,00
D210630 diszkont kincstárjegy		HUF	100	100	0,00
II/4.3. Részvények (összes):				23.903.358	62,75
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				961.942	2,53
ALTEO részvény		HUF	1.847	137.418	0,36
CYBER - A részvény		HUF	11.516	174.023	0,46
MASTERPLAST részvény		HUF	32.854	650.501	1,71
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):				22.941.416	60,22
ADOBE SYSTEMS INC részvény		USD	0	624.606	1,64
AGILENT részvény		USD	35.780	1.260.679	3,31
AMERICAN WATER WORKS CO INC részvény		USD	141	642.097	1,69
ARCADIS részvény		EUR	810	399.733	1,05
BWX TECHNOLOGIES INC részvény		USD	698	1.250.797	3,28
DANAHER CORP részvény		USD	95	625.546	1,64
DONALDSON CO részvény		USD	371.000	1.232.943	3,24
EATON CORP PLC részvény		USD	178	634.830	1,67
EDP RENOVAVEIS SA részvény		EUR	466.650	776.969	2,04
EXELON részvény		USD	50.170	629.861	1,65
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL részvény		USD	914	1.265.979	3,32
NEXTERA ENERGY INC részvény		USD	560	1.284.256	3,37

Portfólió jelentés értékpapíralapra

NORDEX SE részvény	EUR	96.150	777.976	2,04
PERKINELMER INC részvény	USD	15.020	640.921	1,68
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE részvény	EUR	22.732	1.615.625	4,24
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG részvény	EUR	37.280	761.594	2,00
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE SA részvény	EUR	1.818	1.569.410	4,12
THERMO FISHER SCIENTIFIC részvény	USD	4.580	634.350	1,67
TORO CO részvény	USD	44.700	1.260.612	3,31
VESTAS részvény	DKK	11.090	783.516	2,06
WACKER CHEMIE AG részvény	EUR	26.309	1.121.524	2,94
WASTE CONNECTIONS INC részvény	USD	41.360	1.261.489	3,31
WASTE MANAGEMENT részvény	USD	359	1.258.229	3,30
WATTS WATER TECHNOLOGIES INC részvény	USD	1.735	627.874	1,65
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):			698.974	1,83
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			698.974	1,83
IPATH SERIES B S&P 500 VIX	USD	140.000	698.974	1,83
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):			791	0,00
Eszközök összesen:			38.097.149	100,00


Megjegyzés: a magyar forintban kibocsátott értékpapírok névértéke ezer forintban van megadva.

Kelt:

BUDAPEST, 2021. március 12.

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.


Köves Benedek Balázs
vezérigazgató