

**OTP Supra Származtatott
Befektetési Alap**

*Éves jelentés
és
független könyvvizsgálói jelentés*

2020. december 31.

FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

Az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük az OTP Supra Származtatott Befektetési 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 közze tegye 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 Könyvvizsgálati 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 eredő, 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 hívnunk a figyelmet az éves jelentésben közölt számviteli információkban lévő kapcsolódó közzétételekre, vagy ha a közzétételek e tekintetben nem megfelelőek, minősítenünk kell véleményünket. Következtetéseink a független könyvvizsgálói jelentésünk dátumáig megszerzett könyvvizsgálati bizonyítékon alapulnak. Jövőbeli események vagy feltételek azonban okozhatják azt, hogy az Alap nem tudja a vállalkozást folytatni.
- Megvizsgáljuk az éves jelentésben közölt számviteli információkat, különös tekintettel az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárára, valamint az adott időszakban elszámolt kezelési költségekre. Megvizsgáljuk, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek-e összeállításra.

Az irányítással megbízott személyek tudomására hozzuk - egyéb kérdések mellett - a 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.



.....
Pádár Péter

A Deloitte Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft. képviselőjeként
illetve mint kamarai tag könyvvizsgáló

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

Kamarai tag könyvvizsgálói tagszám: 007251



OTP Supra Származtatott Befektetési 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 Supra Származtatott Befektetési 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	317.957.572	260.597.088
09.	I. Követelések	19.816.850	1.475.905
10.	1. Követelések	19.816.850	1.475.905
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	0	0
14.	II. Értékpapírok	295.978.722	251.567.709
15.	1. Értékpapírok	259.701.460	223.983.870
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	36.277.262	27.583.839
17.	a) kamatokból, osztalékból	1.811.698	2.087.107
18.	b) egyéb piaci megítélésből	34.465.564	25.496.732
19.	III. Pénzeszközök	2.162.000	7.553.474
20.	1. Pénzeszközök	2.162.000	7.553.474
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	674	14.400
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	674	14.400
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származékos ügyletek értékelési különbözete	684.581	-237.577
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVAK) ÖSSZESEN:	318.642.827	260.373.911
27.	E. Saját tőke	280.376.766	217.832.038
28.	I. Induló tőke	53.565.334	57.987.106
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	167.988.515	185.977.827
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-114.423.181	-127.990.721
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	226.811.432	159.844.932
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönözete	-336.829.258	-375.593.721
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönözete	489.522.824	545.591.646
34.	2. Értékelési különbözethozamok tartaléka	36.961.843	27.346.262
35.	3. Előző év(ek) eredménye	18.114.917	37.156.023
36.	4. Üzleti év eredménye	19.041.106	-74.655.278
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	26.410.609	42.541.873
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	26.410.609	42.541.873
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	11.855.452	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVAK) ÖSSZESEN:	318.642.827	260.373.911

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	216.181.828	232.915.607
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	180.783.697	303.360.824
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	16.244.313	4.107.628
05.	V. Egyéb ráfordítások	112.712	102.433
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	19.041.106	-74.655.278

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

Kelt: BUDAPEST, 2021. március 12.

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.
Köves Benedek Balázs
vezérigazgató

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: 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 Pádár Péter, kamarai tagsági száma: 007251.

Az Alap 2020. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFÁ-val növelt bruttó könyvvizsgálati díja 2.132 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 értékkülönbözeteként kerülnek elszámolásra.

Származékos ügyletek értékelése és elszámolása

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

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

Külföldi pénzürtékre szóló követelések és kötelezettségek

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

Immateriális javak és tárgyi eszközök

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

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

A mérleg egyes tételeinek magyarázata:

Eszközök:

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

Források:

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

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye -70.445.217 eFt, amely 232.915.607 eFt bevétel és 303.360.824 eFt ráfordítás különbözete. 4.107.628 eFt működési költség és 102.433 eFt egyéb ráfordítás után a veszteség 74.655.278 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 Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyontkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajtája		Időszak nyitó állománya 2020.01.01		Időszak záró állománya 2020.12.31		Megoszlás (%)
Készpénzállomány - banki egyenlegek						
Bank	Lekötési idő					
OTP Bank Nyrt. HUF	folyószámla	1		3.608.022	1,39%	
OTP Bank Nyrt. EUR	folyószámla	176.833		3.748.990	1,44%	
OTP Bank Nyrt. USD	folyószámla	288.552		170.796	0,07%	
OTP Bank Nyrt. GBP	folyószámla	248		46	0,00%	
OTP Bank Nyrt. PLN	folyószámla	52		2.144	0,00%	
OTP Bank Nyrt. TRY	folyószámla	101		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. AUD	folyószámla	52		58	0,00%	
OTP Bank Nyrt. NOK	folyószámla	14		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. CZK	folyószámla	5		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. JPY	folyószámla	129		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. DKK	folyószámla	9		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. RON	folyószámla	6		21	0,00%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.31 - 2020.01.02	123.496		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. HUF	2019.12.31 - 2020.01.02	1.572.502		0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. RON	2020.12.21 - 2021.02.17	0		23.397	0,01%	
Banki egyenlegek összesen:		2.162.000		7.553.474	2,91%	
Átruházható értékpapírok						
Értékpapír neve	Futamidő	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	
Államkötvények:		138.078.081		112.208.197		43,09%
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	3.003.418		0		0,00%
2022/B	2017.01.11 - 2022.10.26	333.907		0		0,00%
2022/C	2019.03.06 - 2022.08.24	2.075.019		0		0,00%
2024/B	2015.03.18 - 2024.06.26	778.986		0		0,00%
2024/C	2015.03.18 - 2024.10.24	2.449.846		0		0,00%
2028/A	2011.03.02 - 2028.10.22	1.419.104		0		0,00%
2031/A	2015.04.22 - 2031.10.22	1.867.486		0		0,00%
2031/A	2015.04.22 - 2031.10.22	0		4.475.500		1,72%
2038/A	2018.02.07 - 2038.10.27	0		104.882		0,04%
BMÁK 2020/P	2014.07.01 - 2020.07.22	104.419		0		0,00%
REPHUN 1.125 04/28/2026	2020.04.28 - 2026.04.28	0		775.152		0,30%
REPHUN 1.25 10/22/25	2018.10.02 - 2025.10.22	4.231.508		4.642.314		1,78%
REPHUN 1.5 11/17/2050	2020.11.17 - 2050.11.17	0		1.300.931		0,50%
REPHUN 1.75 06/05/2035	2020.06.05 - 2035.06.05	0		817.540		0,31%
REPHUN 5.375 02/23	2013.02.19 - 2023.02.21	0		3.592.517		1,38%
ABU DHABI 3.125 05/03/26	2016.05.03 - 2026.05.03	1.235.327		0		0,00%
ARGENT 0.125 07/09/2046	2020.09.04 - 2049.07.09	0		284.193		0,11%
ARGENT 1 07/09/2029	2020.09.04 - 2029.07.09	0		12.462		0,00%
ARGENT 6.875 04/22/21	2016.10.22 - 2021.04.22	216.642		0		0,00%
ARGENT 7.5 04/22/26	2016.10.22 - 2026.04.22	105.705		0		0,00%
ARGENT 7.625 04/22/46	2016.10.22 - 2046.04.22	102.818		0		0,00%
BHRAIN 6.75 09/20/29	2017.09.20 - 2029.09.20	1.051.053		1.044.731		0,40%
BHRAIN 7.5 09/20/47	2017.09.20 - 2047.09.20	1.096.746		0		0,00%
BRAZIL 4.75 01/14/2050	2019.11.14 - 2050.01.14	0		487.283		0,19%
BREPW 1.058 09/05/22	2018.09.05 - 2022.09.05	2.517.547		0		0,00%
BTPS 2.8 03/01/67	2016.09.01 - 2067.03.01	3.130.818		0		0,00%
BTPS 3.45 01/03/48	2017.03.01 - 2048.03.01	10.568.753		0		0,00%
BTPS 3.85 09/01/49	2018.09.01 - 2049.09.01	10.803.198		0		0,00%
CHINA 0.125 11/12/2026	2019.11.12 - 2026.11.12	1.977.253		2.210.894		0,85%
CHINA 0.5 11/12/2031	2019.11.12 - 2031.11.12	1.623.126		1.843.185		0,71%
CHINA 1 11/12/2039	2019.11.12 - 2031.11.12	1.623.366		0		0,00%
EGYPT 5.75 05/29/2024	2020.05.29 - 2024.05.29	0		512.928		0,20%
EGYPT 8.875 05/29/2050	2020.05.29 - 2050.05.29	0		527.118		0,20%
ESTONIA 0.125 06/10/2030	2020.06.10 - 2030.06.10	0		2.262.883		0,87%
GGB 1.875 02/04/2035	2020.02.04 - 2035.02.04	0		6.375.728		2,45%
IVYCST 6.125 06/15/2033	2017.06.15 - 2033.06.15	597.929		673.796		0,26%
KSA 2.375 10/26/21	2016.10.26 - 2021.10.26	892.239		0		0,00%
KSA 3.25 10/26/26	2016.10.26 - 2026.10.26	614.513		0		0,00%
KSA 4.5 10/26/46	2016.10.26 - 2046.10.26	1.313.645		0		0,00%
KUWIB 2.75 20/03/22	2017.03.20 - 2022.03.20	159.966		0		0,00%
KUWIB 3.5 20/03/27	2017.03.20 - 2027.03.20	265.628		0		0,00%
LITHUN 0.5 07/28/2050	2020.07.28 - 2050.07.28	0		5.570.117		2,14%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01	Időszak záró állománya 2020.12.31	Megosztás (%)
MACEDO 3.675 06/03/2026 2020.06.03 - 2026.06.03	0	1.253.284	0,48%
MEX 1.375 01/15/25 2016.11.01 - 2025.01.15	2.211.201	2.427.970	0,93%
MEX 3.375 02/23/31 2016.02.23 - 2031.02.23	824.839	882.871	0,34%
MEX 4.75 04/27/2032 2020.04.27 - 2032.04.27	0	812.653	0,31%
MEX 5 04/27/2051 2020.04.27 - 2051.04.27	0	1.122.148	0,43%
MOROC 1.375 03/30/2026 2020.09.30 - 2026.03.30	0	4.070.103	1,56%
MOROC 2 09/30/2030 2020.09.30 - 2030.09.30	0	3.356.809	1,29%
OMANIB 3.625 06/15/21 2016.06.15 - 2021.06.15	2.970.679	2.985.875	1,15%
PERU 1.862 12/01/2032 2020.12.01 - 2032.12.01	0	195.793	0,08%
PERU 2.78 12/01/2060 2020.12.01 - 2060.12.01	0	195.497	0,07%
PERU 3.23 07/28/2121 2020.12.01 - 2121.07.28	0	193.904	0,07%
POLAND 1.375 10/22/27 2017.03.23 - 2027.10.22	5.830.926	2.021.624	0,78%
POLAND 2 10/25/46 2016.10.25 - 2046.10.25	4.875.524	5.819.702	2,23%
ROMANI 2.375 04/19/27 2017.04.19 - 2027.04.19	7.534.552	6.287.113	2,41%
ROMANI 2.75 02/26/2026 2020.05.26 - 2026.02.26	0	3.607.703	1,39%
ROMANI 2.75 10/29/25 2015.10.29 - 2025.10.29	1.862.517	1.118.547	0,43%
ROMANI 2.875 05/26/28 2016.05.26 - 2028.05.26	1.515.671	1.666.977	0,64%
ROMANI 3.624 05/26/2030 2020.05.26 - 2030.05.26	1.488.014	4.224.619	1,62%
ROMANI 3.875 10/29/35 2015.10.29 - 2035.10.29	7.165.079	8.327.409	3,20%
ROMANI 4.625 04/03/49 2019.04.03 - 2049.04.03	5.253.296	6.321.552	2,43%
SLOREP 1.1875 03/14/2029 2019.01.14 - 2029.03.14	2.167.595	0	0,00%
SLOREP 1.25 03/22/27 2017.01.24 - 2027.03.22	2.357.182	0	0,00%
SLOREP 1.5 03/25/35 2015.03.25 - 2035.03.25	3.003.763	0	0,00%
SLOREP 2.125 07/28/25 2015.07.28 - 2025.07.28	703.570	0	0,00%
SLOVGB 2.25 06/12/68 2018.06.12 - 2068.06.12	2.917.296	3.918.854	1,51%
SOAF 4.85 09/27/27 2017.09.27 - 2027.09.27	1.898.395	1.999.286	0,77%
SOAF 5 10/12/46 2016.10.12 - 2046.10.12	411.749	424.601	0,16%
SOAF 5.65 09/27/47 2017.09.27 - 2047.09.27	1.459.686	1.507.586	0,58%
TURKEY 4.625 03/31/2025 2019.01.31 - 2025.03.31	4.069.632	4.504.281	1,73%
TURKEY 4.875 10/09/26 2016.03.09 - 2026.10.09	1.712.343	1.829.280	0,70%
TURKEY 5.6 11/14/2024 2019.11.14 - 2024.11.14	968.317	1.006.385	0,39%
TURKEY 5.75 05/11/2047 2017.05.11 - 2047.05.11	1.582.284	1.719.580	0,66%
US TREASURY B 0 02/04/2021 2020.08.06 - 2021.02.04	0	892.037	0,34%
US TREASURY BILL 0% 05/14 2019.11.14 - 2020.05.14	13.482.278	0	0,00%
US TREASURY N/B 0 01/23/20 2019.07.25 - 2020.01.23	3.651.728	0	0,00%
Vállalati kötvények:	54.462.757	63.952.786	24,56%
ADNOUH 4.6 11/02/47 2017.11.02 - 2047.11.02	921.738	0	0,00%
ALVGR 3.875 12/29/49 2016.09.07 - 2049.12.29	350.015	365.719	0,14%
ASSGEN 3.875 01/31/29 2019.01.29 - 2029.01.29	1.207.539	1.346.325	0,52%
AXASA 3.375 07/06/2047 2016.03.30 - 2047.07.06	1.923.596	2.149.377	0,83%
BLACK SEA TRADE AND DE' 2020.10.19 - 2023.10.19	0	302.013	0,12%
BNP 6.625 PERP 2019.03.25 - 2167.09.25	649.322	661.435	0,25%
BPCEGP 2.875 04/22/26 2016.04.22 - 2026.04.22	763.842	0	0,00%
BSTDBK 4.875 05/06/21 (INTL 2016.05.06 - 2021.05.06	1.518.853	1.515.300	0,58%
CEPSA FINANCE SA 2.25% 02 2020.07.13 - 2026.02.13	0	1.365.595	0,52%
CESDRA 1.875 05/25/23 2016.05.25 - 2023.05.25	698.014	0	0,00%
CEZCP 0.875 11/21/22 2018.11.21 - 2022.11.21	1.686.301	0	0,00%
CRBKMO 7.5% 05/10/27 2017.04.05 - 2027.10.05	289.333	304.527	0,12%
DEUTSCHE BANK AG 5.625 0 2020.05.19 - 2031.05.19	0	3.182.927	1,22%
DNONO 8.375 05/29/24 2019.05.29 - 2024.05.29	744.441	712.417	0,27%
DNONO 8.75% 06/18/2020 2015.06.18 - 2020.06.18	519.050	0	0,00%
EIB 1.125 04/13/33 2017.05.16 - 2033.04.13	1.296.050	0	0,00%
ENERGO PRO AS 4.5% 05/04/2 2018.05.04 - 2024.05.04	1.037.515	1.100.928	0,42%
ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 2020.10.13 - 2169.01.13	0	669.409	0,26%
ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 2020.10.13 - 2169.10.13	0	691.871	0,27%
FCAIM 3.75 03/29/24 2016.03.30 - 2024.03.29	1.265.669	1.359.644	0,52%
GAZPRU 2.949 01/24/2024 2018.11.16 - 2024.01.24	2.212.769	2.373.124	0,91%
GAZPRU 4.25 06/04/24 2017.04.06 - 2024.04.06	5.108.195	5.272.899	2,03%
GLENLN 1.25 03/17/21 2015.03.17 - 2021.03.17	168.766	0	0,00%
GLENLN 1.75 03/17/25 2015.03.17 - 2025.03.17	174.104	195.323	0,08%
INTL INVST BANK 1.25 10/18/ 2019.10.18 - 2022.10.18	2.001.357	1.984.237	0,76%
ISPIM 7.75 07/29/49 2017.01.11 - 2027.01.11	827.063	902.934	0,35%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01	Időszak záró állománya 2020.12.31	Megosztás (%)
ISTANBUL 6.375 12/09/2025 2020.12.09 - 2025.12.09	0	917.065	0,35%
KAZMUNAYGAS NATIONAL 2018.04.24 - 2025.04.24	1.630.693	0	0,00%
KAZMUNAYGAS NATIONAL 2018.04.24 - 2030.04.24	1.035.759	1.111.202	0,43%
KAZMUNAYGAS NATIONAL 2018.04.24 - 2048.10.24	1.916.593	0	0,00%
KBCBB 1 04/26/21 2016.04.26 - 2021.04.26	337.901	0	0,00%
LGEN 5.25 03/21/2047 2017.03.21 - 2027.03.21	486.441	503.272	0,19%
MAGYAR 2.375% 12/08/21 2015.12.08 - 2021.12.08	5.340.801	0	0,00%
MOLHB 1.5 10/08/2027 2020.10.08 - 2027.10.08	0	265.071	0,10%
MOLHB 2.625 04/28/23 2016.04.28 - 2023.04.28	2.387.079	2.205.759	0,85%
NLMKRU 4.5 06/15/23 2016.06.15 - 2023.06.15	782.015	798.773	0,31%
OTPHB 2.875% 07/15/2029 2019.07.15 - 2029.07.15	5.563.133	8.351.897	3,21%
OTPHB VAR 49-16 2006.11.07 - 2049.11.07	830.656	878.341	0,34%
PEMEX 5.95 01/28/2031 2020.01.28 - 2031.01.28	0	1.092.695	0,42%
PEMEX 6.875 10/16/2025 2020.10.16 - 2025.10.16	0	661.265	0,25%
PEMEX 6.95 01/28/2060 2020.01.28 - 2060.01.28	0	895.380	0,34%
PETBRA 5.093 01/15/30 2019.09.18 - 2030.01.15	301.418	317.177	0,12%
PETBRA 5.6 01/03/2031 2020.06.03 - 2031.01.03	0	520.628	0,20%
PETROBRAS 6.85 06/05/15 2015.06.05 - 2115.06.05	1.526.271	1.674.894	0,64%
PEUGEOT 2 03/23/24 2017.03.23 - 2024.03.23	1.787.785	1.957.301	0,75%
PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 2020.06.04 - 2031.09.04	0	178.378	0,07%
PKOBHB 0.25 11/23/21 2019.01.28 - 2021.11.23	665.686	0	0,00%
SAUDI ARAMCO 1.625 11/24/2025 2020.11.24 - 2025.11.24	0	426.545	0,16%
SAUDI ARAMCO 2.25 11/24/2030 2020.11.24 - 2030.11.24	0	1.365.849	0,52%
SAUDI ARAMCO 3.25 11/24/2050 2020.11.24 - 2050.11.24	0	711.636	0,27%
SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/2070 2020.11.24 - 2070.11.24	0	409.186	0,16%
SID BANKA 0.125% 07/08/2025 2020.07.08 - 2025.07.08	0	738.487	0,28%
SYNGENTA FINANCE NV 3.9 2018.04.24 - 2021.04.23	151.054	153.822	0,06%
SYNGENTA FINANCE NV 4.8 2018.04.24 - 2025.04.24	318.876	331.595	0,13%
SYNGENTA FINANCE NV 5.1 2018.04.24 - 2028.04.24	241.297	247.075	0,09%
SYNGENTA FINANCE NV 5.6 2018.04.24 - 2048.04.24	311.597	330.631	0,13%
TOTAL 3.369 12/29/49 2016.10.06 - 2026.10.06	571.152	621.541	0,24%
UNICREDIT SPA 2.2 07/22/2027 2020.07.22 - 2027.07.22	0	3.329.780	1,28%
UNIQA 1.375 07/09/2030 2020.07.09 - 2030.07.09	0	320.479	0,12%
UNIQA 3.25 10/09/2035 2020.07.09 - 2025.07.09	0	194.832	0,07%
VOLKSWAGEN GROUP 0.75 1 2020.11.24 - 2022.11.23	0	746.635	0,29%
VOLKSWAGEN GROUP 0.875 2020.11.24 - 2023.11.22	0	748.002	0,29%
VOLKSWAGEN GROUP 1.25 1 2020.11.24 - 2025.11.24	0	749.935	0,29%
VOLKSWAGEN GROUP 1.625 2020.11.24 - 2027.11.24	0	599.996	0,23%
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2 2019.07.11 - 2022.07.11	1.551.549	1.684.265	0,65%
WINGHOLDING ZRT 4 08/07/2 2018.08.07 - 2021.08.07	849.606	920.430	0,35%
ZURNVX 5.625 06/24/46 2016.03.24 - 2046.06.24	511.863	536.963	0,21%
Belföldi részvények:	25.544.448	19.255.113	7,39%
MASTERPLAST	151.600	396.000	0,15%
MOL RT	25.311.939	18.854.811	7,24%
OPUS	5.049	4.302	0,00%
WABERER'S INTERNATIONAL ZRT	75.860	0	0,00%
Külföldi részvények:	63.935.299	40.481.630	15,55%
ALBEMARLE CORP	86.111	0	0,00%
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	62.514	69.204	0,03%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE	218.846	222.870	0,09%
DIAMONDBACK ENERGY INC	13.939.862	4.319.149	1,66%
DIGI COMMUNICATIONS NV	6.391.143	7.207.964	2,77%
ERSTE BANK STAMM	3.555.067	2.918.583	1,12%
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85	177.040	177.989	0,07%
MONETA MONEY BANK AS	1.815.032	1.548.009	0,59%
OMV PETROM SA	8.413.835	8.340.659	3,20%
PEKAO	14.029.048	8.720.314	3,35%
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	178.459	0	0,00%
PKO BANK	755.602	0	0,00%
PKO BANK	0	643.539	0,25%
RALFP 4.371 01/23/23	51.259	30.350	0,01%
SBERBANK	234.740	208.699	0,08%
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE	2.028.254	1.667.653	0,64%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta		Időszak nyitó állománya 2020.01.01	Időszak záró állománya 2020.12.31	Megosztás (%)		
UNICREDIT SPA		10.133.873	0	0,00%		
VESTAS		1.638.030	3.885.786	1,49%		
WIZZ AIR HOLDINGS PLC		226.584	240.483	0,09%		
YAPI KREDI BANKASI		0	280.379	0,11%		
Jelzáloglevelek:		336.922	355.561	0,14%		
FJ20NF01	2013.04.10 - 2020.04.10	336.922	0	0,00%		
TJ30NF01	2020.07.31 - 2030.08.21	0	355.561	0,14%		
Befektetési jegyek:		13.621.215	15.314.422	5,87%		
ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY		6.402.265	7.523.277	2,89%		
ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP I		4.309.960	1.829.270	0,70%		
BNP EARTH FUND		0	1.702.388	0,65%		
FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP		2.313.270	2.500.444	0,96%		
FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A		429.676	512.709	0,20%		
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT		47.206	1.155.249	0,44%		
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.		118.838	91.085	0,03%		
Átruházható értékpapírok összesen:		295.978.722	0	251.567.709	0	96,60%
Egyéb eszközök						
Követelések		19.816.850		1.475.905		0,57%
Aktív időbeli elhatárolások		674		14.400		0,01%
Származékos ügyletek értékelési különbözete		684.581		-237.577		-0,09%
Egyéb eszközök összesen:		20.502.105		1.252.728		0,49%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:		318.642.827		260.373.911		100,00%
Kötelezettségek						
1. Hitelállomány:		0		0		0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:						
Alapkezelői díj		404.333		316.991		0,75%
Letétkezelői díj		25.842		21.583		0,05%
Költségként elszámolt egyéb tétel		18.031		20.913		0,05%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		25.962.403		42.182.386		99,15%
3. Céltartalékok:		0		0		0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		11.855.452		0		0,00%
Kötelezettségek összesen:		38.266.061		42.541.873		100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:		280.376.766		217.832.038		

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	53.565.333.661	57.987.106.181
---	----------------	----------------

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

	2019.12.31	2020.12.31
Jelen dokumentum alapján:	5,234295	3,756560
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	5,211712	3,756652 *

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

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

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

IV. Az Alap értékpapír portfóliójának összetétele

Megnevezés	2020.01.01	Megoszl.(%)	2020.12.31	Megoszl.(%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	295.978.722	92,89%	251.567.709	96,61%
b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
a fentiekből:				
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:	192.877.760	60,53%	176.516.544	67,79%

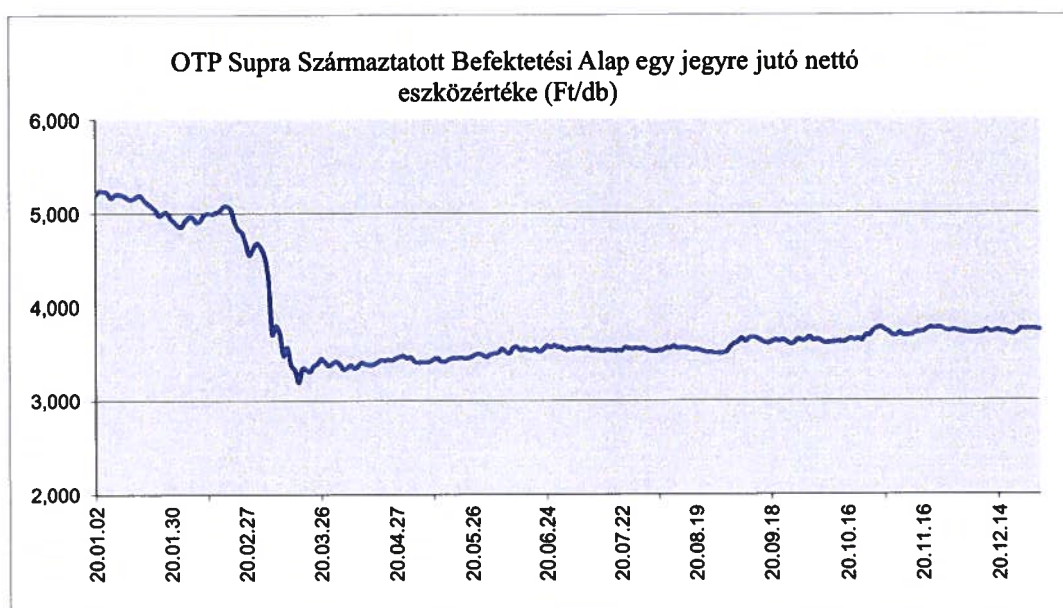
A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

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:	35.398.131	-70.445.217
b) egyéb bevétel:	0	0
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-15.978.491	-3.810.044
d) a letétkezelő díjai:	-93.754	-87.621
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	-106.424	-130.268
bankköltség:	-5.194	-2.130
felügyeleti díj:	-58.375	-75.432
egyéb költség és ráfordítás:	-114.787	-104.566
f) nettó jövedelem:	19.041.106	-74.655.278
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	19.041.106	-74.655.278
h) a tőkeszámla változása:	22.026.591	21.726.131
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése:	30.806.562	-9.615.581
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. Összehasonlítható 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.		31.251.618.808	126.249.818.646	4,039785
2017. december 31.	9,57%	48.635.421.477	215.274.108.629	4,426282
2018. december 31.	-4,49%	49.322.034.304	208.502.506.704	4,227370
2019. december 31.	23,82%	53.565.333.661	280.376.765.403	5,234295
2020. január 31.		55.291.343.390		4,914711
2020. február 28.		56.185.294.155		4,559967
2020. március 31.		53.998.409.697		3,419306
2020. április 30.		54.540.444.935		3,471867
2020. május 29.		55.106.978.734		3,487595
2020. június 30.		55.812.635.157		3,591082
2020. július 31.		55.893.935.495		3,551087
2020. augusztus 31.		55.824.077.412		3,505524
2020. szeptember 30.		55.544.221.218		3,617690
2020. október 30.		55.445.491.037		3,771233
2020. november 30.		55.534.172.714		3,750454
2020. december 31.	-28,23%	57.987.106.181	217.832.038.728	3,756560

Az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap 2020. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után -28,23 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

'A' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	2.574.019.826	848.010.097
2020. február	2.263.880.353	1.369.929.588
2020. március	1.351.497.582	3.538.382.040
2020. április	1.157.149.508	615.114.270
2020. május	881.416.127	314.882.328
2020. június	1.075.536.576	369.880.153
2020. július	608.661.424	527.361.086
2020. augusztus	479.841.426	549.699.509
2020. szeptember	439.830.865	719.687.059
2020. október	444.299.409	543.029.590
2020. november	597.097.943	508.416.266
2020. december	874.067.973	835.252.487
Összesen:	12.747.299.012	10.739.644.473

'I' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	944.713.068	53.516.137
2020. február	691.872.039	73.816.922
2020. március	962.511.687	372.667.494
2020. április	453.727.919	405.442.701
2020. május	293.221.367	218.340.292
2020. június	27.678.285	312.814.193
2020. július	469.311.114	417.488.417
2020. augusztus	196.296.022	58.065.816
2020. szeptember	420.391.948	122.863.257
2020. október	215.036.251	247.355.118
2020. november	263.737.369	281.660.454
2020. december	303.516.960	263.865.247
Összesen:	5.242.014.029	2.827.896.048

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.

A nettó eszközérték napi alakulását bemutató grafikon a 9. oldalon található.

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési 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 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 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	12	17
Nyereségrészesedés	12.275	253.772	266.047
Teljes javadalmazás *	246.528	540.676	787.204

*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 jellegűnek 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 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 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, 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 *	568.008.577.927	432.227.611.644	-23,9047%

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

XII. Egyéb információk

a) Az Alap illikviddé vált eszközeinek bemutatása

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

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

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

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

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

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési 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 távolabbi 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 hangulatból, így januárban és februárban is emelkedett, év eleje óta összesen 4,14%-kal. A cseh és a lengyel index nem tudtak az éve elejétől kiegyensúlyozott teljesítményt nyújtani, a cseh index forintban számítva 2,45%-kal nőtt, a lengyel index forintban számítva 3,15%-kal csökkent év eleje óta. A közép-európai CETOP20 index forintban számítva 0,53%-kal emelkedett az év eleji értékéhez képest.

Az idei január még úgy zajlott a globális feltörekvő 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 eszközosztályt 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 sínylettek 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 abszolút hozam stratégiát követ, aktív eszközallokációval törekszik a piaci árfolyamesések hatásának mérséklésére, illetve származtatott eszközök használatával igyekszik kihasználni a piaci volatilitásban rejlő lehetőségeket. 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)	168.558.209.510	3,728176
	'T' (Ft)	49.243.560.026	3,857504
2021.03.12.	'A' (Ft)	142.395.627.175	3,351084
	'T' (Ft)	45.511.842.137	3,475452

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír			Beszerzési ár	Értékkülönbözet		Piaci érték
megnevezése	futamideje			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:			104.950.692	1.169.643	6.087.862	112.208.197
2031/A	2015.04.22 - 2031.10.22		4.405.736	25.288	44.476	4.475.500
2038/A	2018.02.07 - 2038.10.27		97.323	511	7.048	104.882
REPHUN 1.125 04/28/2024	2020.04.28 - 2026.04.28		702.834	5.582	66.736	775.152
REPHUN 1.25 10/22/25	2018.10.02 - 2025.10.22		4.568.577	10.654	63.083	4.642.314
REPHUN 1.5 11/17/2050	2020.11.17 - 2050.11.17		1.197.667	2.363	100.901	1.300.931
REPHUN 1.75 06/05/2035	2020.06.05 - 2035.06.05		685.568	7.353	124.619	817.540
REPHUN 5.375 02/23	2013.02.19 - 2023.02.21		3.657.927	62.899	-128.309	3.592.517
ARGENT 0.125 07/09/2040	2020.09.04 - 2049.07.09		694.417	314	-410.538	284.193
ARGENT 1 07/09/2029	2020.09.04 - 2029.07.09		25.553	92	-13.183	12.462
BHRAIN 6.75 09/20/29	2017.09.20 - 2029.09.20		1.032.340	16.992	-4.601	1.044.731
BRAZIL 4.75 01/14/2050	2019.11.14 - 2050.01.14		461.863	9.926	15.494	487.283
CHINA 0.125 11/12/2026	2019.11.12 - 2026.11.12		2.050.720	375	159.799	2.210.894
CHINA 0.5 11/12/2031	2019.11.12 - 2031.11.12		1.634.744	1.250	207.191	1.843.185
EGYPT 5.75 05/29/2024	2020.05.29 - 2024.05.29		508.912	2.473	1.543	512.928
EGYPT 8.875 05/29/2050	2020.05.29 - 2050.05.29		477.105	3.579	46.434	527.118
ESTONIA 0.125 06/10/203	2020.06.10 - 2030.06.10		2.053.099	1.538	208.246	2.262.883
GGB 1.875 02/04/2035	2020.02.04 - 2035.02.04		6.289.453	94.654	-8.379	6.375.728
IVYCST 6.125 06/15/2033	2017.06.15 - 2033.06.15		577.265	1.697	94.834	673.796
LITHUN 0.5 07/28/2050	2020.07.28 - 2050.07.28		5.078.291	11.779	480.047	5.570.117
MACEDO 3.675 06/03/202	2020.06.03 - 2026.06.03		1.032.620	23.381	197.283	1.253.284
MEX 1.375 01/15/25	2016.11.01 - 2025.01.15		1.932.055	30.648	465.267	2.427.970
MEX 3.375 02/23/31	2016.02.23 - 2031.02.23		703.790	21.135	157.946	882.871
MEX 4.75 04/27/2032	2020.04.27 - 2032.04.27		774.029	5.747	32.877	812.653
MEX 5 04/27/2051	2020.04.27 - 2051.04.27		1.095.279	8.065	18.804	1.122.148
MOROC 1.375 03/30/2026	2020.09.30 - 2026.03.30		3.993.473	14.071	62.559	4.070.103
MOROC 2 09/30/2030	2020.09.30 - 2030.09.30		3.236.480	16.746	103.583	3.356.809
OMANIB 3.625 06/15/21	2016.06.15 - 2021.06.15		2.971.204	5.020	9.651	2.985.875
PERU 1.862 12/01/2032	2020.12.01 - 2032.12.01		197.184	306	-1.697	195.793
PERU 2.78 12/01/2060	2020.12.01 - 2060.12.01		194.926	456	115	195.497
PERU 3.23 07/28/2121	2020.12.01 - 2121.07.28		194.396	84	-576	193.904
POLAND 1.375 10/22/27	2017.03.23 - 2027.10.22		1.997.958	4.883	18.783	2.021.624
POLAND 2 10/25/46	2016.10.25 - 2046.10.25		5.460.311	16.326	343.065	5.819.702
ROMANI 2.375 04/19/27	2017.04.19 - 2027.04.19		6.037.106	94.642	155.365	6.287.113
ROMANI 2.75 02/26/2026	2020.05.26 - 2026.02.26		3.478.267	53.259	76.177	3.607.703
ROMANI 2.75 10/29/25	2015.10.29 - 2025.10.29		1.091.507	4.842	22.198	1.118.547
ROMANI 2.875 05/26/28	2016.05.26 - 2028.05.26		1.577.841	25.309	63.827	1.666.977
ROMANI 3.624 05/26/2030	2020.05.26 - 2030.05.26		3.948.744	75.769	200.106	4.224.619
ROMANI 3.875 10/29/35	2015.10.29 - 2035.10.29		8.071.411	45.896	210.102	8.327.409
ROMANI 4.625 04/03/49	2019.04.03 - 2049.04.03		5.588.466	157.884	575.202	6.321.552
SLOVGB 2.25 06/12/68	2018.06.12 - 2068.06.12		1.909.685	27.415	1.981.754	3.918.854
SOAF 4.85 09/27/27	2017.09.27 - 2027.09.27		1.927.086	66.381	5.819	1.999.286
SOAF 5 10/12/46	2016.10.12 - 2046.10.12		369.306	4.949	50.346	424.601
SOAF 5.65 09/27/47	2017.09.27 - 2047.09.27		1.462.181	22.094	23.311	1.507.586
TURKEY 4.625 03/31/2020	2019.01.31 - 2025.03.31		4.132.591	143.657	228.033	4.504.281
TURKEY 4.875 10/09/26	2016.03.09 - 2026.10.09		1.793.871	20.017	15.392	1.829.280
TURKEY 5.6 11/14/2024	2019.11.14 - 2024.11.14		980.190	7.008	19.187	1.006.385
TURKEY 5.75 05/11/2047	2017.05.11 - 2047.05.11		1.673.720	14.334	31.526	1.719.580
US TREASURY B 0 02/04,	2020.08.06 - 2021.02.04		925.621	0	-33.584	892.037

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír			Értékkülönbözet		Piaci érték
megnevezése	futamideje	Beszerzési ár	kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Vállalati kötvények:			913.911	6.412.870	63.952.786
ALVGR 3.875 12/29/49	2016.09.07 - 2049.12.29	333.720	4.394	27.605	365.719
ASSGEN 3.875 01/31/29	2019.01.29 - 2029.01.29	954.600	39.306	352.419	1.346.325
AXASA 3.375 07/06/2047	2016.03.30 - 2047.07.06	1.552.206	30.217	566.954	2.149.377
BLACK SEA TRADE ANI	2020.10.19 - 2023.10.19	300.000	1.533	480	302.013
BNP 6.625 PERP	2019.03.25 - 2167.09.25	552.440	10.579	98.416	661.435
BSTDBK 4.875 05/06/21 (I)	2016.05.06 - 2021.05.06	1.535.361	11.120	-31.181	1.515.300
CEPSA FINANCE SA 2.25	2020.07.13 - 2026.02.13	1.230.330	7.960	127.305	1.365.595
CRBKMO 7.5% 05/10/27	2017.04.05 - 2027.10.05	287.240	5.377	11.910	304.527
DEUTSCHE BANK AG 5.1	2020.05.19 - 2031.05.19	2.621.430	93.245	468.252	3.182.927
DNONO 8.375 05/29/24	2019.05.29 - 2024.05.29	727.550	5.629	-20.762	712.417
ENERGO PRO AS 4.5% 05	2018.05.04 - 2024.05.04	937.860	32.682	130.386	1.100.928
ENIIM 2.625 PERP 10/13/2	2020.10.13 - 2169.01.13	627.126	924	41.359	669.409
ENIIM 3.375 PERP 07/13/2	2020.10.13 - 2169.10.13	630.893	4.727	56.251	691.871
FCAIM 3.75 03/29/24	2016.03.30 - 2024.03.29	1.032.603	34.415	292.626	1.359.644
GAZPRU 2.949 01/24/2024	2018.11.16 - 2024.01.24	1.936.200	60.712	376.212	2.373.124
GAZPRU 4.25 06/04/24	2017.04.06 - 2024.04.06	4.290.000	49.373	933.526	5.272.899
GLENLN 1.75 03/17/25	2015.03.17 - 2025.03.17	151.336	2.538	41.449	195.323
INTL INVST BANK 1.25 1	2019.10.18 - 2022.10.18	1.991.538	5.137	-12.438	1.984.237
ISPIM 7.75 07/29/49	2017.01.11 - 2027.01.11	617.780	26.980	258.174	902.934
ISTANBUL 6.375 12/09/20	2020.12.09 - 2025.12.09	879.846	3.584	33.635	917.065
KAZMUNAYGAS NATIO	2018.04.24 - 2030.04.24	1.077.516	9.064	24.622	1.111.202
LGEN 5.25 03/21/2047	2017.03.21 - 2027.03.21	440.145	6.544	56.583	503.272
MOLHB 1.5 10/08/2027	2020.10.08 - 2027.10.08	253.201	1.562	10.308	265.071
MOLHB 2.625 04/28/23	2016.04.28 - 2023.04.28	2.134.870	36.599	34.290	2.205.759
NLMKRU 4.5 06/15/23	2016.06.15 - 2023.06.15	798.895	1.558	-1.680	798.773
OTPHB 2.875% 07/15/2021	2019.07.15 - 2029.07.15	7.973.233	108.297	270.367	8.351.897
OTPHB VAR 49-16	2006.11.07 - 2049.11.07	762.288	3.862	112.191	878.341
PEMEX 5.95 01/28/2031	2020.01.28 - 2031.01.28	892.440	57.514	142.741	1.092.695
PEMEX 6.875 10/16/2025	2020.10.16 - 2025.10.16	621.019	8.625	31.621	661.265
PEMEX 6.95 01/28/2060	2020.01.28 - 2060.01.28	721.906	57.583	115.891	895.380
PETBRA 5.093 01/15/30	2019.09.18 - 2030.01.15	0	4.100	313.077	317.177
PETBRA 5.6 01/03/2031	2020.06.03 - 2031.01.03	500.058	8.463	12.107	520.628
PETROBRAS 6.85 06/05/1	2015.06.05 - 2115.06.05	1.516.994	6.780	151.120	1.674.894
PEUGEOT 2 03/23/24	2017.03.23 - 2024.03.23	1.560.900	28.410	367.991	1.957.301
PHOENIX GRP 4.75 09/04	2020.06.04 - 2031.09.04	175.021	2.533	824	178.378
SAUDI ARAMCO 1.625 1	2020.11.24 - 2025.11.24	426.145	704	-304	426.545
SAUDI ARAMCO 2.25 11/	2020.11.24 - 2030.11.24	1.359.128	3.135	3.586	1.365.849
SAUDI ARAMCO 3.25 11/	2020.11.24 - 2050.11.24	706.067	2.365	3.204	711.636
SAUDI ARAMCO 3.5 11/2	2020.11.24 - 2070.11.24	406.269	1.463	1.454	409.186
SID BANKA 0.125% 07/08	2020.07.08 - 2025.07.08	711.160	443	26.884	738.487
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2021.04.23	125.415	4.037	24.370	153.822
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2025.04.24	250.830	10.043	70.722	331.595
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2028.04.24	188.123	7.979	50.973	247.075
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2048.04.24	250.830	11.653	68.148	330.631
TOTAL 3.369 12/29/49	2016.10.06 - 2026.10.06	461.925	4.398	155.218	621.541
UNICREDIT SPA 2.2 07/2	2020.07.22 - 2027.07.22	3.003.534	30.492	295.754	3.329.780
UNIQA 1.375 07/09/2030	2020.07.09 - 2030.07.09	279.741	1.937	38.801	320.479
UNIQA 3.25 10/09/2035	2020.07.09 - 2025.07.09	174.963	1.366	18.503	194.832
VOLKSWAGEN GROUP (	2020.11.24 - 2022.11.23	759.651	581	-13.597	746.635
VOLKSWAGEN GROUP (	2020.11.24 - 2023.11.22	760.083	677	-12.758	748.002
VOLKSWAGEN GROUP)	2020.11.24 - 2025.11.24	754.532	967	-5.564	749.935

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése	futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbség		Piaci érték
			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
VOLKSWAGEN GROUP I	2020.11.24 - 2027.11.24	599.250	1.006	-260	599.996
WINGHOLDING ZRT 4 0%	2019.07.11 - 2022.07.11	1.585.839	31.199	67.227	1.684.265
WINGHOLDING ZRT 4 0%	2018.08.07 - 2021.08.07	790.585	14.411	115.434	920.430
ZURNVX 5.625 06/24/46	2016.03.24 - 2046.06.24	413.390	13.129	110.444	536.963
Belföldi részvények:		15.342.477	0	3.912.636	19.255.113
MASTERPLAST		84.400	0	311.600	396.000
MOL RT		15.249.407	0	3.605.404	18.854.811
OPUS		8.670	0	-4.368	4.302
Külföldi részvények:		33.831.548	0	6.650.082	40.481.630
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		16.430	0	52.774	69.204
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE		143.455	0	79.415	222.870
DIAMONDBACK ENERGY INC		4.296.641	0	22.508	4.319.149
DIGI COMMUNICATIONS NV		7.332.207	0	-124.243	7.207.964
ERSTE BANK STAMM		2.889.992	0	28.591	2.918.583
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85		89.183	0	88.806	177.989
MONETA MONEY BANK AS		1.508.901	0	39.108	1.548.009
OMV PETROM SA		5.475.591	0	2.865.068	8.340.659
PEKAO		8.841.340	0	-121.026	8.720.314
PKO BANK		680.147	0	-36.608	643.539
RALFP 4.371 01/23/23		154.405	0	-124.055	30.350
SBERBANK		127.287	0	81.412	208.699
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE		1.458.841	0	208.812	1.667.653
VESTAS		377.704	0	3.508.082	3.885.786
WIZZ AIR HOLDINGS PLC		101.102	0	139.381	240.483
YAPI KREDI BANKASI		338.322	0	-57.943	280.379
Jelzáloglevelek:		334.976	3.553	17.032	355.561
TJ30NF01	2020.07.31 - 2030.08.21	334.976	3.553	17.032	355.561
Befektetési jegyek:		12.898.172	0	2.416.250	15.314.422
ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY		5.861.340	0	1.661.937	7.523.277
ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP I		1.082.489	0	746.781	1.829.270
BNP EARTH FUND		1.574.580	0	127.808	1.702.388
FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP		2.249.999	0	250.445	2.500.444
FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A		427.713	0	84.996	512.709
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT		1.000.000	0	155.249	1.155.249
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.		702.051	0	-610.966	91.085
MINDÖSSZESEN:		223.983.870	2.087.107	25.496.732	251.567.709

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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:	EUR / HUF	-40.000	13.263.652	-13.227.593	13.262.061	34.468
	PLN / HUF	-75.190	5.804.421	-5.823.350	5.803.590	-19.760
	EUR / HUF	-38.780	12.880.001	-12.824.152	12.878.456	54.304
	RBL / USD	-3.355.922	52.068	-15.845.389	15.331.103	-514.286
	AUD / USD	-40.000	27.482	-8.264.204	8.096.994	-167.210
	GBP / USD	14.062	-10.830	4.140.509	-4.198.306	-57.797
	NOK / USD	-10.394	94.664	-3.060.479	3.170.820	110.341
	HUF / RON	9.673.612	-138.654	9.673.021	-9.561.485	111.536
	RON / USD	65.215	-15.097	4.497.201	-4.445.262	51.939
	HUF / RON	6.611.805	-95.632	6.611.401	-6.594.717	16.684
	HUF / USD	11.928.000	-40.000	11.926.569	-11.768.857	157.712
	EUR / HUF	-40.000	13.294.080	-13.227.594	13.292.485	64.891
	HUF / USD	14.621.527	-49.000	14.619.772	-14.416.850	202.922
	EUR / HUF	-22.652	7.492.693	-7.490.786	7.491.794	1.008
	HUF / USD	5.727.806	-19.300	5.727.806	-5.688.482	39.324
	EUR / USD	-5.050	5.665	-1.669.984	1.666.672	-3.312
	EUR / HUF	-2.580	857.109	-853.180	857.006	3.826
	HUF / USD	10.735.101	-36.000	10.733.813	-10.591.972	141.841
	EUR / HUF	-14.500	4.817.086	-4.795.003	4.816.508	21.505
	EUR / HUF	-15.000	4.983.193	-4.960.347	4.982.595	22.248
	EUR / HUF	-19.100	6.345.265	-6.316.176	6.344.504	28.328
	EUR / HUF	-3.690	1.225.865	-1.220.245	1.225.718	5.473
	TRY / USD	-200.006	33.636	-9.785.491	9.893.048	107.557
	Összesen:					413.542
2020.12.31-én:	TRY / USD	-230.013	34.320	-9.131.502	10.205.395	1.073.893
	USD / HUF	-50.000	15.468.500	-14.868.000	15.468.500	600.500
	USD / HUF	-50.000	14.870.000	-14.868.000	14.870.000	2.000
	USD / GBP	-331	255	-98.424	103.571	5.147
	RBL / USD	-3.524.690	46.000	-13.957.773	13.678.560	-279.213
	USD / EUR	16.500	-19.688	6.024.645	-5.854.369	170.276
	PLN / EUR	4.760	-21.554	1.738.019	-1.709.012	29.007
	EUR / HUF	-16.000	5.802.262	-5.842.080	5.802.262	-39.818
	EUR / NOK	-8.544	93.477	-3.119.671	3.253.946	134.275
	EUR / HUF	-7.000	2.585.730	-2.555.910	2.585.730	29.820
	EUR / HUF	-35.700	12.875.926	-13.035.141	12.875.926	-159.215
	EUR / HUF	-30.000	11.006.475	-10.953.900	11.006.475	52.575
	EUR / HUF	-45.500	16.699.810	-16.613.415	16.699.810	86.395
	USD / HUF	-60.000	17.760.600	-17.841.600	17.760.600	-81.000
	EUR / HUF	-20.000	7.277.320	-7.302.600	7.277.320	-25.280
	EUR / HUF	-20.000	7.294.170	-7.302.600	7.294.170	-8.430
	EUR / HUF	-2.230	804.953	-814.240	804.953	-9.287
	EUR / HUF	-150	54.243	-54.769	54.243	-526
	EUR / HUF	-50	18.198	-18.256	18.198	-58
	USD / HUF	-7.700	2.361.861	-2.289.672	2.361.861	72.189
	USD / HUF	-6.500	1.897.186	-1.932.840	1.897.186	-35.654
	USD / HUF	-16.900	5.037.593	-5.025.384	5.037.593	12.209
	USD / HUF	-10.139	3.004.723	-3.014.933	3.004.723	-10.210
	USD / HUF	-1.100	321.012	-327.096	321.012	-6.084
	USD / HUF	-11.000	3.275.896	-3.270.960	3.275.896	4.936
	HUF / EUR	-232.397	642	-232.397	234.413	2.016

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

Határidős deviza ügyletek bemutatása - folytatás:

	adatok ezerben	határidős ügylet				
		szerződés szerinti értéke		határidős ügylet diszkontált piaci értéke		
		devizában	forintban	devizás értéké forintban	forint értéké	eredmény
	EUR / HUF	-6.624	2.354.969	-2.418.621	2.354.969	-63.652
	USD / HUF	-2.000	593.798	-594.720	593.798	-922
	EUR / HUF	-17.380	6.273.583	-6.345.959	6.273.583	-72.376
	USD / HUF	-34.120	10.340.725	-10.145.923	10.340.725	194.802
	EUR / HUF	-2.450	885.971	-894.568	885.971	-8.597
	EUR / HUF	-3.390	1.223.674	-1.237.791	1.223.674	-14.117
	EUR / HUF	-83	30.209	-30.306	30.209	-97
	RON / EUR	-183.413	37.400	-13.754.166	13.655.862	-98.304
	PLN / EUR	-135.735	30.300	-10.762.421	11.063.439	301.018
	USD / EUR	-18.326	15.000	-5.449.494	5.476.950	27.456
	USD / EUR	-24.530	20.000	-7.294.241	7.302.600	8.359
	GBP / USD	-10.523	13.508	-4.274.022	4.016.662	-257.360
	AUD / USD	-40.000	29.364	-9.163.600	8.731.798	-431.802
	Összesen:					1.204.871

Határidős tőzsdei ügyletek bemutatása:

Megnevezés	Eladás /Vétel	Devizanem	Nyitott kontraktus	Piaci ár	Piaci érték devizában	Piaci érték (eFt)
CLG0 - WTI CRUDE OIL	Vétel	USD	1.260	61,060	-831.600	-245.106
HGH0 - COPPER FUTURE	Vétel	USD	20	2,797	-16.250	-4.790
RXH0 - EURO-BUND FUT	Eladás	USD	110	1,705	138.156	40.720
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	10	66,000	-8.700	-2.564
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	10	66,000	-8.700	-2.564
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	10	66,000	-8.700	-2.564
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	10	66,000	-8.700	-2.564
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	50	66,000	-43.500	-12.821
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	50	66,000	-43.500	-12.821
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	50	66,000	-43.500	-12.821
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	110	66,000	-95.700	-28.207
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.643
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.643
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.643
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.643
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.643
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.643
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	5	66,000	-4.350	-1.282
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	95	66,000	-82.650	-24.360
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	26	66,000	-22.620	-6.667
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	74	66,000	-64.380	-18.975
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

Határidős tőzsdei ügyletek bemutatása - folytatás:

Megnevezés	Eladás /Vétel	Devizanem	Nyitott kontraktus	Piaci ár	Piaci érték devizában	Piaci érték (eFt)
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	11	66,000	-9.570	-2.821
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	51	66,000	-44.370	-13.078
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	38	66,000	-33.060	-9.744
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	5	66,000	-4.350	-1.282
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	95	66,000	-82.650	-24.360
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	100	66,000	-87.000	-25.642
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	3	66,000	-2.610	-769
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	97	66,000	-84.390	-24.873
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	72	66,000	-62.640	-18.463
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	28	66,000	-24.360	-7.180
COH0 - BRENT CRUDE F	Vétel	USD	40	66,000	-34.800	-10.257
UBH0 - EURO BUXL 30Y	Eladás	EUR	750	1,984	2.295.000	758.543
RXH0 - EURO-BUND FU	Eladás	EUR	1.390	1,705	1.556.800	514.554
2019. összesen:						284.393
CLG1 - WTI CRUDE FUT	Eladás	USD	1.000	48,520	-1.764.000	-524.543
COH1 - BRENT CRUDE F	Eladás	USD	2.300	51,800	-998.200	-296.825
ESH1 - S&P 500 MINI FU	Eladás	USD	651	3.748,750	-935.813	-278.273
ESH1 - S&P 500 MINI FU	Eladás	USD	549	3.748,750	-789.188	-234.673
COH1 - BRENT CRUDE F	Eladás	USD	400	51,800	-228.000	-67.798
2020. összesen:						-1.402.112

Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban):

	Előző év 2019. december 31.	Tárgyév 2020. december 31.
Az Alap által fizetendő fix láb értéke:	442.195.781	446.078.398
Az Alap számára lejáratkor jóváírandó változó lábának értéke:	-455.549.889	-486.415.071
A kamatswap ügylet piaci értéke:	-13.354.108	-40.336.673
Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben:	9.487.812	10.445.311
A mérlegen kívül (0. számlaosztályban) nyilvántartott értékek	1.500.000 USD	1.500.000 USD

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

XIV. Értékpapír-finanszírozási és a teljes hozam-csereügyletek bemutatása:

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

Nyitott 'buy & sell back' ügyletek:

NYILVÁNOS VÁSÁRLÁS ÉS ELADÁS ÜGYLETEK

Értékpapír adatai		Devi-	Vétel	Vételi	Eladás	Eladási	Ügylet
Megnevezése	Névértéke	za	dátuma	érték	dátuma	érték	hozama
2019.12.31-én:							
ROMANI 2.375 04/19/27	9.943.000	EUR	2019.12.03	10.988.867	2019.12.03	10.988.867	0
MOL RT	100.000	eFt	2019.12.04	2.275.789	2019.12.04	2.275.789	0
MOL RT	137.500	eFt	2019.12.04	3.129.210	2019.12.04	3.129.210	0
MOL RT	237.500	eFt	2019.12.04	5.404.999	2019.12.04	5.404.999	0
2024/C	1.497.520	eFt	2019.12.04	1.618.011	2019.12.04	1.618.011	0
2022/C	2.000.000	eFt	2019.12.04	2.073.457	2019.12.04	2.073.457	0
INTL INVST BANK 1.25	2.000.000	eFt	2019.12.04	2.019.633	2019.12.04	2.019.633	0
KAZMUNAYGAS NATIO	55.000	USD	2019.12.18	71.612	2019.12.18	71.612	0
KAZMUNAYGAS NATIO	315.000	USD	2019.12.18	410.141	2019.12.18	410.141	0
KAZMUNAYGAS NATIO	1.530.000	USD	2019.12.18	1.992.112	2019.12.18	1.992.112	0
KAZMUNAYGAS NATIO	1.920.000	USD	2019.12.18	2.499.906	2019.12.18	2.499.906	0
OMANIB 3.625 06/15/21	10.000.000	USD	2019.12.18	10.102.985	2019.12.18	10.102.985	0
2020.12.31-én:							
TURKEY 5.75 05/11/2047	6.000.000	USD	2020.12.28	5.691.342	2020.12.28	5.691.342	0
OMANIB 3.625 06/15/21	10.000.000	USD	2020.12.28	10.032.290	2020.12.28	10.032.290	0
BHRAIN 6.75 09/20/29	2.321.000	USD	2020.12.28	2.729.345	2020.12.28	2.729.345	0
SOAF 4.85 09/27/27	6.000.000	USD	2020.12.28	6.572.818	2020.12.28	6.572.818	0
TURKEY 4.875 10/09/26	6.000.000	USD	2020.12.28	6.114.528	2020.12.28	6.114.528	0
DIAMONDBACK ENERG	3.001	USD	2020.12.28	14.479.970	2020.12.28	14.479.970	0
DEUTSCHE BANK AG 5.	1.100.000	USD	2020.12.29	1.315.717	2020.12.29	1.315.717	0
TURKEY 5.6 11/14/2024	707.000	USD	2020.12.28	744.877	2020.12.28	744.877	0
ROMANI 3.624 05/26/203	5.450.000	USD	2020.10.07	2.272.549.512	2020.10.07	2.272.549.512	0
REPHUN 1.25 10/22/25	10.387.000	USD	2020.11.24	10.991.044	2020.11.24	10.991.044	0
ROMANI 3.875 10/29/35	9.191.000	USD	2020.12.02	4.017.948.284	2020.12.02	4.017.948.284	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 Supra Származtatott Befektetési 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:	53.565.334	17.989.312	-13.567.540	57.987.106
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözete:	152.693.566	56.068.822	-38.764.463	169.997.925
Értékelési különbözet:	36.961.843	27.346.262	-36.961.843	27.346.262
Eredménytartalék:	18.114.917	19.041.106	0	37.156.023
Tárgyévi eredmény:	19.041.106	-74.655.278	-19.041.106	-74.655.278
Tőkenövekmény összesen:	226.811.432	27.800.912	-94.767.412	159.844.932
Saját tőke összesen:	280.376.766	45.790.224	-108.334.952	217.832.038

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	15.978.491.128	15.574.158.046	3.810.044.219	3.493.052.980
Letétkezelői díj	93.753.939	67.912.529	87.621.332	66.038.965
Bizományosi díj	106.424.015	106.424.015	130.267.823	130.267.823
Bankköltség	5.193.776	5.193.776	2.129.877	2.129.877
Felügyeleti díj	58.375.000	42.419.000	75.432.000	56.651.000
Könyvvizsgálat díja	2.075.180	0	2.132.330	0
Összesen:	16.244.313.038	15.796.107.366	4.107.627.581	3.748.140.645

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Cash flow kimutatás

adatok ezer Ft-ban

	2019.01.01- 2019.12.31.	2020.01.01- 2020.12.31.
I. Működési cash flow	-67.367.173	-137.978.171
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)	6.774.346	-90.913.014
3. Elszámolt értékvesztés és visszairás	0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet	30.806.562	-9.615.581
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete	0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye	-54.278.809	-69.668.188
8. Befektetett eszközök állományváltozása	0	0
9.1. Követelések változása	-18.539.249	18.340.945
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása	-32.326.016	8.693.423
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása	-13.307.670	16.131.264
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása	0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása	128.757	-13.726
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása	11.855.452	-11.855.452
Származékos ügyletek állományváltozása	1.519.454	922.158
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás	34.931.365	121.643.514
17. Értékpapírok beszerzése -	-701.408.971	-1.546.468.226
18. Értékpapírok eladása, beváltása +	724.073.576	1.651.854.004
19. Kapott hozamok +	12.266.760	16.257.736
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás	22.026.591	21.726.131
20. Befektetési jegy kibocsátás +	104.923.878	74.058.134
22. Befektetési jegy visszavásárlása -	-82.897.287	-52.332.003
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -	0	0
IV. Pénzeszközök változása	-10.409.217	5.391.474
Pénzeszközök nyitó értéke	12.571.217	2.162.000
Pénzeszközök záró értéke	2.162.000	7.553.474

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.

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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
Tárgynap (T):	2020.12.31
Saját tőke:	217.832.038.728
Egy jegyre jutó NEÉ:	3,756560
Darabszám:	57.987.106.181

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:		42.541.873	100,00
Alapkezelői díj		316.991	0,75
Letétkezelői díj		21.583	0,05
Költségként elszámolt egyéb tétel		20.913	0,05
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		42.182.386	99,15
I/3. Céltartalékok:		0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		0	0,00
Kötelezettségek összesen:		42.541.873	100,00

II. ESZKÖZÖK				Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):				7.530.077	2,89
II/2. Egyéb követelés:				1.475.905	0,57
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):	Bank	Devizanem	Futamidő	23.397	0,01
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:				23.397	0,01
	OTP	RON	20.12.21 - 21.02.17	23.397	0,01
II/4. Értékpapírok (összes):		Devizanem	Névérték devizában	251.567.709	96,61
II/4.1. Állampapírok (összes):				112.208.197	43,10
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):				15.708.836	6,03
2031/A államkötvény		HUF	4.000.000	4.475.500	1,72
2038/A államkötvény		HUF	94.110	104.882	0,04
REPHUN 1.125 04/28/2026 államkötvény		EUR	2.000.000	775.152	0,30
REPHUN 1.25 10/22/25 államkötvény		EUR	12.000.000	4.642.314	1,78
REPHUN 1.5 11/17/2050 államkötvény		EUR	3.500.000	1.300.931	0,50
REPHUN 1.75 06/05/2035 államkötvény		EUR	2.000.000	817.540	0,31
REPHUN 5.375 02/23 államkötvény		USD	10.800.000	3.592.517	1,38
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes):				96.499.361	37,07
ARGENT 0.125 07/09/2046 államkötvény		USD	2.589.900	284.193	0,11
ARGENT 1 07/09/2029 államkötvény		USD	95.367	12.462	0,00
BHRAIN 6.75 09/20/29 államkötvény		USD	3.000.000	1.044.731	0,40
BRAZIL 4.75 01/14/2050 államkötvény		USD	1.500.000	487.283	0,19
CHINA 0.125 11/12/2026 államkötvény		EUR	6.000.000	2.210.894	0,85
CHINA 0.5 11/12/2031 államkötvény		EUR	5.000.000	1.843.185	0,71
EGYPT 5.75 05/29/2024 államkötvény		USD	1.600.000	512.928	0,20
EGYPT 8.875 05/29/2050 államkötvény		USD	1.500.000	527.118	0,20
ESTONIA 0.125 06/10/2030 államkötvény		EUR	6.000.000	2.262.883	0,87
GGB 1.875 02/04/2035 államkötvény		EUR	15.200.000	6.375.728	2,45
IVYCS 6.125 06/15/2033 államkötvény		USD	2.000.000	673.796	0,26
LITHUN 0.5 07/28/2050 államkötvény		EUR	15.000.000	5.570.117	2,14
MACEDO 3.675 06/03/2026 államkötvény		EUR	3.000.000	1.253.284	0,48

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

MEX 1.375 01/15/25 államkötvény	EUR	6.330.000	2.427.970	0,93
MEX 3.375 02/23/31 államkötvény	EUR	2.000.000	882.871	0,34
MEX 4.75 04/27/2032 államkötvény	USD	2.250.000	812.653	0,31
MEX 5 04/27/2051 államkötvény	USD	3.000.000	1.122.148	0,43
MOROC 1.375 03/30/2026 államkötvény	EUR	11.000.000	4.070.103	1,56
MOROC 2 09/30/2030 államkötvény	EUR	9.000.000	3.356.809	1,29
OMANIB 3.625 06/15/21 államkötvény	USD	10.000.000	2.985.875	1,15
PERU 1.862 12/01/2032 államkötvény	USD	650.000	195.793	0,08
PERU 2.78 12/01/2060 államkötvény	USD	650.000	195.497	0,07
PERU 3.23 07/28/2121 államkötvény	USD	650.000	193.904	0,07
POLAND 1.375 10/22/27 államkötvény	EUR	5.000.000	2.021.624	0,78
POLAND 2 10/25/46 államkötvény	EUR	12.000.000	5.819.702	2,24
ROMANI 2.375 04/19/27 államkötvény	EUR	15.500.000	6.287.113	2,41
ROMANI 2.75 02/26/2026 államkötvény	EUR	8.800.000	3.607.703	1,39
ROMANI 2.75 10/29/25 államkötvény	EUR	2.750.000	1.118.547	0,43
ROMANI 2.875 05/26/28 államkötvény	EUR	4.000.000	1.666.977	0,64
ROMANI 3.624 05/26/2030 államkötvény	EUR	9.500.000	4.224.619	1,62
ROMANI 3.875 10/29/35 államkötvény	EUR	18.500.000	8.327.409	3,20
ROMANI 4.625 04/03/49 államkötvény	EUR	12.500.000	6.321.552	2,43
SLOVGB 2.25 06/12/68 államkötvény	EUR	6.000.000	3.918.854	1,51
SOAF 4.85 09/27/27 államkötvény	USD	6.000.000	1.999.286	0,77
SOAF 5 10/12/46 államkötvény	HUF	1.500	424.601	0,16
SOAF 5.65 09/27/47 államkötvény	USD	5.000.000	1.507.586	0,58
TURKEY 4.625 03/31/2025 államkötvény	EUR	11.250.000	4.504.281	1,73
TURKEY 4.875 10/09/26 államkötvény	USD	6.000.000	1.829.280	0,70
TURKEY 5.6 11/14/2024 államkötvény	USD	3.200.000	1.006.385	0,39
TURKEY 5.75 05/11/2047 államkötvény	USD	6.000.000	1.719.580	0,66
US TREASURY B 0 02/04/2021 államkötvény	USD	3.000.000	892.037	0,34
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:			63.952.786	24,56
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			63.952.786	24,56
ALVGR 3.875 12/29/49 kötvény	USD	1.200.000	365.719	0,14
ASSGEN 3.875 01/31/29 kötvény	EUR	3.000.000	1.346.325	0,52
AXASA 3.375 07/06/2047 kötvény	EUR	5.000.000	2.149.377	0,83
BLACK SEA TRADE AND DEVE 2.52 10/19/2023 kötvény	HUF	300.000	302.013	0,12
BNP 6.625 PERP kötvény	USD	2.000.000	661.435	0,25
BSTDBK 4.875 05/06/21 (INTL) kötvény	USD	5.000.000	1.515.300	0,58
CEPSA FINANCE SA 2.25% 02/13/2026 kötvény	EUR	3.500.000	1.365.595	0,52
CRBKMO 7.5% 05/10/27 kötvény	USD	1.000.000	304.527	0,12
DEUTSCHE BANK AG 5.625 05/19/2031 kötvény	EUR	7.300.000	3.182.927	1,22
DNONO 8.375 05/29/24 kötvény	USD	2.500.000	712.417	0,27
ENERGO PRO AS 4.5% 05/04/2024 kötvény	EUR	3.000.000	1.100.928	0,42
ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 kötvény	EUR	1.750.000	669.409	0,26
ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 kötvény	EUR	1.750.000	691.871	0,27
FCAIM 3.75 03/29/24 kötvény	EUR	3.300.000	1.359.644	0,52
GAZPRU 2.949 01/24/2024 kötvény	EUR	6.000.000	2.373.124	0,91
GAZPRU 4.25 06/04/24 kötvény	GBP	12.000.000	5.272.899	2,03
GLENLN 1.75 03/17/25 kötvény	EUR	500.000	195.323	0,08
INTL INVST BANK 1.25 10/18/2022 kötvény	HUF	2.000.000	1.984.237	0,76
ISPIM 7.75 07/29/49 kötvény	EUR	2.000.000	902.934	0,35
ISTANBUL 6.375 12/09/2025 kötvény	USD	3.000.000	917.065	0,35
KAZMUNAYGAS NATIONAL CO 5.375% 04/24/203 kötvény	USD	3.000.000	1.111.202	0,43
LGEN 5.25 03/21/2047 kötvény	USD	1.500.000	503.272	0,19
MOLHB 1.5 10/08/2027 kötvény	EUR	700.000	265.071	0,10

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

MOLHB 2.625 04/28/23 kötvény	EUR	5.620.000	2.205.759	0,85
NLMKRU 4.5 06/15/23 kötvény	USD	2.500.000	798.773	0,31
OTPHB 2.875% 07/15/2029 kötvény	EUR	22.150.000	8.351.897	3,21
OTPHB VAR 49-16 kötvény	EUR	2.700.000	878.341	0,34
PEMEX 5.95 01/28/2031 kötvény	USD	3.500.000	1.092.695	0,42
PEMEX 6.875 10/16/2025 kötvény	USD	2.000.000	661.265	0,25
PEMEX 6.95 01/28/2060 kötvény	USD	3.000.000	895.380	0,34
PETBRA 5.093 01/15/30 kötvény	USD	941.000	317.177	0,12
PETBRA 5.6 01/03/2031 kötvény	USD	1.500.000	520.628	0,20
PETROBRAS 6.85 06/05/15 kötvény	HUF	4.500	1.674.894	0,64
PEUGEOT 2 03/23/24 kötvény	EUR	5.000.000	1.957.301	0,75
PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 kötvény	USD	550.000	178.378	0,07
SAUDI ARAMCO 1.625 11/24/2025 kötvény	USD	1.400.000	426.545	0,16
SAUDI ARAMCO 2.25 11/24/2030 kötvény	USD	4.500.000	1.365.849	0,52
SAUDI ARAMCO 3.25 11/24/2050 kötvény	USD	2.350.000	711.636	0,27
SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/2070 kötvény	USD	1.350.000	409.186	0,16
SID BANKA 0.125% 07/08/2025 kötvény	EUR	2.000.000	738.487	0,28
SYNGENTA FINANCE NV 3.933% 04/23/2021 kötv	USD	500.000	153.822	0,06
SYNGENTA FINANCE NV 4.892% 04/24/2025 kötv	USD	1.000.000	331.595	0,13
SYNGENTA FINANCE NV 5.182% 04/24/2028 kötv	USD	750.000	247.075	0,09
SYNGENTA FINANCE NV 5.676% 04/24/2048 kötv	USD	1.000.000	330.631	0,13
TOTAL 3.369 12/29/49 kötvény	EUR	1.500.000	621.541	0,24
UNICREDIT SPA 2.2 07/22/2027 kötvény	EUR	8.500.000	3.329.780	1,28
UNIQA 1.375 07/09/2030 kötvény	EUR	800.000	320.479	0,12
UNIQA 3.25 10/09/2035 kötvény	EUR	500.000	194.832	0,07
VOLKSWAGEN GROUP 0.75 11/23/2022 kötvény	USD	2.500.000	746.635	0,29
VOLKSWAGEN GROUP 0.875 11/22/2023 kötvény	USD	2.500.000	748.002	0,29
VOLKSWAGEN GROUP 1.25 11/24/2025 kötvény	USD	2.500.000	749.935	0,29
VOLKSWAGEN GROUP 1.625 11/24/2027 kötvény	USD	2.000.000	599.996	0,23
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2022 kötvény	EUR	4.481.000	1.684.265	0,65
WINGHOLDING ZRT 4 08/07/2021 kötvény	EUR	2.450.000	920.430	0,35
ZURNVX 5.625 06/24/46 kötvény	USD	1.500.000	536.963	0,21
II/4.3. Részvények (összes):			59.736.743	22,94
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			19.255.113	7,39
MASTERPLAST részvény	HUF	20.000	396.000	0,15
MOL RT részvény	HUF	1.076.188	18.854.811	7,24
OPUS részvény	HUF	371	4.302	0,00
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):			40.481.630	15,55
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR részvény	USD	0	69.204	0,03
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE részvény	RON	200.000	222.870	0,09
DIAMONDBACK ENERGY INC részvény	USD	3.001	4.319.149	1,66
DIGI COMMUNICATIONS NV részvény	RON	2.770.000	7.207.964	2,77
ERSTE BANK STAMM részvény	EUR	320.500	2.918.583	1,12
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85 részvény	RON	1.391.363	177.989	0,07
MONETA MONEY BANK AS részvény	CZK	1.641.300	1.548.009	0,59
OMV PETROM SA részvény	RON	30.597.968	8.340.659	3,20
PEKAO részvény	PLN	1.800.000	8.720.314	3,35
PKO BANK részvény	PLN	282.600	643.539	0,25
RALFP 4.371 01/23/23 részvény	EUR	500.000	30.350	0,01
SBERBANK részvény	RUB	583.200	208.699	0,08
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE részvény	RON	791.400	1.667.653	0,64
VESTAS részvény	DKK	55.000	3.885.786	1,49

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

WIZZ AIR HOLDINGS PLC részvény	GBP	1	240.483	0,09
YAPI KREDI BANKASI részvény	TRY	2.292.994	280.379	0,11
II/4.4. Jelzáloglevelek (összes):			355.561	0,14
II/4.4.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			355.561	0,14
TJ30NF01 jelzáloglevél	HUF	325.000	355.561	0,14
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):			15.314.422	5,87
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			15.314.422	5,87
ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY	EUR	18.000.000	7.523.277	2,89
ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP I	EUR	3.480.000	1.829.270	0,70
BNP EARTH FUND	USD	3.991.219	1.702.388	0,65
FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP	HUF	2.399.658	2.500.444	0,96
FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A	EUR	1.300.000	512.709	0,20
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT	HUF	1.037.218	1.155.249	0,44
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.	EUR	2.326	91.085	0,03
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):			14.400	0,01
II/6. Származékos ügyletek értékelési különbözete			-237.577	-0,09
Eszközök összesen:			260.373.911	100,00

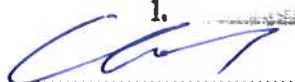
Megjegyzés: a magyar forintban kibocsátott értékpapírok névértéke ezer forintban van megadva.

Kelt:

BUDAPEST, 2021. március 12.

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

1.



Köves Benedek Balázs
vezérigazgató