

OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

*Éves jelentés
és
független könyvvizsgálói jelentés*

2020. december 31.

FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

Az OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük az OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap (az „Alap”) 2020. évi éves jelentésének I - XV. pontjaiban található számviteli információinak (a „számviteli információk”) könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap mellékelt 2020. december 31-ével végződő üzleti évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a Magyarországon hatályos, a számvitelről szóló 2000. évi C. törvénnyel (a „számviteli törvény”), valamint a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek összeállításra. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban szereplő eszközök és kötelezettségek leltárral alátámasztottak. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

A vélemény alapja

Könyvvizsgálatunkat a Magyar Nemzeti 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 könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége” szakasza tartalmazza.

Függetlenek vagyunk az Alaptól és annak kezelőjétől, az OTP Alapkezelő Zrt.-től a vonatkozó, Magyarországon hatályos jogszabályokban és a Magyar Könyvvizsgálói Kamara „A könyvvizsgálói hivatás magatartási (etikai) szabályairól és a fegyelmi eljárásról szóló szabályzata”-ban, valamint az ezekben nem rendezett kérdések tekintetében a Könyvvizsgálók Nemzetközi Etikai Standardok Testülete által kiadott „Nemzetközi etikai kódex kamarai tag könyvvizsgálóknak (a nemzetközi függetlenségi standardokkal egybefoglalva)” című kézikönyvében (az IESBA Kódex-ben) foglaltak szerint, és megfelelünk az ugyanezen normákban szereplő további etikai előírásoknak is.

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

Egyéb információk

Az egyéb információk az éves jelentésben foglalt nem számviteli információkból állnak. Az OTP Alapkezelő Zrt. vezetése (a „vezetés”) felelős az egyéb információk elkészítéséért. Az éves jelentésben közölt számviteli információkra a független könyvvizsgálói jelentésünk „Vélemény” szakaszában adott véleményünk nem vonatkozik az egyéb információkra, és az egyéb információkra vonatkozóan nem bocsátunk ki semmilyen formájú bizonyosságot nyújtó következtetést.

Az éves jelentés általunk végzett könyvvizsgálatával kapcsolatban a mi felelőségünk az egyéb információk átolvasása és ennek során annak mérlegelése, hogy az éves jelentésben foglalt egyéb információk lényegesen ellentmondanak-e az éves jelentésben közölt számviteli információknak vagy a könyvvizsgálat során szerzett ismereteinknek, vagy egyébként úgy tűnik-e, hogy azok lényeges hibás állítást tartalmaznak. Ha az elvégzett munkánk alapján arra a következtetésre jutunk, hogy az egyéb információk lényegesen hibás állítást tartalmaznak, kötelességünk erről és a hibás állítás jellegéről jelentést tenni.

Az egyéb információkban lényeges ellentmondás vagy lényeges hibás állítás nem jutott a tudomásunkra, így e tekintetben nincs jelenteni valónk.

A vezetés és az irányítással megbízott személyek felelősége az éves jelentésben közölt számviteli információkért

A vezetés felelős az éves jelentésben közölt számviteli információknak a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel és a számviteli törvénnyel összhangban történő elkészítéséért, különös tekintettel az eszközök és kötelezettségek leltárral való alátámasztásáért, a kezelési költségeknek az Alap letétkezelője által megadott értékelése alapján történő elszámolásáért, valamint az olyan belső kontrolléért, amelyet a vezetés szükségesnek tart ahhoz, hogy lehetővé váljon az akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állítástól mentes éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése során a vezetés felelős azért, hogy felmérje az Alapnak a vállalkozás folytatására való képességét és az adott helyzetnek megfelelően közzétegye a vállalkozás folytatásával kapcsolatos információkat, valamint a vezetés felel a vállalkozás folytatásának elvén alapuló, éves jelentésben közölt számviteli információk összeállításáért. A vezetésnek a vállalkozás folytatásának elvéből kell kiindulnia, ha ennek az elvnek az érvényesülését eltérő rendelkezés nem akadályozza, illetve a vállalkozási tevékenység folytatásának ellentmondó tényező, körülmény nem áll fenn.

Az irányítással megbízott személyek felelősek az Alap pénzügyi beszámolási folyamatának felügyeletéért.

A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelősége

A könyvvizsgálat során célunk kellő bizonyosságot szerezni arról, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk egésze nem tartalmaz akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állítást, valamint az, hogy ennek alapján a véleményünket tartalmazó független könyvvizsgálói jelentést bocsássunk ki. A kellő bizonyosság magas fokú bizonyosság, de nem garancia arra, hogy a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvényekkel és egyéb jogszabályokkal összhangban elvégzett könyvvizsgálat mindig feltárja az egyébként létező lényeges hibás állítást. A hibás állítások eredhetnek csalásból vagy hibából, és lényegesnek minősülnek, ha észszerű lehet az a várakozás, hogy ezek önmagukban vagy együttesen befolyásolhatják a felhasználók adott éves jelentésben közölt számviteli információk alapján meghozott gazdasági döntéseit.

A Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardok és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok szerinti könyvvizsgálat egésze során szakmai megítélést alkalmazunk és szakmai szkepticizmust tartunk fenn.

Továbbá:

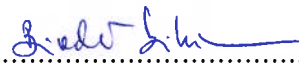
- Azonosítjuk és felmérjük az éves jelentésben közölt számviteli információk akár csalásból, akár hibából eredő lényeges hibás állításainak a kockázatait, kialakítjuk és végrehajtjuk az ezen kockázatok kezelésére alkalmas könyvvizsgálati eljárásokat, valamint elegendő és megfelelő könyvvizsgálati bizonyítékot szerzünk a véleményünk megalapozásához. A csalásból eredő lényeges hibás állítás fel nem tárásának a kockázata nagyobb, mint a hibából eredő, mivel a csalás magában foglalhat összejátszást, hamisítást, szándékos kihagyásokat, téves nyilatkozatokat, vagy a belső kontroll felülírását.
- Megismerjük a könyvvizsgálat szempontjából releváns belső kontrollt annak érdekében, hogy olyan könyvvizsgálati eljárásokat tervezzünk meg, amelyek az adott körülmények között megfelelőek, de nem azért, hogy a belső kontroll hatékonyságára vonatkozóan véleményt nyilvánítsunk.
- Értékeljük a vezetés által alkalmazott számviteli politika megfelelőségét és a vezetés által készített számviteli becslések és kapcsolódó közzétételek észszerűségét.
- Következtetést vonunk le arról, hogy helyénvaló-e a vezetés részéről a vállalkozás folytatásának elvén alapuló számvitel alkalmazása, valamint a megszerzett könyvvizsgálati bizonyíték alapján arról, hogy fennáll-e lényeges bizonytalanság olyan eseményekkel vagy feltételekkel kapcsolatban, amelyek jelentős kétséget vethetnek fel az Alap vállalkozás folytatására való képességét illetően. Amennyiben azt a következtetést vonjuk le, hogy lényeges bizonytalanság áll fenn, független könyvvizsgálói jelentésünkben fel kell hívnunk a figyelmet az éves jelentésben közölt számviteli információkban lévő kapcsolódó közzétételekre, vagy ha a közzétételek e tekintetben nem megfelelőek, minősítenünk kell véleményünket. Következtetéseink a független könyvvizsgálói jelentésünk dátumáig megszerzett könyvvizsgálati bizonyítékon alapulnak. Jövőbeli események vagy feltételek azonban okozhatják azt, hogy az Alap nem tudja a vállalkozást folytatni.
- Megvizsgáljuk az éves jelentésben közölt számviteli információkat, különös tekintettel az éves jelentésben bemutatott eszközök és kötelezettségek időszak végi leltárára, valamint az adott időszakban elszámolt kezelési költségekre. Megvizsgáljuk, hogy az éves jelentésben közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek-e összeállításra.

Az irányítással megbízott személyek tudomására hozzuk - egyéb kérdések mellett - a könyvvizsgálat tervezett hatókörét és ütemezését, a könyvvizsgálat jelentős megállapításait, beleértve az Alapkezelő által alkalmazott belső kontrollnak a könyvvizsgálatunk során általunk azonosított jelentős hiányosságait is, ha voltak ilyenek.

Budapest, 2021. április 27.



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



Binder Szilvia
Kamarai tag könyvvizsgáló
Tagszám: 003801



OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Éves jelentés a 2020. december 31-én zárult üzleti évről

Pénzügyi év: 2020. január 1-től
2020. december 31-ig

Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Székhelye:	1026 Budapest, Riadó u.1-3.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Székhelye:	1051 Budapest, Nádor u.16.

OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Mérleg

		adatok ezer Ft-ban	
A tétel megnevezése		Előző év	Tárgyév
		2019. december 31.	2020. december 31.
a.	b.	c.	d.
01.	A) Befektetett eszközök	0	0
02.	I. Értékpapírok	0	0
03.	1. Értékpapírok	0	0
04.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	0	0
05.	a) kamatokból, osztalékból	0	0
06.	b) egyéb piaci megítélésből	0	0
07.	II. Hosszú lejáratú bankbetétek	0	0
08.	B. Forgóeszközök	16.504.903	12.920.531
09.	I. Követelések	0	0
10.	1. Követelések	0	0
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	15.491.457	12.563.981
15.	1. Értékpapírok	13.520.173	13.390.721
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	1.971.284	-826.740
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	34
18.	b) egyéb piaci megítélésből	1.971.284	-826.774
19.	III. Pénzeszközök	1.013.446	356.550
20.	1. Pénzeszközök	1.013.446	356.550
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	418	0
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	418	0
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származékos ügyletek értékelési különbözete	-201.901	-241.561
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	16.303.420	12.678.970
27.	E. Saját tőke	16.179.545	12.613.534
28.	I. Induló tőke	11.869.691	12.825.313
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	19.687.928	24.362.475
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-7.818.237	-11.537.162
31.	II. Tőkeváltozás (tőkeövekmény)	4.309.854	-211.779
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékülönbözete	-1.300.656	-1.261.104
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékülönbözete	2.602.835	3.109.299
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	1.769.383	-1.068.301
35.	3. Előző év(ek) eredménye	793.550	1.238.292
36.	4. Üzleti év eredménye	444.742	-2.229.965
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	123.875	65.436
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	123.875	65.436
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	16.303.420	12.678.970

Eredménykimutatás

		adatok ezer Ft-ban	
A tétel megnevezése		Előző év	Tárgyév
		2019.01.01-2019.12.31.	2020.01.01-2020.12.31.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei	2.054.930	2.470.600
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	1.448.772	4.525.887
03.	III. Egyéb bevételek	0	26
04.	IV. Működési költségek	161.150	174.431
05.	V. Egyéb ráfordítások	266	273
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	444.742	-2.229.965

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

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.

Kelt: BUDAPEST, 2021. március 12.

Köves Benedek Balázs
vezérigazgató

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Tájékoztató adatok:

Az Alap neve: OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Az Alap felügyeleti nyilvántartásba vételének száma (lajstromszám) és dátuma: 1111-711, 2017. január 17.

Az Alap típusa: nyilvános

Az Alap fajtája: nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az Alap futamideje: 2017. január 17-től határozatlan ideig.

Az Alap üzleti éve: megegyezik a naptári évvel.

Az Alap harmonizációja: nem ÁÉKBV irányelv szerint harmonizált (alternatív befektetési alap, "ABA")

A mérlegkészítés időpontja: a tárgyévet követő január 31-e.

Alapkezelő neve: OTP Alapkezelő Zrt. székhelye: 1026 Budapest, Riadó u.1-3.

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

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

Az Alap képviselőjére jogosult személy Köves Benedek Balázs, lakóhelye 1029 Budapest, Uzsoki utca 3. A könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy Garamvölgyi Zoltán Mihály, lakóhelye 2000 Szentendre, Körte köz 7. mérlegképes igazolvány száma: MK 129785.

Az Alap esetében a könyvvizsgálat kötelező. A könyvvizsgáló neve: Deloitte Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft. székhelye: 1068 Budapest, Dózsa György út 84/C. A könyvvizsgálatért felelős személy Binder Szilvia, kamarai tagsági száma: 003801.

Az Alap 2020. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFÁ-val növelt bruttó könyvvizsgálati díja 978 eFt.

Az Alappal kapcsolatos további információkat ld. az Alapkezelő honlapján:

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

A számviteli politika fő vonásai és az alkalmazott számviteli alapelvek

Az Alap számviteli politikája a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint az egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény ("KBFTV."), a számvitelről szóló 2000. évi C. törvény ("Számviteli Törvény"), a befektetési alapok éves beszámoló készítési és könyvvezetési kötelezettségének sajátosságairól szóló 215/2000. (XII.11.) kormányrendelet ("Kormányrendelet"), valamint az egyéb vonatkozó jogszabályok alapján került kialakításra.

Az Alapkezelő részletes analitikus nyilvántartást vezet az Alap eszközeiről és kötelezettségeiről.

Az eszközök és kötelezettségek értékelési és elszámolási szabályai a Kormányrendelet 7. § előírásai szerint kerültek kialakításra.

Értékpapírok értékelése és elszámolása

- A Kormányrendelet előírásainak megfelelően az értékpapírok nettó beszerzési értéken kerülnek nyilvántartásba vételre. Az értékpapírok eladása során az értékesítésre jutó könyv szerinti érték FIFO módszerrel kerül meghatározásra.

- Az értékpapírok a KBFTV., a Kormányrendelet, valamint az Alap kibocsátási tájékoztatója által előírt rendszerességgel piaci értéken kerülnek értékelésre.

- A Kormányrendelet előírásainak megfelelően az értékpapírok után tárgyévben járó időarányos kamatok és osztalékok az értékpapírok értékkülönbszeteiként 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 pénzügyi értékre szóló követelések és kötelezettségek

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

Immateriális javak és tárgyi eszközök

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

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

A mérleg egyes tételeinek magyarázata:

Eszközök:

A mérleg 15. sorában az értékpapírok beszerzési áron, ezen belül a kamatozó értékpapírok a nettó (felhalmozott kamatok nélküli) beszerzési áron szerepelnek. A 17. sorban a fordulónapon állományban lévő értékpapírok tárgyév végi felhalmozott kamatai, a 18. sorban pedig a fordulónapi (nettó) forgalmi érték és a (nettó) beszerzési ár 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 -2.055.287 eFt, amely 2.470.600 eFt bevétel és 4.525.887 eFt ráfordítás különbsége. 174.431 eFt működési költség és 273 eFt egyéb ráfordítás után a veszteség 2.229.965 eFt.

A működési költségeket a likviditási jelentés II. táblázata részletezi, amelyben a "pénzügyileg realizált oszlop" tartalmazza az 2020. évi költségek azon részét, amelyet a futamidő végéig kifizetett. Az Alappal kapcsolatos azon költségeket, amelyek a fent említett táblázatban nem szerepelnek (pl.: forgalmazási díj, reklám költségek) az Alap tájékoztatójának megfelelően az Alapkezelő viseli.

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

I. Vagyonkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2020.01.01		Időszak záró állománya 2020.12.31		Megoszlás (%)
Készpénzállomány - banki egyenlegek					
Bank	Lekötési idő				
OTP Bank Nyrt. HUF	folyószámla	1.232	218.234	1,72%	
OTP Bank Nyrt. USD	folyószámla	77	138.316	1,09%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.18 - 2020.01.02	442.110	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.18 - 2020.01.02	147.370	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. USD	2019.12.31 - 2020.01.02	422.657	0	0,00%	
Banki egyenlegek összesen:		1.013.446	356.550	2,81%	
Átruházható értékpapírok					
Értékpapír neve	Futamidő	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír
Államkötvények:		0		183.947	1,45%
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	0		183.947	1,45%
Befektetési jegyek:		0	15.491.457	0	12.380.034
OTP SUPRA I SOROZAT		0	15.491.457	0	12.380.034
Átruházható értékpapírok összesen:		0	15.491.457	183.947	12.380.034
Egyéb eszközök					
Követelések		0		0	0,00%
Aktív időbeli elhatárolások		418		0	0,00%
Származékos ügyletek értékelési különbözete		-201.901		-241.561	-1,90%
Egyéb eszközök összesen:		-201.483		-241.561	-1,90%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:		16.303.420		12.678.970	100,00%
Kötelezettségek					
1. Hitelállomány:		0		0	0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:					
Alapkezelői díj		15.523		12.823	19,59%
Letétkezelői díj		1.450		1.267	1,94%
Költségként elszámolt egyéb tétel		1.838		2.100	3,21%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		105.064		49.246	75,26%
3. Céltartalékok:		0		0	0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		0		0	0,00%
Kötelezettségek összesen:		123.875		65.436	100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:		16.179.545		12.613.534	

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	40.271.733	43.130.591
---	------------	------------

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

	2019.12.31	2020.12.31
Jelen dokumentum alapján:	1,363097	0,983488
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	1,362667	0,986484

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 Dollár Alapba Fektető Alap

IV. Az Alap értékpapír portfóliójának összetétele

Megnevezés	2020.01.01	Megoszl.(%)	2020.12.31	Megoszl.(%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	0	0,00%	183.947	1,45%
b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok:	15.491.457	94,86%	12.380.034	97,64%
<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:	0	0,00%	183.947	1,45%

A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

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

V. Az Alap eszközeinek alakulása

Megnevezés	2019. december 31- el zárult üzleti év	2020. december 31- el zárult üzleti év
a) befektetésekből származó jövedelem:	606.158	-2.055.287
b) egyéb bevétel:	0	26
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-151.866	-163.193
d) a letétkezelő díjai:	-5.107	-5.546
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	0	0
bankköltség:	-60	-61
felügyeleti díj:	-3.173	-4.652
egyéb költség és ráfordítás:	-1.210	-1.252
f) nettó jövedelem:	444.742	-2.229.965
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	444.742	-2.229.965
h) a tőkeszámla változása:	2.615.685	1.501.638
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értéksökkenése:	2.462.668	-2.837.684
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 Dollár Alapba Fektető Alap

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

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma és nettó eszközértéke:

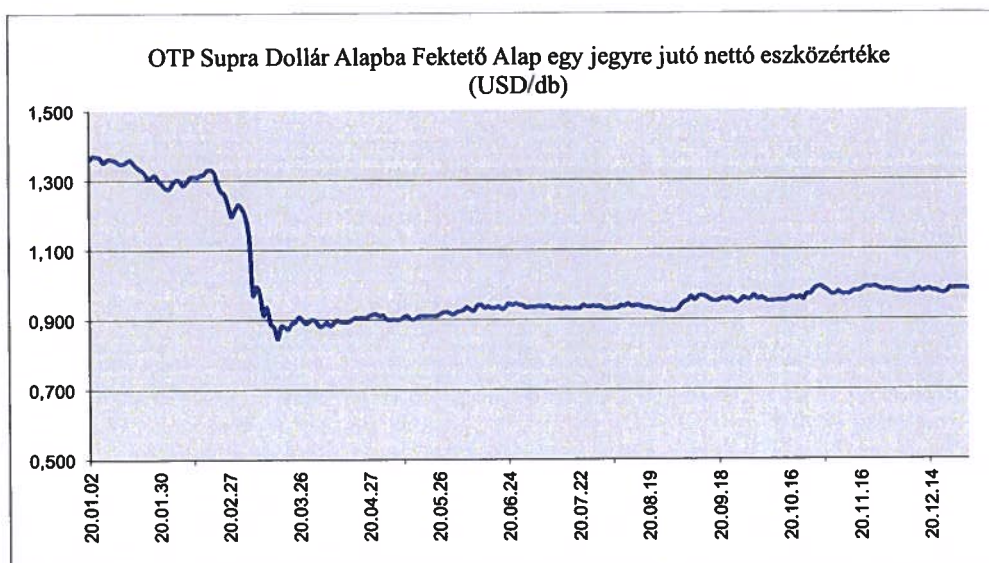
	Elért hozamok éves bontásban	Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	Fordulónapi nettó eszközérték (Ft)	Egy jegyre jutó nettó eszközérték (USD/db)
2017. január 17.		687.278	202.788.246	1,000000
2017. december 31.	11,68%	30.322.623	8.765.028.529	1,116834
2018. december 31.	-2,55%	34.850.491	10.656.450.454	1,088404
2019. december 31.	25,24%	40.271.733	16.179.544.821	1,363097
2020. január 31.		42.684.235		1,290057
2020. február 28.		45.383.131		1,198733
2020. március 31.		43.773.671		0,901413
2020. április 30.		43.931.737		0,915920
2020. május 29.		44.488.832		0,919746
2020. június 30.		44.532.296		0,946719
2020. július 31.		44.641.166		0,936480
2020. augusztus 31.		44.378.782		0,924205
2020. szeptember 30.		43.641.881		0,952924
2020. október 30.		43.431.370		0,991133
2020. november 30.		43.289.733		0,986128
2020. december 31.	-27,85%	43.130.591	12.613.534.906	0,983488

Az OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap 2020. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után -27,85 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

(névérték 1 USD)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2020. január	2.957.481	544.979
2020. február	3.656.342	957.446
2020. március	1.179.658	2.789.118
2020. április	940.717	782.651
2020. május	957.302	400.207
2020. június	1.134.003	1.090.539
2020. július	951.079	842.209
2020. augusztus	440.997	703.381
2020. szeptember	348.722	1.085.623
2020. október	233.370	443.881
2020. november	704.998	846.635
2020. december	697.974	979.033
Összesen:	14.202.643	11.465.702

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.



Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető 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 2020. évben kifizetett összes: eFt.

Megnevezés	Összeg
Rögzített javadalmazás	638.978
Változó javadalmazás	867.956
Összesen	1.506.934

Az Alap kockázati profiljára lényeges hatást gyakorlók körében 2020. évben kifizetett összes: eFt.

Megnevezés	Ügyvezetők	Egyéb munkavállalók	Összesen
Kedvezményezettek száma	5	13	18
Nyerésrészesezés	0	0	0
Teljes javadalmazás *	246.528	591.478	838.006

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

X. Kockázatkezelésre vonatkozó információk

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

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

b) likviditáskezeléssel kapcsolatos megállapodások bemutatása

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

Az Alapkezelő alapvetően éven belül lejáró likvid magyar állampapírokból illetve feltörhető lekötött betétben tartja az alap likviditását a kezelési szabályzatban meghatározott limitek betartásával.

A likviditáskezelés során a tranzakciós költségek csökkentése érdekében az Alapkezelő megvizsgálja a likviditási többlettel, illetve a likviditás hiánnyal rendelkező alapokat, és azok magyar állampapír állományának javára, illetve terhére, az alapok között köt piaci áras adásvételi ügyleteket. Így a likviditáskezelés során első körben az OTP Alapkezelő által kezelt alapok között kerül sor tranzakciókra, elsősorban diszkontkincstárjegyekkel. Amennyiben ezek után nettó kitettsége marad az alapoknak, további likviditáskezeléshez kapcsolódó ügyleteket az Alapkezelő külső partnerekkel köt piaci áras tranzakciók keretében.

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető 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

	2019.12.31	2020.12.31	Változás 2020/2019
Tőkeáttétel *	55.102.139 USD	43.427.006 USD	-21,1882%

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

XII. Egyéb információk

a) Az Alap illikviddé vált eszközeinek bemutatása

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

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

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

c) Egyéb információk

A befektetési alapot az Alapkezelő tevékenységének ellátásáért, valamint a Kezelési Szabályzat 36.1 pontjában felsorolt közvetített és közvetített szolgáltatásnak nem minősülő egyéb szolgáltatásokért felszámított díj maximális nagysága az alap nettó eszközértékének éves 0.5%-a. Az alap portfóliójában potenciális befektetésként szereplő, egyenként a nettó eszközérték legalább 20%-át kitevő más befektetési alapok, egyéb kollektív befektetési formákat terhelő befektetési alapkezelési díjak mértéke közül a legnagyobb díjmérték a nettó eszközérték éves 2%-a.

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

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

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Az amerikai és európai állampapírpiacokon a politikai és járványhelyzet befolyásolta az eseményeket. Az USA-ban a Biden-kormányzat már az első napján rekordszámú, 17 elnöki rendeletet kiadva módosította Trump elnök számos nagy visszhangot kiváltó intézkedését. A kötvényhozamok az amerikai demokrata sikerek hatására az erősebb költségvetési költések és az ezzel járó magasabb infláció várakozása miatt felfelé tendáltak. Talán éppen azért, mert a Fed megszólaló döntéshozói hangsúlyozták, hogy a kamatemelés vagy akár a kötvényvásárlások lassítása még távoli kilátás. Mindezt a Joe Biden amerikai elnök által azóta már aláírt 1 900 milliárd dolláros fiskális élénkítő-csomag várakozása is fütötte. Ugyanakkor távolabbra tekintve a megugró növekedés inflációs hatására számítanak a piacok. Az EKB számára erősebb fejtörést okozhat a monetáris kondícióknak a hozamemelkedés hatására előálló szigorodása. A hozamgörbék meredeksége világszerte visszatért a tavaly márciusi lezárások előtt jellemző szintekre, a nulla közeli irányadó kamatok mellett a 2-10 éves hozamgörbe-meredekségek rég látott inflációs prémiumokat áraznak.

A közép-kelet európai régió részvénypiacai vegyesen teljesítettek az év első két hónapjában. A hazai BUX index ki tudta venni a részét a feltörekvő piaci jó hangulatból, így januárban és februárban is emelkedett, év eleje óta összesen 4,14%-kal. A cseh és a lengyel index nem tudtak az éve elejétől kiegyensúlyozott teljesítményt nyújtani, a cseh index forintban számítva 2,45%-kal nőtt, a lengyel index forintban számítva 3,15%-kal csökkent év eleje óta. A közép-európai CETOP20 index forintban számítva 0,53%-kal emelkedett az év eleji értékéhez képest.

Az idei január még úgy zajlott a globális feltörekvő részvénypiacokon, ahogyan a 2020-as év zárult, jó hangulatban, emelkedéssel. A február már felemásra sikeredett, a hónap első felében még hatott a vakcina-optimizmus, azonban a hónap végére felerősödtek az inflációs aggodalmak és az amerikai hosszú hozamok meginduló emelkedése megakasztotta a fejlődő piacokra irányuló pénzáramlást. A nyersanyagpiaci eszközök áremelkedése ugyanakkor összességében kedvezően hatott a feltörekvő piacokra. Az eszközosztályt reprezentáló MSCI Emerging Market Index forintban számítva közel 4%-ot tudott emelkedni év eleje óta.

Nehezen indult be az év elején a fejlett piacokon az oltási kampány, emiatt januárban a fejlett piacok részvényárfolyamai valamelyest csökkentek. Februárban azonban fordult a helyzet: A vártnál kedvezőbb amerikai munkaerőpiaci adatok, a jó gyorsjelentések és az oltási program felpörgetése mind hozzájárult ahhoz, hogy az amerikai indexek új csúcsra tudtak emelkedni. Európában a lelkesedés sokkal visszafogottabb volt, vélhetően a vírus harmadik hulláma miatt bevezetett újabb korlátozó intézkedések miatt. Február közepén aztán a kötvénypiacokon bontakozott ki eladási hullám, párhuzamosan az inflációs várakozások fokozódásával. A kötvénypiaci volatilitás február végére áterjedt a részvénypiacokra is. Különösen a spekulatív részvények sinylették meg a hozamemelkedést, hiszen itt a befektetői fantáziára épülő árfolyamokat a jövőbeni lehetőségek jelenértéke - és ezen keresztül a kötvényhozamok - sokkal jobban befolyásolja, mint a már most is pozitív cash-flow-val rendelkező, unalmas old-economy részvényeket. Az MSCI World index év eleje óta forintban kifejezve 1,67%-ot emelkedett.

Az Alap abszolút hozam stratégiát követ, aktív eszközallokációval törekszik a piaci árfolyamesések hatásának mérséklésére, illetve származtatott eszközök használatával igyekszik kihasználni a piaci volatilitásban rejlő lehetőségeket. Nehezen becsülhető a koronavírus okozta további közép- és hosszú távú pénzügyi hatás, de az Alapkezelő továbbra is elkötelezett az Alap további működtetése mellett.

A fordulónap utáni eseményekre vonatkozó leírás a február végéig rendelkezésre álló információk alapján készült.

Az alábbi táblázatban bemutatásra kerül az Alap nettó eszközértékének és egy jegyre jutó árfolyamának a változása a fordulónapot követően:

Dátum	Sorozat	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó nettó eszközérték
2020.12.31.	'A' (USD)	42.446.492	0,986484
2021.03.12.	'A' (USD)	35.191.672	0,887192

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése	Értékpapír futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbözet		Piaci érték
			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:		183.784	34	129	183.947
2021/A	2015.02.24 - 2021.06.23	183.784	34	129	183.947
Befektetési jegyek:		13.206.937	0	-826.903	12.380.034
OTP SUPRA I SOROZAT		13.206.937	0	-826.903	12.380.034
MINDÖSSZESEN:		13.390.721	34	-826.774	12.563.981

Határidős deviza ügyletek bemutatása:

	adatok ezerben	határidős ügylet szerződés szerinti értéke		határidős ügylet diszkontált piaci értéke		eredmény
		devizában	forintban	devizás értéke forintban	forint értéke	
		2019.12.31-én:	HUF / USD	-62.628	210	
	HUF / USD	-138.147	465	-138.130	136.813	-1.317
	HUF / USD	-362.608	1.220	-362.565	358.950	-3.615
	HUF / USD	-3.077.396	10.320	-3.077.026	3.036.365	-40.661
	HUF / USD	-11.766.863	39.460	-11.765.452	11.609.978	-155.474
	Összesen:					-201.901
2020.12.31-én:	HUF / USD	-10.340.725	34.120	-10.340.724	10.145.923	-194.801
	HUF / USD	-1.500.193	4.950	-1.500.192	1.471.932	-28.260
	HUF / USD	-981.945	3.240	-981.945	963.446	-18.499
	Összesen:					-241.560

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

Az Alapban a tárgyidőszakban sem értékpapír-finanszírozási ügyletek, sem teljeshozam-csereügyletek nem fordultak elő.

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Kiegészítő melléklet az éves jelentéshez

XV. A mérleghez és eredménykimutatáshoz kapcsolódó kiegészítő megjegyzések

Saját tőke mozgástábla

adatok eFt-ban

Megnevezés	Nyitó egyenleg	Növekedés	Csökkenés	Záró egyenleg
Induló tőke változása:	11.869.691	4.674.547	-3.718.925	12.825.313
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözete:	1.302.179	546.016	0	1.848.195
Értékelési különbözet:	1.769.383	-1.068.301	-1.769.383	-1.068.301
Eredménytartalék:	793.550	444.742	0	1.238.292
Tárgyévi eredmény:	444.742	-2.229.965	-444.742	-2.229.965
Tőkenövekmény összesen:	4.309.854	-2.307.508	-2.214.125	-211.779
Saját tőke összesen:	16.179.545	2.367.039	-5.933.050	12.613.534

Likviditási jelentés

I. Hitelállomány összetétele

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

II. Költségek összetétele

adatok Ft-ban

Költségelem megnevezése	2019. évi költség	2019. évben pénzügyileg realizált	2020. évi költség	2020. évben pénzügyileg realizált
Alapkezelési díj	151.866.447	136.343.596	163.192.797	150.369.997
Letétkezelői díj	5.106.705	3.656.339	5.546.359	4.279.808
Bankköltség	60.334	60.334	60.849	60.849
Felügyeleti díj	3.173.402	2.278.867	4.652.000	3.531.000
Könyvvizsgálat díja	943.286	0	978.484	0
Összesen:	161.150.174	142.339.136	174.430.489	158.241.654

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Cash flow kimutatás	adatok ezer Ft-ban	
	2019.01.01- 2019.12.31.	2020.01.01- 2020.12.31.
I. Működési cash flow	314.045	-2.311.236
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)	444.742	-2.238.402
3. Elszámolt értékvesztés és visszaírás	0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet	2.462.668	-2.837.684
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete	0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye	-196.015	-14.813
8. Befektetett eszközök állományváltozása	0	0
9.1. Követelések változása	0	0
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása	-2.507.603	2.798.024
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása	65.736	-58.439
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása	0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása	-418	418
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása	0	0
Származékos ügyletek állományváltozása	44.935	39.660
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás	-2.308.335	152.702
17. Értékpapírok beszerzése -	-7.002.023	-11.971.065
18. Értékpapírok eladása, beváltása +	4.693.688	12.115.330
19. Kapott hozamok +	0	8.437
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás	2.615.685	1.501.638
20. Befektetési jegy kibocsátás +	6.513.223	5.181.011
22. Befektetési jegy visszavásárlása -	-3.897.538	-3.679.373
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -	0	0
IV. Pénzeszközök változása	621.395	-656.896
Pénzeszközök nyitó értéke	392.051	1.013.446
Pénzeszközök záró értéke	1.013.446	356.550

Megjegyzések:

1. A részletező sorok számozása a Kormányrendelet 4. sz. melléklete szerint.
2. A 9. Forgóeszközök állományváltozása sor további bontásra került.
3. További részletező sor került beiktatására "Származékos ügyletek állományváltozása" megnevezéssel sorszámozás nélkül.

Éves jelentés - OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap

Portfólió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve: OTP Supra Dollár Alapba Fektető Alap
 Alap lajstromszáma: 1111-711
 Alapkezelő neve: OTP Alapkezelő Zrt.
 Letétkezelő neve: OTP Bank Nyrt.
 Nettó Eszközérték számítás típusa: T

USD

Tárgynap (T):	2020.12.31
Saját tőke:	42.418.398
Egy jegyre jutó NEÉ:	0,983488
Darabszám:	43.130.591

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:				65.436	100,00
Alapkezelői díj				12.823	19,59
Letétkezelői díj				1.267	1,94
Költségként elszámolt egyéb tétel				2.100	3,21
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség				49.246	75,26
I/3. Céltartalékok:				0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:				0	0,00
Kötelezettségek összesen:				65.436	100,00
II. ESZKÖZÖK					
				Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):				356.550	2,81
II/2. Egyéb követelés:				0	0,00
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):	Bank	Devizanem	Futamidó	0	0,00
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:				0	0,00
II/4. Értékpapírok (összes):		Devizanem	Névérték devizában	12.563.981	99,09
II/4.1. Állampapírok (összes):				183.947	1,45
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):				183.947	1,45
2021/A államkötvény		HUF	183.600	183.947	1,45
II/4.5. Befektetési jegyek (összes):				12.380.034	97,64
II/4.5.2. Tőzsdén kívüli (összes):				12.380.034	97,64
OTP SUPRA I SOROZAT		HUF	3.209.338	12.380.034	97,64
II/6. Származékos ügyletek értékelési különbözete				-241.561	-1,90
Eszközök összesen:				12.678.970	100,00

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

Kelt:

BUDAPEST, 2021. március 12.

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.

.....
 Köves Benedek Balázs
 vezérigazgató