

OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

*Éves jelentés
és független könyvvizsgálói jelentés*

2016. december 31.

FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

Az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap (az „Alap”) 2016. évi éves jelentésének I - XIV. pontjaiban található számviteli információinak (továbbiakban: „számviteli információk”) könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap mellékelt 2016. 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.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk általunk végzett könyvvizsgálatára vonatkozó, Magyarországon hatályos etikai követelményeknek megfelelően, függetlenek vagyunk az Alaptól és annak kezelőjétől, az OTP Alapkezelő Zrt.-től, és ugyanezen etikai követelményekkel összhangban eleget tettünk egyéb etikai felelősségeinknek is.

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

Kulcsfontosságú könyvvizsgálati kérdések

Megállapítottuk, hogy nincsenek a jelentésünkben kommunikálandó kulcsfontosságú könyvvizsgálati kérdések.

Egyéb információk

Az egyéb információk az éves jelentésben foglalt nem számviteli információkból állnak, de nem tartalmazzák az éves jelentésben található számviteli információkat és az azokra vonatkozó könyvvizsgálói jelentésünket. Az OTP Alapkezelő Zrt. ügyvezetése (a „vezetés”) felelős az egyéb információk elkészítéséért. A jelentésünk „Vélemény” szakaszában az éves jelentésben közölt számviteli információkra adott véleményünk nem vonatkozik az egyéb információkra, és az egyéb információkra vonatkozóan nem bocsátunk ki semmilyen formájú bizonyosságot nyújtó következtetést.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk 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 ezt a tényt jelenteni. Ebben a 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 számvitel éves jelentésben való alkalmazásáért, azt az esetet kivéve, ha a vezetésnek szándékában áll megszüntetni az Alapot vagy beszüntetni az üzletszerű tevékenységet, vagy amikor ezen kívül nem áll előtte más reális lehetőség.

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 Könyvvizsgálati Standardokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálat mindig feltárja az egyébként létező lényeges hibás állítást. A hibás állítások eredhetnek csalásból vagy hibából, és lényegesnek minősülnek, ha ésszerű lehet az a várakozás, hogy ezek önmagukban vagy együttesen befolyásolhatják a felhasználók adott éves jelentésben közölt számviteli információk alapján meghozott gazdasági döntéseit.

Egy, a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal összhangban elvégzésre kerülő könyvvizsgálatnak a részeként szakmai megítélést alkalmazunk, és szakmai szkepticizmust tartunk fenn a könyvvizsgálat egésze során. Emellett:

- Azonosítjuk és felmérjük az éves jelentésben közölt számviteli információk akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állításainak kockázatait, az ezen kockázatok kezelésére alkalmas könyvvizsgálati eljárásokat alakítunk ki és hajtunk végre, valamint véleményünk megalapozásához elegendő és megfelelő könyvvizsgálati bizonyítékot szerzünk. A csalásból eredő lényeges hibás állítás fel nem tárásának 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 ésszerűségét.
- 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, 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.

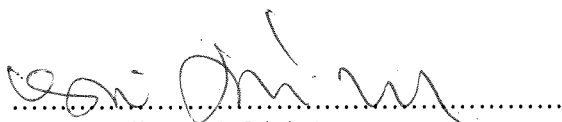
Kommunikáljuk az irányítással megbízott személyek felé – egyéb kérdések mellett – a könyvvizsgálat tervezett hatókörét és ütemezését, a könyvvizsgálat jelentős megállapításait, beleértve a belső kontrollnak a könyvvizsgálatunk során általunk azonosított jelentős hiányosságait is.

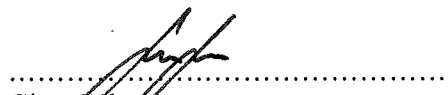
Nyilatkozunk az irányítással megbízott személyeknek arról, hogy megfelelünk a függetlenségre vonatkozó releváns etikai követelményeknek, és kommunikáljuk feléjük mindazon kapcsolatokat és egyéb kérdéseket, amelyekről ésszerűen feltételezhető, hogy befolyásolják a függetlenségünket, valamint adott esetben a kapcsolódó biztosítékokat.

Az irányítással megbízott személyek felé kommunikált kérdések közül meghatározzuk azokat a kérdéseket, amelyek az éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálata során a legjelentősebb kérdések, és ennél fogva a kulcsfontosságú könyvvizsgálati kérdések voltak. Könyvvizsgálói jelentésünkben ismertetjük ezeket a kérdéseket, kivéve, ha jogszabály vagy szabályozás kizárja az adott kérdés nyilvános közzétételét, vagy ha - rendkívül ritka körülmények között - azt állapítjuk meg, hogy egy adott kérdést a könyvvizsgálói jelentésben nem lehet kommunikálnunk, mert ésszerű várakozások alapján annak hátrányos következményei súlyosabbak lennének, mint a kommunikáció közérdekű hasznai.

A jelen független könyvvizsgálói jelentést eredményező könyvvizsgálat megbízásért felelős partnerének a jelentés aláírói minősülnek.

Budapest, 2017. április 27.


 Nagyváradiné Szépfalvi Zsuzsanna
 Deloitte Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft.
 1068 Budapest Dózsa György út 84/C.
 Nyilvántartási szám: 000083


 Gion Gábor
 Kamarai tag könyvvizsgáló
 Tagszám: 005252



OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Éves jelentés a 2016. december 31-én zárult üzleti évről

Pénzügyi év: 2016. január 1-től
2016. december 31-ig

Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Székhelye:	1134 BUDAPEST, Váci út 33.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Székhelye:	1051 BUDAPEST, Nádor u.16.

OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Mérleg

		adatok ezer Ft-ban	
A tétel megnevezése		Előző év 2015. december 31.	Tárgyév 2016. 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	99.898.225	163.123.080
09.	I. Követelések	0	3.120.423
10.	1. Követelések	0	3.120.423
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	95.518.332	158.390.730
15.	1. Értékpapírok	90.159.781	151.444.455
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	5.358.551	6.946.275
17.	a) kamatokból, osztalékból	769.259	1.004.282
18.	b) egyéb piaci megítélésből	4.589.292	5.941.993
19.	III. Pénzeszközök	4.379.893	1.611.927
20.	1. Pénzeszközök	4.379.893	1.611.927
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	208	1.985
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	208	1.985
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származtatott ügyletek értékelési különbözete	651.190	761.346
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	100.549.623	163.886.411
27.	E. Saját tőke	100.151.413	126.249.818
28.	I. Induló tőke	27.293.673	31.251.619
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	76.669.213	92.197.331
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-49.375.540	-60.945.712
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	72.857.740	94.998.199
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékülkülönbözete	-117.665.178	-149.767.408
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékülkülönbözete	181.506.744	225.213.639
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	6.009.741	7.707.621
35.	3. Előző év(ek) eredménye	9.423.733	3.006.433
36.	4. Üzleti év eredménye	-6.417.300	8.837.914
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	398.210	37.636.593
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	398.210	37.636.593
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	100.549.623	163.886.411

Eredménykimutatás

		adatok ezer Ft-ban	
A tétel megnevezése		Előző év 2015.01.01-2015.12.31.	Tárgyév 2016.01.01-2016.12.31.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei	26.027.785	35.981.219
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	30.337.790	22.684.058
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	2.057.704	4.405.837
05.	V. Egyéb ráfordítások	49.591	53.410
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	-6.417.300	8.837.914

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.

Kelt: BUDAPEST, 2017. március 31.

.....
az Alapkezelő vezetője

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Tájékoztató adatok:

Az Alap neve: OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Az Alap felügyeleti nyilvántartásba vételének száma (lajstromszám) és dátuma: 1111-276, 2008. május 14.

Az Alap típusa: nyilvános

Az Alap fajtája: nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az Alap futamideje: 2008. május 14-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: Budapest, 1134 Váci út 33.

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

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

Az Alap képviselőjére jogosult személy Köves Benedek Balázs, lakóhelye 1126 Budapest, Márvány utca 27. fszt. 6. A könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy Szabó Andrea, lakóhelye 2151 Fót, Németh Kálmán utca 72. mérlegképes igazolvány száma: MK 191836.

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 Gion Gábor, kamarai tagsági száma: 005252.

Az Alap 2016. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFA-val növelt bruttó könyvvizsgálati díj 1.342 eFt. Ezt részben az Alapkezelő által számlázott alapkezelői díj tartalmazta, de a szerződéses konstrukció változása miatt 1.276 eFt már az Alapot közvetlenül terhelte.

Az Alap tőzsdei bevezetésének dátuma: 2014. december 23.

Az Alappal kapcsolatos további információkat ld. az Alapkezelő honlapján:

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

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 értékkülönbszeteként 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 különbsége szerepel. Az elszámolt értékkülönbségeket 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 különbsége a 32-33. sorban szerepel.

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye 13.297.161 eFt, amely 35.981.219 eFt bevétel és 22.684.058 eFt ráfordítás különbsége. 4.405.837 eFt működési költség és 53.410 eFt egyéb ráfordítás után a nyereség 8.837.914 eFt.

A működési költségeket a likviditási jelentés II. táblázata részletezi, amelyben a "pénzügyileg realizált oszlop" tartalmazza az 2016. 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 Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyongkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta		Időszak nyitó állománya 2016.01.01		Időszak záró állománya 2016.12.31		Megosztás (%)
Készpénzállomány - banki egyenlegek						
Bank	Lekötési idő					
OTP Bank Nyrt. HUF	folyószámla	18		16.816		0,01%
OTP Bank Nyrt. EUR	folyószámla	49.714		98.774		0,06%
OTP Bank Nyrt. USD	folyószámla	1.445.183		1.475.906		0,90%
OTP Bank Nyrt. GBP	folyószámla	72.026		120		0,00%
OTP Bank Nyrt. PLN	folyószámla	3.617		3.078		0,00%
OTP Bank Nyrt. CHF	folyószámla	969		0		0,00%
OTP Bank Nyrt. JPY	folyószámla	1.900		2.023		0,00%
OTP Bank Nyrt. SEK	folyószámla	0		25		0,00%
OTP Bank Nyrt. TRY	folyószámla	0		316		0,00%
OTP Bank Nyrt. AUD	folyószámla	0		836		0,00%
OTP Bank Nyrt. CAD	folyószámla	0		29		0,00%
OTP Bank Nyrt. RBL	folyószámla	0		13.558		0,01%
OTP Bank Nyrt. NOK	folyószámla	1.797		446		0,00%
OTP Bank Nyrt. RBL	2015.12.30 - 2016.01.06	213.268		0		0,00%
OTP Bank Nyrt. HUF	2015.12.31 - 2016.01.04	1.349.720		0		0,00%
OTP Bank Nyrt. USD	2015.12.30 - 2016.01.06	95.161		0		0,00%
OTP Bank Nyrt. USD	2015.12.30 - 2016.01.06	143.315		0		0,00%
OTP Bank Nyrt. USD	2015.12.30 - 2016.01.06	1.003.205		0		0,00%
Banki egyenlegek összesen:		4.379.893		1.611.927		0,98%
Átruházható értékpapírok						
Értékpapír neve	Futamidő	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	
Államkötvények:		45.161.782		76.716.712		46,82%
2023/A	2007.01.10 - 2023.11.24	11.448.113		2.106.497		1,28%
2024/B	2015.03.18 - 2024.06.26	3.965.665		4.415.335		2,69%
2025/B	2014.01.15 - 2025.06.24	3.611.795		3.476.800		2,12%
2027/A	2016.01.13 - 2027.10.27	0		3.967.195		2,42%
2028/A	2011.03.02 - 2028.10.22	0		336.138		0,20%
2031/A	2015.04.22 - 2031.10.22	0		2.205.599		1,34%
BMÁK 2020/P	2014.07.01 - 2020.07.22	106.355		108.419		0,07%
PEMÁK 2016/X	2013.01.17 - 2016.05.25	1.463.105		0		0,00%
PEMÁK 2016/Y	2013.05.21 - 2016.05.25	18.462.639		0		0,00%
REPHUN 4 05/20/16	2008.05.20 - 2016.05.20	823.818		0		0,00%
REPHUN 4.125 02/18	2013.02.19 - 2018.02.19	302.829		305.357		0,19%
REPHUN 5.375 02/23	2013.02.19 - 2023.02.21	318.385		324.229		0,20%
REPHUN 6 01/11/19	2011.05.11 - 2019.01.11	343.620		251.615		0,15%
REPHUN 6.25 01/29/20	2010.01.29 - 2020.01.29	0		329.773		0,20%
SOAF 5 10/12/46	2016.10.12 - 2046.10.12	0		412.215		0,25%
ABU DHABI 3.125 05/03/26	2016.05.03 - 2026.05.03	0		1.162.415		0,71%
ARGENT 6.25 04/22/19 PHASE	2016.04.22 - 2019.04.22	0		422.489		0,26%
ARGENT 6.875 04/22/21 PHAS	2016.04.22 - 2021.04.22	0		422.112		0,26%
ARGENT 7.5 04/22/26 PHASE	2016.04.22 - 2026.04.22	0		209.700		0,13%
ARGENT 7.625 04/22/46 PHAS	2016.04.22 - 2046.04.22	0		199.888		0,12%
BTPS 2.8 03/01/67	2016.09.01 - 2067.03.01	0		4.200.537		2,56%
CROATI 3 03/11/25	2015.03.11 - 2025.03.11	2.929.891		0		0,00%
INDON 2.625 06/14/23	2016.06.14 - 2023.06.14	0		476.852		0,29%
INDON 3.75 06/14/28	2016.06.14 - 2028.06.14	0		64.819		0,04%
KSA 2.375 10/26/21	2016.10.26 - 2021.10.26	0		861.157		0,53%
KSA 3.25 10/26/26	2016.10.26 - 2021.10.26	0		562.519		0,34%
KSA 4.5 10/26/46	2016.10.26 - 2046.10.26	0		1.139.024		0,70%
MEX 1.375 01/15/25	2016.11.01 - 2025.01.25	0		1.878.668		1,15%
MEX 3.375 02/23/31	2016.02.23 - 2031.02.23	0		653.386		0,40%
OMANIB 3.625 06/15/21	2016.06.15 - 2021.06.15	0		2.945.207		1,80%
OMANIB 4.75 06/15/26	2016.06.15 - 2026.06.15	0		1.996.668		1,22%
POLAND 1 10/25/28	2016.10.25 - 2028.10.25	0		3.578.259		2,18%
POLAND 2 10/25/46	2016.10.25 - 2046.10.25	0		3.505.902		2,14%
POLGB 2,5 07/25/26	2015.07.25 - 2026.07.25	0		9.718.565		5,93%
RAGB 1.5 11/02/86	2016.11.02 - 2086.11.02	0		1.729.792		1,06%
ROMANI 2.75 10/29/25	2015.10.29 - 2025.10.29	0		1.634.569		1,00%
ROMANI 2.875 05/26/28	2016.05.26 - 2028.05.26	0		1.307.663		0,80%
ROMANI 2.875 10/28/24	2014.10.28 - 2024.10.28	1.302.655		1.331.602		0,81%
ROMANI 3.875 10/29/35	2015.10.29 - 2035.10.29	0		1.161.966		0,71%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2016.01.01	Időszak záró állománya 2016.12.31	Megosztás (%)
SERBIA 5.25 21/11/17 2012.11.21 - 2017.11.21	0	1.211.444	0,74%
SLOREP 1.5 03/25/35 2015.03.25 - 2035.03.25	0	4.539.052	2,77%
SLOREP 1.75 11/03/40 2016.11.03 - 2040.11.03	0	1.524.789	0,93%
SLOREP 2.125 07/28/25 2015.07.28 - 2025.07.28	0	1.393.705	0,85%
SPGB 1.3 10/31/2026 2016.07.26 - 2026.10.31	0	5.583.189	3,41%
TURKEY 4.875 10/09/26 2016.03.09 - 2026.10.09	0	1.651.934	1,01%
TURKGB 7.1 03/08/23 2013.03.20 - 2023.03.08	82.912	0	0,00%
UKT 4.25 12/07/27 2006.09.06 - 2027.12.07	0	1.409.668	0,86%
Kötvények:	26.849.360	42.753.462	26,09%
ALVGR 3.875 12/29/49 2016.09.07 - 2049.12.29	0	301.705	0,18%
AXASA 3.375 07/06/2047 2016.03.30 - 2047.07.06	0	1.608.458	0,98%
BNP 2.5 04/09/2018 2015.04.09 - 2018.04.09	1.014.848	1.040.608	0,63%
BNP 4.5 11/27/2016 2013.11.27 - 2016.11.27	1.033.465	0	0,00%
BPCEGP 2.875 04/22/26 2016.04.22 - 2026.04.22	0	652.878	0,40%
BSTDDBK 4.875 05/06/21 (INTL) 2016.05.06 - 2021.05.06	0	1.236.705	0,75%
CEMEX 4.625 06/15/24 2016.06.14 - 2024.06.15	0	112.611	0,07%
CESDRA 1.875 05/25/23 2016.05.25 - 2023.05.25	0	652.011	0,40%
CEZCP 0 08/04/17 2014.02.04 - 2017.07.21	634.362	696.275	0,42%
DELL 5.45 06/15/23 2016.06.01 - 2023.06.15	0	468.635	0,29%
DELL 5.875 06/15/21 2016.06.22 - 2021.06.15	0	77.888	0,05%
DELL 6.02 06/15/26 2016.06.01 - 2026.06.15	0	477.744	0,29%
DELL 7.125 06/15/24 2016.06.22 - 2024.06.15	0	81.327	0,05%
DELL 8.1 07/15/36 2016.06.01 - 2036.07.15	0	546.762	0,33%
DELL 8.35 07/15/46 2016.06.01 - 2046.07.15	0	376.933	0,23%
FCAIM 3.75 03/29/24 2016.03.30 - 2024.03.29	0	1.097.071	0,67%
FIAT 6.625 03/15/18 2013.03.15 - 2018.03.15	357.711	0	0,00%
GLENLN 1.25 03/17/21 2015.03.17 - 2021.03.17	116.056	157.916	0,10%
GLENLN 1.75 03/17/25 2015.03.17 - 2025.03.17	101.339	150.953	0,09%
KBCBB 1 04/26/21 2016.04.26 - 2021.04.26	0	321.473	0,20%
MAEXIM 4 01/30/20 2014.10.02 - 2020.01.31	1.177.116	1.228.777	0,75%
MAEXIM 5.5 02/12/18 2012.12.12 - 2018.02.12	1.855.553	1.403.131	0,86%
MAGNOLIA VAR 03/49 2006.03.20 - 2016.03.20	931.783	0	0,00%
MAGYAR 1.875 04/16/18 2015.09.30 - 2018.04.16	1.979.311	0	0,00%
MAGYAR 2.375% 12/08/21 2015.12.08 - 3000.01.01	6.820.179	6.958.390	4,25%
MAGYAR 5.875 05/16 2011.05.31 - 2016.05.31	496.690	0	0,00%
MAGYAR 6.25 10/21/20 2013.10.21 - 2020.10.21	3.363.873	2.876.521	1,76%
MOLHB 2.625 04/28/23 2016.04.28 - 2023.04.28	0	1.938.797	1,18%
MOLHB 6.25 09/19 2012.09.26 - 2019.09.26	2.797.612	2.268.956	1,38%
NLMKRU 4.5 06/15/23 2016.06.15 - 2023.06.15	0	734.281	0,45%
OTPHB 5.27 09/16 2006.09.19 - 2016.09.19	2.442.655	0	0,00%
OTPHB VAR 49-16 2006.11.07 - 2016.11.07	840.328	784.447	0,48%
PETBRA 8.375 05/23/21 2016.05.23 - 2021.05.23	0	159.713	0,10%
PETBRA 8.75 05/23/26 2016.05.23 - 2026.05.23	0	479.892	0,29%
PETROBRAS 6.85 06/05/15 2015.06.05 - 2115.06.05	845.819	1.084.545	0,66%
RZB 5.169 05/29/49 2006.04.26 - 2049.05.29	40.660	0	0,00%
TOTAL 3.369 12/29/49 2016.10.06 - 2026.10.06	0	453.826	0,28%
UNICREDIT-PEKAO ELC 2016.12.15 - 2019.12.15	0	11.862.953	7,24%
ZURNVX 5.625 06/24/46 2016.03.24 - 2046.06.24	0	461.280	0,28%
Belföldi részvények:	15.236.352	20.963.733	12,79%
ENEFI	452.390	0	0,00%
MASTERPLAST	101.400	100.200	0,06%
MOL TÖRZS	12.402.562	18.571.500	11,33%
OTP TÖRZS (100)	2.280.000	2.292.033	1,40%
Külföldi részvények:	5.707.647	15.934.822	9,75%
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	23.294	25.789	0,02%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE	0	162.827	0,10%
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85	0	176.846	0,11%
GILEAD SCIENCES INC	0	42.063	0,03%
HALK BANKASI	71.174	0	0,00%
MARATHON PETROLEUM CORP	81.725	0	0,00%
MICRON TECHNOLOGY INC	1.171.700	3.146.019	1,92%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyongkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta		Időszak nyitó állománya 2016.01.01		Időszak záró állománya 2016.12.31		Megosztás (%)
MONETA MONEY BANK AS		0		1.564.205		0,95%
MONSANTO CO		0		61.798		0,04%
OMV PETROM SA		0		4.388.776		2,68%
PEKAO		0		2.210.620		1,35%
PKO BANK		567.365		558.972		0,34%
ROMGAZ - GDR		197.941		178.845		0,11%
SBERBANK		77.135		160.989		0,10%
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE		497.055		1.171.863		0,72%
TURK HAVA		65.086		0		0,00%
UNICREDIT SPA		1.862.944		1.028.061		0,63%
VESTAS		1.015.013		959.999		0,59%
WIZZ AIR HOLDINGS PLC		77.215		97.150		0,06%
Jelzáloglevelek:		1.621.559		630.233		0,38%
FJ18NF01	2013.03.13 - 2018.03.13	997.296		70		0,00%
FJ20NF01	2013.04.10 - 2020.04.10	624.263		630.163		0,38%
Befektetési jegyek:		941.632		1.391.768		0,83%
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT		0		48.920		0,03%
ETF SH		179.459		0		0,00%
ETFS CORN		0		118.601		0,07%
ETFS PHYSICAL GOLD		0		163.864		0,10%
ETFS PHYSICAL SILVER		0		136.213		0,08%
ETFS SHORT COPPER		120.557		0		0,00%
ETFS WHEAT		0		80.647		0,05%
GLOBAL X SILVER MINERS ETF		0		84.873		0,05%
LYXOR ETF BRAZIL IBOVESPA		42.553		0		0,00%
LYXOR UCITS ETF SGI DAILY DOUBLE		0		173.036		0,10%
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.		599.063		254.243		0,15%
PROSHARES SHORT S&P 500		0		241.458		0,15%
PROSHARES ULTRASHORT 20		0		89.913		0,05%
Átruházható értékpapírok összesen:		95.518.332	0	158.390.730	0	96,66%
Egyéb eszközök						
Követelések		0		3.120.423		1,90%
Aktív időbeli elhatárolások		208		1.985		0,00%
Származtatott ügyletek értékelési különbözete		651.190		761.346		0,46%
Egyéb eszközök összesen:		651.398		3.883.754		2,36%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:		100.549.623		163.886.411		100,00%
Kötelezettségek						
1. Hitelállomány:		0		0		0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:						
Alapkezelői díj		167.903		2.388.327		6,35%
Letétkezelői díj		9.772		11.650		0,03%
Költségként elszámolt egyéb tétel		7.887		11.540		0,03%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		212.648		35.225.076		93,59%
3. Céltartalékok:		0		0		0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		0		0		0,00%
Kötelezettségek összesen:		398.210		37.636.593		100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:		100.151.413		126.249.818		

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	27.293.673.776	31.251.618.808	
--	-----------------------	-----------------------	--

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

	2015.12.31	2016.12.31
Jelen dokumentum alapján:	3,669400	4,039785
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	3,692248	4,037527

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	2016.01.01	Megoszl.(%)	2016.12.31	Megoszl.(%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	95.518.332	95,00%	158.390.730	96,65%
b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
<i>a fentiekből:</i>				
c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
d) egyéb átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok:	73.632.701	73,23%	120.100.407	73,28%

*A megoszlási viszonyszámok az Alap összes eszközértékéhez viszonyított arányokat mutatja (előző évi auditált jelentésben az arányszám az értékpapír portfólió összetételére alapján lett számszerűsítve).

A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

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

V. Az Alap eszközeinek alakulása

Megnevezés	2015. december 31- el zárult üzleti év	2016. december 31- el zárult üzleti év
a) befektetésekből származó jövedelem:	-4.310.005	13.297.161
b) egyéb bevétel:	0	0
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-1.979.651	-4.321.584
d) a letétkezelő díjai:	-39.576	-42.679
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	-11.180	-13.014
bankköltség:	-746	-533
felügyeleti díj:	-24.691	-26.751
egyéb költség és ráfordítás:	-51.451	-54.686
f) nettó jövedelem:	-6.417.300	8.837.914
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	-6.417.300	8.837.914
h) a tőkeszámla változása:	-6.648.503	15.562.611
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értéksökkenése:	-2.756.603	1.697.880
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 Supra Származtatott Befektetési Alap

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

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma és nettó eszközértéke:

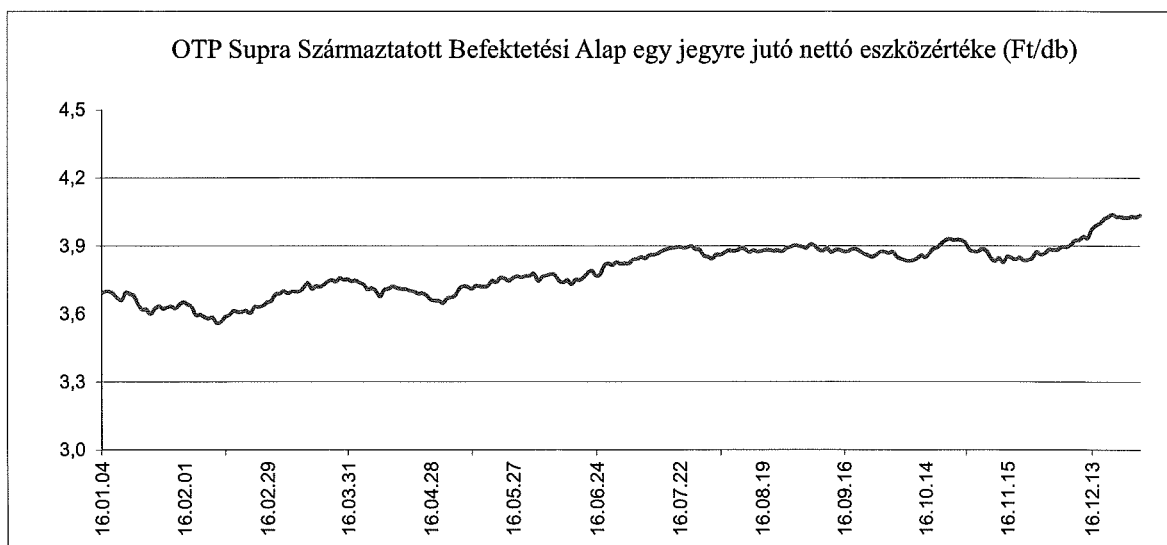
	Elért hozamok éves bontásban	Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	Fordulónapi nettó eszközérték (Ft)	Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db)
2012. december 31.		8.798.978.068	29.658.865.982	3,370717
2013. december 31.	8,23%	24.141.020.690	88.067.245.371	3,648033
2014. december 31.	8,08%	29.414.785.241	115.973.817.825	3,942705
2015. december 31.	-6,93%	27.293.673.776	100.151.413.369	3,669400
2016. január 29.		26.330.520.557		3,643602
2016. február 29.		26.051.686.852		3,652455
2016. március 31.		26.751.114.599		3,753545
2016. április 29.		27.439.814.013		3,659330
2016. május 31.		28.231.588.346		3,762872
2016. június 30.		27.495.867.458		3,816628
2016. július 29.		28.413.007.523		3,884845
2016. augusztus 31.		28.965.570.755		3,904434
2016. szeptember 30.		29.209.202.661		3,875377
2016. október 28.		29.954.545.085		3,915405
2016. november 30.		30.141.451.499		3,883533
2016. december 31.	10,09%	31.251.618.808	126.249.818.646	4,039785

Az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap 2016. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után 10,09 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

(névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2016. január	825.920.170	1.789.073.389
2016. február	956.598.841	1.235.432.546
2016. március	1.411.196.325	711.768.578
2016. április	1.397.735.576	709.036.162
2016. május	1.477.967.745	686.193.412
2016. június	843.960.401	1.579.681.289
2016. július	1.551.160.597	634.020.532
2016. augusztus	1.166.698.894	614.135.662
2016. szeptember	1.504.144.155	1.260.512.249
2016. október	1.307.773.803	562.431.379
2016. november	1.148.986.953	962.080.539
2016. december	1.935.974.247	825.806.938
Összesen:	15.528.117.707	11.570.172.675

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.



Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

VII. A származtatott ügyletek és a kapcsolódó kötelezettségvállalások bemutatása

A származtatott ügyletek és kapcsolódó kötelezettségvállalások a XIII. pontban az értékpapírok értékkülönbségének 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 tárgydőszak 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 2016. évben kifizetett összes:

eFt.

Megnevezés	Összeg
Rögzített javadalmazás	366.809
Változó javadalmazás	292.317
Összesen	659.126

Az Alap kockázati profiljára lényeges hatást gyakorlók körében 2016. évben kifizetett összes:

eFt.

Megnevezés	Ügyvezetők	Egyéb munkavállalók	Összesen
Kedvezményezettek száma	5	5	10
Nyereségrészesedés	0	57.003	57.003
Teljes javadalmazás *	168.098	88.673	256.771

*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 tárgydőszakban, 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 tárgydőszakban, 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 állampapírokból 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 Supra Származtatott Befektetési 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, 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

	2015.12.31	2016.12.31	Változás 2016/2015
Tőkeáttétel	144.440.018.949	244.862.155.734	169,5251%

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.

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír			Beszerzési ár	Értékkülönbözet		Piaci érték
megnevezése	futamideje			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:			75.897.801	649.512	169.399	76.716.712
2023/A	2007.01.10 -	2023.11.24	2.072.020	10.600	23.877	2.106.497
2024/B	2015.03.18 -	2024.06.26	4.222.789	66.021	126.525	4.415.335
2025/B	2014.01.15 -	2025.06.24	3.281.697	81.648	113.455	3.476.800
2027/A	2016.01.13 -	2027.10.27	3.824.221	21.699	121.275	3.967.195
2028/A	2011.03.02 -	2028.10.22	323.300	3.283	9.555	336.138
2031/A	2015.04.22 -	2031.10.22	2.144.472	14.540	46.587	2.205.599
BMÁK 2020/P	2014.07.01 -	2020.07.22	100.500	1.500	6.419	108.419
REPHUN 4.125 02/18	2013.02.19 -	2018.02.19	289.983	4.481	10.893	305.357
REPHUN 5.375 02/23	2013.02.19 -	2023.02.21	214.457	5.752	104.020	324.229
REPHUN 6 01/11/19	2011.05.11 -	2019.01.11	243.166	12.468	-4.019	251.615
REPHUN 6.25 01/29/20	2010.01.29 -	2020.01.29	310.830	7.845	11.098	329.773
SOAF 5 10/12/46	2016.10.12 -	2046.10.12	414.525	4.888	-7.198	412.215
ABU DHABI 3.125 05/03/26	2016.05.03 -	2026.05.03	1.164.335	5.934	-7.854	1.162.415
ARGENT 6.25 04/22/19 PI	2016.04.22 -	2019.04.22	370.473	4.749	47.267	422.489
ARGENT 6.875 04/22/21 P	2016.04.22 -	2021.04.22	362.543	5.224	54.345	422.112
ARGENT 7.5 04/22/26 PH	2016.04.22 -	2026.04.22	182.634	2.871	24.195	209.700
ARGENT 7.625 04/22/46 P	2016.04.22 -	2046.04.22	174.887	2.919	22.082	199.888
BTPS 2.8 03/01/67	2016.09.01 -	2067.03.01	4.580.233	43.662	-423.358	4.200.537
INDON 2.625 06/14/23	2016.06.14 -	2023.06.14	462.576	6.744	7.532	476.852
INDON 3.75 06/14/28	2016.06.14 -	2028.06.14	61.336	1.285	2.198	64.819
KSA 2.375 10/26/21	2016.10.26 -	2021.10.26	827.619	3.841	29.697	861.157
KSA 3.25 10/26/26	2016.10.26 -	2021.10.26	549.918	3.504	9.097	562.519
KSA 4.5 10/26/46	2016.10.26 -	2046.10.26	1.092.436	9.704	36.884	1.139.024
MEX 1.375 01/15/25	2016.11.01 -	2025.01.25	1.932.055	927	-54.314	1.878.668
MEX 3.375 02/23/31	2016.02.23 -	2031.02.23	703.790	18.003	-68.407	653.386
OMANIB 3.625 06/15/21	2016.06.15 -	2021.06.15	2.888.667	4.959	51.581	2.945.207
OMANIB 4.75 06/15/26	2016.06.15 -	2026.06.15	1.980.475	4.548	11.645	1.996.668
POLAND 1 10/25/28	2016.10.25 -	2028.10.25	3.548.447	6.953	22.859	3.578.259
POLAND 2 10/25/46	2016.10.25 -	2046.10.25	3.458.434	13.906	33.562	3.505.902
POLGB 2.5 07/25/26	2015.07.25 -	2026.07.25	9.917.199	115.545	-314.179	9.718.565
RAGB 1.5 11/02/86	2016.11.02 -	2086.11.02	1.823.757	4.601	-98.566	1.729.792
ROMANI 2.75 10/29/25	2015.10.29 -	2025.10.29	1.609.762	7.499	17.308	1.634.569
ROMANI 2.875 05/26/28	2016.05.26 -	2028.05.26	1.249.551	21.558	36.554	1.307.663
ROMANI 2.875 10/28/24	2014.10.28 -	2024.10.28	1.219.269	6.370	105.963	1.331.602
ROMANI 3.875 10/29/35	2015.10.29 -	2035.10.29	1.187.616	7.396	-33.046	1.161.966
SERBIA 5.25 21/11/17	2012.11.21 -	2017.11.21	1.157.755	6.928	46.761	1.211.444
SLOREP 1.5 03/25/35	2015.03.25 -	2035.03.25	4.435.184	54.066	49.802	4.539.052
SLOREP 1.75 11/03/40	2016.11.03 -	2040.11.03	1.512.192	4.399	8.198	1.524.789
SLOREP 2.125 07/28/25	2015.07.28 -	2025.07.28	1.338.921	11.371	43.413	1.393.705
SPGB 1.3 10/31/2026	2016.07.26 -	2026.10.31	5.563.281	12.393	7.515	5.583.189
TURKEY 4.875 10/09/26	2016.03.09 -	2026.10.09	1.721.268	19.770	-89.104	1.651.934
UKT 4.25 12/07/27	2006.09.06 -	2027.12.07	1.379.228	3.158	27.282	1.409.668
Kötvények:			41.165.159	325.070	1.263.233	42.753.462
ALVGR 3.875 12/29/49	2016.09.07 -	2049.12.29	333.720	4.340	-36.355	301.705
AXASA 3.375 07/06/2047	2016.03.30 -	2047.07.06	1.552.206	25.739	30.513	1.608.458
BNP 2.5 04/09/2018	2015.04.09 -	2018.04.09	1.017.329	18.288	4.991	1.040.608
BPCEGP 2.875 04/22/26	2016.04.22 -	2026.04.22	616.016	12.445	24.417	652.878
BSTDBK 4.875 05/06/21 (I)	2016.05.06 -	2021.05.06	1.194.444	8.787	33.474	1.236.705
CEMEX 4.625 06/15/24	2016.06.14 -	2024.06.15	108.700	234	3.677	112.611

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír			Beszerzési ár	Értékkülönbözöt		Piaci érték
megnevezése	futamideje			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
CESDRA 1.875 05/25/23	2016.05.25 -	2023.05.25	625.039	7.062	19.910	652.011
CEZCP 0 08/04/17	2014.02.04 -	2017.07.21	642.593	0	53.682	696.275
DELL 5.45 06/15/23	2016.06.01 -	2023.06.15	469.588	1.118	-2.071	468.635
DELL 5.875 06/15/21	2016.06.22 -	2021.06.15	78.626	201	-939	77.888
DELL 6.02 06/15/26	2016.06.01 -	2026.06.15	476.509	1.235	0	477.744
DELL 7.125 06/15/24	2016.06.22 -	2024.06.15	81.413	244	-330	81.327
DELL 8.1 07/15/36	2016.06.01 -	2036.07.15	416.666	20.921	109.175	546.762
DELL 8.35 07/15/46	2016.06.01 -	2046.07.15	277.758	14.378	84.797	376.933
FCAIM 3.75 03/29/24	2016.03.30 -	2024.03.29	1.032.603	29.209	35.259	1.097.071
GLENLN 1.25 03/17/21	2015.03.17 -	2021.03.17	151.992	1.544	4.380	157.916
GLENLN 1.75 03/17/25	2015.03.17 -	2025.03.17	151.336	2.162	-2.545	150.953
KBCBB 1 04/26/21	2016.04.26 -	2021.04.26	307.959	2.130	11.384	321.473
MAEXIM 4 01/30/20	2014.10.02 -	2020.01.31	1.162.097	19.955	46.725	1.228.777
MAEXIM 5.5 02/12/18	2012.12.12 -	2018.02.12	1.360.799	28.279	14.053	1.403.131
MAGYAR 2.375% 12/08/2	2015.12.08 -	3000.01.01	7.014.431	10.200	-66.241	6.958.390
MAGYAR 6.25 10/21/20	2013.10.21 -	2020.10.21	2.828.607	31.755	16.159	2.876.521
MOLHB 2.625 04/28/23	2016.04.28 -	2023.04.28	1.887.240	33.283	18.274	1.938.797
MOLHB 6.25 09/19	2012.09.26 -	2019.09.26	2.162.020	34.146	72.790	2.268.956
NLMKRU 4.5 06/15/23	2016.06.15 -	2023.06.15	682.800	1.539	49.942	734.281
OTPHB VAR 49-16	2006.11.07 -	2016.11.07	762.288	0	22.159	784.447
PETBRA 8.375 05/23/21	2016.05.23 -	2021.05.23	137.603	1.314	20.796	159.713
PETBRA 8.75 05/23/26	2016.05.23 -	2026.05.23	410.190	4.119	65.583	479.892
PETROBRAS 6.85 06/05/1	2015.06.05 -	2115.06.05	1.027.830	6.697	50.018	1.084.545
TOTAL 3.369 12/29/49	2016.10.06 -	2026.10.06	461.925	3.746	-11.845	453.826
UNICREDIT-PEKAO ELC	2016.12.15 -	2019.12.15	11.319.442	0	543.511	11.862.953
ZURNVX 5.625 06/24/46	2016.03.24 -	2046.06.24	413.390	0	47.890	461.280
Belföldi részvények:			18.735.343	0	2.228.390	20.963.733
MASTERPLAST			84.400	0	15.800	100.200
MOL TÖRZS			16.476.809	0	2.094.691	18.571.500
OTP TÖRZS (100)			2.174.134	0	117.899	2.292.033
Külföldi részvények:			13.174.021	0	2.760.801	15.934.822
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR			16.430	0	9.359	25.789
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE			143.455	0	19.372	162.827
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85			176.850	0	-4	176.846
GILEAD SCIENCES INC			46.342	0	-4.279	42.063
MICRON TECHNOLOGY INC			1.894.028	0	1.251.991	3.146.019
MONETA MONEY BANK AS			1.406.184	0	158.021	1.564.205
MONSANTO CO			59.056	0	2.742	61.798
OMV PETROM SA			3.505.330	0	883.446	4.388.776
PEKAO			2.249.495	0	-38.875	2.210.620
PKO BANK			680.147	0	-121.175	558.972
ROMGAZ - GDR			218.023	0	-39.178	178.845
SBERBANK			127.287	0	33.702	160.989
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE			1.229.000	0	-57.137	1.171.863
UNICREDIT SPA			1.052.575	0	-24.514	1.028.061
VESTAS			252.341	0	707.658	959.999
WIZZ AIR HOLDINGS PLC			117.478	0	-20.328	97.150
Jelzáloglevelek:			588.774	29.700	11.759	630.233
FJ18NF01	2013.03.13 -	2018.03.13	70	3	-3	70
FJ20NF01	2013.04.10 -	2020.04.10	588.704	29.697	11.762	630.163

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

XIII. Értékpapírok értékkülönbözetének részletezése, valamint a származtatott ügyletek és a kapcsolódó kötelezettségvállalások bemutatása - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbözlet		Piaci érték
		kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Befektetési jegyek:	1.883.357	0	-491.589	1.391.768
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT	50.000	0	-1.080	48.920
ETFS CORN	114.895	0	3.706	118.601
ETFS PHYSICAL GOLD	167.308	0	-3.444	163.864
ETFS PHYSICAL SILVER	138.582	0	-2.369	136.213
ETFS WHEAT	99.661	0	-19.014	80.647
GLOBAL X SILVER MINERS ETF	84.094	0	779	84.873
LYXOR UCITS ETF SGI DAILY DOUBLE	179.655	0	-6.619	173.036
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.	702.051	0	-447.808	254.243
PROSHARES SHORT S&P 500	282.034	0	-40.576	241.458
PROSHARES ULTRASHORT 20	65.077	0	24.836	89.913
MINDÖSSZESEN:	151.444.455	1.004.282	5.941.993	158.390.730

Határidős deviza ügyletek bemutatása:

		határidős ügylet szerződés szerinti értéke		határidős ügylet diszkontált piaci értéke		
		devizában	forintban	devizás értéke forintban	forint értéke	eredmény
2015.12.31-én:	PLN	130.436	-9.542.960	9.581.829	-9.542.960	38.869
	EUR	-17.868	5.607.413	-5.594.828	5.607.412	12.584
	USD	-724	208.429	-207.520	208.428	908
	EUR	-42.000	13.334.542	-13.151.040	13.334.542	183.502
	CHF/EUR	-830	770	-240.189	241.102	913
	EUR/GBP	-1.500	1.104	-469.680	469.235	-445
	EUR/USD	-10.000	10.944	-3.131.200	3.136.793	5.593
	CAD/AUD	-2.033	2.000	-419.827	419.460	-367
	EUR/PLN	-31.770	138.453	-9.947.822	10.170.755	222.933
	JPY/USD	-60.203	500	-143.355	143.315	-40
	RBL/USD	-2.568.449	35.300	-9.928.351	10.118.039	189.688
	TRY	-897	87.960	-87.780	87.959	179
	EUR/USD	-1.000	1.098	-313.120	314.687	1.567
	AUD/CAD	-2.000	2.022	-419.460	417.646	-1.814
	USD	-1.500	429.060	-429.945	429.060	-885
	EUR	-2.000	628.210	-626.240	628.210	1.970
	Összesen:					655.155

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Határidős deviza ügyletek bemutatása (folytatás):

	adatok ezerben	határidős ügylet szerződés szerinti értéke		határidős ügylet diszkontált piaci értéke		eredmény
		devizában	forintban	devizás értéke forintban	forint értéke	
2016.12.31-én:	CNY/USD	-6.771	1.000	-286.282	293.316	7.034
	KRW/JPY	-655.554	60.000	-160.152	150.804	-9.348
	TRY/EUR	-7.295	1.975	-607.620	614.264	6.644
	AUD/EUR	-1.433	1.000	-303.981	311.020	7.039
	USD/EUR	-1.062	1.000	-311.924	311.020	-904
	USD	52.500	-15.468.230	15.415.628	-15.468.230	-52.602
	EUR	13.800	-4.324.157	4.292.076	-4.324.157	-32.081
	RBL/EUR	-2.845.861	44.200	-13.509.193	13.747.084	237.891
	USD/AUD	-1.082	1.500	-317.729	318.285	556
	GBP/EUR	-840	1.000	-303.763	311.020	7.257
	NOK/USD	-16.199	2.000	-554.343	587.262	32.919
	JPY/EUR	-4.823.011	39.350	-12.122.123	12.238.637	116.514
	USD/CNY	-1.000	6.781	-293.316	286.680	-6.636
	EUR/TRY	-1.000	3.536	-311.020	294.533	-16.487
	GBP/USD	-500	621	-180.806	182.245	1.439
	EUR/TRY	-1.000	3.602	-311.020	300.019	-11.001
	USD/NOK	-2.000	16.780	-587.262	574.212	-13.050
	JPY/KRW	-60.000	635.130	-150.804	155.162	4.358
	AUD/USD	-1.500	1.116	-318.285	327.739	9.454
	EUR/USD	-1.000	1.061	-311.020	311.464	444
	GBP/USD	-3.823	4.872	-1.382.384	1.430.642	48.258
	EUR	-3.850	1.208.768	-1.197.427	1.208.767	11.340
	EUR	-2.440	766.076	-758.889	766.076	7.187
	EUR	-1.945	610.663	-604.934	610.663	5.729
	EUR	-17.000	5.346.798	-5.287.340	5.346.798	59.458
	EUR	-2.435	765.783	-757.334	765.783	8.449
	AUD/USD	-40.000	29.900	-8.487.600	8.779.567	291.967
	EUR/PLN	-25.280	111.743	-7.862.586	7.854.391	-8.195
	USD	-2.000	596.910	-587.262	596.910	9.648
	USD	-279	82.369	-81.869	82.369	500
	EUR/AUD	-1.000	1.449	-311.020	307.463	-3.557
	Összesen:					720.224

Határidős tőzsdei ügyletek bemutatása:

Megnevezés	Eladás /Vétel	Devizanem	Nyitott kontraktus	Piaci ár	Piaci érték devizában	Piaci érték ezer forintban
W H6 - WHEAT FUTURE	Vétel	USD	14	4,7000	-13.993	-4.011
CLG6 - WTI CRUDE FUT	Eladás	USD	10	37,0400	-100	-28
2015. összesen:						-4.039
HGH7 - COPPER FUTUR	Eladás	USD	5	2,5055	2.012	591
HGH7 - COPPER FUTUR	Eladás	USD	3	2,5055	11.025	3.238
W H7 - WHEAT FUTURE	Vétel	USD	14	4,0800	127.078	37.322
2016. összesen:						41.151

Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban):

	Előző év 2015. december 31.	Tárgyév 2016. december 31.
Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke:	1.497.743	1.502.540
Az Alap által fizetendő változó láb értéke:	-1.422.723	-1.531.622
A kamatswap ügylet piaci értéke:	75.020	-29.082
Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben:	0	9.102.555
A mérlegen kívül (0. számlaosztályban) nyilvántartott értékek	1.500.000	1.500.000

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

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

Nyitott 'sell & buy back' ügyletek:

2016.12.31

Értékpapír adatai		Devi- za	Eladás dátuma	Eladási érték	Vétel dátuma	Vételi érték	Ügylet ráfordítása
Megnevezése	Névértéke						
2022/A	677.780	eFt	2016.11.16	856.218	2017.02.15	857.733	-1.515
2024/B	4.250.000	eFt	2016.11.16	4.264.590	2017.02.15	4.272.138	-7.548
2023/A	834.390	eFt	2016.11.28	1.012.622	2017.01.04	1.012.971	-349
MOLHB 2.625 04/28/23	2.318.000	EUR	2016.12.07	2.400.608	2017.03.08	2.398.991	1.617
MAEXIM 5.5 02/12/18	2.994.000	USD	2016.12.07	3.182.111	2017.01.11	3.185.436	-3.325
MAGYAR 6.25 10/21/20	4.000.000	USD	2016.12.07	4.468.824	2017.01.11	4.473.496	-4.671
MAGYAR 6.25 10/21/20	4.770.000	USD	2016.12.07	5.329.073	2017.01.11	5.334.643	-5.570
POLAND 1 10/25/28	12.000.000	EUR	2016.12.07	11.399.137	2017.03.08	11.391.459	7.678
2028/A	250.000	eFt	2016.12.07	329.257	2017.03.08	329.634	-377
FJ20NF01	500.000	eFt	2016.12.07	625.054	2017.03.08	625.771	-717
BNP 2.5 04/09/2018	1.000.000	eFt	2016.12.07	1.038.945	2017.03.08	1.040.137	-1.192
2031/A	2.300.000	eFt	2016.12.07	2.170.041	2017.03.08	2.172.529	-2.488
2025/B	2.836.880	eFt	2016.12.07	3.387.672	2017.03.08	3.391.558	-3.886
2027/A	3.700.350	eFt	2016.12.07	3.575.648	2017.03.08	3.579.748	-4.100
SLOREP 1.5 03/25/35	10.310.000	EUR	2016.12.28	10.000.233	2017.01.11	9.999.649	583
POLAND 2 10/25/46	10.700.000	EUR	2016.12.28	10.009.549	2017.01.11	10.008.965	584
SPGB 1.3 10/31/2026	11.056.000	EUR	2016.12.28	10.998.683	2017.01.11	10.998.041	642

Nyitott 'buy & sell back' ügyletek:

2016.12.31

Értékpapír adatai		Devi- za	Vétel dátuma	Vételi érték	Eladás dátuma	Eladási érték	Ügylet ráfordítása
Megnevezése	Névértéke						
2022/A	677.780	eFt	2016.12.27	882.297	2017.02.15	882.297	0
2023/A	834.390	eFt	2016.12.29	1.035.798	2017.01.04	1.035.798	0
MAGYAR 6.25 10/21/20	919.000	USD	2016.12.30	1.029.426	2017.01.04	1.029.426	0
2024/B	866.440	eFt	2016.12.30	899.997	2017.01.04	899.997	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 tárgyidőszakban, illetve a fordulónapon az Alap nem kötött egyéb értékpapír finanszírozási, illetve teljes hozamcsereügyletet.

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

XV. A mérleghez és eredménykimutatáshoz kapcsolódó kiegészítő megjegyzések

Saját tőke mozgástábla

adatok eFt-ban

Megnevezés	Nyitó egyenleg	Növekedés	Csökkenés	Záró egyenleg
Induló tőke változása:	27.293.673	15.528.118	-11.570.172	31.251.619
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözete:	63.841.566	43.706.895	-32.102.230	75.446.231
Értékelési különbözet:	6.009.741	7.707.621	-6.009.741	7.707.621
Eredménytartalék:	3.006.433	8.837.914	0	11.844.347
Tőkenövekmény összesen:	72.857.740	60.252.430	-38.111.971	94.998.199
Saját tőke összesen:	100.151.413	75.780.548	-49.682.143	126.249.818

Likviditási jelentés

I. Hitelállomány összetétele

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

II. Költségek összetétele

adatok Ft-ban

Költségelem megnevezése	2015. évi költség	2015. évben pénzügyileg realizált	2016. évi költség	2016. évben pénzügyileg realizált
Alapkezelési díj	1.979.651.334	1.811.748.043	4.321.583.635	1.933.256.351
Letétkezelési díj	39.576.114	29.804.102	42.678.876	31.028.506
Bizományosi díj	11.179.568	11.179.568	13.013.612	13.013.612
Tanácsadó testület díja				
Bankköltség	746.361	746.361	533.401	533.401
Felügyeleti díj	24.691.000	18.632.000	26.751.000	16.487.333
Könyvvizsgálat díja	1.827.530	0	1.276.371	0
Tőkevisszafiz. garancia díja				
Tőzsdei díjak				
Tőke- és hozamfiz. jutalék				
Alapítási költségek				
jegyzési jutalék, szerv.díj				
reklám, hirdetés				
felügyeleti díj				
bef. jegy nyomtatása				
Egyéb	31.822	31.822	0	0
Összesen:	2.057.703.729	1.872.141.896	4.405.836.895	1.994.319.203

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Cash flow kimutatás		adatok ezer Ft-ban	
		2015.01.01- 2015.12.31.	2016.01.01- 2016.12.31.
I. Működési cash flow		-21.199.225	13.410.118
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)		-10.997.737	-2.863.784
3. Elszámolt értékvesztés és visszairás		0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet		-2.756.603	1.697.880
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete		0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye		-7.662.255	-17.842.281
8. Befektetett eszközök állományváltozása		0	0
9.1. Követelések változása		0	-3.120.423
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása		1.458.873	-1.587.724
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása		-1.209.316	37.238.383
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása		0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása		5.152	-1.777
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása		-1.335.069	0
Származtatott ügyletek állományváltozása		1.297.730	-110.156
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás		-19.096.197	-31.740.695
17. Értékpapírok beszerzése -		-127.469.013	-716.346.845
18. Értékpapírok eladása, beváltása +		103.792.379	672.904.452
19. Kapott hozamok +		4.580.437	11.701.698
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás		-6.648.503	15.562.611
20. Befektetési jegy kibocsátás +		51.528.990	59.235.013
22. Befektetési jegy visszavásárlása -		-58.177.493	-43.672.402
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -		0	0
IV. Pénzeszközök változása		-46.943.925	-2.767.966
Pénzeszközök nyitó értéke		51.323.818	4.379.893
Pénzeszközök záró értéke		4.379.893	1.611.927

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 "Származtatott ügyletek állományváltozása" megnevezéssel sorszámozás nélkül.

Portfólió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve:	OTP Supra Származtatott Befektetési Alap
Alap lajstromszáma:	1111-276
Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Nettó Eszközérték számítás típusa:	T

Ft

Tárgnap (T):	2016.12.31
Saját tőke:	126.249.818.646
Egy jegyre jutó NEE:	4,039785
Darabszám:	31.251.618.808

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

adatok eFt-ban

I. KÖTELEZETTSÉGEK

	Futamidő	Összeg	%
I/1. Hitelállomány:		0	0,00
I/2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:		37.636.593	100,00
Alapkezelői díj		2.388.327	6,35
Letétkezelői díj		11.650	0,03
Bizományosi díj		0	0,00
Forgalmi ktg.		0	0,00
Közzétételi ktg.		0	0,00
Reklám ktg.		0	0,00
Költségként elszámolt egyéb tétel		11.540	0,03
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		35.225.076	93,59
I/3. Céltartalékok:		0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		0	0,00

Kötelezettségek összesen:	37.636.593	100,00
----------------------------------	-------------------	---------------

II. ESZKÖZÖK

			Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):			1.611.927	0,98
II/2. Egyéb követelés:			3.120.423	1,90
II/3. Lекötött bankbetétek (összes):	Bank	Futamidő	0	0,00
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:			0	0,00
II/4. Értékpapírok (összes):	Devizanem	Névérték devizában	158.390.730	96,66
II/4.1. Állampapírok (összes):			76.716.712	46,82
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):			18.239.172	11,11
2023/A államkötvény	HUF	1.697.000	2.106.497	1,28
2024/B államkötvény	HUF	4.250.000	4.415.335	2,69
2025/B államkötvény	HUF	2.836.880	3.476.800	2,12
2027/A államkötvény	HUF	4.000.000	3.967.195	2,42
2028/A államkötvény	HUF	250.000	336.138	0,20
2031/A államkötvény	HUF	2.300.000	2.205.599	1,34
BMÁK 2020/P államkötvény	HUF	100.000	108.419	0,07
REPHUN 4.125 02/18 államkötvény	USD	1.000.000	305.357	0,19
REPHUN 5.375 02/23 államkötvény	USD	1.000.000	324.229	0,20
REPHUN 6 01/11/19 államkötvény	EUR	685.000	251.615	0,15
REPHUN 6.25 01/29/20 államkötvény	USD	1.000.000	329.773	0,20
SOAF 5 10/12/46 államkötvény	HUF	1.500	412.215	0,25
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes):			58.477.540	35,71
ABU DHABI 3.125 05/03/26 államkötvény	USD	4.000.000	1.162.415	0,71
ARGENT 6.25 04/22/19 PHASE 1 államkötvény	USD	1.330.000	422.489	0,26
ARGENT 6.875 04/22/21 PHASE 1 államkötvény	USD	1.330.000	422.112	0,26
ARGENT 7.5 04/22/26 PHASE 1 államkötvény	USD	670.000	209.700	0,13
ARGENT 7.625 04/22/46 PHASE 1 államkötvény	USD	670.000	199.888	0,12

Portfólió jelentés értékpapíralapra

BTPS 2.8 03/01/67 államkötvény	EUR	15.000.000	4.200.537	2,56
INDON 2.625 06/14/23 államkötvény	EUR	1.500.000	476.852	0,29
INDON 3.75 06/14/28 államkötvény	EUR	200.000	64.819	0,04
KSA 2.375 10/26/21 államkötvény	USD	3.000.000	861.157	0,53
KSA 3.25 10/26/26 államkötvény	USD	2.000.000	562.519	0,34
KSA 4.5 10/26/46 államkötvény	USD	4.000.000	1.139.024	0,70
MEX 1.375 01/15/25 államkötvény	EUR	6.330.000	1.878.668	1,15
MEX 3.375 02/23/31 államkötvény	EUR	2.000.000	653.386	0,40
OMANIB 3.625 06/15/21 államkötvény	USD	10.000.000	2.945.207	1,80
OMANIB 4.75 06/15/26 államkötvény	USD	7.000.000	1.996.668	1,22
POLAND 1 10/25/28 államkötvény	EUR	12.000.000	3.578.259	2,18
POLAND 2 10/25/46 államkötvény	EUR	12.000.000	3.505.902	2,14
POLGB 2.5 07/25/26 államkötvény	PLN	150.000.000	9.718.565	5,93
RAGB 1.5 11/02/86 államkötvény	EUR	6.000.000	1.729.792	1,06
ROMANI 2.75 10/29/25 államkötvény	EUR	5.000.000	1.634.569	1,00
ROMANI 2.875 05/26/28 államkötvény	EUR	4.000.000	1.307.663	0,80
ROMANI 2.875 10/28/24 államkötvény	EUR	4.000.000	1.331.602	0,81
ROMANI 3.875 10/29/35 államkötvény	EUR	3.500.000	1.161.966	0,71
SERBIA 5.25 21/11/17 államkötvény	USD	4.000.000	1.211.444	0,74
SLOREP 1.5 03/25/35 államkötvény	EUR	15.000.000	4.539.052	2,77
SLOREP 1.75 11/03/40 államkötvény	EUR	5.000.000	1.524.789	0,93
SLOREP 2.125 07/28/25 államkötvény	EUR	4.000.000	1.393.705	0,85
SPGB 1.3 10/31/2026 államkötvény	EUR	18.044.000	5.583.189	3,41
TURKEY 4.875 10/09/26 államkötvény	USD	6.000.000	1.651.934	1,01
UKT 4.25 12/07/27 államkötvény	GBP	3.000.000	1.409.668	0,86
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:			42.753.462	26,09
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			42.753.462	26,09
ALVGR 3.875 12/29/49 kötvény	USD	1.200.000	301.705	0,18
AXASA 3.375 07/06/2047 kötvény	EUR	5.000.000	1.608.458	0,98
BNP 2.5 04/09/2018 kötvény	HUF	1.000.000	1.040.608	0,63
BPCEGP 2.875 04/22/26 kötvény	EUR	2.000.000	652.878	0,40
BSTDBK 4.875 05/06/21 (INTL) kötvény	USD	4.000.000	1.236.705	0,75
CEMEX 4.625 06/15/24 kötvény	EUR	350.000	112.611	0,07
CESDRA 1.875 05/25/23 kötvény	EUR	2.000.000	652.011	0,40
CEZCP 0 08/04/17 kötvény	HUF	2.000	696.275	0,42
DELL 5.45 06/15/23 kötvény	USD	1.500.000	468.635	0,29
DELL 5.875 06/15/21 kötvény	USD	250.000	77.888	0,05
DELL 6.02 06/15/26 kötvény	USD	1.500.000	477.744	0,29
DELL 7.125 06/15/24 kötvény	USD	250.000	81.327	0,05
DELL 8.1 07/15/36 kötvény	USD	1.500.000	546.762	0,33
DELL 8.35 07/15/46 kötvény	USD	1.000.000	376.933	0,23
FCAIM 3.75 03/29/24 kötvény	EUR	3.300.000	1.097.071	0,67
GLENLN 1.25 03/17/21 kötvény	EUR	500.000	157.916	0,10
GLENLN 1.75 03/17/25 kötvény	EUR	500.000	150.953	0,09
KBCBB 1 04/26/21 kötvény	EUR	1.000.000	321.473	0,20
MAEXIM 4 01/30/20 kötvény	USD	4.000.000	1.228.777	0,75
MAEXIM 5.5 02/12/18 kötvény	USD	4.500.000	1.403.131	0,86
MAGYAR 2.375% 12/08/21 kötvény	EUR	21.000.000	6.958.390	4,25
MAGYAR 6.25 10/21/20 kötvény	USD	8.770.000	2.876.521	1,76
MOLHB 2.625 04/28/23 kötvény	EUR	6.000.000	1.938.797	1,18
MOLHB 6.25 09/19 kötvény	USD	7.000.000	2.268.956	1,38
NLMKRU 4.5 06/15/23 kötvény	USD	2.500.000	734.281	0,45

Portfólió jelentés értékpapíralapra

OTPHB VAR 49-16 kötvény	EUR	2.700.000	784.447	0,48
PETBRA 8.375 05/23/21 kötvény	USD	500.000	159.713	0,10
PETBRA 8.75 05/23/26 kötvény	USD	1.500.000	479.892	0,29
PETROBRAS 6.85 06/05/15 kötvény	HUF	4.500	1.084.545	0,66
TOTAL 3.369 12/29/49 kötvény	EUR	1.500.000	453.826	0,28
UNICREDIT-PEKAO ELC kötvény	EUR	41.895.570	11.862.953	7,24
ZURNVX 5.625 06/24/46 kötvény	USD	1.500.000	461.280	0,28
II/4.3. Részvények (összes):			36.898.555	22,54
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			20.963.733	12,79
MASTERPLAST részvény	HUF	20.000	100.200	0,06
MOL TÖRZS részvény	HUF	900.000	18.571.500	11,33
OTP TÖRZS (100) részvény	HUF	27.286	2.292.033	1,40
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):			15.934.822	9,75
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR részvény	USD	0	25.789	0,02
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE részvény	RON	200.000	162.827	0,10
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85 részvény	RON	2.759.079	176.846	0,11
GILEAD SCIENCES INC részvény	USD	2	42.063	0,03
MICRON TECHNOLOGY INC részvény	USD	48.869	3.146.019	1,92
MONETA MONEY BANK AS részvény	CZK	1.641.300	1.564.205	0,95
MONSANTO CO részvény	USD	20	61.798	0,04
OMV PETROM SA részvény	RON	24.537.037	4.388.776	2,68
PEKAO részvény	PLN	250.000	2.210.620	1,35
PKO BANK részvény	PLN	282.600	558.972	0,34
ROMGAZ - GDR részvény	USD	107.400	178.845	0,11
SBERBANK részvény	RUB	583.200	160.989	0,10
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE részvény	RON	684.000	1.171.863	0,72
UNICREDIT SPA részvény	EUR	1.209.016	1.028.061	0,63
VESTAS részvény	DKK	50.000	959.999	0,59
WIZZ AIR HOLDINGS PLC részvény	GBP	2	97.150	0,06
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes):			630.233	0,38
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			630.233	0,38
FJ18NF01 jelzáloglevél	EUR	200	70	0,00
FJ20NF01 jelzáloglevél	HUF	500.000	630.163	0,38
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):			1.391.768	0,83
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			1.391.768	0,83
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT bef.jegy	HUF	50.000	48.920	0,03
ETFS CORN bef.jegy	USD	420.000	118.601	0,07
ETFS PHYSICAL GOLD bef.jegy	USD	5.000	163.864	0,10
ETFS PHYSICAL SILVER bef.jegy	USD	30.000	136.213	0,08
ETFS WHEAT bef.jegy	USD	400.000	80.647	0,05
GLOBAL X SILVER MINERS ETF bef.jegy	USD	9.000	84.873	0,05
LYXOR UCITS ETF SGI DAILY DOUBLE bef.jegy	EUR	15.000	173.036	0,10
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. bef.jegy	EUR	2.326	254.243	0,15
PROSHARES SHORT S&P 500 bef.jegy	USD	22.500	241.458	0,15
PROSHARES ULTRASHORT 20 bef.jegy	USD	7.500	89.913	0,05
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):			1.985	0,00
II/6. Származtatott ügyletek értékelési különbözete			761.346	0,46
Eszközök összesen:			163.886.411	100,00

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

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.

Kelt:

BUDAPEST, 2017. március 31.



 az Alapkezelő vezetője