

OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

*Éves jelentés
és
független könyvvizsgálói jelentés*

2020. december 31.

FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

Az OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük az OTP Quality Nyíltvégű 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 felelősségünk 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 lényeges 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 kontrollért, amelyet a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő lényeges 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 közlétegye 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 lényeges 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 Könyvvizsgálói Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvényekkel és egyéb jogszabályokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálat mindig feltárja az egyébként létező lényeges hibás állítást. A hibás állítások eredhetnek csalásból vagy hibából, és lényegesnek 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 könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok szerinti könyvvizsgálat egésze során szakmai megítélést alkalmazunk és szakmai szkepticizmust tartunk fenn.

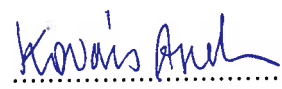
Továbbá:

- 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 könyvvizsgálat 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 hívunk a figyelmet az éves jelentésben közölt számviteli információkban lévő kapcsolódó közzétételekre, vagy ha a közzétételek e tekintetben nem megfelelőek, minősíteniünk 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 könyvvizsgálat tervezett hatókörét és ütemezését, a könyvvizsgálat jelentős megállapításait, beleértve az Alapkezelő által alkalmazott belső kontrollnak a könyvvizsgálatunk 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


.....
Kovács Andrea
Kamarai tag könyvvizsgáló
Tagszám: 003950



OTP Quality Nyíltvégű 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 Quality Nyíltvégű 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	40.452.312	43.387.921
09.	I. Követelések	3.606.820	2.543.869
10.	1. Követelések	3.606.820	2.543.869
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	32.184.338	37.827.667
15.	1. Értékpapírok	28.655.574	33.958.453
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	3.528.764	3.869.214
17.	a) kamatokból, osztalékból	35.662	34.798
18.	b) egyéb piaci megítélésből	3.493.102	3.834.416
19.	III. Pénzeszközök	4.661.154	3.016.385
20.	1. Pénzeszközök	4.661.154	3.016.385
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	1.338	3.388
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	1.338	3.388
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származékos ügyletek értékelési különbözete	8.143	6.545
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	40.461.793	43.397.854
27.	E. Saját tőke	40.056.943	43.158.829
28.	I. Induló tőke	8.682.777	9.562.948
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	131.460.736	134.936.302
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-122.777.959	-125.373.354
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	31.374.166	33.595.881
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	-171.544.095	-178.978.874
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	148.695.201	158.314.465
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	3.536.907	3.875.759
35.	3. Előző év(ek) eredménye	47.423.882	50.686.153
36.	4. Üzleti év eredménye	3.262.271	-301.622
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	404.850	86.119
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	404.850	86.119
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	152.906
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	40.461.793	43.397.854

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	4.474.743	6.467.587
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	764.749	6.200.154
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	429.607	550.855
05.	V. Egyéb ráfordítások	18.116	18.200
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	3.262.271	-301.622

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

Kelt: BUDAPEST, 2021. március 12.

OTP ALAPKEZELŐ RT.
Köves Benedek Balázs
vezérigazgató

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

Tájékoztató adatok:

Az Alap neve: OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

Az Alap felügyeleti nyilvántartásba vételének száma (lajstromszám) és dátuma: 1111-43, 1997. szeptember 2.

Az Alap típusa: nyilvános

Az Alap fajtája: nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az Alap futamideje: 1997. szeptember 2-től 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 Kovács Andrea, kamarai tagsági száma: 003950.

Az Alap 2020. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFÁ-val növelt bruttó könyvvizsgálati díja 1.480 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 értékkülönbségeként 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.

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 értékpapírain és egyéb eszközein elért, még realizálatlan árfolyamnyereség és időarányos kamat a 34. sorban, a befektetési jegyek adásvételéből származó realizált árfolyam különbség a 32-33. sorban szerepel.

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye 267.433 eFt, amely 6.467.587 eFt bevétel és 6.200.154 eFt ráfordítás különbözete. 550.855 eFt működési költség és 18.200 eFt egyéb ráfordítás után a veszteség 301.622 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 Quality Nyíltvégű Részvény Alap

adatok ezer Ft-ban

I. Vagyongkimutatás

Vagyongimutatas

Vagyonelem, ill.ertekpapir fajta	Idoszak nyito allomanya 2020.01.01		Idoszak zaro allomanya 2020.12.31		Megosztas (%)
Keszpenzallomany - banki egyenlegek					
Bank	Lekotesi ido				
OTP Bank Nyrt. HUF	folyoszaml	399.537	1.192.200	2,75%	
OTP Bank Nyrt. EUR	folyoszaml	260.810	8.570	0,02%	
OTP Bank Nyrt. USD	folyoszaml	169	15.216	0,04%	
OTP Bank Nyrt. GBP	folyoszaml	235	57	0,00%	
OTP Bank Nyrt. PLN	folyoszaml	54	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. CHF	folyoszaml	0	256	0,00%	
OTP Bank Nyrt. RON	folyoszaml	48	71	0,00%	
OTP Bank Nyrt. HRK	folyoszaml	43	15	0,00%	
OTP Bank Nyrt. CZK	folyoszaml	258	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. HUF	2019.11.06 - 2020.02.05	1.000.000	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. HUF	2019.11.11 - 2020.05.11	1.000.000	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. HUF	2019.11.06 - 2020.05.06	1.000.000	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. HUF	2019.11.11 - 2020.02.10	1.000.000	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. USD	2020.10.05 - 2021.01.04	0	500.000	1,15%	
OTP Bank Nyrt. USD	2020.10.05 - 2021.01.04	0	1.000.000	2,30%	
OTP Bank Nyrt. HUF	2020.10.05 - 2021.01.04	0	300.000	0,69%	
Banki egyenlegek osszesen:		4.661.154	3.016.385	6,95%	
Atruhazhato ertekpapirok					
Ertekpapir neve	Futamido	Tozsdei ertekpapir	Tozsden kivuli ertekpapir	Tozsdei ertekpapir	Tozsden kivuli ertekpapir
Allamkotvenyek:		631.076		15.930	0,04%
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	0		15.930	0,04%
2021/C	2018.02.07 - 2021.04.21	631.076		0	0,00%
Diszkont kincstarjegyek:		72.602		0	0,00%
D200429	2019.05.08 - 2020.04.29	72.602		0	0,00%
Vallalati kotvenyek:		1.209.680		1.283.596	2,96%
OTPHB 2.875% 07/15/2029	2019.07.15 - 2029.07.15	688.933		754.122	1,74%
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2	2019.07.11 - 2022.07.11	28.046		30.445	0,07%
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2	2019.07.11 - 2022.07.11	70.072		75.343	0,17%
YKBNK 13.875 PERP	2019.01.15 - 2024.01.15	422.629		423.686	0,98%
Belfoldi reszvenyek:		10.876.036		11.912.534	27,46%
ALLAMI NYOMDA - 98		6.685		0	0,00%
ALTEO		60.209		66.344	0,15%
ANY BIZTONSAGI NYOMDA NYRT		0		6.252	0,01%
APPENINN		0		111.949	0,26%
CIG PANNONIA		78.689		139.262	0,32%
DUNA HOUSE		108.420		0	0,00%
GRAPHISOFT PARK SE		112.885		74.671	0,17%
MAGYAR TELEKOM		550.802		766.583	1,77%
MASTERPLAST		114.998		280.592	0,65%
MOL RT		3.134.187		3.042.449	7,01%
OPUS		713		58.606	0,14%
OTP TORZS (100)		4.624.695		4.481.145	10,33%
PANNERGY		48.882		41.993	0,10%
RICHTER - 100		2.016.613		2.819.395	6,50%
WABERER'S INTERNATIONAL ZRT		9.504		14.960	0,03%
ZWACK RT. TORZS		8.754		8.333	0,02%
Kulfoldi reszvenyek:		19.277.159		23.846.637	54,93%
AGORA		1.558		1.105	0,00%
ALIOR BANK SA		1.035		625	0,00%
ANDRITZ AG		59.018		22.580	0,05%
ARYZTA AG		93.865		65.583	0,15%
ATRIUM		183.742		151.097	0,35%
AVAST PLC (LONDON)		0		1.071.365	2,47%
AVAST PLC (PRAGA)		0		725.545	1,67%
BANCA TRANSILVANIA SA		1.005.785		783.120	1,80%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE		376.195		383.114	0,88%
CCC S.A.		0		25.356	0,06%

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

I. Vagyongkimutató - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01	Időszak záró állománya 2020.12.31	Megosztás (%)
CD PROJEKT SA	106.686	708.970	1,63%
CEZ	905.964	838.415	1,93%
DEVELIA SA	0	17.864	0,04%
DIGI COMMUNICATIONS NV	154.956	70.675	0,16%
DUNA HOUSE	0	100.636	0,23%
ENGIE SA	0	191.999	0,44%
ERSTE BANK STAMM	2.775.437	2.690.852	6,20%
EVONIK INDUSTRIES AG	0	224.058	0,52%
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85	461.781	483.139	1,11%
HRVATSKI TELEKOM	257.870	350.679	0,81%
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	51.974	0	0,00%
JERONIMO MARTINS	0	310.835	0,72%
KGHM	865.527	1.693.470	3,90%
KLEPIERRE	0	203.222	0,47%
KOMERCNI	1.097.418	933.950	2,15%
KRKA	616.731	871.366	2,01%
LINAS AGRO GROUP AB	67.487	91.264	0,21%
LOGITECH INTERNATIONAL XNGS	0	222.533	0,51%
LOTOS	0	236.633	0,55%
MONETA MONEY BANK AS	642.935	619.238	1,43%
MOTOR OIL (HELLAS) SA	139.319	88.075	0,20%
NOSTRUM OIL & GAS PLC	1.261	708	0,00%
NWR	46	48	0,00%
O2 CZECH REPUBLIC SA	0	208.882	0,48%
OMV	0	415.701	0,96%
OMV PETROM SA	396.235	266.080	0,61%
PEKAO	1.436.348	1.228.247	2,83%
PGE	137.266	90.182	0,21%
PGNIG	640.955	0	0,00%
PKN	1.527.476	1.357.778	3,13%
PKO BANK	1.393.391	1.691.985	3,90%
PLAZA CENTERS NV	425	319	0,00%
PRYSMIAN SPA	134.955	201.742	0,47%
PZU SA - 0.1	2.046.773	2.071.673	4,77%
RAIFFEISEN INTERN BH	113.647	81.349	0,19%
REXEL SA	0	244.834	0,56%
RHI MAGNESITA N.V. (LONDON)	0	118.191	0,27%
SAP AG	0	96.464	0,22%
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE	389.971	274.280	0,63%
SOLAR COMPANY S.A.	2.195	1.576	0,00%
TERNA ENERGY SA	126.592	120.497	0,28%
TITAN CEMENT INTL NPV	0	11.250	0,03%
TOTAL PRODUCE	60.132	63.735	0,15%
TUI AG	256.219	128.763	0,30%
UBISOFT ENTERTAINMENT	0	194.311	0,45%
UNIQA INSURANCE GROUP AG	135.983	105.709	0,24%
VALAMAR RIVIERA	88.847	127.622	0,29%
VERALLIA	0	106.071	0,24%
VIG AV	420.440	349.971	0,81%
VOLKSWAGEN AG	0	111.306	0,26%
WIZZ AIR HOLDINGS PLC	102.719	0	0,00%
Befektetési jegyek:	117.785	768.970	1,77%
OTP BUX ETF ALAP BEFJEGY	117.785	107.163	0,25%
FORESTAY II. INGATLANFEJLESZTŐ	0	296.000	0,68%
RECONCEPT II. ALAP	0	365.807	0,84%
Átruházható értékpapírok összesen:	32.184.338	37.827.667	87,16%
Egyéb eszközök			
Követelések	3.606.820	2.543.869	5,86%
Aktív időbeli elhatárolások	1.338	3.388	0,01%
Származékos ügyletek értékelési különbözete	8.143	6.545	0,02%
Egyéb eszközök összesen:	3.616.301	2.553.802	5,89%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:	40.461.793	43.397.854	100,00%

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

I. Vagyongkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01	Időszak záró állománya 2020.12.31	Megosztás (%)
Kötelezettségek			
1. Hitelállomány:	0	0	0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:			
Alapkezelői díj	33.893	35.527	14,86%
Letétkezelői díj	3.834	3.865	1,62%
Költségként elszámolt egyéb tétel	3.812	4.843	2,03%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség	363.311	41.884	17,52%
3. Céltartalékok:	0	0	0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:	0	152.906	63,97%
Kötelezettségek összesen:	404.850	239.025	100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:	40.056.943	43.158.829	

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	8.682.777.300	9.562.947.194
---	---------------	---------------

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

	2019.12.31	2020.12.31
Jelen dokumentum alapján:	4,613379	4,513130
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	4,623184	4,520090 *

*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.

IV. Az Alap értékpapír portfóliójának összetétele

Megnevezés	2020.01.01	Megoszl.(%)	2020.12.31	Megoszl.(%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	32.184.338	79,54%	37.827.667	87,15%
b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
a fentiékből:				
c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok:	72.602	0,18%	0	0,00%
d) egyéb átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok:	1.913.358	4,73%	1.299.526	2,99%

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:	3.709.994	267.433
b) egyéb bevétel:	0	0
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-400.483	-515.357
d) a letétkezelő díjai:	-14.849	-14.620
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	-3.116	-6.538
bankköltség:	-242	-248
felügyeleti díj:	-9.250	-12.613
egyéb költség és ráfordítás:	-19.783	-19.679
f) nettó jövedelem:	3.262.271	-301.622
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	3.262.271	-301.622
h) a tőkeszámla változása:	860.348	3.064.656
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése:	781.927	338.852
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 Quality Nyíltvégű 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.		8.282.779.966	28.045.972.440	3,386058
2017. december 31.	20,66%	9.756.859.965	39.861.906.881	4,085526
2018. december 31.	-0,15%	8.616.865.250	35.152.396.546	4,079488
2019. december 31.	13,09%	8.682.777.300	40.056.942.994	4,613379
2020. január 31.		8.722.992.799		4,493543
2020. február 28.		8.757.406.129		4,152715
2020. március 31.		8.426.884.900		3,428515
2020. április 30.		9.453.558.706		3,614689
2020. május 29.		9.477.625.239		3,812213
2020. június 30.		9.398.656.206		3,904175
2020. július 31.		9.458.573.613		3,875609
2020. augusztus 31.		9.458.573.613		3,926601
2020. szeptember 30.		9.560.718.840		3,770486
2020. október 30.		9.590.333.007		3,577582
2020. november 30.		9.562.988.461		4,282357
2020. december 31.	-2,17%	9.562.947.194	43.158.827.896	4,513130

Az OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap 2020. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után -2,17 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

'A' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	40.215.499	0
2020. február	34.413.330	0
2020. március	683.143.537	1.013.664.766
2020. április	1.026.673.806	0
2020. május	24.066.533	0
2020. június	0	78.969.033
2020. július	59.917.407	0
2020. szeptember	102.145.227	0
2020. október	29.614.167	0
2020. november	752.928.552	780.273.098
2020. december	10.744.882	98.088.400
Összesen:	2.763.862.940	1.970.995.297

'B' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	59.107.335	39.923.278
2020. február	44.672.069	58.334.388
2020. március	53.928.819	183.549.967
2020. április	72.106.975	46.004.633
2020. május	82.067.542	12.621.071
2020. június	67.459.783	29.523.349
2020. július	53.771.006	43.164.930
2020. augusztus	46.630.346	44.961.291
2020. szeptember	11.739.576	39.045.227
2020. október	17.369.923	25.987.790
2020. november	98.623.787	53.784.662
2020. december	104.225.232	47.499.556
Összesen:	711.702.393	624.400.142

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.
A nettó eszközérték napi alakulását bemutató grafikon a 13. oldalon található.

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

VII. A származékos ügyletek és a kapcsolódó kötelezettségvállalások bemutatása

A származékos ügyletek és kapcsolódó kötelezettségvállalások a XIII. pontban az értékpapírok értékkülönbözetének 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/bemutakozas.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
Kedvezményezettek száma	5	15	20
Nyereségrészesedés	0	0	0
Teljes javadalmazás *	246.528	380.286	626.814

*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 jellegűnél 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 lejáró 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 kitettsége marad az alapoknak, további likviditáskezeléshez kapcsolódó ügyleteket az Alapkezelő külső partnerekkel köt piaci áras tranzakciók keretében.

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű 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, összeférhetetlenségi, üzletviteli 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 *	40.190.523.125	43.400.507.643	7,9869%

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

XII. Egyéb információk

a) Az Alap illikviddévált eszközeinek bemutatása

Az Alapkezelő részéről az Alap vonatkozásában sem a tárgyidőszakban, sem az előző időszakban nem történt a KBFTV. szerinti illikviddévált 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 elkezd 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 Quality Nyíltvégű Részvény Alap

Az amerikai és európai állampapírpiacon 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 költségek 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 távolabbra tekintve 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 részvénypiaci vegyesen teljesítettek az év első két hónapjában. A hazai BUX index ki tudta venni a részét a feltörekvő piaci jó hangulattól, 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 részvénypiacon, 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 csúcsra tudtak emelkedni. Európában a lelkesedés sokkal visszafogottabb volt, vélhetően a vírus harmadik hulláma miatt bevezetett újabb korlátozó intézkedések miatt. Február közepén aztán a kötvénypiacon bontakozott ki eladási hullám, párhuzamosan az inflációs várakozások fokozódásával. A kötvénypiaci volatilitás február végére áttért a részvénypiacokra is. Különösen a spekulatív részvények sinylették 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 portfóliójának 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)	6.964.888.897	3,979912
	'B' (Ft)	36.241.191.385	4,641149
2021.03.12.	'A' (Ft)	7.599.242.490	4,207195
	'B' (Ft)	38.521.360.979	4,917630

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése	futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbség		Piaci érték
			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:		15.916	3	11	15.930
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	15.916	3	11	15.930
Vállalati kötvények:		1.114.935	34.795	133.866	1.283.596
OTPHB 2.875% 07/15/2021	2019.07.15 - 2029.07.15	664.039	9.778	80.305	754.122
WINGHOLDING ZRT 4 0%	2019.07.11 - 2022.07.11	27.059	564	2.822	30.445
WINGHOLDING ZRT 4 0%	2019.07.11 - 2022.07.11	66.030	1.393	7.920	75.343
YKBNK 13.875 PERP	2019.01.15 - 2024.01.15	357.807	23.060	42.819	423.686
Belföldi részvények:		11.062.332	0	850.202	11.912.534
ALTEO		47.796	0	18.548	66.344
ANY BIZTONSÁGI NYOMDA NYRT		5.272	0	980	6.252
APPENINN		110.446	0	1.503	111.949
CIG PANNÓNIA		110.408	0	28.854	139.262
GRAPHISOFT PARK SE		96.633	0	-21.962	74.671
MAGYAR TELEKOM		732.808	0	33.775	766.583
MASTERPLAST		191.456	0	89.136	280.592
MOL RT		3.030.702	0	11.747	3.042.449
OPUS		48.376	0	10.230	58.606
OTP TÖRZS (100)		4.145.115	0	336.030	4.481.145
PANNERGY		34.971	0	7.022	41.993
RICHTER - 100		2.491.416	0	327.979	2.819.395
WABERER'S INTERNATIONAL ZRT		9.592	0	5.368	14.960
ZWACK RT. TÖRZS		7.341	0	992	8.333
Külföldi részvények:		21.001.480	0	2.845.157	23.846.637
AGORA		5.384	0	-4.279	1.105
ALIOR BANK SA		1.910	0	-1.285	625
ANDRITZ AG		16.669	0	5.911	22.580
ARYZTA AG		96.811	0	-31.228	65.583
ATRIUM		191.879	0	-40.782	151.097
AVAST PLC (LONDON)		807.430	0	263.935	1.071.365
AVAST PLC (PRÁGA)		634.956	0	90.589	725.545
BANCA TRANSILVANIA SA		434.378	0	348.742	783.120
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE		267.078	0	116.036	383.114
CCC S.A.		10.505	0	14.851	25.356
CD PROJEKT SA		683.068	0	25.902	708.970
CEZ		718.798	0	119.617	838.415
DEVELIA SA		16.659	0	1.205	17.864
DIGI COMMUNICATIONS NV		59.640	0	11.035	70.675
DUNA HOUSE		110.088	0	-9.452	100.636
ENGIE SA		178.234	0	13.765	191.999
ERSTE BANK STAMM		2.027.837	0	663.015	2.690.852
EVONIK INDUSTRIES AG		176.183	0	47.875	224.058
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85		340.668	0	142.471	483.139
HRVATSKI TELEKOM		369.832	0	-19.153	350.679
JERONIMO MARTINS		309.758	0	1.077	310.835
KGHM		706.679	0	986.791	1.693.470
KLEPIERRE		132.893	0	70.329	203.222
KOMERCNI		902.338	0	31.612	933.950
KRKA		479.993	0	391.373	871.366
LINAS AGRO GROUP AB		0	0	91.264	91.264
LOGITECH INTERNATIONAL XNGS		178.006	0	44.527	222.533

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése	futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbség		Piaci érték
			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
LOTOS		209.052	0	27.581	236.633
MONETA MONEY BANK AS		473.077	0	146.161	619.238
MOTOR OIL (HELLAS) SA		122.953	0	-34.878	88.075
NOSTRUM OIL & GAS PLC		31.232	0	-30.524	708
NWR		109.310	0	-109.262	48
O2 CZECH REPUBLIC SA		164.694	0	44.188	208.882
OMV		328.014	0	87.687	415.701
OMV PETROM SA		211.228	0	54.852	266.080
PEKAO		2.117.753	0	-889.506	1.228.247
PGE		189.106	0	-98.924	90.182
PKN		1.111.975	0	245.803	1.357.778
PKO BANK		1.931.987	0	-240.002	1.691.985
PLAZA CENTERS NV		20.217	0	-19.898	319
PRYSMIAN SPA		120.404	0	81.338	201.742
PZU SA - 0.1		1.882.556	0	189.117	2.071.673
RAIFFEISEN INTERN BH		89.279	0	-7.930	81.349
REXEL SA		177.154	0	67.680	244.834
RHI MAGNESITA N.V. (LONDON)		89.427	0	28.764	118.191
SAP AG		82.270	0	14.194	96.464
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE		244.226	0	30.054	274.280
SOLAR COMPANY S.A.		49.948	0	-48.372	1.576
TERNA ENERGY SA		44.718	0	75.779	120.497
TITAN CEMENT INTL NPV		10.673	0	577	11.250
TOTAL PRODUCE		12.876	0	50.859	63.735
TUI AG		234.259	0	-105.496	128.763
UBISOFT ENTERTAINMENT		181.642	0	12.669	194.311
UNIQA INSURANCE GROUP AG		80.486	0	25.223	105.709
VALAMAR RIVIERA		121.537	0	6.085	127.622
VERALLIA		99.416	0	6.655	106.071
VIG AV		498.679	0	-148.708	349.971
VOLKSWAGEN AG		103.658	0	7.648	111.306
Befektetési jegyek:		763.790	0	5.180	768.970
OTP BUX ETF ALAP BEFJEGY		108.410	0	-1.247	107.163
FORESTAY II. INGATLANFEJLESZTŐ		296.000	0	0	296.000
RECONCEPT II. ALAP		359.380	0	6.427	365.807
MINDÖSSZESEN:		33.958.453	34.798	3.834.416	37.827.667

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

Határidős deviza ügyletek bemutatása:

	adatok ezerben	határidős ügylet szerződés szerinti értéke		határidős ügylet diszkontált piaci értéke		eredmény
		devizában	forintban	devizás értéke forintban	forint értéke	
2019.12.31-én:	USD / HUF	-1.247	375.684	-367.541	375.684	8.143
	Összesen:					8.143
2020.12.31-én:	USD / HUF	-1.100	333.641	-327.096	333.641	6.545
	Összesen:					6.545

XIV. Értékpapír-finanszírozási és a teljeshozam-csereügyletek bemutatása:

Fordulónapon nyitott szállítási repo, fordított repo, sell & buy back és buy & sell back ügyletek bemutatása:

Nyitott 'buy & sell back' ügyletek:

Nyitott "buy & sell back" ügyletek:							
Értékpapír adatai		Devi- za	Vétel dátuma	Vételi érték	Eladás dátuma	Eladási érték	Ügylet hozama
Megnevezése	Névértéke						
2019.12.31-én:							
YY INC - ADR	0	USD	2019.12.30	1.119.847	2019.12.30	1.119.847	0

Nyitott 'sell & buy back' ügyletek:

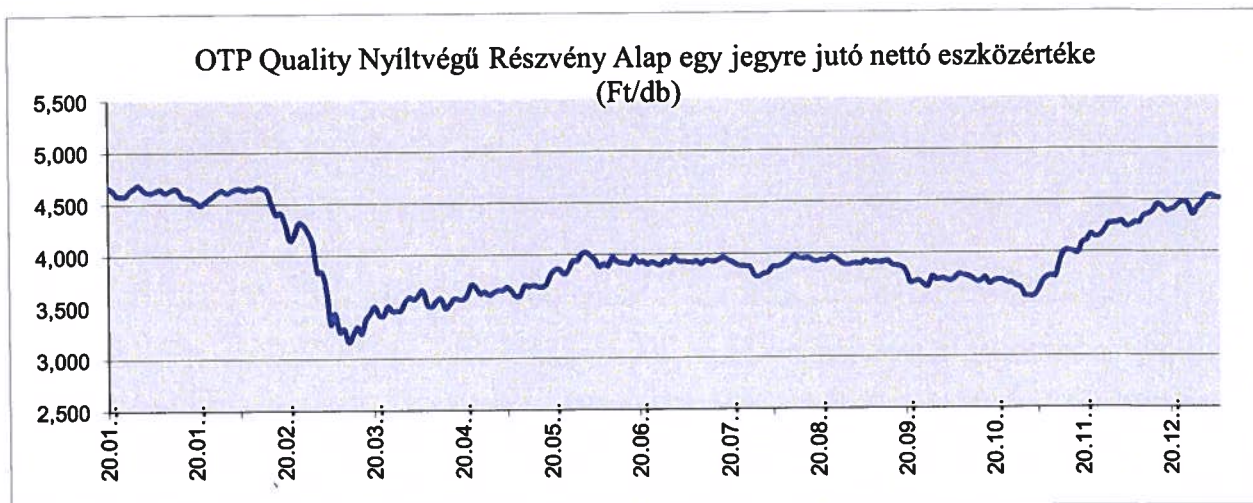
Nyitott - szett & buy back - ügyfelek.

Értékpapír adatai		Devi- za	Eladás dátuma	Eladási érték	Vétel dátuma	Vételi érték	Ügylet ráfordítása
Megnevezése	Névértéke						
2019.12.31-én:							
MAGYAR TELEKOM	6.400	eFt	2019.12.09	28.163	2019.12.09	28.163	0
YY INC - ADR	0	USD	2020.01.23	1.177.189	2020.01.23	1.177.189	0
JOYY INC - ADR	0	USD	2020.01.23	1.119.847	2020.01.23	1.119.847	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 Quality Nyíltvégű Részvény Alap

XIV. Értékpapír-finanszírozási ügyletek bemutatása és az újrafelhasználás átláthatóságáról szóló egyéb adatok - folytatás

Az Alap által kölcsönbe adott értékpapírok bemutatása (nyitott kölcsönök)

Értékpapír megnevezése	Értékpapír típusa	Szerződő fél neve	Értékpapír lejárat	Kölcsön várható lejárat	Deviza	Értékpapír névértéke devizában	Szerződés szerinti érték (Ft)	Piaci érték (Ft)
OTP BUX ETF ALAP BEFJEGY	befekt.jegy	OTP Bank Nyrt.	lejárat nélkül	2021.01.08	HUF	25.000	35.646.490	41.530.802
OTP TÖRZS (100)	részvény	OTP Bank Nyrt.	lejárat nélkül	2021.01.11	HUF	4.000.000	525.605.000	534.400.000
OTP TÖRZS (100)	részvény	OTP Bank Nyrt.	lejárat nélkül	2021.01.12	HUF	8.300.000	1.092.285.000	1.108.880.000
CD PROJEKT SA	részvény	OTP KE Részvény Alap	lejárat nélkül	2021.03.09	PLN	2.200	75.229.097	47.918.119
CD PROJEKT SA	részvény	OTP KE Részvény Alap	lejárat nélkül	2021.03.11	PLN	2.500	79.674.540	54.452.408
CEZ	részvény	OTP KE Részvény Alap	lejárat nélkül	2021.03.12	CZK	730.000	46.387.120	52.144.265
PKN	részvény	OTP KE Részvény Alap	lejárat nélkül	2021.02.26	PLN	16.000	69.113.440	73.225.901
CEZ	részvény	OTP Paletta Alap	lejárat nélkül	2021.01.26	CZK	1.091.300	64.428.183	77.952.105
CEZ	részvény	OTP Paletta Alap	lejárat nélkül	2021.01.27	CZK	608.600	36.073.791	43.472.602
CD PROJEKT SA	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.03.11	PLN	2.600	82.861.522	56.630.504
CEZ	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.01.26	CZK	1.797.500	106.120.827	128.396.324
CEZ	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.01.27	CZK	1.002.500	59.421.584	71.609.076
CEZ	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.02.01	CZK	2.000.000	119.209.500	142.861.000
MONETA MONEY BANK AS	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.03.29	CZK	24.671	23.117.714	23.268.700
PKO BANK	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.02.08	PLN	15.156	25.246.516	34.513.377
PKO BANK	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.02.09	PLN	13.817	22.992.041	31.464.194
RICHTER - 100	részvény	OTP Új Európa Alap	lejárat nélkül	2021.02.26	HUF	1.130.000	80.456.000	84.072.000
Összesen:							2.543.868.365	2.606.791.377

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

XIV. Értékpapír-finanszírozási ügyletek bemutatása és az újrafelhasználás átláthatóságáról szóló egyéb adatok - folytatás

Az Alap kapott óvadékának bemutatása 2020.12.31-ével

Értékpapír megnevezése	Értékpapír típusa	Biztosíték kibocsátó	Kibocsátó neve	Az értékpapír fordulónapi minősítése	Deviza	Szerződő fél letelepédési helye szerinti ország	Lejárat	Kiegészítés és elszámolás módja	Névérték	Óvadékérték (Ft)
KOMERCNT BANKA AS	részvény	OTP KE Részvény Alap	KOMERCNT BANKA AS	alacsony kockázatú	CZK	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	800.000	7.290.072.000
MONETA MONEY BANK AS	részvény	OTP KE Részvény Alap	MONETA MONEY BANK AS	alacsony kockázatú	CZK	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	126.000	118.838.160
VESTAS WIND SYSTEMS AS	részvény	OTP KE Részvény Alap	VESTAS WIND SYSTEMS AS	alacsony kockázatú	DKK	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	1.200	84.780.792
RICHTER GEDEON NYRT 100 T	részvény	OTP KE Részvény Alap	RICHTER GEDEON NYRT 100 T	alacsony kockázatú	HUF	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	1.750.000	130.200.000
MÁK 2022/A	állampapír	OTP BANK NyRt.	Magyar Állam	alacsony kockázatú	HUF	Magyarország	2022.06.24	háromoldalú	1.808.160.000	2.045.674.720
ANDRITZ AG	részvény	OTP Új Európa Alap	ANDRITZ AG	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	2.310	31.612.517
AUSTRIA TECHNOLOGIE AND	részvény	OTP Paletta Alap	AUSTRIA TECHNOLOGIE AND	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	4.000	38.119.572
AUSTRIA TECHNOLOGIE AND	részvény	OTP KE Részvény Alap	AUSTRIA TECHNOLOGIE AND	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	9.000	85.769.037
AUSTRIA TECHNOLOGIE AND	részvény	OTP Új Európa Alap	AUSTRIA TECHNOLOGIE AND	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	6.700	63.850.283
JUMBO SA	részvény	OTP Új Európa Alap	JUMBO SA	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	6.860	40.446.695
LYXOR ETF SGI DLY DBLE SH	befekt.jegy	OTP Új Európa Alap	LYXOR ETF SGI DLY DBLE SH	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	9.000	87.122.939
OTPHB 2 2.875 06/15/29	kötvény	OTP Új Európa Alap	OTP Bank	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	2029.06.15	háromoldalú	100.000	37.706.077
VOLKSWAGEN AG PFD	részvény	OTP Új Európa Alap	VOLKSWAGEN AG PFD	alacsony kockázatú	EUR	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	1.600	89.044.983
PEKAO	részvény	OTP Új Európa Alap	PEKAO	alacsony kockázatú	PLN	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	17.200	83.327.447
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI	részvény	OTP Új Európa Alap	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI	alacsony kockázatú	TRY	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	120.000	22.438.440
GLOBALTRA SPONS GDR REG	részvény	OTP Paletta Alap	GLOBALTRA SPONS GDR REG	alacsony kockázatú	USD	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	51.000	90.688.853
GLOBALTRA SPONS GDR REG	részvény	OTP Új Európa Alap	GLOBALTRA SPONS GDR REG	alacsony kockázatú	USD	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	83.000	147.591.662
LYX ETF DX2 SHORT 10Y UST	befekt.jegy	OTP Paletta Alap	LYX ETF DX2 SHORT 10Y USTR	alacsony kockázatú	USD	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	3.000	59.671.808
LYX ETF DX2 SHORT 10Y UST	befekt.jegy	OTP Új Európa Alap	LYX ETF DX2 SHORT 10Y USTR	alacsony kockázatú	USD	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	14.300	284.435.620
MOMO INC SPON ADR	részvény	OTP Új Európa Alap	MOMO INC SPON ADR	alacsony kockázatú	USD	Magyarország	lejárat nélkül	háromoldalú	0,70	29.058.019
Összesen:										10.860.449.624

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

XIV. Értékpapír-finanszírozási ügyletek bemutatása és az újrafelhasználás átláthatóságáról szóló egyéb adatok - folytatás

Globális adatok:

A kölcsönbe adott értékpapírok és áruk értékének a készpénz és pénzeszköz-egyenértékesek nélkül számított teljes kölcsönözhető eszközállományhoz viszonyított aránya: 6,89%

Az értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek egyes típusaiban felhasznált eszközök értéke abszolút értékben (Ft): 2.606.791.377

Az értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek egyes típusaiban felhasznált eszközöknek az Alap által kezelt eszközökhöz viszonyított arányuk: 6,04%

Koncentrációra vonatkozó adatok:

	Név	Biztosítékként kapott értékpapírok mennyisége
Biztosítékkibocsátó:	Lásd a táblázatban az előző oldalon.	Lásd a táblázatban az előző oldalon.
Szerződő fél:	Lásd a táblázatban az előző oldalon.	Lásd a táblázatban az előző oldalon.

Összesített ügyleti adatok az értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek egyes típusai szerint elkülönítve - az alábbi kategóriák szerinti bontásban:

A biztosíték típusa és minősége:	Részletesen ld. 'Alap kapott óvadékának bemutatása'	(előző oldal)
A biztosíték pénzneme:	Részletesen ld. 'Alap kapott óvadékának bemutatása'	(előző oldal)
A szerződő felek letelepedési helye szerinti ország:	Részletesen ld. 'Alap kapott óvadékának bemutatása'	(előző oldal)
A kiegyenlítés és elszámolás (háromoldalú, központi szerződő fél általi, kétoldalú):	Részletesen ld. 'Alap kapott óvadékának bemutatása'	(előző oldal)

Lejárat profil:	1-7 nap	7-30 nap	1-3 hónap	3 hónap-1 év	Éven túli	Lejárat nélküli	Összesen:
Kapott óvadék:	0	0	0	0	#####	8.777.068.827	10.860.449.624
Adott kölcsön:	0	0	0	0	0	2.606.791.377	2.606.791.377

A biztosítékok újrafelhasználására vonatkozó adatok:

A kapott, újrafelhasznált biztosítékoknak a tájékoztatóban vagy a befektetők számára nyújtott egyéb tájékoztatásban meghatározott maximális összeghez viszonyított aránya:

A kapott biztosítékok újrafelhasználására vonatkozóan korlátozás nem áll fenn, a biztosítékok cseréje CSA megállapodások alapján szabályozott.

Készpénzbiztosíték újbóli befektetéséből elért hozam:

A biztosítékok esetleges újrafelhasználása esetén az Alap Befektetési Politikája szerinti limitek maximálisan figyelembe vételre kerülnek.

A kollektív befektetési forma által értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek keretében kapott biztosítékok letéti őrzése:

Az eszközök és kapott biztosítékok a Letétkezelőnél kerülnek őrzésre.

A Letétkezelő neve:

OTP Bank Nyrt.

Őrzött biztosítékeszköz összege (Ft):

10.860.449.624

A kollektív befektetési forma által értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek keretében nyújtott biztosítékok letéti őrzése:

Az elkülönített vagy összevont számlákon, illetve bármely más számlán tartott biztosítékok aránya:

100%, az értékpapír finanszírozási ügyletekhez kapcsolódó biztosítékok tartása minden esetben elkülönített vagy összevont számlán történik.

Az értékpapír-finanszírozási ügyletek és teljeshozam-csereügyletek egyes típusainak hozamára és költségeire vonatkozó adatok a 2020.01.01-2020.12.31. időszakban:

	Hozam (Ft)	Ráfordítás (Ft)
Kölcsönzési ügyletek:	69.961.483	0
Teljes hozamcsere ügyletek:	0	0
Alap összesen:	69.961.483	0

Az értékpapír-finanszírozási ügyletekből és teljeshozam-csereügyletekből származó bevétel (hozam) teljes mértékben az Alapot illeti, az ügyletek díja (fizetendő kamat) az Alapot terheli. A fentiekben túlmenően más díj és költség nem terheli az Alapot. Az Alapkezelő illetve 3. fél nem vesz részt a finanszírozásban.

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű 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:	8.682.777	3.475.566	-2.595.395	9.562.948
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözete:	-22.848.894	9.619.264	-7.434.779	-20.664.409
Értékelési különbözet:	3.536.907	3.875.759	-3.536.907	3.875.759
Eredménytartalék:	47.423.882	3.262.271	0	50.686.153
Tárgyévi eredmény:	3.262.271	-301.622	-3.262.271	-301.622
Tőkenövekmény összesen:	31.374.166	16.455.672	-14.233.957	33.595.881
Saját tőke összesen:	40.056.943	19.931.238	-16.829.352	43.158.829

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	400.483.050	366.589.903	515.357.320	479.829.823
Letétkezelői díj	14.849.346	11.015.221	14.619.625	10.754.770
Bizományosi díj	3.115.664	3.115.664	6.537.740	6.537.740
Bankköltség	241.520	241.520	248.049	248.049
Felügyeleti díj	9.250.000	6.877.000	12.613.000	9.250.000
Könyvvizsgálat díja	1.438.910	0	1.479.550	0
Egyéb	228.786	228.786	0	0
Összesen:	429.607.276	388.068.094	550.855.284	506.620.382

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű 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		-2.375.205	-6.068.776
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)		2.021.469	-1.222.111
3. Elszámolt értékvesztés és visszairás		0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet		781.927	338.852
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete		0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye		-2.990.086	-5.741.741
8. Befektetett eszközök állományváltozása		0	0
9.1. Követelések változása		-1.271.968	1.062.951
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása		-773.784	-340.450
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása		-155.132	-318.731
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása		0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása		20.512	-2.050
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása		0	152.906
Származékos ügyletek állományváltozása		-8.143	1.598
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás		4.270.961	1.359.351
17. Értékpapírok beszerzése -		-34.566.931	-104.100.414
18. Értékpapírok eladása, beváltása +		37.597.090	104.539.276
19. Kapott hozamok +		1.240.802	920.489
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás		860.348	3.064.656
20. Befektetési jegy kibocsátás +		7.619.975	13.094.830
22. Befektetési jegy visszavásárlása -		-6.759.627	-10.030.174
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -		0	0
IV. Pénzeszközök változása		2.756.104	-1.644.769
Pénzeszközök nyitó értéke		1.905.050	4.661.154
Pénzeszközök záró értéke		4.661.154	3.016.385

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 Quality Nyíltvégű Részvény Alap
Alap lajstromszáma:	1111-43
Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Nettó Eszközérték számítás típusa:	T

	Ft
Tárgynap (T):	2020.12.31
Saját tőke:	43.158.827.896
Egy jegyre jutó NEÉ:	4,513130
Darabszám:	9.562.947.194

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

adatok eFt-ban

I. KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg	%
I/1. Hitelállomány:	Futamidő	0	0,00
I/2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:		86.119	36,03
Alapkezelői díj		35.527	14,86
Letétkezelői díj		3.865	1,62
Költségként elszámolt egyéb tétel		4.843	2,03
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		41.884	17,52
I/3. Céltartalékok:		0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		152.906	63,97
Kötelezettségek összesen:		239.025	100,00

II. ESZKÖZÖK				Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):				1.216.385	2,80
II/2. Egyéb követelés:				2.543.869	5,86
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):	Bank	Devizanem	Futamidő	1.800.000	4,14
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:				1.800.000	4,14
	OTP	USD	20.10.05 - 21.01.04	500.000	1,15
	OTP	USD	20.10.05 - 21.01.04	1.000.000	2,30
	OTP	HUF	20.10.05 - 21.01.04	300.000	0,69
II/4. Értékpapírok (összes):		Devizanem	Névérték devizában	37.827.667	87,16
II/4.1. Állampapírok (összes):				15.930	0,04
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):				15.930	0,04
2021/A államkötvény		HUF	15.900	15.930	0,04
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:				1.283.596	2,96
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				1.283.596	2,96
OTPHB 2.875% 07/15/2029 kötvény		EUR	2.000.000	754.122	1,74
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2022 kötvény		EUR	81.000	30.445	0,07
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2024 kötvény		EUR	200.000	75.343	0,17
YKBK 13.875 PERP kötvény		USD	1.200.000	423.686	0,98
II/4.3. Részvények (összes):				35.759.171	82,39
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):				11.912.534	27,46
ALTEO részvény		HUF	892	66.344	0,15
ANY BIZTONSÁGI NYOMDA NYRT részvény		HUF	471	6.252	0,01
APPENINN részvény		HUF	37.567	111.949	0,26
CIG PANNÓNIA részvény		HUF	13.556	139.262	0,32
GRAPHISOFT PARK SE részvény		HUF	0	74.671	0,17
MAGYAR TELEKOM részvény		HUF	201.732	766.583	1,77
MASTERPLAST részvény		HUF	14.171	280.592	0,65
MOL RT részvény		HUF	173.656	3.042.449	7,01
OPUS részvény		HUF	5.052	58.606	0,14

Portfólió jelentés értékpapíralapra

OTP TÖRZS (100) részvény	HUF	33.542	4.481.145	10,33
PANNERGY részvény	HUF	1.105	41.993	0,10
RICHTER - 100 részvény	HUF	37.895	2.819.395	6,50
WABERER'S INTERNATIONAL ZRT részvény	HUF	3	14.960	0,03
ZWACK RT. TÖRZS részvény	HUF	496	8.333	0,02
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):			23.846.637	54,93
AGORA részvény	PLN	1.931	1.105	0,00
ALIOR BANK SA részvény	PLN	4.650	625	0,00
ANDRITZ AG részvény	EUR	1.650	22.580	0,05
ARYZTA AG részvény	CHF	5.700	65.583	0,15
ATRIUM részvény	EUR	825.985	151.097	0,35
AVAST PLC (LONDON) részvény	GBP	49.075	1.071.365	2,47
AVAST PLC (PRÁGA) részvény	CZK	33.619	725.545	1,67
BANCA TRANSILVANIA SA részvény	RON	4.641.331	783.120	1,80
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE részvény	RON	343.800	383.114	0,88
CCC S.A. részvény	PLN	365	25.356	0,06
CD PROJEKT SA részvény	PLN	32.550	708.970	1,63
CEZ részvény	CZK	11.737.500	838.415	1,93
DEVELIA SA részvény	PLN	114.370	17.864	0,04
DIGI COMMUNICATIONS NV részvény	RON	27.160	70.675	0,16
DUNA HOUSE részvény	HUF	1.390	100.636	0,23
ENGIE SA részvény	EUR	42.000	191.999	0,44
ERSTE BANK STAMM részvény	EUR	295.492	2.690.852	6,20
EVONIK INDUSTRIES AG részvény	EUR	23.000	224.058	0,52
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85 részvény	RON	3.776.757	483.139	1,11
HRVATSKI TELEKOM részvény	HRK	3.996.100	350.679	0,81
JERONIMO MARTINS részvény	EUR	61.599	310.835	0,72
KGHM részvény	PLN	116.710	1.693.470	3,90
KLEPIERRE részvény	EUR	42.371	203.222	0,47
KOMERCNI részvény	CZK	102.490	933.950	2,15
KRKA részvény	EUR	26.110	871.366	2,01
LINAS AGRO GROUP AB részvény	EUR	102.092	91.264	0,21
LOGITECH INTERNATIONAL XNGS részvény	USD	1.925	222.533	0,51
LOTOS részvény	PLN	72.000	236.633	0,55
MONETA MONEY BANK AS részvény	CZK	656.557	619.238	1,43
MOTOR OIL (HELLAS) SA részvény	EUR	15.332	88.075	0,20
NOSTRUM OIL & GAS PLC részvény	GBP	192	708	0,00
NWR részvény	GBP	79.979	48	0,00
O2 CZECH REPUBLIC SA részvény	CZK	60.000	208.882	0,48
OMV részvény	EUR	34.500	415.701	0,96
OMV PETROM SA részvény	RON	976.120	266.080	0,61
PEKAO részvény	PLN	253.528	1.228.247	2,83
PGE részvény	PLN	1.749.800	90.182	0,21
PKN részvény	PLN	296.677	1.357.778	3,13
PKO BANK részvény	PLN	743.008	1.691.985	3,90
PLAZA CENTERS NV részvény	PLN	2.488	319	0,00
PRYSMIAN SPA részvény	EUR	1.900	201.742	0,47
PZU SA - 0.1 részvény	PLN	80.741	2.071.673	4,77
RAIFFEISEN INTERN BH részvény	EUR	13.357	81.349	0,19
REXEL SA részvény	EUR	260.000	244.834	0,56
RHI MAGNESITA N.V. (LONDON) részvény	GBP	8.300	118.191	0,27
SAP AG részvény	EUR	2.464	96.464	0,22

Éves jelentés - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

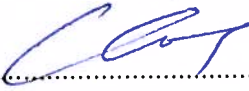
Portfólió jelentés értékpapíralapra

SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE részvény	RON	130.162	274.280	0,63
SOLAR COMPANY S.A. részvény	PLN	5.387	1.576	0,00
TERNA ENERGY SA részvény	EUR	7.500	120.497	0,28
TITAN CEMENT INTL NPV részvény	EUR	2.223	11.250	0,03
TOTAL PRODUCE részvény	EUR	1.272	63.735	0,15
TUI AG részvény	EUR	68.000	128.763	0,30
UBISOFT ENTERTAINMENT részvény	EUR	523	194.311	0,45
UNIQA INSURANCE GROUP AG részvény	EUR	45.236	105.709	0,24
VALAMAR RIVIERA részvény	HRK	89.174	127.622	0,29
VERALLIA részvény	EUR	10.000	106.071	0,24
VIG AV részvény	EUR	46.081	349.971	0,81
VOLKSWAGEN AG részvény	EUR	2.000	111.306	0,26
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):			768.970	1,77
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			768.970	1,77
OTP BUX ETF ALAP BEFJEGY	HUF	64.508	107.163	0,25
FORESTAY II. INGATLANFEJLESZTŐ	HUF	296.000	296.000	0,68
RECONCEPT II. ALAP	EUR	1.008.613	365.807	0,84
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):			3.388	0,01
II/6. Származékos ügyletek értékelési különbözete			6.545	0,03
Eszközök összesen:			43.397.854	100,00

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

Kelt:

BUDAPEST, 2021. március 12.


 OTP ALAPKEZELŐ ZRT.
 1.
 Köves Benedek Balázs
 vezérigazgató