

OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Éves jelentés

2021. december 31.

Tartalom

Független könyvvizsgálói jelentés

Éves jelentés

Független Könyvvizsgálói Jelentés

Az OTP Alapkezelő Zrt. részére

Az éves jelentésben közzétett számviteli információk könyvvizsgálatáról készült jelentés

Vélemény

Elvégeztük az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap (továbbiakban: „az Alap”) mellékelt 2021. évi éves jelentés I-XV. pontjaiban közzétett számviteli információinak („számviteli információk”) a könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap 2021. december 31-ével végződő évre vonatkozó éves jelentésében közzétett számviteli információk minden lényeges szempontból a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel (a „Törvény”), valamint a számvitelről szóló 2000. évi C. törvény (a „számviteli törvény”) az éves beszámoló mérlegére és eredménykimutatására vonatkozó előírásaival összhangban kerültek összeállításra.

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 könyvvizsgálónak a számviteli információk könyvvizsgálataért való felelőssége” szakasza tartalmazza.

Függetlenek vagyunk az Alaptól és annak kezelőjétől az OTP Alapkezelő Zrt-től (továbbiakban: „az Alapkezelő”) a vonatkozó, Magyarországon hatályos jogszabályokban és a Magyar Könyvvizsgálói Kamarának a könyvvizsgálói hivatás magatartási (etikai) szabályairól és a fegyelmi eljárásról szóló szabályzatában, valamint az ezekben nem rendezett kérdések tekintetében a Nemzetközi Etikai Standardok Testülete (IESBA) által kiadott „Nemzetközi Etikai Kódex Könyvvizsgálóknak (benne foglalva a Függetlenségre Vonatkozó Nemzetközi Standardok)”-ban (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 kérdések

Az Alap 2020. évi számviteli információit más könyvvizsgáló auditálta, aki azokról 2021. április 27-én korlátozás nélküli véleményt bocsátott ki.

Egyéb információk

Az Alapkezelő ügyvezetése (továbbiakban: „vezetés”) felelős az egyéb információkért és az éves jelentésnek a Törvény vonatkozó előírásaival összhangban történő elkészítéséért. Az egyéb információk az Alap 2021. évi éves jelentésében foglalt információkból állnak, de nem tartalmazzák a számviteli információkat és az azokra vonatkozó könyvvizsgálói jelentésünket. A számviteli információkra vonatkozó véleményünk nem vonatkozik az egyéb információkra, és azokra vonatkozóan nem bocsátunk ki semmilyen formájú bizonyosságot nyújtó következtetést.

Az éves jelentésben közzétett számviteli információk általunk végzett könyvvizsgálatával kapcsolatban a mi felelősségünk az egyéb információk átolvasása és ennek során annak mérlegelése, hogy az egyéb információk lényegesen ellentmondanak-e a 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 jelenenivalónk.

A vezetés és az irányítással megbízott személyek felelőssége a számviteli információkért

A vezetés felelős a számviteli információknak a Törvény, illetve a számviteli törvénynek az éves beszámoló mérlegére és eredménykimutatására vonatkozó előírásaival összhangban történő elkészítéséért, valamint az olyan belső kontrollokért, amelyeket a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő, lényeges hibás állításoktól mentes számviteli információk elkészítése.

A számviteli információk elkészítése során a vezetés felelős azért, hogy felmérje az Alapnak a vállalkozás folytatására való képességét és az adott helyzetnek megfelelően közzétegye a vállalkozás folytatásával kapcsolatos információkat, valamint a vezetés felel a vállalkozás folytatásának elvén alapuló számvitelnek a számviteli információkban való alkalmazásáért. 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 Alapkezelőnél irányítással megbízott személyek felelősek az Alap pénzügyi beszámolási folyamatának felügyeletéért.

A könyvvizsgálónak a számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége

A könyvvizsgálat során célunk kellő bizonyosságot szerezni arról, hogy a 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 számviteli információk alapján meghozott gazdasági döntéseit.

Egy, a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó - Magyarországon hatályos - törvényekkel és egyéb jogszabályokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálatnak a részeként szakmai megítélést alkalmazunk, és szakmai szkepticizmust tartunk fenn a könyvvizsgálat egésze során. Emellett:

- ▶ Azonosítjuk és felbecsüljük a 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 az Alapkezelőnek az Alapra vonatkozóan alkalmazott belső kontrolljának 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 tevékenység folytatására való képességét illetően. Amennyiben azt a következtetést vonjuk le, hogy lényeges bizonytalanság áll fenn, független könyvvizsgálói jelentésünkben fel kell hívnunk a figyelmet a 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 tevékenységet folytatni.

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

Jelentés egyéb jogi és szabályozói követelményekről

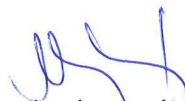
A Törvény 132. § (1) szerint a vezetés felelős az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, valamint a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által adott értékelése alapján történő elszámolásáért. A Törvény 135. § (1) bekezdésével összhangban a mi felelősségünk annak vizsgálata, hogy az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárral alátámasztottak-e, valamint az adott időszaki kezelési költségek elszámolása a letétkezelő által adott értékelés alapján történt-e. Véleményünk

szerint az éves jelentésben szereplő eszközök és kötelezettségek a leltárral alátámasztottak, az éves jelentésben bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

Budapest, 2022. április 28.



Nagyváradiné Szépfalvi Zsuzsanna
Ernst & Young Kft.
1132 Budapest, Váci út 20.
Nyilvántartásba-vételi szám: 001165



Mészáros Péter
Kamarai tag könyvvizsgáló
Kamarai tagsági szám: 005805



OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Éves jelentés a 2021. december 31-én zárult üzleti évről

Pénzügyi év: 2021. január 1-től
2021. 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 2020. december 31.	Tárgyév 2021. 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, osztalékokból	0	0
06.	b) egyéb	0	0
07.	II. Hosszú lejáratú bankbetétek	0	0
08.	B. Forgóeszközök	260.597.088	229.957.903
09.	I. Követelések	1.475.905	8.842.908
10.	1. Követelések	1.475.905	8.842.908
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	251.567.709	219.328.321
15.	1. Értékpapírok	223.983.870	207.089.438
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	27.583.839	12.238.883
17.	a) kamatokból, osztalékokból	2.087.107	1.602.212
18.	b) egyéb	25.496.732	10.636.671
19.	III. Pénzeszközök	7.553.474	1.786.674
20.	1. Pénzeszközök	7.553.474	1.786.674
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	14.400	47.496
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	14.400	47.496
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származékos ügyletek értékelési különbözete	-237.577	-5.587.816
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	260.373.911	224.417.583
27.	E. Saját tőke	217.832.038	142.029.564
28.	I. Induló tőke	57.987.106	45.600.927
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	185.977.827	191.133.509
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-127.990.721	-145.532.582
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	159.844.932	96.428.637
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	-375.593.721	-416.594.750
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	545.591.646	558.243.409
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	27.346.262	6.651.067
35.	3. Előző év(ek) eredménye	37.156.023	-37.499.255
36.	4. Tárgyévi eredmény	-74.655.278	-14.371.834
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	42.541.873	82.388.019
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	42.541.873	82.388.019
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	260.373.911	224.417.583

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Előző év 2020.01.01-2020.12.31.	Tárgyév 2021.01.01-2021.12.31.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei	232.915.607	94.061.568
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	303.360.824	105.219.378
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	4.107.628	3.134.213
05.	V. Egyéb ráfordítások	102.433	79.811
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény (I - II + III - IV - V - VI)	-74.655.278	-14.371.834

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

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.



Köves Benedek Balázs
vezérigazgató
OTP Alapkezelő Zrt.

Kelt: BUDAPEST, 2022. április 28.

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Tájékoztató adatok:

1. Az Alap neve: OTP Supra Származtatott Befektetési Alap
2. Az Alap felügyeleti nyilvántartásba vételének száma (lajstromszám) és dátuma: 1111-276, 2008. május 14.
3. Az Alap típusa: nyilvános
4. Az Alap fajtája: nyíltvégű értékpapír-befektetési alap
5. Az Alap futamideje: 2008. május 14-től határozatlan ideig.
6. Az Alap üzleti éve: 2021.01.01-2021.12.31-ig.
7. Az Alap harmonizációja: nem ÁÉKBV irányelv szerint harmonizált (alternatív befektetési alap, "ABA")
8. A mérlegkészítés időpontja: 2022. április 28.
9. Alapkezelő neve: OTP Alapkezelő Zrt. székhelye: 1026 Budapest, Riadó u.1-3.
10. Letétkezelő neve: OTP Bank Nyrt. székhelye: 1051 Budapest, Nádor u.16.
11. 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
12. 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: Ernst & Young Könyvvizsgáló Kft.
13. székhelye: 1132 Budapest, Váci út 20. A könyvvizsgálatért felelős személy Mészáros Péter, kamarai tagsági
száma: 005805.
14. Az Alap 2021. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFA-val növelt nettó könyvvizsgálati díja 1.905 eFt.
Az Alappal kapcsolatos további információkat ld. az Alapkezelő honlapján:

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

A beszámoló fordulónapja utáni események bemutatása:

2022. február második felében fegyveres konfliktus bontakozott ki Oroszország és Ukrajna között. Az Alapkezelő vezetése a 2021-es év vonatkozásában értékelte az Ukrajnában kialakult fegyveres konfliktust és megállapította, hogy a 2021. december 31-i Éves jelentés adataira nincs hatása. Az Alapkezelő megvizsgálta a konfliktus hatását az Alap vonatkozásában és továbbra is úgy értékeli, hogy a vállalkozás folytatásának elve érvényesül.

Az Alap orosz kitettsége 2021.12.31-én 10% alatti, míg 2022.04.20-án 5% alatti.

A 2022-es évben az értékelési folyamat során – az Alapkezelő számára elérhető piaci árak hiányában – az Alapkezelő Értékelési Bizottsága a rendelkezésre álló információkat felhasználva valószínűségekkel súlyozott eszközértékelést alkalmaz. Nem zárható azonban ki, hogy az Alapban található orosz eszközök értéke az Alapkezelő által alkalmazott értékelési modellből adódó áráktól jelentősen eltér.

Az Alapkezelő menedzsmentje folyamatosan figyelemmel kíséri az ukrán-orosz konfliktus alakulását és a szükséges lépéseket meg fogja tenni az üzleti kockázat mérséklése érdekében.

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.

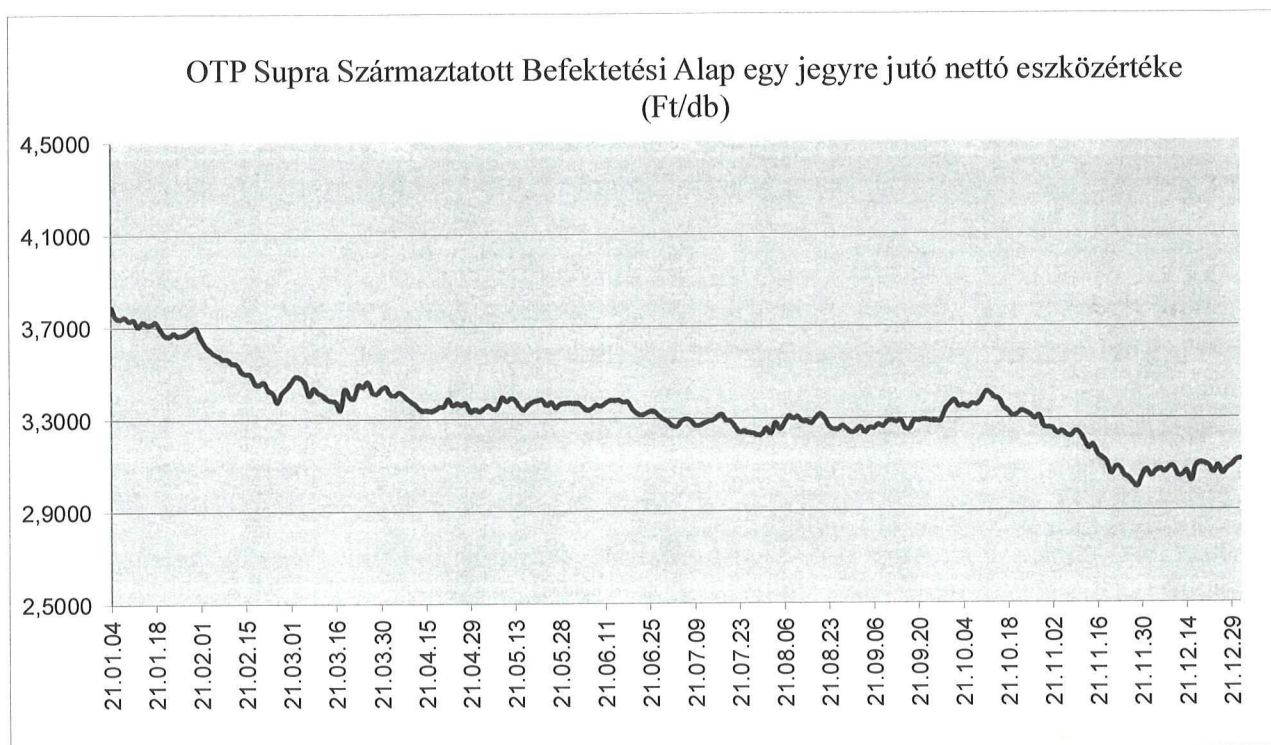
Források:

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

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye -11.157.810 eFt, amely 94.061.568 eFt bevétel és 105.219.378 eFt ráfordítás különbsége. 3.134.213 eFt működési költség és 79.811 eFt egyéb ráfordítás után a veszteség 14.371.834 eFt.

A működési költségeket a likviditási jelentés II. táblázata részletezi, amelyben a "pénzügyileg realizált oszlop" tartalmazza az 2021. 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 2021.01.01		Időszak záró állománya 2021.12.31		Megoszlás (%)
Készpénzállomány - banki egyenlegek						
Bank	Lekötési idő					
OTP Bank Nyrt. HUF	folyószámla	3.608.022		47.824		0,02%
OTP Bank Nyrt. EUR	folyószámla	3.748.990		1.438.342		0,64%
OTP Bank Nyrt. USD	folyószámla	170.796		296.483		0,13%
OTP Bank Nyrt. GBP	folyószámla	46		14		0,00%
OTP Bank Nyrt. PLN	folyószámla	2.144		3.752		0,00%
OTP Bank Nyrt. AUD	folyószámla	58		60		0,00%
OTP Bank Nyrt. NOK	folyószámla	0		17		0,00%
OTP Bank Nyrt. RBL	folyószámla	0		146		0,00%
OTP Bank Nyrt. RON	folyószámla	21		36		0,00%
OTP Bank Nyrt. RON	2020.12.21 - 2021.02.17	23.397				0,00%
Banki egyenlegek összesen:		7.553.474		1.786.674		0,79%
Átruházható értékpapírok						
Értékpapír neve	Futamidő	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	
Államkötvények:		112.208.197		84.252.699		37,52%
2031/A	2015.04.22 - 2031.10.22	4.475.500		0		0,00%
2038/A	2018.02.07 - 2038.10.27	104.882		0		0,00%
REPHUN 0.125 09/21/2028	2021.09.21 - 2028.09.21	0		719.461		0,32%
REPHUN 1.125 04/28/2026	2020.04.28 - 2026.04.28	775.152		0		0,00%
REPHUN 1.25 10/22/25	2018.10.02 - 2025.10.22	4.642.314		0		0,00%
REPHUN 1.5 11/17/2050	2020.11.17 - 2050.11.17	1.300.931		1.231.819		0,55%
REPHUN 1.75 06/05/2035	2020.06.05 - 2035.06.05	817.540		0		0,00%
REPHUN 5.375 02/23	2013.02.19 - 2023.02.21	3.592.517		0		0,00%
ARGENT 0.125 07/09/2046	2020.09.04 - 2049.07.09	284.193		273.846		0,12%
ARGENT 1 07/09/2029	2020.09.04 - 2029.07.09	12.462		11.496		0,01%
BGB 0.65 06/22/2071	2021.02.09 - 2071.06.22	0		1.519.739		0,68%
BHRAIN 6.75 09/20/29	2017.09.20 - 2029.09.20	1.044.731		0		0,00%
BRAZIL 4.75 01/14/2050	2019.11.14 - 2050.01.14	487.283		446.194		0,20%
BTPS 1.5 04/30/2045	2020.10.30 - 2045.04.30	0		3.821.788		1,70%
BTPS 2.15 03/01/2072	2021.03.01 - 2072.03.01	0		14.353.689		6,40%
CHINA 0.125 11/12/2026	2019.11.12 - 2026.11.12	2.210.894		0		0,00%
CHINA 0.5 11/12/2031	2019.11.12 - 2031.11.12	1.843.185		0		0,00%
EGYPT 5.75 05/29/2024	2020.05.29 - 2024.05.29	512.928		545.910		0,24%
EGYPT 5.8 09/30/2027	2021.09.30 - 2027.09.30	0		1.593.500		0,71%
EGYPT 7.3 09/30/2033	2021.09.30 - 2033.09.30	0		1.531.586		0,68%
EGYPT 8.75 09/30/2051	2021.09.30 - 2051.09.30	0		748.779		0,33%
EGYPT 8.875 05/29/2050	2020.05.29 - 2050.05.29	527.118		448.514		0,20%
ESTONIA 0.125 06/10/2030	2020.06.10 - 2030.06.10	2.262.883		0		0,00%
GGB 1.875 02/04/2035	2020.02.04 - 2035.02.04	6.375.728		0		0,00%
HELLENIC REP GGB 1.875 01/2021	2021.03.24 - 2052.01.24	0		5.978.668		2,66%
IVYCST 6.125 06/15/2033	2017.06.15 - 2033.06.15	673.796		689.764		0,31%
LITHUN 0.5 07/28/2050	2020.07.28 - 2050.07.28	5.570.117		4.345.270		1,94%
MACEDO 3.675 06/03/2026	2020.06.03 - 2026.06.03	1.253.284		0		0,00%
MEX 1.375 01/15/25	2016.11.01 - 2025.01.15	2.427.970		0		0,00%
MEX 3.375 02/23/31	2016.02.23 - 2031.02.23	882.871		862.080		0,38%
MEX 4.75 04/27/2032	2020.04.27 - 2032.04.27	812.653		0		0,00%
MEX 5 04/27/2051	2020.04.27 - 2051.04.27	1.122.148		1.124.609		0,50%
MOROC 1.375 03/30/2026	2020.09.30 - 2026.03.30	4.070.103		0		0,00%
MOROC 2 09/30/2030	2020.09.30 - 2030.09.30	3.356.809		0		0,00%
OMANIB 3.625 06/15/21	2016.06.15 - 2021.06.15	2.985.875		0		0,00%
PERU 1.862 12/01/2032	2020.12.01 - 2032.12.01	195.793		193.863		0,09%
PERU 2.78 12/01/2060	2020.12.01 - 2060.12.01	195.497		186.867		0,08%
PERU 3.23 07/28/2121	2020.12.01 - 2121.07.28	193.904		185.585		0,08%
PGB 1 04/12/2052	2021.02.10 - 2052.04.12	0		1.016.331		0,45%
POLAND 1.375 10/22/27	2017.03.23 - 2027.10.22	2.021.624		0		0,00%
POLAND 2 10/25/46	2016.10.25 - 2046.10.25	5.819.702		5.384.430		2,40%
ROMANI 2.375 04/19/27	2017.04.19 - 2027.04.19	6.287.113		3.973.992		1,77%
ROMANI 2.75 02/26/2026	2020.05.26 - 2026.02.26	3.607.703		3.571.337		1,59%
ROMANI 2.75 10/29/25	2015.10.29 - 2025.10.29	1.118.547		0		0,00%
ROMANI 2.875 05/26/28	2016.05.26 - 2028.05.26	1.666.977		1.214.654		0,54%
ROMANI 3.624 05/26/2030	2020.05.26 - 2030.05.26	4.224.619		3.886.524		1,73%
ROMANI 3.875 10/29/35	2015.10.29 - 2035.10.29	8.327.409		7.459.552		3,32%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyongkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2021.01.01	Időszak záró állománya 2021.12.31	Megosztás (%)
ROMANI 4.625 04/03/49 2019.04.03 - 2049.04.03	6.321.552	5.380.631	2,40%
SERBIA 1 09/23/2028 2021.09.23 - 2028.09.23	0	702.886	0,31%
SERBIA 2.05 09/23/2036 2021.09.23 - 2036.09.23	0	1.393.088	0,62%
SLOREP 0.4875 10/20/2050 2020.10.20 - 2050.10.20	0	406.415	0,18%
SLOVGB 2.25 06/12/68 2018.06.12 - 2068.06.12	3.918.854	3.160.072	1,41%
SOAF 4.85 09/27/27 2017.09.27 - 2027.09.27	1.999.286	0	0,00%
SOAF 5 10/12/46 2016.10.12 - 2046.10.12	424.601	449.756	0,20%
SOAF 5.65 09/27/47 2017.09.27 - 2047.09.27	1.507.586	1.590.426	0,71%
TURKEY 4.625 03/31/2025 2019.01.31 - 2025.03.31	4.504.281	1.231.957	0,55%
TURKEY 4.875 10/09/26 2016.03.09 - 2026.10.09	1.829.280	0	0,00%
TURKEY 5.6 11/14/2024 2019.11.14 - 2024.11.14	1.006.385	1.015.334	0,45%
TURKEY 5.75 05/11/2047 2017.05.11 - 2047.05.11	1.719.580	1.602.287	0,71%
US TREASURY B 0 02/04/2021 2020.08.06 - 2021.02.04	892.037	0	0,00%
Vállalati kötvények:	63.952.786	43.566.947	19,43%
ALVGR 3.875 12/29/49 2016.09.07 - 2049.12.29	365.719	394.438	0,18%
ASSGEN 3.875 01/31/29 2019.01.29 - 2029.01.29	1.346.325	1.321.479	0,59%
AXASA 3.375 07/06/2047 2016.03.30 - 2047.07.06	2.149.377	1.259.269	0,56%
BLACK SEA TRADE AND DE 2020.10.19 - 2023.10.19	302.013	0	0,00%
BNP 6.625 PERP 2019.03.25 - 2167.09.25	661.435	0	0,00%
BSTDBK 4.875 05/06/21 (INTL 2016.05.06 - 2021.05.06	1.515.300	0	0,00%
CEPSA FINANCE SA 2.25% 02 2020.07.13 - 2026.02.13	1.365.595	0	0,00%
CRBKMO 7.5% 05/10/27 2017.04.05 - 2027.10.05	304.527	330.880	0,15%
DEUTSCHE BANK AG 5.625 0 2020.05.19 - 2031.05.19	3.182.927	0	0,00%
DNONO 8.375 05/29/24 2019.05.29 - 2024.05.29	712.417	851.685	0,38%
ENERGO PRO 4 12/07/2022 2017.12.07 - 2022.12.07	0	1.108.882	0,49%
ENERGO PRO AS 4.5% 05/04/2 2018.05.04 - 2024.05.04	1.100.928	0	0,00%
ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 2020.10.13 - 2169.01.13	669.409	673.952	0,30%
ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 2020.10.13 - 2169.10.13	691.871	683.525	0,30%
FCAIM 3.75 03/29/24 2016.03.30 - 2024.03.29	1.359.644	0	0,00%
GAZPRU 2.949 01/24/2024 2018.11.16 - 2024.01.24	2.373.124	2.369.538	1,06%
GAZPRU 4.25 06/04/24 2017.04.06 - 2024.04.06	5.272.899	5.551.349	2,47%
GLENLN 1.75 03/17/25 2015.03.17 - 2025.03.17	195.323	0	0,00%
GTCAPW 2.25 06/23/2026 2021.06.23 - 2026.06.23	0	735.983	0,33%
INTL INVST BANK 1.25 10/18/ 2019.10.18 - 2022.10.18	1.984.237	1.943.937	0,87%
ISPIM 7.75 07/29/49 2017.01.11 - 2027.01.11	902.934	925.758	0,41%
ISTANBUL 6.375 12/09/2025 2020.12.09 - 2025.12.09	917.065	895.097	0,40%
KAZMUNAYGAS NATIONAL 2018.04.24 - 2030.04.24	1.111.202	0	0,00%
LGEN 5.25 03/21/2047 2017.03.21 - 2027.03.21	503.272	538.800	0,24%
MAGYAR 4.6 10/24/2029 2021.12.08 - 2029.10.24	0	783.148	0,35%
MOLHB 1.5 10/08/2027 2020.10.08 - 2027.10.08	265.071	263.967	0,12%
MOLHB 2.625 04/28/23 2016.04.28 - 2023.04.28	2.205.759	0	0,00%
MVMHU 0.875 11/18/2027 2021.11.18 - 2027.11.18	0	444.889	0,20%
NLMKRU 4.5 06/15/23 2016.06.15 - 2023.06.15	798.773	0	0,00%
OTPHB 2.875% 07/15/2029 2019.07.15 - 2029.07.15	8.351.897	8.574.705	3,82%
OTPHB VAR 49-16 2006.11.07 - 2049.11.07	878.341	0	0,00%
PCRK 2024/A 2021.06.24 - 2024.06.24	0	567.813	0,25%
PEMEX 5.95 01/28/2031 2020.01.28 - 2031.01.28	1.092.695	1.173.807	0,52%
PEMEX 6.875 10/16/2025 2020.10.16 - 2025.10.16	661.265	0	0,00%
PEMEX 6.95 01/28/2060 2020.01.28 - 2060.01.28	895.380	931.937	0,42%
PETBRA 5.093 01/15/30 2019.09.18 - 2030.01.15	317.177	0	0,00%
PETBRA 5.6 01/03/2031 2020.06.03 - 2031.01.03	520.628	0	0,00%
PETROBRAS 6.85 06/05/15 2015.06.05 - 2115.06.05	1.674.894	1.469.781	0,66%
PEUGEOT 2 03/23/24 2017.03.23 - 2024.03.23	1.957.301	0	0,00%
PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 2020.06.04 - 2031.09.04	178.378	192.984	0,09%
QATAR PETROLEUM 2.25 07/ 2021.07.12 - 2031.07.12	0	326.753	0,15%
QATAR PETROLEUM 3.3 07/1 2021.07.12 - 2051.07.12	0	1.367.593	0,61%
SAUDI ARAMCO 1.625 11/24/2 2020.11.24 - 2025.11.24	426.545	0	0,00%
SAUDI ARAMCO 2.25 11/24/20 2020.11.24 - 2030.11.24	1.365.849	0	0,00%
SAUDI ARAMCO 3.25 11/24/20 2020.11.24 - 2050.11.24	711.636	751.659	0,34%
SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/20 2020.11.24 - 2070.11.24	409.186	432.147	0,19%
SID BANKA 0.125% 07/08/202 2020.07.08 - 2025.07.08	738.487	0	0,00%
SYNGENTA FINANCE NV 3.9 2018.04.24 - 2021.04.23	153.822	0	0,00%
SYNGENTA FINANCE NV 4.8 2018.04.24 - 2025.04.24	331.595	361.647	0,16%
SYNGENTA FINANCE NV 5.1 2018.04.24 - 2028.04.24	247.075	283.665	0,13%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2021.01.01	Időszak záró állománya 2021.12.31	Megoszlás (%)
SYNGENTA FINANCE NV 5.6' 2018.04.24 - 2048.04.24	330.631	413.247	0,18%
TOTAL 3.369 12/29/49 2016.10.06 - 2026.10.06	621.541	607.970	0,27%
UNICAJA BANCO SA 4.875 PE 2021.11.18 - 2170.02.18	0	368.862	0,16%
UNICREDIT SPA 0.8 07/05/202 2021.07.05 - 2029.07.05	0	1.111.566	0,50%
UNICREDIT SPA 2.2 07/22/202 2020.07.22 - 2027.07.22	3.329.780	0	0,00%
UNIQA 1.375 07/09/2030 2020.07.09 - 2030.07.09	320.479	0	0,00%
UNIQA 3.25 10/09/2035 2020.07.09 - 2025.07.09	194.832	0	0,00%
VOLKSWAGEN GROUP 0.75 1 2020.11.24 - 2022.11.23	746.635	0	0,00%
VOLKSWAGEN GROUP 0.875 2020.11.24 - 2023.11.22	748.002	0	0,00%
VOLKSWAGEN GROUP 1.25 1 2020.11.24 - 2025.11.24	749.935	0	0,00%
VOLKSWAGEN GROUP 1.625 2020.11.24 - 2027.11.24	599.996	0	0,00%
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2 2019.07.11 - 2022.07.11	1.684.265	1.692.607	0,75%
WINGHOLDING ZRT 4 08/07/2 2018.08.07 - 2021.08.07	920.430	0	0,00%
YKBNK 7.875 01/22/2031 2021.01.22 - 2031.01.22	0	328.135	0,15%
ZURICH FINANCE IRELAND 2021.01.19 - 2051.04.19	0	972.501	0,43%
ZURNVX 5.625 06/24/46 2016.03.24 - 2046.06.24	536.963	560.992	0,25%
Belföldi részvények:	19.255.113	22.519.004	10,04%
MASTERPLAST	396.000	820.000	0,37%
MOL RT	18.854.811	21.695.948	9,67%
OPUS	4.302	3.056	0,00%
Külföldi részvények:	40.481.630	52.209.747	23,27%
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	69.204	38.691	0,02%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE	222.870	263.942	0,12%
DIAMONDBACK ENERGY INC	4.319.149	878	0,00%
DIGI COMMUNICATIONS NV	7.207.964	8.467.779	3,77%
ERSTE BANK STAMM	2.918.583	4.890.237	2,18%
FONDUL PROPRIETATEA SA - .52	0	242.874	0,11%
FONDUL PROPRIETATEA SA - .85	177.989	0	0,00%
MONETA MONEY BANK AS	1.548.009	2.283.459	1,02%
OMV PETROM SA	8.340.659	11.384.108	5,07%
PEKAO	8.720.314	17.633.880	7,86%
PKO BANK	643.539	1.019.587	0,45%
RALFP 4.371 01/23/23	30.350	40.529	0,02%
SBERBANK	208.699	248.296	0,11%
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE	1.667.653	2.301.265	1,03%
VESTAS WIND SYSTEM	3.885.786	2.728.550	1,22%
WIENERBERGER AG	0	477.339	0,21%
WIZZ AIR HOLDINGS PLC	240.483	0	0,00%
YAPI KREDI BANKASI	280.379	188.333	0,08%
Jelzáloglevelek:	355.561	0	0,00%
TJ30NF01 2020.07.31 - 2030.08.21	355.561	0	0,00%
Befektetési jegyek:	15.314.422	16.779.924	7,48%
ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY	7.523.277	6.872.742	3,06%
ADVENTUM SATIS EUR ZK AA	0	2.951.057	1,32%
ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP I	1.829.270	1.023.513	0,46%
BNP EARTH FUND	1.702.388	1.574.796	0,70%
FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP	2.500.444	2.716.412	1,21%
FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A	512.709	535.537	0,24%
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT	1.155.249	1.013.173	0,45%
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.	91.085	92.694	0,04%
Átruházható értékpapírok összesen:	251.567.709	219.328.321	0 97,74%
Egyéb eszközök			
Követelések	1.475.905	8.842.908	3,94%
Aktív időbeli elhatárolások	14.400	47.496	0,02%
Származékos ügyletek értékelési különbözete	-237.577	-5.587.816	-2,49%
Egyéb eszközök összesen:	1.252.728	3.302.588	1,47%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:	260.373.911	224.417.583	100,00%

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyongkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2021.01.01	Időszak záró állománya 2021.12.31	Megoszlás (%)
Kötelezettségek			
1. Hitelállomány:	0	0	0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:			
Alapkezelői díj	316.991	202.350	0,24%
Letétkezelői díj	21.583	15.377	0,02%
Költségként elszámolt egyéb tétel	20.913	15.250	0,02%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség	42.182.386	82.155.042	99,72%
3. Céltartalékok:	0	0	0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:	0	0	0,00%
Kötelezettségek összesen:	42.541.873	82.388.019	100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:	217.832.038	142.029.564	

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	57.987.106.181	45.600.926.870	
--	-----------------------	-----------------------	--

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

	2020.12.31	2021.12.31
Jelen dokumentum alapján:	3,756560	3,114620
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	3,756652	3,118950 *

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

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

IV. Az Alap értékpapír portfóliójának összetétele

Megnevezés	2021.01.01	Megoszl.(%)	2021.12.31	Megoszl.(%)
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	251.567.709	96,61%	219.328.321	97,74%
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:	176.516.544	67,79%	127.819.646	56,95%

A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

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

V. Az Alap eszközeinek alakulása

Megnevezés	2020. december 31- el zárult üzleti év	2021. december 31- el zárult üzleti év
a) befektetésekből származó jövedelem:	-70.445.217	-11.157.810
b) egyéb bevétel:	0	0
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-3.810.044	-2.965.105
d) a letétkezelő díjai:	-87.621	-69.627
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	-130.268	-30.601
bankköltség:	-2.130	-1.185
felügyeleti díj:	-75.432	-61.143
egyéb költség és ráfordítás:	-104.566	-86.363
f) nettó jövedelem:	-74.655.278	-14.371.834
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	-74.655.278	-14.371.834
h) a tőkeszámla változása:	21.726.131	-40.735.445
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése:	-9.615.581	-20.695.195
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)
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. december 31.	-28,23%	57.987.106.181	217.832.038.728	3,756560
2021. január 29.		57.422.688.259		3,696647
2021. február 26.		55.681.458.759		3,434827
2021. március 31.		54.568.053.529		3,440484
2021. április 30.		53.688.161.070		3,342378
2021. május 31.		52.758.636.561		3,367818
2021. június 30.		51.892.323.713		3,298215
2021. július 30.		51.159.624.657		3,231234
2021. augusztus 31.		50.465.575.032		3,244288
2021. szeptember 30.		49.512.111.827		3,377894
2021. október 29.		48.999.134.392		3,257997
2021. november 30.		47.462.625.366		3,047149
2021. december 31.	-17,09%	45.600.926.870	142.029.563.465	3,114620

Az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap 2021. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után -17,09 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

'A' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2021. január	443.316.925	1.007.734.847
2021. február	200.873.667	1.942.103.167
2021. március	445.063.063	1.558.468.293
2021. április	122.016.934	1.001.909.393
2021. május	162.332.664	1.091.857.173
2021. június	84.338.584	950.651.432
2021. július	86.111.190	818.810.246
2021. augusztus	72.361.517	766.411.142
2021. szeptember	56.361.752	1.009.824.957
2021. október	169.299.437	682.276.872
2021. november	60.696.278	1.597.205.304
2021. december	83.084.664	1.332.847.147
Összesen:	1.985.856.675	13.760.099.973

'B' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2021. január	468.644.360	361.647.720
2021. február	150.410.157	191.522.796
2021. március	340.720.873	333.470.482
2021. április	186.657.369	226.475.882
2021. május	59.258.497	637.282.829
2021. június	414.575.499	303.722.828
2021. július	211.150.914	0
2021. augusztus	155.462.247	387.545.969
2021. szeptember	236.898.654	187.332.858
2021. október	560.327.632	418.614.274
2021. november	354.822.329	113.400.973
2021. december	30.895.897	620.743.830
Összesen:	3.169.824.428	3.781.760.441

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.
A nettó eszközérték napi alakulását bemutató grafikon a 4. 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 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 tárgydíszak 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 2021. évben kifizetett összes:

eFt.

Megnevezés	Összeg
Rögzített javadalmazás	677.770
Változó javadalmazás	988.789
Összesen	1.666.560

Az Alap kockázati profiljára lényeges hatást gyakorlók körében 2021. évben kifizetett összes:

eFt.

Megnevezés	Ügyvezetők	Egyéb munkavállalók	Összesen
Kedvezményezett száma	4	12	16
Nyereségrészesedés	0	0	0
Teljes javadalmazás *	270.395	425.624	696.019

*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 tárgydíszakban, sem előző időszakban nem tartalmazott nem likvid jellegű fogva különleges kezelési szabály alá tartozó eszközöket.

b) likviditáskezeléssel kapcsolatos megállapodások bemutatása

Az Alapkezelő az Alap nevében sem tárgydíszakban, 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 díszkontkincstárjegyekkel. Amennyiben ezek után nettó kitétsége 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

	2020.12.31	2021.12.31	Változás 2021/2020
Tőkeáttétel *	432.227.611.644	507.253.746.474	17,3580%

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

XII. Egyéb információk

a) Az Alap illikviddévált eszközeinek bemutatása

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

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

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

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír			Beszerzési ár	Értékkülönböz		Piaci érték
megnevezése	futamideje			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:			85.221.255	935.689	-1.904.245	84.252.699
REPHUN 0.125 09/21/2028	2021.09.21 -	2028.09.21	689.271	258	29.932	719.461
REPHUN 1.5 11/17/2050	2020.11.17 -	2050.11.17	1.197.667	2.388	31.764	1.231.819
ARGENT 0.125 07/09/2040	2020.09.04 -	2049.07.09	694.417	508	-421.079	273.846
ARGENT 1 07/09/2029	2020.09.04 -	2029.07.09	25.553	150	-14.207	11.496
BGB 0.65 06/22/2071	2021.02.09 -	2071.06.22	1.745.879	6.341	-232.481	1.519.739
BRAZIL 4.75 01/14/2050	2019.11.14 -	2050.01.14	461.863	10.872	-26.541	446.194
BTPS 1.5 04/30/2045	2020.10.30 -	2045.04.30	3.909.378	10.509	-98.099	3.821.788
BTPS 2.15 03/01/2072	2021.03.01 -	2072.03.01	14.892.809	107.396	-646.516	14.353.689
EGYPT 5.75 05/29/2024	2020.05.29 -	2024.05.29	508.912	2.709	34.289	545.910
EGYPT 5.8 09/30/2027	2021.09.30 -	2027.09.30	1.575.187	24.067	-5.754	1.593.500
EGYPT 7.3 09/30/2033	2021.09.30 -	2033.09.30	1.516.050	30.291	-14.755	1.531.586
EGYPT 8.75 09/30/2051	2021.09.30 -	2051.09.30	758.025	18.154	-27.400	748.779
EGYPT 8.875 05/29/2050	2020.05.29 -	2050.05.29	473.111	3.920	-28.517	448.514
HELLENIC REP GGB 1.875 03/24/2052	2021.03.24 -	2052.01.24	6.266.332	73.081	-360.745	5.978.668
IVYCST 6.125 06/15/2033	2017.06.15 -	2033.06.15	577.265	1.858	110.641	689.764
LITHUN 0.5 07/28/2050	2020.07.28 -	2050.07.28	4.458.853	10.317	-123.900	4.345.270
MEX 3.375 02/23/31	2016.02.23 -	2031.02.23	703.790	21.291	136.999	862.080
MEX 5 04/27/2051	2020.04.27 -	2051.04.27	989.950	8.834	125.825	1.124.609
PERU 1.862 12/01/2032	2020.12.01 -	2032.12.01	197.184	335	-3.656	193.863
PERU 2.78 12/01/2060	2020.12.01 -	2060.12.01	194.926	500	-8.559	186.867
PERU 3.23 07/28/2121	2020.12.01 -	2121.07.28	194.396	2.941	-11.752	185.585
PGB 1 04/12/2052	2021.02.10 -	2052.04.12	964.948	9.857	41.526	1.016.331
POLAND 2 10/25/46	2016.10.25 -	2046.10.25	5.462.411	16.499	-94.480	5.384.430
ROMANI 2.375 04/19/27	2017.04.19 -	2027.04.19	3.966.919	61.706	-54.633	3.973.992
ROMANI 2.75 02/26/2026	2020.05.26 -	2026.02.26	3.505.326	75.597	-9.586	3.571.337
ROMANI 2.875 05/26/28	2016.05.26 -	2028.05.26	1.191.574	19.183	3.897	1.214.654
ROMANI 3.624 05/26/2030	2020.05.26 -	2030.05.26	3.861.215	76.572	-51.263	3.886.524
ROMANI 3.875 10/29/35	2015.10.29 -	2035.10.29	7.514.831	46.383	-101.662	7.459.552
ROMANI 4.625 04/03/49	2019.04.03 -	2049.04.03	5.308.757	159.558	-87.684	5.380.631
SERBIA 1 09/23/2028	2021.09.23 -	2028.09.23	695.845	2.022	5.019	702.886
SERBIA 2.05 09/23/2036	2021.09.23 -	2036.09.23	1.390.895	8.497	-6.304	1.393.088
SLOREP 0.4875 10/20/2050	2020.10.20 -	2050.10.20	465.125	450	-59.160	406.415
SLOVGB 2.25 06/12/68	2018.06.12 -	2068.06.12	3.169.787	27.705	-37.420	3.160.072
SOAF 5 10/12/46	2016.10.12 -	2046.10.12	381.508	5.421	62.827	449.756
SOAF 5.65 09/27/47	2017.09.27 -	2047.09.27	1.509.704	24.201	56.521	1.590.426
TURKEY 4.625 03/31/2025	2019.01.31 -	2025.03.31	1.190.580	41.941	-564	1.231.957
TURKEY 5.6 11/14/2024	2019.11.14 -	2024.11.14	998.840	7.676	8.818	1.015.334
TURKEY 5.75 05/11/2047	2017.05.11 -	2047.05.11	1.612.172	15.701	-25.586	1.602.287
Vállalati kötvények:			39.855.177	666.523	3.045.247	43.566.947
ALVGR 3.875 12/29/49	2016.09.07 -	2049.12.29	333.720	4.813	55.905	394.438
ASSGEN 3.875 01/31/29	2019.01.29 -	2029.01.29	954.600	39.606	327.273	1.321.479
AXASA 3.375 07/06/2047	2016.03.30 -	2047.07.06	931.323	18.322	309.624	1.259.269
CRBKMO 7.5% 05/10/27	2017.04.05 -	2027.10.05	287.240	5.890	37.750	330.880
DNONO 8.375 05/29/24	2019.05.29 -	2024.05.29	727.550	6.166	117.969	851.685
ENERGO PRO 4 12/07/2022	2017.12.07 -	2022.12.07	1.063.150	3.033	42.699	1.108.882
ENIIM 2.625 PERP 10/13/2020	2020.10.13 -	2169.01.13	627.126	3.715	43.111	673.952
ENIIM 3.375 PERP 07/13/2020	2020.10.13 -	2169.10.13	630.893	4.777	47.855	683.525
GAZPRU 2.949 01/24/2024	2018.11.16 -	2024.01.24	1.936.200	61.177	372.161	2.369.538
GAZPRU 4.25 06/04/24	2017.04.06 -	2024.04.06	5.236.229	53.491	261.629	5.551.349

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír				Értékkülönbség		Piaci érték
megnevezése	futamideje	Beszerzési ár		kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
GTCAPW 2.25 06/23/2026	2021.06.23 - 2026.06.23	698.186		8.735	29.062	735.983
INTL INVST BANK 1.25 1	2019.10.18 - 2022.10.18	1.975.663		5.137	-36.863	1.943.937
ISPIM 7.75 07/29/49	2017.01.11 - 2027.01.11	617.780		27.265	280.713	925.758
ISTANBUL 6.375 12/09/20	2020.12.09 - 2025.12.09	913.182		3.925	-22.010	895.097
LGEM 5.25 03/21/2047	2017.03.21 - 2027.03.21	440.145		7.168	91.487	538.800
MAGYAR 4.6 10/24/2029	2021.12.08 - 2029.10.24	777.145		2.420	3.583	783.148
MOLHB 1.5 10/08/2027	2020.10.08 - 2027.10.08	253.201		902	9.864	263.967
MVMHU 0.875 11/18/2027	2021.11.18 - 2027.11.18	437.701		477	6.711	444.889
OTPHB 2.875% 07/15/2021	2019.07.15 - 2029.07.15	8.513.518		109.444	-48.257	8.574.705
PCRK 2024/A	2021.06.24 - 2024.06.24	533.070		14.482	20.261	567.813
PEMEX 5.95 01/28/2031	2020.01.28 - 2031.01.28	1.051.281		62.812	59.714	1.173.807
PEMEX 6.95 01/28/2060	2020.01.28 - 2060.01.28	721.906		62.887	147.144	931.937
PETROBRAS 6.85 06/05/1	2015.06.05 - 2115.06.05	1.413.037		7.427	49.317	1.469.781
PHOENIX GRP 4.75 09/04	2020.06.04 - 2031.09.04	175.021		2.774	15.189	192.984
QATAR PETROLEUM 2.2	2021.07.12 - 2031.07.12	317.475		3.473	5.805	326.753
QATAR PETROLEUM 3.3	2021.07.12 - 2051.07.12	1.331.721		20.378	15.494	1.367.593
SAUDI ARAMCO 3.25 11/	2020.11.24 - 2050.11.24	705.718		2.590	43.351	751.659
SAUDI ARAMCO 3.5 11/2	2020.11.24 - 2070.11.24	411.798		1.602	18.747	432.147
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2025.04.24	250.830		11.001	99.816	361.647
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2028.04.24	188.122		8.740	86.803	283.665
SYNGENTA FINANCE N°	2018.04.24 - 2048.04.24	250.830		12.764	149.653	413.247
TOTAL 3.369 12/29/49	2016.10.06 - 2026.10.06	461.925		4.445	141.600	607.970
UNICAJA BANCO SA 4.8	2021.11.18 - 2170.02.18	361.530		2.168	5.164	368.862
UNICREDIT SPA 0.8 07/0	2021.07.05 - 2029.07.05	1.052.805		4.367	54.394	1.111.566
WINGHOLDING ZRT 4 07	2019.07.11 - 2022.07.11	1.622.097		31.529	38.981	1.692.607
YKBNK 7.875 01/22/2031	2021.01.22 - 2031.01.22	295.570		11.600	20.965	328.135
ZURICH FINANCE IRELA	2021.01.19 - 2051.04.19	889.500		20.640	62.361	972.501
ZURNVX 5.625 06/24/46	2016.03.24 - 2046.06.24	466.389		14.381	80.222	560.992
Belföldi részvények:				0	2.777.447	22.519.004
MASTERPLAST		920.483		0	-100.483	820.000
MOL RT		18.812.404		0	2.883.544	21.695.948
OPUS		8.670		0	-5.614	3.056
Külföldi részvények:				0	4.526.805	52.209.747
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		16.430		0	22.261	38.691
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE		143.455		0	120.487	263.942
DIAMONDBACK ENERGY INC		879		0	-1	878
DIGI COMMUNICATIONS NV		8.541.744		0	-73.965	8.467.779
ERSTE BANK STAMM		4.858.332		0	31.905	4.890.237
FONDUL PROPRIETATEA SA - .52		89.183		0	153.691	242.874
MONETA MONEY BANK AS		1.508.901		0	774.558	2.283.459
OMV PETROM SA		11.308.748		0	75.360	11.384.108
PEKAO		17.621.000		0	12.880	17.633.880
PKO BANK		680.147		0	339.440	1.019.587
RALFP 4.371 01/23/23		154.405		0	-113.876	40.529
SBERBANK		127.287		0	121.009	248.296
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE		1.458.841		0	842.424	2.301.265
VESTAS WIND SYSTEM		377.704		0	2.350.846	2.728.550
WIENERBERGER AG		457.564		0	19.775	477.339
YAPI KREDI BANKASI		338.322		0	-149.989	188.333

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbség		Piaci érték
		kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Befektetési jegyek:	14.588.507	0	2.191.417	16.779.924
ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY	5.210.080	0	1.662.662	6.872.742
ADVENTUM SATIS EUR ZK AA	2.815.484	0	135.573	2.951.057
ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP I	455.438	0	568.075	1.023.513
BNP EARTH FUND	1.727.743	0	-152.947	1.574.796
FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP	2.249.998	0	466.414	2.716.412
FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A	427.713	0	107.824	535.537
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT	1.000.000	0	13.173	1.013.173
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.	702.051	0	-609.357	92.694
MINDÖSSZESEN:	207.089.438	1.602.212	10.636.671	219.328.321

Határidős deviza ügyletek bemutatása:

2020.12.31-én:	adatok ezerben	határidős ügylet szerződés szerinti értéke		határidős ügylet diszkontált piaci értéke		
		devizában	forintban	devizás érték forintban	forint értéke	eredmény
	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
	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

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

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	
2021.12.31-én:	USD / EUR	-73.612	60.000	-23.975.506	22.144.810	-1.830.696
	USD / EUR	-48.066	40.000	-15.647.941	14.780.022	-867.919
	USD / EUR	-11.890	10.000	-3.871.303	3.693.991	-177.312
	USD / EUR	-9.376	8.000	-3.052.290	2.955.909	-96.381
	RON / EUR	-175.389	35.060	-13.037.833	12.946.273	-91.560
	USD / EUR	28.900	-32.623	10.665.169	-10.625.352	39.817
	USD / EUR	27.000	-32.209	9.968.660	-10.489.873	-521.213
	USD / EUR	-59.184	50.000	-19.268.344	18.472.343	-796.001
	USD / EUR	-27.094	23.000	-8.820.458	8.498.238	-322.220
	USD / EUR	-2.931	2.500	-954.042	923.722	-30.320
	PLN / EUR	-154.371	33.385	-12.365.959	12.327.762	-38.197
	GBP / USD	-9.312	12.949	-4.094.147	4.214.744	120.597
	EUR / HUF	-50.000	18.386.500	-18.504.013	17.963.066	-540.947
	EUR / HUF	-50.000	18.535.000	-18.525.500	17.893.575	-631.925
	USD / HUF	-50.000	15.932.410	-16.226.475	15.388.578	-837.897
	EUR / HUF	-60.000	22.274.214	-22.144.810	22.242.086	97.276
	EUR / HUF	-50.000	18.519.600	-18.451.542	18.509.317	57.775
	EUR / NOK	-9.160	93.952	-3.381.553	3.471.410	89.857
	EUR / HUF	-50.000	18.523.500	-18.524.160	17.893.413	-630.747
	EUR / HUF	-99.750	36.668.599	-36.811.440	36.644.169	-167.271
	EUR / USD	-43.000	48.836	-15.868.591	15.906.104	37.513
	EUR / HUF	-33.000	12.219.174	-12.178.221	12.211.033	32.812
	USD / HUF	-10.000	3.010.994	-3.256.816	3.000.555	-256.261
	USD / HUF	-650	212.338	-211.709	212.197	488
	USD / HUF	-700	228.672	-227.994	228.520	526
	USD / HUF	-6.870	2.221.171	-2.237.529	2.216.491	-21.038
	Összesen:					-7.381.244

Határidős tőzsdei ügyletek bemutatása:

Megnevezés	Eladás /Vétel	Devizanem	Nyitott kontraktus	Piaci ár	Piaci érték devizában	Piaci érték (eFt)
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
UBH2 - EURO BUXL 30Y	Eladás	USD	200	2,067	2.347.389	764.568
UBH2 - EURO BUXL 30Y	Eladás	USD	200	2,067	2.383.642	776.376
WNH2 - US ULTRA BON	Eladás	USD	600	1,971	-1.518.750	-494.672
UBH2 - EURO BUXL 30Y	Eladás	USD	300	2,067	115.557	37.638
NQH2 - NASDAQ 100 E-N	Eladás	USD	200	16.320,750	679.000	221.157
ESH2 - S&P 500 MINI FU	Eladás	USD	1.200	4.758,500	1.560.000	508.108
2021. összesen:						1.813.175

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

Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban):

	Előző év 2020. december 31.	Tárgyév 2021. december 31.
Az Alap által fizetendő fix láb értéke:	446.078.398	488.608.131
Az Alap számára lejáratkor jóváírandó változó lábának értéke:	-486.415.071	-508.355.596
A kamatswap ügylet piaci értéke:	-40.336.673	-19.747.465
Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben:	10.445.311	10.065.000
A mérlegen kívül (0. számlaosztályban) nyilvántartott értékek	1.500.000 USD	1.500.000 USD

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

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

Nyitott 'buy & sell back' ügyletek:

Értékpapír adatai Megnevezése	Névértéke	Devi- za	Vétel dátuma	Vételi érték	Eladás dátuma	Eladási érték	Ügylet hozama
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 05/26/2030	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
2021.12.31-én:							
LITHUN 0.5 07/28/2050	7.200	eFt	2021.12.22	2.493.382	2022.03.23	2.493.382	0
POLAND 2 10/25/46	12.000	eFt	2021.12.22	5.498.461	2022.03.23	5.498.461	0
BNP EARTH FUND	16	eFt	2021.12.23	2.006	2022.01.06	2.006	0
DIGI COMMUNICATIONS	28	eFt	2021.12.29	8.541.744	2022.01.05	8.541.744	0
ERSTE BANK STAMM	321	eFt	2021.12.29	4.858.332	2022.01.05	4.858.332	0
PEKAO	550	eFt	2021.12.29	5.349.755	2022.01.05	5.349.755	0
PEKAO	1.250	eFt	2021.12.29	12.271.245	2022.03.29	12.271.245	0
ROMANI 3.624 05/26/2030	5.860	eFt	2021.12.29	2.453.032	2022.03.29	2.453.032	0
ROMANI 2.375 04/19/27	7.000	eFt	2021.12.29	2.838.752	2022.03.29	2.838.752	0
ROMANI 2.75 02/26/2026	7.443	eFt	2021.12.29	8.202	2022.01.05	8.202	0
BTPS 1.5 04/30/2045	7.500	eFt	2021.12.29	2.694.252	2022.03.29	2.694.252	0
ROMANI 4.625 04/03/49	8.500	eFt	2021.12.29	3.756.965	2022.03.29	3.756.965	0
ROMANI 3.875 10/29/35	12.500	eFt	2021.12.29	5.162.270	2022.03.29	5.162.270	0
BTPS 2.15 03/01/2072	13.500	eFt	2021.12.29	5.027.750	2022.01.05	5.027.750	0
OTPHB 2.875% 07/15/2022	15.000	eFt	2021.12.29	5.896.196	2022.03.29	5.896.196	0
OMV PETROM SA	30.598	eFt	2021.12.29	11.308.748	2022.01.05	11.308.748	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 a tevékenységet záró beszámolóhoz

XV. A mérleghez és eredménykimutatáshoz kapcsolódó kiegészítő megjegyzések

Saját tőke mozgástábla

adatok eFt-ban

Megnevezés	Nyitó egyenleg	Növekedés	Csökkenés	Záró egyenleg
Induló tőke változása:	57.987.106	5.155.682	-17.541.861	45.600.927
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözete:	169.997.925	12.651.763	-41.001.029	141.648.659
Értékelési különbözet:	27.346.262	6.651.067	-27.346.262	6.651.067
Eredménytartalék:	37.156.023	0	-74.655.278	-37.499.255
Tárgyévi eredmény:	-74.655.278	-14.371.834	74.655.278	-14.371.834
Tőkenövekmény összesen:	159.844.932	4.930.996	-68.347.291	96.428.637
Saját tőke összesen:	217.832.038	10.086.678	-85.889.152	142.029.564

Likviditási jelentés

I. Hitelállomány összetétele

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

II. Költségek összetétele

adatok Ft-ban

Költségelem megnevezése	2020. évi költség	2020. évben pénzügyileg realizált	2021. évi költség	2021. évben pénzügyileg realizált
Alapkezelési díj	3.810.044.219	3.493.052.980	2.965.105.167	2.762.755.191
Letétkezelői díj	87.621.332	66.038.965	69.626.534	54.249.279
Bizományosi díj	130.267.823	130.267.823	30.600.937	30.600.937
Bankköltség	2.129.877	2.129.877	1.184.957	1.184.957
Felügyeleti díj	75.432.000	56.651.000	61.143.000	47.798.000
Könyvvizsgálat díja	2.132.330	0	1.905.000	0
Egyéb	0	0	4.647.505	4.647.505
Összesen:	4.107.627.581	3.748.140.645	3.134.213.100	2.901.235.869

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Cash flow kimutatás

adatok ezer Ft-ban

	2020.01.01- 2020.12.31.	2021.01.01- 2021.12.31.
I. Működési cash flow	-137.978.171	-55.426.325
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)	-90.913.014	-32.042.695
3. Elszámolt értékvesztés és visszaírás	0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet	-9.615.581	-20.695.195
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete	0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye	-69.668.188	-55.829.677
8. Befektetett eszközök állományváltozása	0	0
9.1. Követelések változása	18.340.945	-7.367.003
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása	8.693.423	15.344.956
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása	16.131.264	39.846.146
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása	0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása	-13.726	-33.096
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása	-11.855.452	0
Származékos ügyletek állományváltozása	922.158	5.350.239
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás	121.643.514	90.394.970
17. Értékpapírok beszerzése -	-1.546.468.226	-2.056.633.668
18. Értékpapírok eladása, beváltása +	1.651.854.004	2.129.357.777
19. Kapott hozamok +	16.257.736	17.670.861
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás	21.726.131	-40.735.445
20. Befektetési jegy kibocsátás +	74.058.134	17.807.445
22. Befektetési jegy visszavásárlása -	-52.332.003	-58.542.890
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -	0	0
IV. Pénzeszközök változása	5.391.474	-5.766.800
Pénzeszközök nyitó értéke	2.162.000	7.553.474
Pénzeszközök záró értéke	7.553.474	1.786.674

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.
4. A megszűnés napján fennálló követelések/kötelezettségek a fordulónap után rendezésre kerültek.

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

Tárgnap (T):	2021.12.31
Saját tőke:	142.029.563.465
Egy jegyre jutó NEÉ:	3,114620
Darabszám:	45.600.926.870

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:		82.388.019	100,00
Alapkezelői díj		202.350	0,24
Letétkezelői díj		15.377	0,02
Költségmentes elszámolt egyéb tétel		15.250	0,02
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		82.155.042	99,72
I/3. Céltartalékok:		0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		0	0,00
Kötelezettségek összesen:		82.388.019	100,00

II. ESZKÖZÖK				Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):				1.786.674	0,80
II/2. Egyéb követelés:				8.842.908	3,94
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):	Bank	Devizanem	Futamidő	0	0,00
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:				0	0,00
II/4. Értékpapírok (összes):	Devizanem	Névérték devizában		219.328.321	97,73
II/4.1. Állampapírok (összes):				84.252.699	37,52
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):				1.951.280	0,87
REPHUN 0.125 09/21/2028 államkötvény	EUR	2.000.000		719.461	0,32
REPHUN 1.5 11/17/2050 államkötvény	EUR	3.500.000		1.231.819	0,55
II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes):				82.301.419	36,65
ARGENT 0.125 07/09/2046 államkötvény	USD	2.589.900		273.846	0,12
ARGENT 1 07/09/2029 államkötvény	USD	95.367		11.496	0,01
BGB 0.65 06/22/2071 államkötvény	EUR	5.000.000		1.519.739	0,68
BRAZIL 4.75 01/14/2050 államkötvény	USD	1.500.000		446.194	0,20
BTPS 1.5 04/30/2045 államkötvény	EUR	11.000.000		3.821.788	1,70
BTPS 2.15 03/01/2072 államkötvény	EUR	40.500.000		14.353.689	6,40
EGYPT 5.75 05/29/2024 államkötvény	USD	1.600.000		545.910	0,24
EGYPT 5.8 09/30/2027 államkötvény	USD	5.000.000		1.593.500	0,71
EGYPT 7.3 09/30/2033 államkötvény	USD	5.000.000		1.531.586	0,68
EGYPT 8.75 09/30/2051 államkötvény	USD	2.500.000		748.779	0,33
EGYPT 8.875 05/29/2050 államkötvény	USD	1.500.000		448.514	0,20
HELLENIC REP GGB 1.875 01/24/2052 államkötvén	EUR	16.250.000		5.978.668	2,66
IVYCST 6.125 06/15/2033 államkötvény	USD	2.000.000		689.764	0,31
LITHUN 0.5 07/28/2050 államkötvény	EUR	13.000.000		4.345.270	1,94
MEX 3.375 02/23/31 államkötvény	EUR	2.000.000		862.080	0,38
MEX 5 04/27/2051 államkötvény	USD	3.000.000		1.124.609	0,50
PERU 1.862 12/01/2032 államkötvény	USD	650.000		193.863	0,09
PERU 2.78 12/01/2060 államkötvény	USD	650.000		186.867	0,08
PERU 3.23 07/28/2121 államkötvény	USD	650.000		185.585	0,08
PGB 1 04/12/2052 államkötvény	EUR	3.000.000		1.016.331	0,45

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

POLAND 2 10/25/46 államkötvény	EUR	12.000.000	5.384.430	2,40
ROMANI 2.375 04/19/27 államkötvény	EUR	10.000.000	3.973.992	1,77
ROMANI 2.75 02/26/2026 államkötvény	EUR	8.800.000	3.571.337	1,59
ROMANI 2.875 05/26/28 államkötvény	EUR	3.000.000	1.214.654	0,54
ROMANI 3.624 05/26/2030 államkötvény	EUR	9.500.000	3.886.524	1,73
ROMANI 3.875 10/29/35 államkötvény	EUR	18.500.000	7.459.552	3,32
ROMANI 4.625 04/03/49 államkötvény	EUR	12.500.000	5.380.631	2,40
SERBIA 1 09/23/2028 államkötvény	EUR	2.000.000	702.886	0,31
SERBIA 2.05 09/23/2036 államkötvény	EUR	4.100.000	1.393.088	0,62
SLOREP 0.4875 10/20/2050 államkötvény	EUR	1.250.000	406.415	0,18
SLOVGB 2.25 06/12/68 államkötvény	EUR	6.000.000	3.160.072	1,41
SOAF 5 10/12/46 államkötvény	HUF	1.500	449.756	0,20
SOAF 5.65 09/27/47 államkötvény	USD	5.000.000	1.590.426	0,71
TURKEY 4.625 03/31/2025 államkötvény	EUR	3.250.000	1.231.957	0,55
TURKEY 5.6 11/14/2024 államkötvény	USD	3.200.000	1.015.334	0,45
TURKEY 5.75 05/11/2047 államkötvény	USD	6.000.000	1.602.287	0,71
II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.:			43.566.947	19,42
II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			43.566.947	19,42
ALVGR 3.875 12/29/49 kötvény	USD	1.200.000	394.438	0,18
ASSGEN 3.875 01/31/29 kötvény	EUR	3.000.000	1.321.479	0,59
AXASA 3.375 07/06/2047 kötvény	EUR	3.000.000	1.259.269	0,56
CRBKMO 7.5% 05/10/27 kötvény	USD	1.000.000	330.880	0,15
DNONO 8.375 05/29/24 kötvény	USD	2.500.000	851.685	0,38
ENERGO PRO 4 12/07/2022 kötvény	EUR	3.000.000	1.108.882	0,49
ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 kötvény	EUR	1.750.000	673.952	0,30
ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 kötvény	EUR	1.750.000	683.525	0,30
GAZPRU 2.949 01/24/2024 kötvény	EUR	6.000.000	2.369.538	1,06
GAZPRU 4.25 06/04/24 kötvény	GBP	12.000.000	5.551.349	2,47
GTCAPW 2.25 06/23/2026 kötvény	EUR	2.000.000	735.983	0,33
INTL INVST BANK 1.25 10/18/2022 kötvény	HUF	2.000.000	1.943.937	0,87
ISPIM 7.75 07/29/49 kötvény	EUR	2.000.000	925.758	0,41
ISTANBUL 6.375 12/09/2025 kötvény	USD	3.000.000	895.097	0,40
LGEN 5.25 03/21/2047 kötvény	USD	1.500.000	538.800	0,24
MAGYAR 4.6 10/24/2029 kötvény	HUF	800.000	783.148	0,35
MOLHB 1.5 10/08/2027 kötvény	EUR	700.000	263.967	0,12
MVMHU 0.875 11/18/2027 kötvény	EUR	1.225.000	444.889	0,20
OTPHB 2.875% 07/15/2029 kötvény	EUR	22.150.000	8.574.705	3,82
PCRK 2024/A kötvény	EUR	1.500.000	567.813	0,25
PEMEX 5.95 01/28/2031 kötvény	USD	3.500.000	1.173.807	0,52
PEMEX 6.95 01/28/2060 kötvény	USD	3.000.000	931.937	0,42
PETROBRAS 6.85 06/05/15 kötvény	HUF	4.500	1.469.781	0,65
PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 kötvény	USD	550.000	192.984	0,09
QATAR PETROLEUM 2.25 07/12/2031 kötvény	USD	1.000.000	326.753	0,15
QATAR PETROLEUM 3.3 07/12/2051 kötvény	USD	4.000.000	1.367.593	0,61
SAUDI ARAMCO 3.25 11/24/2050 kötvény	USD	2.350.000	751.659	0,34
SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/2070 kötvény	USD	1.350.000	432.147	0,19
SYNGENTA FINANCE NV 4.892% 04/24/2025 kötv	USD	1.000.000	361.647	0,16
SYNGENTA FINANCE NV 5.182% 04/24/2028 kötv	USD	750.000	283.665	0,13
SYNGENTA FINANCE NV 5.676% 04/24/2048 kötv	USD	1.000.000	413.247	0,18
TOTAL 3.369 12/29/49 kötvény	EUR	1.500.000	607.970	0,27
UNICAJA BANCO SA 4.875 PERP kötvény	EUR	1.000.000	368.862	0,16
UNICREDIT SPA 0.8 07/05/2029 kötvény	EUR	3.000.000	1.111.566	0,50
WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2022 kötvény	EUR	4.481.000	1.692.607	0,75
YKBNK 7.875 01/22/2031 kötvény	USD	1.000.000	328.135	0,15

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

ZURICH FINANCE IRELAND 3 04/19/2051 kötvény	USD	3.000.000	972.501	0,43
ZURNVX 5.625 06/24/46 kötvény	USD	1.500.000	560.992	0,25
II/4.3. Részvények (összes):			74.728.751	33,31
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			22.519.004	10,04
MASTERPLAST részvény	HUF	20.000	820.000	0,37
MOL RT részvény	HUF	1.076.188	21.695.948	9,67
OPUS részvény	HUF	371	3.056	0,00
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):			52.209.747	23,27
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR részvény	USD	0	38.691	0,02
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE részvény	RON	200.000	263.942	0,12
DIAMONDBACK ENERGY INC részvény	USD	0	878	0,00
DIGI COMMUNICATIONS NV részvény	RON	27.700	8.467.779	3,77
ERSTE BANK STAMM részvény	EUR	320.500	4.890.237	2,18
FONDUL PROPRIETATEA SA - .52 részvény	RON	851.187	242.874	0,11
MONETA MONEY BANK AS részvény	CZK	1.641.300	2.283.459	1,02
OMV PETROM SA részvény	RON	30.597.968	11.384.108	5,07
PEKAO részvény	PLN	1.800.000	17.633.880	7,86
PKO BANK részvény	PLN	282.600	1.019.587	0,45
RALFP 4.371 01/23/23 részvény	EUR	500.000	40.529	0,02
SBERBANK részvény	RUB	583.200	248.296	0,11
SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE részvény	RON	791.400	2.301.265	1,03
VESTAS WIND SYSTEM részvény	DKK	55.000	2.728.550	1,22
WIENERBERGER AG részvény	EUR	40.000	477.339	0,21
YAPI KREDI BANKASI részvény	TRY	2.292.994	188.333	0,08
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):			16.779.924	7,48
II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			16.779.924	7,48
ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY	EUR	16.000.000	6.872.742	3,06
ADVENTUM SATIS EUR ZK AA	EUR	8.000.000	2.951.057	1,32
ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP I	EUR	1.464.147	1.023.513	0,46
BNP EARTH FUND	USD	39.912	1.574.796	0,70
FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP	HUF	2.399.658	2.716.412	1,21
FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A	EUR	1.300.000	535.537	0,24
OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT	HUF	1.037.218	1.013.173	0,45
PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S.	EUR	2.326	92.694	0,04
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):			47.496	0,02
II/6. Származékos ügyletek értékelési különbözete			-5.587.816	-2,49
Eszközök összesen:			224.417.583	100,00

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

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2

Kelt:

BUDAPEST, 2022. április 28.



Köves Benedek Balázs
vezérigazgató
OTP Alapkezelő Zrt.

OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Kibocsátói Nyilatkozat :

Az Alap alapkezelői feladatait ellátó OTP Alapkezelő Zrt. (székhely: 1026 Budapest, Riadó utca 1-3.; cégjegyzékszám: 01-10-043959, adószám: 11766199-4-41, továbbiakban Alapkezelő) képviselőjében, amely olyan nyilvános, zártvégű befektetési alapokat is létrehozó és kezelő gazdasági társaság, amely a nyilvánosan forgalomba hozott értékpapírokkal kapcsolatos tájékoztatási kötelezettség részletes szabályairól szóló 24/2008. (VIII. 15.) PM rendelet (továbbiakban "PM Rendelet") 1. paragrafusa értelmében az általa létrehozott és kezelt nyilvános, zártvégű befektetési alapok (továbbiakban Alapok) tekintetében tájékoztatási kötelezettség teljesítésére kötelezett jogi személynek minősül, az alábbi nyilatkozatot tesszük

A PM Rendelet 1. melléklet 2.4 pontja alapján kijelentjük, hogy

- az alkalmazható számviteli jogszabályok és előírások alapján, az Alapok éves beszámolóit valós és megbízható képet adnak az Alapok eszközeiről, kötelezettségeiről, pénzügyi helyzetéről, valamint nyereségéről és veszteségéről, továbbá
- az Alapok Üzleti-Vezetőségi jelentése megbízható képet ad a kibocsátó helyzetéről, fejlődéséről és teljesítményéről, ismertetve a főbb kockázatokat és bizonytalansági tényezőket.

Kelt: BUDAPEST, 2022. április 28.

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.



Köves Benedek Balázs
vezérigazgató
OTP Alapkezelő Zrt.