



OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Éves jelentés a 2022. december 31-én zárult üzleti évről

Pénzügyi év: 2022. január 1-től
2022. 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 2021. december 31. | Tárgyév 2022. 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 | 229.957.903 | 144.118.236 |
| 09. | I. Követelések | 8.842.908 | 8.070.036 |
| 10. | 1. Követelések | 8.842.908 | 8.070.036 |
| 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 | 219.328.321 | 118.501.082 |
| 15. | 1. Értékpapírok | 207.089.438 | 120.004.270 |
| 16. | 2. Értékpapírok értékelési különbözete | 12.238.883 | -1.503.188 |
| 17. | a) kamatokból, osztalékokból | 1.602.212 | 1.133.619 |
| 18. | b) egyéb | 10.636.671 | -2.636.807 |
| 19. | III. Pénzeszközök | 1.786.674 | 17.547.118 |
| 20. | 1. Pénzeszközök | 1.786.674 | 17.547.118 |
| 21. | 2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete | 0 | 0 |
| 22. | C. Aktív időbeli elhatárolások | 47.496 | 74.462 |
| 23. | 1. Aktív időbeli elhatárolás | 47.496 | 74.462 |
| 24. | 2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-) | 0 | 0 |
| 25. | D. Származékos ügyletek értékelési különbözete | -5.587.816 | 3.686.403 |
| 26. | ESZKÖZÖK (AKTÍVAK) ÖSSZESEN: | 224.417.583 | 147.879.101 |
| 27. | E. Saját tőke | 142.029.564 | 125.973.267 |
| 28. | I. Induló tőke | 45.600.927 | 34.811.505 |
| 29. | 1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke | 191.133.509 | 196.529.520 |
| 30. | 2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-) | -145.532.582 | -161.718.015 |
| 31. | II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény) | 96.428.637 | 91.161.762 |
| 32. | 1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete | -416.594.750 | -451.052.338 |
| 33. | 1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete | 558.243.409 | 569.995.721 |
| 34. | 2. Értékelési különbözet tartaléka | 6.651.067 | 2.183.215 |
| 35. | 3. Előző év(ek) eredménye | -37.499.255 | -51.871.089 |
| 36. | 4. Tárgyévi eredmény | -14.371.834 | 21.906.253 |
| 37. | F. Céltartalékok | 0 | 0 |
| 38. | G. Kötelezettségek | 82.388.019 | 21.905.834 |
| 39. | I. Hosszú lejáratú kötelezettségek | 0 | 0 |
| 40. | II. Rövid lejáratú kötelezettségek | 82.388.019 | 21.905.834 |
| 41. | III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete | 0 | 0 |
| 42. | H. Passzív időbeli elhatárolások | 0 | 0 |
| 43. | FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN: | 224.417.583 | 147.879.101 |

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

| | A tétel megnevezése | Előző év 2021.01.01-2021.12.31. | Tárgyév 2022.01.01-2022.12.31. |
|------------|--|------------------------------------|-----------------------------------|
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 94.061.568 | 165.460.176 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 105.219.378 | 141.204.735 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 3.134.213 | 2.292.334 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 79.811 | 56.854 |
| 06. | VI. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 07. | VII. Tárgyévi eredmény (I - II + III - IV - V - VI) | -14.371.834 | 21.906.253 |

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

Kelt: BUDAPEST, 2023. április 27.

Éder György István
vezérigazgató
OTP Alapkezelő Zrt.

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: 2022.01.01-2022.12.31-ig.
7. Az Alap harmonizációja: nem ÁÉKBV irányelv szerint harmonizált (alternatív befektetési alap, "ABA")
8. A mérlegkészítés időpontja: 2023. április 27.
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 Éder György István, lakóhelye 2100 Gödöllő, Pipacs utca 17. 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: Ernst & Young Könyvvizsgáló Kft. székhelye: 1132 Budapest, Váci út 20. A könyvvizsgálatért felelős személy Bertalan Zsuzsanna, kamarai tagsági száma: 005611.

14. Az Alap 2022. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFÁ-val növelt nettó könyvvizsgálati díja 1.905 eFt.

Az Alappal kapcsolatos további információkat ld. az Alapkezelő honlapján:

<https://www.otpbank.hu/otpalapkezeslo/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 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 különbséget a 32-33. sorban szerepel.

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye 24.255.441 eFt, amely 165.460.176 eFt bevétel és 141.204.735 eFt ráfordítás különbsége. 2.292.334 eFt működési költség és 56.854 eFt egyéb ráfordítás után a nyereség 21.906.253 eFt.

A működési költségeket a likviditási jelentés II. táblázata részletezi, amelyben a "pénzügyileg realizált oszlop" tartalmazza az 2022. 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. Vagyonkimutatás

adatok ezer Ft-ban

| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2022.01.01 | Időszak záró állománya 2022.12.31 | Megoszlás (%) | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | foliószám | 47.824 | 68 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | foliószám | 1.438.342 | 22.650 | 0,02% | |
| OTP Bank Nyrt. USD | foliószám | 296.483 | 1.186.945 | 0,80% | |
| OTP Bank Nyrt. GBP | foliószám | 14 | 363 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. PLN | foliószám | 3.752 | 36 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. CHF | foliószám | 0 | 4 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. AUD | foliószám | 60 | 65 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. NOK | foliószám | 17 | 3 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. RBL | foliószám | 146 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. CZK | foliószám | 0 | 77 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. TRY | foliószám | 0 | 6 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. RON | foliószám | 36 | 36 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. CAD | foliószám | 0 | 126 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. DKK | foliószám | 0 | 16 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2022.12.21 - 2023.01.04 | 0 | 6.404.000 | 4,33% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2022.12.30 - 2023.01.02 | 0 | 3.653.082 | 2,47% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2022.12.30 - 2023.01.02 | 0 | 801.100 | 0,54% | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2022.12.30 - 2023.01.02 | 0 | 5.478.541 | 3,71% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1.786.674 | 17.547.118 | 11,87% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 84.252.699 | | 33.512.363 | 22,65% |
| REPHUN 0.125 09/21/2028 | 2021.09.21 - 2028.09.21 | 719.461 | | 593.955 | 0,40% |
| REPHUN 1.5 11/17/2050 | 2020.11.17 - 2050.11.17 | 1.231.819 | | 0 | 0,00% |
| REPHUN 5 02/22/2027 | 2022.11.21 - 2027.02.22 | 0 | | 715.970 | 0,48% |
| ARGENT 0.125 07/09/2046 | 2020.09.04 - 2046.07.09 | 273.846 | | 252.519 | 0,17% |
| ARGENT 1 07/09/2029 | 2020.09.04 - 2029.07.09 | 11.496 | | 9.979 | 0,01% |
| BGB 0.65 06/22/2071 | 2021.02.09 - 2071.06.22 | 1.519.739 | | 0 | 0,00% |
| BRAZIL 10.25 01/10/2028 | 2007.02.14 - 2028.01.10 | 0 | | 1.385.135 | 0,94% |
| BRAZIL 4.75 01/14/2050 | 2019.11.14 - 2050.01.14 | 446.194 | | 0 | 0,00% |
| BTPS 1.5 04/30/2045 | 2020.10.30 - 2045.04.30 | 3.821.788 | | 0 | 0,00% |
| BTPS 2.15 03/01/2072 | 2021.03.01 - 2072.03.01 | 14.353.689 | | 0 | 0,00% |
| EGYPT 5.75 05/29/2024 | 2020.05.29 - 2024.05.29 | 545.910 | | 0 | 0,00% |
| EGYPT 5.8 09/30/2027 | 2021.09.30 - 2027.09.30 | 1.593.500 | | 1.586.023 | 1,07% |
| EGYPT 7.3 09/30/2033 | 2021.09.30 - 2033.09.30 | 1.531.586 | | 0 | 0,00% |
| EGYPT 8.75 09/30/2051 | 2021.09.30 - 2051.09.30 | 748.779 | | 655.256 | 0,44% |
| EGYPT 8.875 05/29/2050 | 2020.05.29 - 2050.05.29 | 448.514 | | 387.113 | 0,26% |
| HELLENIC REP GGB 1.875 01/ | 2021.03.24 - 2052.01.24 | 5.978.668 | | 0 | 0,00% |
| IVYCST 6.125 06/15/2033 | 2017.06.15 - 2033.06.15 | 689.764 | | 0 | 0,00% |
| LITHUN 0.5 07/28/2050 | 2020.07.28 - 2050.07.28 | 4.345.270 | | 2.189.360 | 1,48% |
| MEX 3.375 02/23/31 | 2016.02.23 - 2031.02.23 | 862.080 | | 0 | 0,00% |
| MEX 5 04/27/2051 | 2020.04.27 - 2051.04.27 | 1.124.609 | | 0 | 0,00% |
| PERU 1.862 12/01/2032 | 2020.12.01 - 2032.12.01 | 193.863 | | 179.569 | 0,12% |
| PERU 2.78 12/01/2060 | 2020.12.01 - 2060.12.01 | 186.867 | | 144.406 | 0,10% |
| PERU 3.23 07/28/2121 | 2020.12.01 - 2121.07.28 | 185.585 | | 146.812 | 0,10% |
| PGB 1 04/12/2052 | 2021.02.10 - 2052.04.12 | 1.016.331 | | 0 | 0,00% |
| POLAND 2 10/25/46 | 2016.10.25 - 2046.10.25 | 5.384.430 | | 3.443.443 | 2,33% |
| ROMANI 2.125 03/07/2028 | 2022.02.07 - 2028.03.07 | 0 | | 1.556.791 | 1,05% |
| ROMANI 2.375 04/19/27 | 2017.04.19 - 2027.04.19 | 3.973.992 | | 3.648.489 | 2,47% |
| ROMANI 2.75 02/26/2026 | 2020.05.26 - 2026.02.26 | 3.571.337 | | 1.862.855 | 1,26% |
| ROMANI 2.875 05/26/28 | 2016.05.26 - 2028.05.26 | 1.214.654 | | 1.060.370 | 0,72% |
| ROMANI 3.624 05/26/2030 | 2020.05.26 - 2030.05.26 | 3.886.524 | | 3.203.057 | 2,17% |
| ROMANI 3.75 02/07/2034 | 2022.02.07 - 2034.02.07 | 0 | | 2.003.167 | 1,35% |
| ROMANI 3.875 10/29/35 | 2015.10.29 - 2035.10.29 | 7.459.552 | | 3.433.443 | 2,32% |
| ROMANI 4.625 04/03/49 | 2019.04.03 - 2049.04.03 | 5.380.631 | | 0 | 0,00% |
| SERBIA 1 09/23/2028 | 2021.09.23 - 2028.09.23 | 702.886 | | 401.592 | 0,27% |
| SERBIA 1.5 06/26/2029 | 2019.06.26 - 2029.06.26 | 0 | | 581.808 | 0,39% |
| SERBIA 2.05 09/23/2036 | 2021.09.23 - 2036.09.23 | 1.393.088 | | 940.564 | 0,64% |
| SLOREP 0.4875 10/20/2050 | 2020.10.20 - 2050.10.20 | 406.415 | | 0 | 0,00% |
| SLOVGB 2.25 06/12/68 | 2018.06.12 - 2068.06.12 | 3.160.072 | | 579.349 | 0,39% |
| SOAF 5 10/12/46 | 2016.10.12 - 2046.10.12 | 449.756 | | 403.248 | 0,27% |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2022.01.01 | Időszak záró állománya 2022.12.31 | Megoszlás (%) |
|-------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|------------------|
| SOAF 5.65 09/27/47 | 2017.09.27 - 2047.09.27 | 1.590.426 | 707.518 | 0,48% |
| TURKEY 4.625 03/31/2025 | 2019.01.31 - 2025.03.31 | 1.231.957 | 0 | 0,00% |
| TURKEY 5.6 11/14/2024 | 2019.11.14 - 2024.11.14 | 1.015.334 | 0 | 0,00% |
| TURKEY 5.75 05/11/2047 | 2017.05.11 - 2047.05.11 | 1.602.287 | 0 | 0,00% |
| US TREASURY BILL 0 05/18/2 | 2022.05.19 - 2023.05.18 | 0 | 1.440.572 | 0,97% |
| Vállalati kötvények: | | 43.566.947 | 26.028.448 | 17,60% |
| ALVGR 3.875 12/29/49 | 2016.09.07 - 2049.12.29 | 0 | 314.573 | 0,21% |
| ASSGEN 3.875 01/31/29 | 2019.01.29 - 2029.01.29 | 0 | 1.188.019 | 0,80% |
| AXASA 3.375 07/06/2047 | 2016.03.30 - 2047.07.06 | 0 | 564.930 | 0,38% |
| DNONO 8.375 05/29/24 | 2019.05.29 - 2024.05.29 | 0 | 443.734 | 0,30% |
| ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 | 2020.10.13 - 2169.01.13 | 0 | 639.936 | 0,43% |
| ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 | 2020.10.13 - 2169.10.13 | 0 | 587.546 | 0,40% |
| GTCAPW 2.25 06/23/2026 | 2021.06.23 - 2026.06.23 | 0 | 593.167 | 0,40% |
| ISPIM 7.75 07/29/49 | 2017.01.11 - 2049.07.29 | 0 | 805.340 | 0,54% |
| ISTANBUL 6.375 12/09/2025 | 2020.12.09 - 2025.12.09 | 0 | 1.006.072 | 0,68% |
| LGEN 5.25 03/21/2047 | 2017.03.21 - 2047.03.21 | 0 | 532.995 | 0,36% |
| MAGYAR 4.6 10/24/2029 | 2021.12.08 - 2029.10.24 | 0 | 584.581 | 0,40% |
| MVMHU 0.875 11/18/2027 | 2021.11.18 - 2027.11.18 | 0 | 809.704 | 0,55% |
| OTPHB 2.875% 07/15/2029 | 2019.07.15 - 2029.07.15 | 0 | 5.018.208 | 3,39% |
| OTPHB 5.5 07/13/2025 | 2022.07.13 - 2025.07.13 | 0 | 1.306.612 | 0,88% |
| OTPHB 7.35 03/04/2026 | 2022.12.01 - 2026.03.04 | 0 | 289.949 | 0,20% |
| PCRK 2024/A | 2021.06.24 - 2024.06.24 | 0 | 589.816 | 0,40% |
| PEMEX 5.95 01/28/2031 | 2020.07.28 - 2031.01.28 | 0 | 673.726 | 0,46% |
| PEMEX 6.95 01/28/2060 | 2020.07.28 - 2060.01.28 | 0 | 789.118 | 0,53% |
| PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 | 2020.06.04 - 2031.09.04 | 0 | 194.261 | 0,13% |
| SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/2070 | 2020.11.24 - 2070.11.24 | 0 | 346.945 | 0,23% |
| SYNGENTA FINANCE NV 4.8% | 2018.04.24 - 2025.04.24 | 0 | 377.439 | 0,26% |
| SYNGENTA FINANCE NV 5.1% | 2018.04.24 - 2028.04.24 | 0 | 277.893 | 0,19% |
| SYNGENTA FINANCE NV 5.6% | 2018.04.24 - 2048.04.24 | 0 | 332.585 | 0,23% |
| TOTAL 3.369 12/29/49 | 2016.10.06 - 2049.12.29 | 0 | 566.934 | 0,38% |
| UNICAJA BANCO SA 4.875 PE | 2021.11.18 - 2170.02.18 | 0 | 293.158 | 0,20% |
| UNICREDIT SPA 0.8 07/05/202 | 2021.07.05 - 2029.07.05 | 0 | 484.614 | 0,33% |
| YKBNK 7.875 01/22/2031 | 2021.01.22 - 2031.01.22 | 0 | 369.085 | 0,25% |
| ZURICH FINANCE IRELAND | 2021.01.19 - 2051.04.19 | 0 | 889.002 | 0,60% |
| ZURNVX 5.625 06/24/46 | 2016.03.24 - 2046.06.24 | 0 | 568.662 | 0,38% |
| CRBKMO 7.5% 05/10/27 | 2017.04.05 - 2027.10.05 | 0 | 102.990 | 0,07% |
| GAZPRU 4.25 06/04/24 | 2017.04.06 - 2024.04.06 | 0 | 2.309.396 | 1,56% |
| IBRD 5.75 01/14/2028 BRL | 2021.01.15 - 2028.01.14 | 0 | 481.890 | 0,33% |
| MOLHB 1.5 10/08/2027 | 2020.10.08 - 2027.10.08 | 0 | 233.162 | 0,16% |
| PETROBRAS 6.85 06/05/15 | 2015.06.05 - 2115.06.05 | 0 | 1.444.731 | 0,98% |
| RALFP 4.371 01/23/23 | 2017.05.23 - 2032.02.28 | 0 | 17.675 | 0,01% |
| ALVGR 3.875 12/29/49 | 2016.09.07 - 2049.12.29 | 394.438 | 0 | 0,00% |
| ASSGEN 3.875 01/31/29 | 2019.01.29 - 2029.01.29 | 1.321.479 | 0 | 0,00% |
| AXASA 3.375 07/06/2047 | 2016.03.30 - 2047.07.06 | 1.259.269 | 0 | 0,00% |
| CRBKMO 7.5% 05/10/27 | 2017.04.05 - 2027.10.05 | 330.880 | 0 | 0,00% |
| DNONO 8.375 05/29/24 | 2019.05.29 - 2024.05.29 | 851.685 | 0 | 0,00% |
| ENERGO PRO 4 12/07/2022 | 2017.12.07 - 2022.12.07 | 1.108.882 | 0 | 0,00% |
| ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 | 2020.10.13 - 2169.01.13 | 673.952 | 0 | 0,00% |
| ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 | 2020.10.13 - 2169.10.13 | 683.525 | 0 | 0,00% |
| GAZPRU 2.949 01/24/2024 | 2018.11.16 - 2024.01.24 | 2.369.538 | 0 | 0,00% |
| GAZPRU 4.25 06/04/24 | 2017.04.06 - 2024.04.06 | 5.551.349 | 0 | 0,00% |
| GTCAPW 2.25 06/23/2026 | 2021.06.23 - 2026.06.23 | 735.983 | 0 | 0,00% |
| INTL INVST BANK 1.25 10/18/ | 2019.10.18 - 2022.10.18 | 1.943.937 | 0 | 0,00% |
| ISPIM 7.75 07/29/49 | 2017.01.11 - 2027.01.11 | 925.758 | 0 | 0,00% |
| ISTANBUL 6.375 12/09/2025 | 2020.12.09 - 2025.12.09 | 895.097 | 0 | 0,00% |
| LGEN 5.25 03/21/2047 | 2017.03.21 - 2027.03.21 | 538.800 | 0 | 0,00% |
| MAGYAR 4.6 10/24/2029 | 2021.12.08 - 2029.10.24 | 783.148 | 0 | 0,00% |
| MOLHB 1.5 10/08/2027 | 2020.10.08 - 2027.10.08 | 263.967 | 0 | 0,00% |
| MVMHU 0.875 11/18/2027 | 2021.11.18 - 2027.11.18 | 444.889 | 0 | 0,00% |
| OTPHB 2.875% 07/15/2029 | 2019.07.15 - 2029.07.15 | 8.574.705 | 0 | 0,00% |
| PCRK 2024/A | 2021.06.24 - 2024.06.24 | 567.813 | 0 | 0,00% |
| PEMEX 5.95 01/28/2031 | 2020.01.28 - 2031.01.28 | 1.173.807 | 0 | 0,00% |
| PEMEX 6.95 01/28/2060 | 2020.01.28 - 2060.01.28 | 931.937 | 0 | 0,00% |
| PETROBRAS 6.85 06/05/15 | 2015.06.05 - 2115.06.05 | 1.469.781 | 0 | 0,00% |
| PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 | 2020.06.04 - 2031.09.04 | 192.984 | 0 | 0,00% |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | Időszak nyitó állománya 2022.01.01 | Időszak záró állománya 2022.12.31 | Megoszlás (%) |
|---|---------------------------------------|--------------------------------------|------------------|
| QATAR PETROLEUM 2.25 07/ 2021.07.12 - 2031.07.12 | 326.753 | 0 | 0,00% |
| QATAR PETROLEUM 3.3 07/1 2021.07.12 - 2051.07.12 | 1.367.593 | 0 | 0,00% |
| SAUDI ARAMCO 3.25 11/24/20 2020.11.24 - 2050.11.24 | 751.659 | 0 | 0,00% |
| SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/20 2020.11.24 - 2070.11.24 | 432.147 | 0 | 0,00% |
| SYNGENTA FINANCE NV 4.8 2018.04.24 - 2025.04.24 | 361.647 | 0 | 0,00% |
| SYNGENTA FINANCE NV 5.1 2018.04.24 - 2028.04.24 | 283.665 | 0 | 0,00% |
| SYNGENTA FINANCE NV 5.6 2018.04.24 - 2048.04.24 | 413.247 | 0 | 0,00% |
| TOTAL 3.369 12/29/49 2016.10.06 - 2026.10.06 | 607.970 | 0 | 0,00% |
| UNICAJA BANCO SA 4.875 PE 2021.11.18 - 2170.02.18 | 368.862 | 0 | 0,00% |
| UNICREDIT SPA 0.8 07/05/202 2021.07.05 - 2029.07.05 | 1.111.566 | 0 | 0,00% |
| WINGHOLDING ZRT 4 07/11/2 2019.07.11 - 2022.07.11 | 1.692.607 | 0 | 0,00% |
| YKBNK 7.875 01/22/2031 2021.01.22 - 2031.01.22 | 328.135 | 0 | 0,00% |
| ZURICH FINANCE IRELAND 2021.01.19 - 2051.04.19 | 972.501 | 0 | 0,00% |
| ZURNVX 5.625 06/24/46 2016.03.24 - 2046.06.24 | 560.992 | 0 | 0,00% |
| Belföldi részvények: | 22.519.004 | 477.328 | 0,32% |
| MASTERPLAST | 0 | 475.578 | 0,32% |
| OPUS | 0 | 1.750 | 0,00% |
| MASTERPLAST | 820.000 | 0 | 0,00% |
| MOL RT | 21.695.948 | 0 | 0,00% |
| OPUS | 3.056 | 0 | 0,00% |
| Külföldi részvények: | 52.209.747 | 38.721.451 | 26,20% |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 0 | 992.810 | 0,67% |
| AMREST HOLDINGS SE | 0 | 941.466 | 0,64% |
| AUSTRIA TECHNOLOGIE | 0 | 1.439.363 | 0,97% |
| BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE | 0 | 203.859 | 0,14% |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 0 | 269.941 | 0,18% |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 0 | 1.285 | 0,00% |
| DIGI COMMUNICATIONS NV | 0 | 7.057.185 | 4,77% |
| ERSTE BANK STAMM | 0 | 1.348.938 | 0,91% |
| FIDELITY CHINA SPECIAL SITUATIONS | 0 | 293.549 | 0,20% |
| FONDUL PROPRIETATEA SA - .52 | 0 | 205.444 | 0,14% |
| HALYK SAVINGS BANK-GDR REG S | 0 | 782.234 | 0,53% |
| HELLO GROUP INC -SPN ADR | 0 | 303.625 | 0,21% |
| JD.COM INC-ADR | 0 | 1.054.345 | 0,71% |
| JOYY INC - ADR | 0 | 261.090 | 0,18% |
| JUMBO SA | 0 | 1.915.102 | 1,30% |
| KARDEMIR KARABUK DEMIR-CL D | 0 | 125.421 | 0,09% |
| KASPI.KZ JSC GDR | 0 | 1.076.835 | 0,73% |
| LOGO YAZILIM SANAYI VE TICAR | 0 | 140.242 | 0,10% |
| MERCIALYS | 0 | 19.552 | 0,01% |
| NASPERS LTD-N SHS SPON ADR | 0 | 657.064 | 0,44% |
| NOVATEK | 0 | 28.018 | 0,02% |
| OMV PETROM SA | 0 | 5.655.571 | 3,82% |
| PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | 0 | 305.866 | 0,21% |
| PEKAO | 0 | 3.275.907 | 2,22% |
| PKO BANK | 0 | 168.033 | 0,11% |
| PLUG POWER INC | 0 | 302.066 | 0,20% |
| PROSUS | 0 | 1.779.931 | 1,20% |
| RAIFFEISEN INTERN BH | 0 | 614.384 | 0,42% |
| RENAULT SA | 0 | 1.251.782 | 0,85% |
| SBERBANK | 0 | 5.301 | 0,00% |
| SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE | 0 | 279.064 | 0,19% |
| STELLANTIS NV (FR) | 0 | 1.779.291 | 1,20% |
| STS HOLDING SA | 0 | 88.593 | 0,06% |
| TEAMVIEWER AG | 0 | 880.206 | 0,60% |
| VESTEL BEYAZ | 0 | 795.202 | 0,54% |
| VOLKSWAGEN AG | 0 | 535.867 | 0,36% |
| VONOVIA SE | 0 | 1.270.026 | 0,86% |
| WIENERBERGER AG | 0 | 601.211 | 0,41% |
| YANDEX NV-A (RUS) | 0 | 15.782 | 0,01% |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 38.691 | 0 | 0,00% |
| BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE | 263.942 | 0 | 0,00% |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 878 | 0 | 0,00% |
| DIGI COMMUNICATIONS NV | 8.467.779 | 0 | 0,00% |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

I. Vagyonkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | Időszak nyitó állománya 2022.01.01 | Időszak záró állománya 2022.12.31 | Megoszlás (%) | | |
|---|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------|----------|---------------|
| ERSTE BANK STAMM | 4.890.237 | 0 | 0,00% | | |
| FONDUL PROPRIETATEA SA - .52 | 242.874 | 0 | 0,00% | | |
| MONETA MONEY BANK AS | 2.283.459 | 0 | 0,00% | | |
| OMV PETROM SA | 11.384.108 | 0 | 0,00% | | |
| PEKAO | 17.633.880 | 0 | 0,00% | | |
| PKO BANK | 1.019.587 | 0 | 0,00% | | |
| RALFP 4.371 01/23/23 | 40.529 | 0 | 0,00% | | |
| SBERBANK | 248.296 | 0 | 0,00% | | |
| SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE | 2.301.265 | 0 | 0,00% | | |
| VESTAS WIND SYSTEM | 2.728.550 | 0 | 0,00% | | |
| WIENERBERGER AG | 477.339 | 0 | 0,00% | | |
| YAPI KREDI BANKASI | 188.333 | 0 | 0,00% | | |
| Befektetési jegyek: | 16.779.924 | 19.761.492 | 13,36% | | |
| ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY | 0 | 7.820.242 | 5,29% | | |
| ADVENTUM SATIS EUR ZK AA | 0 | 3.452.547 | 2,33% | | |
| BNP EARTH FUND | 0 | 1.363.874 | 0,92% | | |
| ETF BRAZIL EWZ | 0 | 1.996.476 | 1,35% | | |
| ETF KOREA | 0 | 318.277 | 0,22% | | |
| FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A | 0 | 594.357 | 0,40% | | |
| ISHARES MSCI CHILE ETF | 0 | 915.946 | 0,62% | | |
| KRANESHARES CSI CHINA INTERNET FUND | 0 | 1.928.741 | 1,30% | | |
| LYXOR MSCI CHINA UCITS ETF | 0 | 308.192 | 0,21% | | |
| SPROTT PHYSICAL URANIUM TRUS | 0 | 985.407 | 0,67% | | |
| PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. | 0 | 77.433 | 0,05% | | |
| ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY | 6.872.742 | 0 | 0,00% | | |
| ADVENTUM SATIS EUR ZK AA | 2.951.057 | 0 | 0,00% | | |
| ADVENTUM TRIUM INGATLAN ALAP 1 | 1.023.513 | 0 | 0,00% | | |
| BNP EARTH FUND | 1.574.796 | 0 | 0,00% | | |
| FINEXT OPTIMUM I. RÉSZALAP | 2.716.412 | 0 | 0,00% | | |
| FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A | 535.537 | 0 | 0,00% | | |
| OTP SIGMA BEFJEGY I SOROZAT | 1.013.173 | 0 | 0,00% | | |
| PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. | 92.694 | 0 | 0,00% | | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 219.328.321 | 0 | 118.501.082 | 0 | 80,13% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | 8.842.908 | 8.070.036 | 5,46% | | |
| Aktív időbeli elhatárolások | 47.496 | 74.462 | 0,05% | | |
| Származékos ügyletek értékelési különbözete | -5.587.816 | 3.686.403 | 2,49% | | |
| Egyéb eszközök összesen: | 3.302.588 | 11.830.901 | 8,00% | | |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 224.417.583 | 147.879.101 | 100,00% | | |
| Kötelezettségek | | | | | |
| 1. Hitelállomány: | 0 | 0 | 0,00% | | |
| 2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek: | | | | | |
| Alapkezelői díj | 202.350 | 176.699 | 0,81% | | |
| Letétkezelői díj | 15.377 | 15.240 | 0,07% | | |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel | 15.250 | 12.606 | 0,06% | | |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | 82.155.042 | 21.701.289 | 99,06% | | |
| 3. Céltartalékok: | 0 | 0 | 0,00% | | |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | 0 | 0 | 0,00% | | |
| Kötelezettségek összesen: | 82.388.019 | 21.905.834 | 100,00% | | |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 142.029.564 | 125.973.267 | | | |

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | | |
|---|----------------|----------------|
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 45.600.926.870 | 34.811.505.005 |
|---|----------------|----------------|

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

| | 2021.12.31 | 2022.12.31 |
|--|------------|------------|
| Jelen dokumentum alapján: | 3,114620 | 3,618725 |
| A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján: | 3,118950 | 3,640716 * |

*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 | 2022.01.01 | Megoszl.(%) | 2022.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|-------------|-------------|-------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 219.328.321 | 97,73% | 118.501.082 | 80,13% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| <i>a fentiekből:</i> | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 127.819.646 | 56,96% | 59.540.811 | 40,25% |

A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

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

V. Az Alap eszközeinek alakulása

| Megnevezés | 2021. december 31- el zárult üzleti év | 2022. december 31- el zárult üzleti év |
|---|---|---|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | -11.157.810 | 24.255.441 |
| b) egyéb bevétel: | 0 | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | -2.965.105 | -2.088.172 |
| d) a letétkezelő díjai: | -69.627 | -61.363 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| bizományosi díj: | -30.601 | -94.061 |
| bankköltség: | -1.185 | -2.709 |
| felügyeleti díj: | -61.143 | -44.106 |
| egyéb költség és ráfordítás: | -86.363 | -58.777 |
| f) nettó jövedelem: | -14.371.834 | 21.906.253 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 | 0 |
| újra befektetett jövedelem: | -14.371.834 | 21.906.253 |
| h) a tőkeszámla változása: | -40.735.445 | -33.494.698 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -20.695.195 | -4.467.852 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (*) | 0 | 0 |

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

Éves jelentés - OTP 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) | |
|----------------------|------------------------------|--|------------------------------------|---|----------|
| 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. december 31. | -17,09% | 45.600.926.870 | 142.029.563.465 | 3,114620 | |
| 2022. január 31. | | 45.135.442.499 | | 3,282123 | |
| 2022. február 28. | | 44.517.294.653 | | 3,006078 | |
| 2022. március 31. | | 42.182.912.762 | | 2,960955 | |
| 2022. április 29. | | 41.312.496.437 | | 3,074098 | |
| 2022. május 31. | | 40.811.970.982 | | 3,126694 | |
| 2022. június 30. | | 40.598.989.199 | | 3,122896 | |
| 2022. július 29. | | 40.288.996.698 | | 3,064748 | |
| 2022. augusztus 31. | | 39.680.780.747 | | 3,204143 | |
| 2022. szeptember 30. | | 39.021.456.275 | | 3,202455 | |
| 2022. október 28. | | 38.173.442.313 | | 3,167801 | |
| 2022. november 30. | | 37.566.866.842 | | 3,494424 | |
| 2022. december 31. | 16,19% | 34.811.505.005 | | 125.973.267.630 | 3,618725 |

Az OTP Supra Származtatott Befektetési Alap 2022. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után 16,19 % lett.

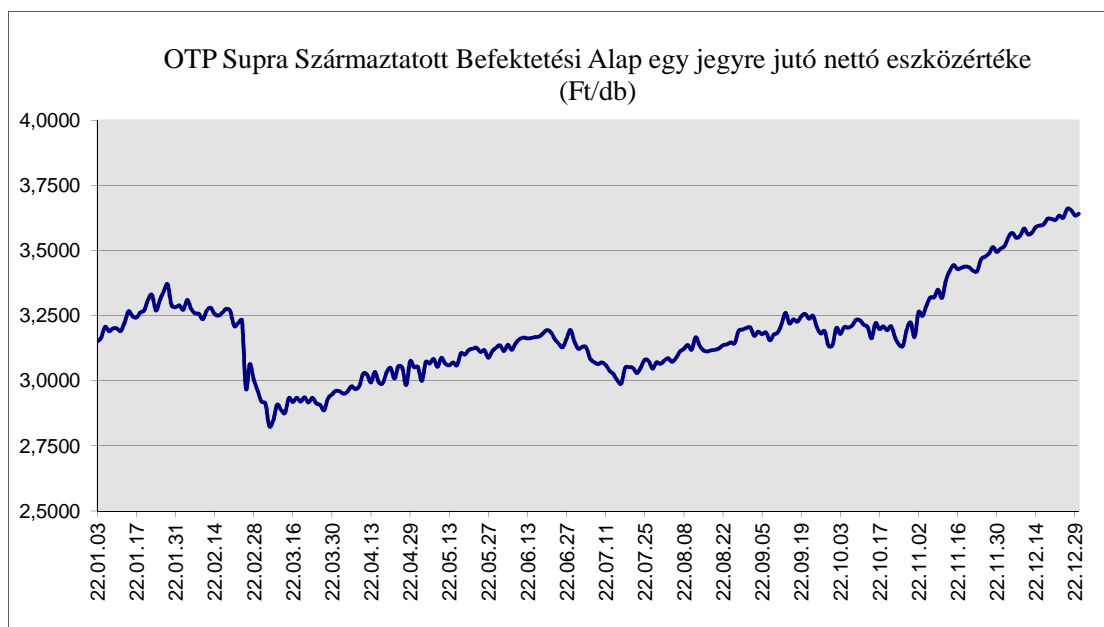
Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

| 'A' sorozat (névérték 1 Ft.) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| 2022. január | 285.663.977 | 751.148.348 |
| 2022. február | 135.021.489 | 753.169.335 |
| 2022. március | 82.370.435 | 2.416.752.326 |
| 2022. április | 75.425.416 | 945.841.741 |
| 2022. május | 107.780.931 | 608.306.386 |
| 2022. június | 153.020.241 | 366.002.024 |
| 2022. július | 195.150.886 | 505.143.387 |
| 2022. augusztus | 138.816.894 | 747.032.845 |
| 2022. szeptember | 67.858.947 | 727.183.419 |
| 2022. október | 50.784.118 | 898.798.080 |
| 2022. november | 99.071.675 | 705.647.146 |
| 2022. december | 243.635.240 | 390.256.811 |
| Összesen: | 1.634.600.249 | 9.815.281.848 |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

| 'B' sorozat (névérték 1 Ft.) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------------------|----------------------------|------------------------------|
| 2022. január | 244.123.693 | 821.075.631 |
| 2022. február | 427.725.987 | 169.873.491 |
| 2022. március | 680.948.150 | 1.259.418.402 |
| 2022. április | 282.600.298 | 535.553.412 |
| 2022. május | 220.091.095 | 324.357.142 |
| 2022. június | 309.940.748 | 80.542.859 |
| 2022. július | 482.928.085 | 746.427.825 |
| 2022. augusztus | 462.258.747 | 366.931.035 |
| 2022. szeptember | 282.638.852 | 523.105.583 |
| 2022. október | 344.979.490 | 558.865.305 |
| 2022. november | 23.176.477 | 536.380.073 |
| 2022. december | 0 | 447.621.130 |
| Összesen: | 3.761.411.622 | 6.370.151.888 |

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.



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 tárgyidőszak folyamán jelentős változás nem történt.

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

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

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

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

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

Az Alapkezelő által 2022. évben kifizetett összes:

eFt.

| Megnevezés | Összeg |
|------------------------|------------------|
| Rögzített javadalmazás | 1.037.785 |
| Változó javadalmazás | 823.865 |
| Összesen | 1.861.650 |

Az Alap kockázati profiljára lényeges hatást gyakorlók körében 2022. évben kifizetett összes:

eFt.

| Megnevezés | Ügyvezetők | Egyéb munkavállalók | Összesen |
|--------------------------|------------|---------------------|----------|
| Kedvezményezetttek száma | 6 | 15 | 21 |
| Nyerésgrészesedés | 0 | 0 | 0 |
| Teljes javadalmazás * | 344.331 | 408.894 | 753.225 |

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

X. Kockázatkezelésre vonatkozó információk

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

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

b) likviditáskezeléssel kapcsolatos megállapodások bemutatása

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

Az Alapkezelő alapvetően éven belül 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 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, összeférhetlenségi, üzletviteli és kockázatkezelési követelményekről szóló 79/2014. (III. 14.) Korm. rendelet („79/2014. Korm. rendelet”) 24. paragrafusának megfelelően lett kialakítva.

XI. Tőkeáttétel mértékében bekövetkezett változások

| | 2021.12.31 | 2022.12.31 | Változás 2022/2021 |
|---------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| Tőkeáttétel * | 507.253.746.474 | 2.439.743.819.977 | 380,9711% |

* 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.

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 | |
| Államkötvények: | | 36.543.041 | 576.289 | -3.606.967 | 33.512.363 |
| REPHUN 0.125 09/21/2028 | 2021.09.21 - 2028.09.21 | 613.752 | 280 | -20.077 | 593.955 |
| REPHUN 5 02/22/2027 | 2022.11.21 - 2027.02.22 | 718.514 | 4.026 | -6.570 | 715.970 |
| ARGENT 0.125 07/09/2040 | 2020.09.04 - 2046.07.09 | 694.417 | 1.190 | -443.088 | 252.519 |
| ARGENT 1 07/09/2029 | 2020.09.04 - 2029.07.09 | 25.553 | 350 | -15.924 | 9.979 |
| BRAZIL 10.25 01/10/2028 | 2007.02.14 - 2028.01.10 | 1.330.634 | 69.843 | -15.342 | 1.385.135 |
| EGYPT 5.8 09/30/2027 | 2021.09.30 - 2027.09.30 | 1.534.947 | 27.759 | 23.317 | 1.586.023 |
| EGYPT 8.75 09/30/2051 | 2021.09.30 - 2051.09.30 | 758.025 | 20.939 | -123.708 | 655.256 |
| EGYPT 8.875 05/29/2050 | 2020.05.29 - 2050.05.29 | 473.111 | 4.522 | -90.520 | 387.113 |
| LITHUN 0.5 07/28/2050 | 2020.07.28 - 2050.07.28 | 2.757.344 | 10.052 | -578.036 | 2.189.360 |
| PERU 1.862 12/01/2032 | 2020.12.01 - 2032.12.01 | 197.184 | 386 | -18.001 | 179.569 |
| PERU 2.78 12/01/2060 | 2020.12.01 - 2060.12.01 | 194.926 | 577 | -51.097 | 144.406 |
| PERU 3.23 07/28/2121 | 2020.12.01 - 2121.07.28 | 194.396 | 3.393 | -50.977 | 146.812 |
| POLAND 2 10/25/46 | 2016.10.25 - 2046.10.25 | 3.922.230 | 17.896 | -496.683 | 3.443.443 |
| ROMANI 2.125 03/07/2028 | 2022.02.07 - 2028.03.07 | 1.515.699 | 34.776 | 6.316 | 1.556.791 |
| ROMANI 2.375 04/19/27 | 2017.04.19 - 2027.04.19 | 3.742.387 | 66.932 | -160.830 | 3.648.489 |
| ROMANI 2.75 02/26/2026 | 2020.05.26 - 2026.02.26 | 1.855.605 | 44.727 | -37.477 | 1.862.855 |
| ROMANI 2.875 05/26/28 | 2016.05.26 - 2028.05.26 | 1.075.242 | 20.808 | -35.680 | 1.060.370 |
| ROMANI 3.624 05/26/2030 | 2020.05.26 - 2030.05.26 | 3.341.095 | 83.056 | -221.094 | 3.203.057 |
| ROMANI 3.75 02/07/2034 | 2022.02.07 - 2034.02.07 | 2.020.799 | 86.322 | -103.954 | 2.003.167 |
| ROMANI 3.875 10/29/35 | 2015.10.29 - 2035.10.29 | 3.659.893 | 31.274 | -257.724 | 3.433.443 |
| SERBIA 1 09/23/2028 | 2021.09.23 - 2028.09.23 | 404.969 | 1.520 | -4.897 | 401.592 |
| SERBIA 1.5 06/26/2029 | 2019.06.26 - 2029.06.26 | 557.630 | 6.217 | 17.961 | 581.808 |
| SERBIA 2.05 09/23/2036 | 2021.09.23 - 2036.09.23 | 1.390.895 | 9.217 | -459.548 | 940.564 |
| SLOVGB 2.25 06/12/68 | 2018.06.12 - 2068.06.12 | 938.389 | 10.017 | -369.057 | 579.349 |
| SOAF 5 10/12/46 | 2016.10.12 - 2046.10.12 | 381.508 | 6.253 | 15.487 | 403.248 |
| SOAF 5.65 09/27/47 | 2017.09.27 - 2047.09.27 | 745.508 | 13.957 | -51.947 | 707.518 |
| US TREASURY BILL 0 05 | 2022.05.19 - 2023.05.18 | 1.498.389 | 0 | -57.817 | 1.440.572 |
| Vállalati kötvények: | | 26.459.046 | 557.330 | -987.928 | 26.028.448 |
| ALVGR 3.875 12/29/49 | 2016.09.07 - 2049.12.29 | 333.720 | 5.552 | -24.699 | 314.573 |
| ASSGEN 3.875 01/31/29 | 2019.01.29 - 2029.01.29 | 954.600 | 42.960 | 190.459 | 1.188.019 |
| AXASA 3.375 07/06/2047 | 2016.03.30 - 2047.07.06 | 465.662 | 9.937 | 89.331 | 564.930 |
| DNONO 8.375 05/29/24 | 2019.05.29 - 2024.05.29 | 340.719 | 3.330 | 99.685 | 443.734 |
| ENIIM 2.625 PERP 10/13/20 | 2020.10.13 - 2169.01.13 | 627.126 | 4.030 | 8.780 | 639.936 |
| ENIIM 3.375 PERP 07/13/20 | 2020.10.13 - 2169.10.13 | 630.893 | 5.181 | -48.528 | 587.546 |
| GTCAPW 2.25 06/23/2026 | 2021.06.23 - 2026.06.23 | 698.186 | 9.474 | -114.493 | 593.167 |
| ISPIM 7.75 07/29/49 | 2017.01.11 - 2049.07.29 | 617.780 | 29.575 | 157.985 | 805.340 |
| ISTANBUL 6.375 12/09/20 | 2020.12.09 - 2025.12.09 | 913.182 | 4.527 | 88.363 | 1.006.072 |
| LGEN 5.25 03/21/2047 | 2017.03.21 - 2047.03.21 | 440.145 | 8.268 | 84.582 | 532.995 |
| MAGYAR 4.6 10/24/2029 | 2021.12.08 - 2029.10.24 | 758.571 | 6.957 | -180.947 | 584.581 |
| MVMHU 0.875 11/18/2027 | 2021.11.18 - 2027.11.18 | 909.457 | 1.193 | -100.946 | 809.704 |
| OTPHB 2.875% 07/15/2021 | 2019.07.15 - 2029.07.15 | 5.218.311 | 72.621 | -272.724 | 5.018.208 |
| OTPHB 5.5 07/13/2025 | 2022.07.13 - 2025.07.13 | 1.332.297 | 33.714 | -59.399 | 1.306.612 |
| OTPHB 7.35 03/04/2026 | 2022.12.01 - 2026.03.04 | 295.025 | 463 | -5.539 | 289.949 |
| PCRK 2024/A | 2021.06.24 - 2024.06.24 | 533.070 | 15.708 | 41.038 | 589.816 |
| PEMEX 5.95 01/28/2031 | 2020.07.28 - 2031.01.28 | 671.108 | 45.539 | -42.921 | 673.726 |
| PEMEX 6.95 01/28/2060 | 2020.07.28 - 2060.01.28 | 818.450 | 72.535 | -101.867 | 789.118 |
| PHOENIX GRP 4.75 09/04 | 2020.06.04 - 2031.09.04 | 175.021 | 3.200 | 16.040 | 194.261 |
| SAUDI ARAMCO 3.5 11/2 | 2020.11.24 - 2070.11.24 | 411.798 | 1.848 | -66.701 | 346.945 |
| SYNGENTA FINANCE NV | 2018.04.24 - 2025.04.24 | 250.830 | 12.689 | 113.920 | 377.439 |
| SYNGENTA FINANCE NV | 2018.04.24 - 2028.04.24 | 188.123 | 10.080 | 79.690 | 277.893 |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

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

adatok ezer Ft-ban

| Értékpapír megnevezése | futamideje | Beszerzési ár | Értékkülönbség | | Piaci érték |
|-----------------------------------|-------------------------|-------------------|--------------------------|-----------------------------|-------------------|
| | | | kamatból, osztalékból | egyéb piaci megítélésből | |
| SYNGENTA FINANCE NV | 2018.04.24 - 2048.04.24 | 250.830 | 14.722 | 67.033 | 332.585 |
| TOTAL 3.369 12/29/49 | 2016.10.06 - 2049.12.29 | 461.925 | 4.821 | 100.188 | 566.934 |
| UNICAJA BANCO SA 4.8' | 2021.11.18 - 2170.02.18 | 361.530 | 2.352 | -70.724 | 293.158 |
| UNICREDIT SPA 0.8 07/0: | 2021.07.05 - 2029.07.05 | 526.402 | 2.369 | -44.157 | 484.614 |
| YKBNK 7.875 01/22/2031 | 2021.01.22 - 2031.01.22 | 295.570 | 13.380 | 60.135 | 369.085 |
| ZURICH FINANCE IRELA | 2021.01.19 - 2051.04.19 | 889.500 | 23.807 | -24.305 | 889.002 |
| ZURNVX 5.625 06/24/46 | 2016.03.24 - 2046.06.24 | 466.389 | 16.587 | 85.686 | 568.662 |
| CRBKMO 7.5% 05/10/27 | 2017.04.05 - 2027.10.05 | 287.240 | 6.793 | -191.043 | 102.990 |
| GAZPRU 4.25 06/04/24 | 2017.04.06 - 2024.04.06 | 3.054.713 | 32.050 | -777.367 | 2.309.396 |
| IBRD 5.75 01/14/2028 BRI | 2021.01.15 - 2028.01.14 | 460.230 | 31.523 | -9.863 | 481.890 |
| MOLHB 1.5 10/08/2027 | 2020.10.08 - 2027.10.08 | 253.201 | 979 | -21.018 | 233.162 |
| PETROBRAS 6.85 06/05/1 | 2015.06.05 - 2115.06.05 | 1.413.037 | 8.566 | 23.128 | 1.444.731 |
| RALFP 4.371 01/23/23 | 2017.05.23 - 2032.02.28 | 154.405 | 0 | -136.730 | 17.675 |
| Belföldi részvények: | | 520.964 | 0 | -43.636 | 477.328 |
| MASTERPLAST | | 512.294 | 0 | -36.716 | 475.578 |
| OPUS | | 8.670 | 0 | -6.920 | 1.750 |
| Külföldi részvények: | | 39.154.711 | 0 | -433.260 | 38.721.451 |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | | 974.012 | 0 | 18.798 | 992.810 |
| AMREST HOLDINGS SE | | 860.683 | 0 | 80.783 | 941.466 |
| AUSTRIA TECHNOLOGIE | | 1.587.058 | 0 | -147.695 | 1.439.363 |
| BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE | | 139.069 | 0 | 64.790 | 203.859 |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | | 291.739 | 0 | -21.798 | 269.941 |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | | 879 | 0 | 406 | 1.285 |
| DIGI COMMUNICATIONS NV | | 7.655.422 | 0 | -598.237 | 7.057.185 |
| ERSTE BANK STAMM | | 1.299.857 | 0 | 49.081 | 1.348.938 |
| FIDELITY CHINA SPECIAL SITUATIONS | | 317.577 | 0 | -24.028 | 293.549 |
| FONDUL PROPRIETATEA SA - .52 | | 19.185 | 0 | 186.259 | 205.444 |
| HALYK SAVINGS BANK-GDR REG S | | 687.327 | 0 | 94.907 | 782.234 |
| HELLO GROUP INC -SPN ADR | | 212.059 | 0 | 91.566 | 303.625 |
| JD.COM INC-ADR | | 975.867 | 0 | 78.478 | 1.054.345 |
| JOYY INC - ADR | | 273.174 | 0 | -12.084 | 261.090 |
| JUMBO SA | | 1.526.106 | 0 | 388.996 | 1.915.102 |
| KARDEMIR KARABUK DEMIR-CL D | | 122.869 | 0 | 2.552 | 125.421 |
| KASPI.KZ JSC GDR | | 730.885 | 0 | 345.950 | 1.076.835 |
| LOGO YAZILIM SANAYI VE TICAR | | 103.436 | 0 | 36.806 | 140.242 |
| MERCIALYS | | 16.258 | 0 | 3.294 | 19.552 |
| NASPERS LTD-N SHS SPON ADR | | 616.812 | 0 | 40.252 | 657.064 |
| NOVATEK | | 684.124 | 0 | -656.106 | 28.018 |
| OMV PETROM SA | | 5.405.184 | 0 | 250.387 | 5.655.571 |
| PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | | 212.581 | 0 | 93.285 | 305.866 |
| PEKAO | | 3.401.675 | 0 | -125.768 | 3.275.907 |
| PKO BANK | | 157.710 | 0 | 10.323 | 168.033 |
| PLUG POWER INC | | 589.213 | 0 | -287.147 | 302.066 |
| PROSUS | | 1.838.525 | 0 | -58.594 | 1.779.931 |
| RAIFFEISEN INTERN BH | | 435.968 | 0 | 178.416 | 614.384 |
| RENAULT SA | | 1.238.165 | 0 | 13.617 | 1.251.782 |
| SBERBANK | | 127.287 | 0 | -121.986 | 5.301 |
| SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE | | 195.600 | 0 | 83.464 | 279.064 |
| STELLANTIS NV (FR) | | 1.893.654 | 0 | -114.363 | 1.779.291 |
| STS HOLDING SA | | 96.144 | 0 | -7.551 | 88.593 |
| TEAMVIEWER AG | | 956.324 | 0 | -76.118 | 880.206 |
| VESTEL BEYAZ | | 485.922 | 0 | 309.280 | 795.202 |

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 megnevezése | futamideje | Beszerzési ár | Értékülönbözlet | | Piaci érték |
|-------------------------------------|------------|--------------------|--------------------------|-----------------------------|--------------------|
| | | | kamatból, osztalékból | egyéb piaci megítélésből | |
| VOLKSWAGEN AG | | 614.506 | 0 | -78.639 | 535.867 |
| VONOVIA SE | | 1.334.048 | 0 | -64.022 | 1.270.026 |
| WIENERBERGER AG | | 543.188 | 0 | 58.023 | 601.211 |
| YANDEX NV-A (RUS) | | 534.619 | 0 | -518.837 | 15.782 |
| Befektetési jegyek: | | 17.326.508 | 0 | 2.434.984 | 19.761.492 |
| ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY | | 5.210.080 | 0 | 2.610.162 | 7.820.242 |
| ADVENTUM SATIS EUR ZK AA | | 2.815.484 | 0 | 637.063 | 3.452.547 |
| BNP EARTH FUND | | 1.656.164 | 0 | -292.290 | 1.363.874 |
| ETF BRAZIL EWZ | | 2.269.117 | 0 | -272.641 | 1.996.476 |
| ETF KOREA | | 360.308 | 0 | -42.031 | 318.277 |
| FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A | | 427.713 | 0 | 166.644 | 594.357 |
| ISHARES MSCI CHILE ETF | | 942.346 | 0 | -26.400 | 915.946 |
| KRANESHARES CSI CHINA INTERNET FUND | | 1.634.397 | 0 | 294.344 | 1.928.741 |
| LYXOR MSCI CHINA UCITS ETF | | 310.911 | 0 | -2.719 | 308.192 |
| SPROTT PHYSICAL URANIUM TRUS | | 997.937 | 0 | -12.530 | 985.407 |
| PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. | | 702.051 | 0 | -624.618 | 77.433 |
| MINDÖSSZESEN: | | 120.004.270 | 1.133.619 | -2.636.807 | 118.501.082 |

Határidős deviza ügyletek bemutatása:

| | 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 |

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 | | eredmény |
|-----------------------|-------------------|---|-------------|--|---------------|------------------|
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2022.12.31-én: | USD / NOK | -9.478 | 94.296 | -3.540.846 | 3.577.281 | 36.435 |
| | HUF / USD | -2.272.740 | 6.000 | -2.268.317 | 2.252.994 | -15.323 |
| | HUF / EUR | -8.549.476 | 21.270 | -8.528.688 | 8.511.069 | -17.619 |
| | HUF / USD | -2.257.500 | 6.000 | -2.253.106 | 2.252.994 | -112 |
| | RON / HUF | -86.566 | 7.280.201 | -6.962.696 | 7.175.956 | 213.260 |
| | USD / EUR | 45.591 | -48.000 | 18.235.086 | -18.004.439 | 230.647 |
| | PLN / EUR | 24.534 | -116.080 | 9.809.559 | -9.870.865 | -61.306 |
| | EUR / HUF | -265.000 | 108.404.610 | -106.032.629 | 108.088.451 | 2.055.822 |
| | GBP / EUR | -1.530 | 1.772 | -690.621 | 708.814 | 18.193 |
| | CZK / EUR | -303.830 | 12.436 | -5.024.488 | 4.973.654 | -50.834 |
| | USD / EUR | -7.986 | 7.497 | -2.992.609 | 2.997.295 | 4.686 |
| | USD / EUR | -38.070 | 35.740 | -14.266.042 | 14.289.172 | 23.130 |
| | RON / EUR | -97.656 | 19.790 | -7.890.071 | 7.918.075 | 28.004 |
| | USD / EUR | -3.684 | 3.456 | -1.380.512 | 1.381.794 | 1.282 |
| | USD / EUR | -1.400 | 1.311 | -524.625 | 524.307 | -318 |
| | Összesen: | | | | | 2.465.947 |

Határidős tőzsdei ügyletek bemutatása:

| Megnevezés | Eladás /Vétel | Devizanem | Nyitott kontraktus | Piaci ár | Piaci érték devizában | Piaci érték (eFt) |
|------------------------|------------------|-----------|--------------------|------------|--------------------------|-------------------|
| 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-M | 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 |
| ESH3 - S&P 500 MINI FU | Eladás | USD | 456 | 3.861,000 | -1.128.850 | -424.086 |
| NQH3 - NASDAQ 100 MI | Eladás | USD | 182 | 11.022,250 | -908.180 | -341.185 |
| WNH3 - US ULTRA BON | Eladás | USD | 140 | 1,343 | -83.125 | -31.228 |
| DMH3 - DJ INDUSTRIAL | Eladás | USD | 40 | 33.285,000 | -47.800 | -17.958 |
| DMH3 - DJ INDUSTRIAL | Eladás | USD | 40 | 33.285,000 | -47.800 | -17.958 |
| GCG3 - GOLD 100 OZ FU | Vétel | USD | 20 | 1.826,200 | 106.320 | 39.942 |
| UBH3 - EURO BUXL 30Y | Eladás | USD | 180 | 1,352 | 5.231.547 | 1.965.388 |
| 2022. összesen: | | | | | | 1.172.915 |

Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban):

| | Előző év 2021. december 31. | Tárgyév 2022. december 31. |
|---|--------------------------------|-------------------------------|
| Az Alap által fizetendő fix láb értéke: | 488.608.131 | 11.013.209.205 |
| Az Alap számára lejáratkor jóváírandó változó lábának értéke: | -508.355.596 | -10.966.306.255 |
| A kamatswap ügylet piaci értéke: | -19.747.465 | 46.902.950 |
| Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 10.065.000 | 12.150.105 |
| A mérlegen kívül (0. számlaosztályban) nyilvántartott értékek | 1.500.000 USD | 1.500.000 USD |
| | XXX | 10.000.000.000 Ft |

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

| Értékpapír adatai | | Devi- za | Vétel dátuma | Vételi érték | Eladás dátuma | Eladási érték | Ügylet hozama |
|-------------------------|------------|-------------|-----------------|-----------------|------------------|------------------|------------------|
| Megnevezése | Névértéke | | | | | | |
| 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 COMMUNICATION | 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% 07/15/202 | 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 |
| 2022.12.31-én: | | | | | | | |
| OTPHB 2.875% 07/15/202 | 8.868.000 | EUR | 2022.10.04 | 3.508.548.811 | 2023.01.04 | 3.508.548.811 | 0 |
| ROMANI 3.624 05/26/2030 | 9.500.000 | EUR | 2022.10.04 | 3.217.059.944 | 2023.01.04 | 3.217.059.944 | 0 |
| ROMANI 2.375 04/19/27 | 10.000.000 | EUR | 2022.10.04 | 3.805.028.598 | 2023.01.04 | 3.805.028.598 | 0 |
| STELLANTIS NV (FR) | 2.700 | EUR | 2022.12.13 | 1.550.574.957 | 2023.01.04 | 1.550.574.957 | 0 |
| PROSUS | 3.500 | EUR | 2022.12.13 | 1.895.750.464 | 2023.01.04 | 1.895.750.464 | 0 |
| AUSTRIA TECHNOLOGI | 80.000 | EUR | 2022.12.13 | 1.137.169.292 | 2023.01.04 | 1.137.169.292 | 0 |
| PEKAO | 364.070 | EUR | 2022.12.13 | 2.699.655.738 | 2023.01.04 | 2.699.655.738 | 0 |
| RENAULT SA | 224.333 | EUR | 2022.12.19 | 786.832.114 | 2023.01.04 | 786.832.114 | 0 |

Nyitott 'sell & buy back' ügyletek:

| Értékpapír adatai | | Devi- za | Eladás dátuma | Eladási érték | Vétel dátuma | Vételi érték | Ügylet ráfordítása |
|-------------------------|------------|-------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|
| Megnevezése | Névértéke | | | | | | |
| 2022.12.31-én: | | | | | | | |
| ROMANI 3.624 05/26/2030 | 9.500.000 | EUR | 2022.12.13 | 3.446.461.702 | 2023.01.04 | 3.446.461.702 | 0 |
| ROMANI 2.375 04/19/27 | 10.000.000 | EUR | 2022.12.13 | 3.836.650.108 | 2023.01.04 | 3.836.650.108 | 0 |
| PROSUS | 1.500 | EUR | 2022.12.19 | 786.923.804 | 2023.01.04 | 786.923.804 | 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: | 45.600.927 | 5.396.011 | -16.185.433 | 34.811.505 |
| Tőkenövekmény változásának levezetése: | | | | |
| Jegyforgalmazás értékkülönbözete: | 141.648.659 | 11.752.312 | -34.457.588 | 118.943.383 |
| Értékelési különbözet: | 6.651.067 | 2.183.215 | -6.651.067 | 2.183.215 |
| Eredménytartalék: | -37.499.255 | 0 | -14.371.834 | -51.871.089 |
| Tárgyévi eredmény: | -14.371.834 | 21.906.253 | 14.371.834 | 21.906.253 |
| Tőkenövekmény összesen: | 96.428.637 | 35.841.780 | -41.108.655 | 91.161.762 |
| Saját tőke összesen: | 142.029.564 | 41.237.791 | -57.294.088 | 125.973.267 |

Likviditási jelentés

I. Hitelállomány összetétele

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

II. Költségek összetétele

adatok Ft-ban

| Költségelem megnevezése | 2021. évi költség | 2021. évben pénzügyileg realizált | 2022. évi költség | 2022. évben pénzügyileg realizált |
|-------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|
| Alapkezelési díj | 2.965.105.167 | 2.762.755.191 | 2.088.171.535 | 1.911.472.408 |
| Letétkezelői díj | 69.626.534 | 54.249.279 | 61.363.406 | 46.123.723 |
| Bizományosi díj | 30.600.937 | 30.600.937 | 94.061.106 | 94.061.106 |
| Bankköltség | 1.184.957 | 1.184.957 | 2.709.208 | 2.709.208 |
| Felügyeleti díj | 61.143.000 | 47.798.000 | 44.106.000 | 33.405.000 |
| Könyvvizsgálat díja | 1.905.000 | 0 | 1.905.000 | 0 |
| Egyéb | 4.647.505 | 4.647.505 | 17.782 | 17.782 |
| Összesen: | 3.134.213.100 | 2.901.235.869 | 2.292.334.037 | 2.087.789.227 |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

| Cash flow kimutatás | adatok ezer Ft-ban | |
|--|------------------------------------|------------------------------------|
| | 2021.01.01- 2021.12.31. | 2022.01.01- 2022.12.31. |
| I. Működési cash flow | -55.426.325 | -140.182.855 |
| 1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül) | -32.042.695 | 9.802.179 |
| 3. Elszámolt értékvesztés és visszaírás | 0 | 0 |
| 4. Elszámolt értékelési különbözet | -20.695.195 | -4.467.852 |
| 5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete | 0 | 0 |
| 7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye | -55.829.677 | -90.248.755 |
| 8. Befektetett eszközök állományváltozása | 0 | 0 |
| 9.1. Követelések változása | -7.367.003 | 772.872 |
| 9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása | 15.344.956 | 13.742.071 |
| 10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása | 39.846.146 | -60.482.185 |
| 11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása | 0 | 0 |
| 12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása | -33.096 | -26.966 |
| 13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása | 0 | 0 |
| Származékos ügyletek állományváltozása | 5.350.239 | -9.274.219 |
| II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás | 90.394.970 | 189.437.997 |
| 17. Értékpapírok beszerzése - | -2.056.633.668 | -795.329.992 |
| 18. Értékpapírok eladása, beváltása + | 2.129.357.777 | 972.663.915 |
| 19. Kapott hozamok + | 17.670.861 | 12.104.074 |
| III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás | -40.735.445 | -33.494.698 |
| 20. Befektetési jegy kibocsátás + | 17.807.445 | 17.148.323 |
| 22. Befektetési jegy visszavásárlása - | -58.542.890 | -50.643.021 |
| 23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok - | 0 | 0 |
| IV. Pénzeszközök változása | -5.766.800 | 15.760.444 |
| Pénzeszközök nyitó értéke | 7.553.474 | 1.786.674 |
| Pénzeszközök záró értéke | 1.786.674 | 17.547.118 |

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.

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): | 2022.12.31 |
| Saját tőke: | 125.973.267.630 |
| Egy jegyre jutó NEÉ: | 3,618725 |
| Darabszám: | 34.811.505.005 |

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

| | | adatok eFt-ban | |
|--|-----------------|-------------------|---------------|
| | | Összeg | % |
| I. KÖTELEZETTSÉGEK | | | |
| I/1. Hitelállomány: | Futamidó | 0 | 0,00 |
| I/2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek: | | 21.905.834 | 100,00 |
| Alapkezelői díj | | 176.699 | 0,81 |
| Letétkezelői díj | | 15.240 | 0,07 |
| Költségként elszámolt egyéb tétel | | 12.606 | 0,06 |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 21.701.289 | 99,06 |
| I/3. Céltartalékok: | | 0 | 0,00 |
| I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | | 0 | 0,00 |
| Kötelezettségek összesen: | | 21.905.834 | 100,00 |

| II. ESZKÖZÖK | | | | Összeg | % |
|---|-------------|------------------|---------------------------|--------------------|--------------|
| II/1. Folyószámla, készpénz (összes): | | | | 1.210.395 | 0,82 |
| II/2. Egyéb követelés: | | | | 8.070.036 | 5,46 |
| II/3. Lekötött bankbetétek (összes): | Bank | Devizanem | Futamidó | 16.336.723 | 11,05 |
| II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek: | | | | 16.336.723 | 11,05 |
| | OTP | EUR | 22.12.21 - 23.01.04 | 6.404.000 | 4,33 |
| | OTP | EUR | 22.12.30 - 23.01.02 | 3.653.082 | 2,47 |
| | OTP | HUF | 22.12.30 - 23.01.02 | 801.100 | 0,54 |
| | OTP | USD | 22.12.30 - 23.01.02 | 5.478.541 | 3,71 |
| II/4. Értékpapírok (összes): | | Devizanem | Névérték devizában | 118.501.082 | 80,13 |
| II/4.1. Állampapírok (összes): | | | | 33.512.363 | 22,65 |
| II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes): | | | | 1.309.925 | 0,88 |
| REPHUN 0.125 09/21/2028 államkötvény | | | | 593.955 | 0,40 |
| REPHUN 5 02/22/2027 államkötvény | | | | 715.970 | 0,48 |
| II/4.1.4. Külföldi állampapírok (összes): | | | | 32.202.438 | 21,77 |
| ARGENT 0.125 07/09/2046 államkötvény | | | | 252.519 | 0,17 |
| ARGENT 1 07/09/2029 államkötvény | | | | 9.979 | 0,01 |
| BRAZIL 10.25 01/10/2028 államkötvény | | | | 1.385.135 | 0,94 |
| EGYPT 5.8 09/30/2027 államkötvény | | | | 1.586.023 | 1,07 |
| EGYPT 8.75 09/30/2051 államkötvény | | | | 655.256 | 0,44 |
| EGYPT 8.875 05/29/2050 államkötvény | | | | 387.113 | 0,26 |
| LITHUN 0.5 07/28/2050 államkötvény | | | | 2.189.360 | 1,48 |
| PERU 1.862 12/01/2032 államkötvény | | | | 179.569 | 0,12 |
| PERU 2.78 12/01/2060 államkötvény | | | | 144.406 | 0,10 |
| PERU 3.23 07/28/2121 államkötvény | | | | 146.812 | 0,10 |
| POLAND 2 10/25/46 államkötvény | | | | 3.443.443 | 2,33 |
| ROMANI 2.125 03/07/2028 államkötvény | | | | 1.556.791 | 1,05 |
| ROMANI 2.375 04/19/27 államkötvény | | | | 3.648.489 | 2,47 |
| ROMANI 2.75 02/26/2026 államkötvény | | | | 1.862.855 | 1,26 |
| ROMANI 2.875 05/26/28 államkötvény | | | | 1.060.370 | 0,72 |

Éves jelentés - OTP Supra Származtatott Befektetési Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

| | | | | |
|---|-----|------------|-------------------|--------------|
| ROMANI 3.624 05/26/2030 államkötvény | EUR | 9.500.000 | 3.203.057 | 2,17 |
| ROMANI 3.75 02/07/2034 államkötvény | EUR | 6.400.000 | 2.003.167 | 1,35 |
| ROMANI 3.875 10/29/35 államkötvény | EUR | 11.500.000 | 3.433.443 | 2,32 |
| SERBIA 1 09/23/2028 államkötvény | EUR | 1.386.000 | 401.592 | 0,27 |
| SERBIA 1.5 06/26/2029 államkötvény | EUR | 2.000.000 | 581.808 | 0,39 |
| SERBIA 2.05 09/23/2036 államkötvény | EUR | 4.100.000 | 940.564 | 0,64 |
| SLOVGB 2.25 06/12/68 államkötvény | EUR | 2.000.000 | 579.349 | 0,39 |
| SOAF 5 10/12/46 államkötvény | USD | 1.500.000 | 403.248 | 0,27 |
| SOAF 5.65 09/27/47 államkötvény | USD | 2.500.000 | 707.518 | 0,48 |
| US TREASURY BILL 0 05/18/2023 államkötvény | USD | 3.900.000 | 1.440.572 | 0,97 |
| II/4.2. Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő ép.: | | | 26.028.448 | 17,60 |
| II/4.2.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | 26.028.448 | 17,60 |
| ALVGR 3.875 12/29/49 kötvény | USD | 1.200.000 | 314.573 | 0,21 |
| ASSGEN 3.875 01/31/29 kötvény | EUR | 3.000.000 | 1.188.019 | 0,80 |
| AXASA 3.375 07/06/2047 kötvény | EUR | 1.500.000 | 564.930 | 0,38 |
| DNONO 8.375 05/29/24 kötvény | USD | 1.170.774 | 443.734 | 0,30 |
| ENIIM 2.625 PERP 10/13/25 kötvény | EUR | 1.750.000 | 639.936 | 0,43 |
| ENIIM 3.375 PERP 07/13/29 kötvény | EUR | 1.750.000 | 587.546 | 0,40 |
| GTCAPW 2.25 06/23/2026 kötvény | EUR | 2.000.000 | 593.167 | 0,40 |
| ISPIM 7.75 07/29/49 kötvény | EUR | 2.000.000 | 805.340 | 0,54 |
| ISTANBUL 6.375 12/09/2025 kötvény | USD | 3.000.000 | 1.006.072 | 0,68 |
| LGEN 5.25 03/21/2047 kötvény | USD | 1.500.000 | 532.995 | 0,36 |
| MAGYAR 4.6 10/24/2029 kötvény | HUF | 800.000 | 584.581 | 0,40 |
| MVMHU 0.875 11/18/2027 kötvény | EUR | 2.825.000 | 809.704 | 0,55 |
| OTPHB 2.875% 07/15/2029 kötvény | EUR | 13.550.000 | 5.018.208 | 3,39 |
| OTPHB 5.5 07/13/2025 kötvény | EUR | 3.250.000 | 1.306.612 | 0,88 |
| OTPHB 7.35 03/04/2026 kötvény | EUR | 727.000 | 289.949 | 0,20 |
| PCRK 2024/A kötvény | EUR | 1.500.000 | 589.816 | 0,40 |
| PEMEX 5.95 01/28/2031 kötvény | USD | 2.200.000 | 673.726 | 0,46 |
| PEMEX 6.95 01/28/2060 kötvény | USD | 3.000.000 | 789.118 | 0,53 |
| PHOENIX GRP 4.75 09/04/2031 kötvény | USD | 550.000 | 194.261 | 0,13 |
| SAUDI ARAMCO 3.5 11/24/2070 kötvény | USD | 1.350.000 | 346.945 | 0,23 |
| SYNGENTA FINANCE NV 4.892% 04/24/2025 kötv | USD | 1.000.000 | 377.439 | 0,26 |
| SYNGENTA FINANCE NV 5.182% 04/24/2028 kötv | USD | 750.000 | 277.893 | 0,19 |
| SYNGENTA FINANCE NV 5.676% 04/24/2048 kötv | USD | 1.000.000 | 332.585 | 0,23 |
| TOTAL 3.369 12/29/49 kötvény | EUR | 1.500.000 | 566.934 | 0,38 |
| UNICAJA BANCO SA 4.875 PERP kötvény | EUR | 1.000.000 | 293.158 | 0,20 |
| UNICREDIT SPA 0.8 07/05/2029 kötvény | EUR | 1.500.000 | 484.614 | 0,33 |
| YKBNK 7.875 01/22/2031 kötvény | USD | 1.000.000 | 369.085 | 0,25 |
| ZURICH FINANCE IRELAND 3 04/19/2051 kötvény | USD | 3.000.000 | 889.002 | 0,60 |
| ZURNVX 5.625 06/24/46 kötvény | USD | 1.500.000 | 568.662 | 0,38 |
| CRBKMO 7.5% 05/10/27 kötvény | USD | 1.000.000 | 102.990 | 0,07 |
| GAZPRU 4.25 06/04/24 kötvény | GBP | 7.000.000 | 2.309.396 | 1,56 |
| IBRD 5.75 01/14/2028 BRL kötvény | BRL | 8.000.000 | 481.890 | 0,33 |
| MOLHB 1.5 10/08/2027 kötvény | EUR | 700.000 | 233.162 | 0,16 |
| PETROBRAS 6.85 06/05/15 kötvény | USD | 4.500.000 | 1.444.731 | 0,98 |
| RALFP 4.371 01/23/23 kötvény | EUR | 500.000 | 17.675 | 0,01 |
| II/4.3. Részvények (összes): | | | 39.198.779 | 26,52 |
| II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | 477.328 | 0,32 |
| MASTERPLAST részvény | HUF | 12.450 | 475.578 | 0,32 |
| OPUS részvény | HUF | 371 | 1.750 | 0,00 |

Portfólió jelentés értékpapíralapra

| | | | | |
|--|-----|------------|-------------------|--------------|
| II/4.3.2. Külföldi részvények (összes): | | | 38.721.451 | 26,20 |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR részvény | USD | 1 | 992.810 | 0,67 |
| AMREST HOLDINGS SE részvény | PLN | 56.394 | 941.466 | 0,64 |
| AUSTRIA TECHNOLOGIE részvény | EUR | 112.380 | 1.439.363 | 0,97 |
| BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE részvény | RON | 193.885 | 203.859 | 0,14 |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG részvény | CHF | 9.600 | 269.941 | 0,18 |
| DIAMONDBACK ENERGY INC részvény | USD | 0 | 1.285 | 0,00 |
| DIGI COMMUNICATIONS NV részvény | RON | 27.700 | 7.057.185 | 4,77 |
| ERSTE BANK STAMM részvény | EUR | 112.717 | 1.348.938 | 0,91 |
| FIDELITY CHINA SPECIAL SITUATIONS részvény | GBP | 270.614 | 293.549 | 0,20 |
| FONDUL PROPRIETATEA SA - .52 részvény | RON | 647.481 | 205.444 | 0,14 |
| HALYK SAVINGS BANK-GDR REG S részvény | USD | 187.584 | 782.234 | 0,53 |
| HELLO GROUP INC -SPN ADR részvény | USD | 9 | 303.625 | 0,21 |
| JD.COM INC-ADR részvény | USD | 1 | 1.054.345 | 0,71 |
| JOYY INC - ADR részvény | USD | 0 | 261.090 | 0,18 |
| JUMBO SA részvény | EUR | 263.491 | 1.915.102 | 1,30 |
| KARDEMIR KARABUK DEMIR-CL D részvény | TRY | 347.369 | 125.421 | 0,09 |
| KASPI.KZ JSC GDR részvény | USD | 40.089 | 1.076.835 | 0,73 |
| LOGO YAZILIM SANAYI VE TICAR részvény | TRY | 100.181 | 140.242 | 0,10 |
| MERCIALYS részvény | EUR | 5.000 | 19.552 | 0,01 |
| NASPERS LTD-N SHS SPON ADR részvény | USD | 53.000 | 657.064 | 0,44 |
| NOVATEK részvény | RUB | 13.500 | 28.018 | 0,02 |
| OMV PETROM SA részvény | RON | 16.648.920 | 5.655.571 | 3,82 |
| PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS részvény | TRY | 31.750 | 305.866 | 0,21 |
| PEKAO részvény | PLN | 443.723 | 3.275.907 | 2,22 |
| PKO BANK részvény | PLN | 64.997 | 168.033 | 0,11 |
| PLUG POWER INC részvény | USD | 650 | 302.066 | 0,20 |
| PROSUS részvény | EUR | 3.450 | 1.779.931 | 1,20 |
| RAIFFEISEN INTERN BH részvény | EUR | 100.000 | 614.384 | 0,42 |
| RENAULT SA részvény | EUR | 381.000 | 1.251.782 | 0,85 |
| SBERBANK részvény | RUB | 583.200 | 5.301 | 0,00 |
| SOCIETATEA NATIONALA DE GAZE részvény | RON | 91.400 | 279.064 | 0,19 |
| STELLANTIS NV (FR) részvény | EUR | 3.350 | 1.779.291 | 1,20 |
| STS HOLDING SA részvény | PLN | 60.000 | 88.593 | 0,06 |
| TEAMVIEWER AG részvény | EUR | 182.577 | 880.206 | 0,60 |
| VESTEL BEYAZ részvény | TRY | 2.875.284 | 795.202 | 0,54 |
| VOLKSWAGEN AG részvény | EUR | 11.500 | 535.867 | 0,36 |
| VONOVIA SE részvény | EUR | 144.100 | 1.270.026 | 0,86 |
| WIENERBERGER AG részvény | EUR | 66.582 | 601.211 | 0,41 |
| YANDEX NV-A (RUS) részvény | RUB | 450 | 15.782 | 0,01 |
| II/4.5. Befektetési jegyek (összes): | | | 19.761.492 | 13,36 |
| II/4.5.1. Tőzsdére bevezetett (összes): | | | 19.761.492 | 13,36 |
| ADVENTUM MAGIS ZK AA BEFJEGY | EUR | 16.000.000 | 7.820.242 | 5,29 |
| ADVENTUM SATIS EUR ZK AA | EUR | 8.000.000 | 3.452.547 | 2,33 |
| BNP EARTH FUND | USD | 39.912 | 1.363.874 | 0,92 |
| ETF BRAZIL EWZ | USD | 190.000 | 1.996.476 | 1,35 |
| ETF KOREA | USD | 15.000 | 318.277 | 0,22 |
| FORESTAY DIÁKHOTEL I. ING.A. A | EUR | 1.300.000 | 594.357 | 0,40 |
| ISHARES MSCI CHILE ETF | USD | 90.000 | 915.946 | 0,62 |
| KRANESHARES CSI CHINA INTERNET FUND | USD | 170.000 | 1.928.741 | 1,30 |
| LYXOR MSCI CHINA UCITS ETF | EUR | 50.000 | 308.192 | 0,21 |
| SPROTT PHYSICAL URANIUM TRUS | CAD | 224.500 | 985.407 | 0,67 |
| PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. | EUR | 2.326 | 77.433 | 0,05 |

Portfólió jelentés értékpapíralapra

| | | |
|---|--------------------|---------------|
| II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes): | 74.462 | 0,05 |
| II/6. Származékos ügyletek értékelési különbözete | 3.686.403 | 2,49 |
| Eszközök összesen: | 147.879.101 | 100,00 |

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

Kelt:

BUDAPEST, 2023. április 27.

.....
Éder György István
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, 2023. április 27.

.....
Éder György István
vezérigazgató
OTP Alapkezelő Zrt.



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 2022. évi éves jelentés I-XV. pontjaiban közzétett számviteli információinak („számviteli információk”) a könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap 2022. 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 Könyvvizsgálói 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 könyvvizsgálatáért 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 könyvvizsgálói bizonyíték elegendő és megfelelő alapot nyújt véleményünkhöz.

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 2022. 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 lényegesen hibás állítást tartalmaznak. Ha az elvégzett munkánk alapján arra a következtetésre jutunk, hogy az egyéb információk lényegesen hibás állítást tartalmaznak, kötelességünk ezt a tényt jelenteni. Ebben a tekintetben nincs jelentenivalónk.

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, lényegesen 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 szereznünk arról, hogy a számviteli információk egésze nem tartalmaz akár csalásból, akár hibából eredő lényegesen hibás állítást, valamint az, hogy ennek alapján a véleményünket tartalmazó független könyvvizsgálói jelentést bocsássunk ki. A kellő bizonyosság magas fokú bizonyosság, de nem garancia arra, hogy a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvényekkel és egyéb jogszabályokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálat mindig feltárja az egyébként létező lényegesen hibás állítást. A hibás állítások eredhetnek csalásból vagy hibából, és lényegesen minősülnek, ha észszerű lehet az a várakozás, hogy ezek önmagukban vagy együttesen befolyásolhatják a felhasználók adott 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 lényegesen 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 lényegesen hibás állítás fel nem tárásának kockázata nagyobb, mint a hibából eredőé, mivel a csalás magában foglalhatja 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, minősíteniük 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, 2023. április 27.

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

Bertalan Zsuzsanna
Kamarai tag könyvvizsgáló
Kamarai tagsági szám: 005611