

**Az
OTP Befektetési Alapok
2013. évi beszámolóí**

Tartalomjegyzék

| | |
|--|-----|
| A befektetési alapok teljesítményére hatással bíró értékpapír-piaci szegmensek | |
| 2013. évi eseményeinek bemutatása | 5 |
| 1) Hazai állampapírpiac | 5 |
| 2) Közép-kelet-európai részvénytőzsdék | 9 |
| 3) Fejlett részvénytőzsdék | 11 |
| 4) Feltörekvő részvénytőzsdék | 13 |
| Az OTP befektetési alapok állandó adatai | 14 |
| OTP Tőkegarantált Pénzpiaci Alap | 15 |
| OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alap | 20 |
| OTP Euró Pénzpiaci Alap | 24 |
| OTP Dollár Pénzpiaci Alap | 29 |
| OTP Optima Nyíltvégű Értékpapír Alap | 34 |
| OTP Maxima Kötvény Alap | 41 |
| OTP EMEA Alap | 46 |
| OTP Paletta Nyíltvégű Értékpapír Alap | 51 |
| OTP G10 Euró Származtatott Alap | 59 |
| OTP EMDA Származtatott Alap | 66 |
| OTP Supra Származtatott Alap | 74 |
| OTP Abszolút Hozam Nyíltvégű Származtatott Alap | 81 |
| OTP Föld Kincsei Árupiaci Alapok Alapja | 89 |
| OTP Új Európa Alap | 95 |
| OTP Ázsiai Ingatlan Alapok Alapja | 103 |
| OTP Omega Alapok Alapja | 108 |
| OTP Trend Alap | 113 |
| OTP Planéta Alapok Alapja | 119 |
| OTP Klímaváltozás 130/30 Alap | 126 |
| OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap | 132 |
| OTP Közép - Európai Részvény Alap | 139 |
| OTP Tőzsdén Kereskedett BUX Indexkövető Alap | 145 |
| OTP Orosz Részvény Alap | 151 |
| OTP Török Részvény Alap | 157 |
| OTP Afrika Részvény Alap | 164 |
| OTP Prémium Klasszikus Alap | 170 |
| OTP Prémium Kiegyensúlyozott Alap | 175 |
| OTP Prémium Származtatott Alap | 180 |
| OTP Prémium Euró Alap | 185 |
| OTP Prémium Növekedési Alap | 190 |
| OTP Agrárpiaci Trend Fix I. Alap | 195 |

| | |
|--|-----|
| OTP Agrárpiazi Trend Fix II. Alap | 201 |
| OTP Aranygól Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap | 206 |
| OTP Árupiaci Trend Fix I. Alap | 211 |
| OTP Árupiaci Trend Fix II. Alap | 216 |
| OTP Árupiaci Trend Fix III. Alap | 220 |
| OTP Dupla Fix II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap..... | 225 |
| OTP Dupla Fix Plusz Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap | 229 |
| OTP Dupla Fix Plusz II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap | 233 |
| OTP Eurogól Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 237 |
| OTP Európa-válogatott Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap..... | 241 |
| OTP Fejlett Piaci Trend Fix I. Alap | 246 |
| OTP Fejlett Piaci Trend Fix II. Alap | 252 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix I. Alap | 258 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix II. Alap | 263 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix III. Alap | 268 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IV. Alap | 273 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix V. Alap | 278 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VI. Alap | 282 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VII. Alap | 287 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VIII. Alap | 292 |
| OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IX. Alap | 298 |
| OTP Jövő Márkái Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap..... | 302 |
| OTP Jövő Márkái II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap..... | 307 |
| OTP Jubileum Tőkevédett Nyíltvégű Származtatott Alap | 312 |
| OTP Remix20 Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap..... | 317 |
| OTP Szinergia Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 321 |
| OTP Szinergia II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap..... | 326 |
| OTP Szinergia III. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 330 |
| OTP Szinergia IV. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap..... | 334 |
| OTP Szinergia Plusz Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 338 |
| OTP Szinergia Plusz II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 342 |
| OTP Trendvadász I. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 346 |
| OTP Trendvadász II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap | 350 |
| OTP Világjátékok Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap..... | 354 |

A befektetési alapok teljesítményére hatással bíró értékpapír-piaci szegmensek 2013. évi eseményeinek bemutatása

1) Hazai állampapírpiac

2013-ban jól teljesített a hazai állampapírpiac. A hozamok a leghosszabb, 15 éves lejárat kivételével az egész hozamgörbén csökkentek. A legnagyobb, két százalékpont feletti mértékben az éven belüli lejáratok hozamai csökkentek, a görbe közepén egy-másfél, a tízéves papírok esetében fél százalékponttal estek a hozamok, míg a görbe hosszú végén a 15 éves papír hozama 15 bázisponttal emelkedett. A hozamgörbe meredeksége drasztikusan nőtt, korábban soha nem volt ekkora hozamkülönbség a görbe eleje és vége között.

| (%) | 3 hó | 6 hó | 1 év | 3 év | 5 év | 10 év | 15 év |
|-----------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-------------|
| 2012.12.31 | 5.33 | 5.28 | 5.40 | 5.61 | 5.89 | 6.11 | 6.11 |
| 2013.03.31 | 4.71 | 4.63 | 4.58 | 5.12 | 5.61 | 6.27 | 6.43 |
| 2013.06.30 | 4.18 | 4.20 | 4.38 | 5.11 | 5.44 | 6.12 | 6.52 |
| 2013.09.30 | 3.55 | 3.62 | 3.60 | 4.55 | 5.08 | 5.83 | 6.42 |
| 2013.12.31 | 2.86 | 2.85 | 3.04 | 4.01 | 4.66 | 5.61 | 6.26 |
| Hozam-változás | -2.47 | -2.43 | -2.36 | -1.60 | -1.23 | -0.50 | 0.15 |

Az év jelentősebb piacmozgató események híján csendes állampapír-piaci kereskedéssel kezdődött. A hozamok a görbe elején tovább csökkentek, a közepén oldalaztak, míg a hosszú lejáratok hozamai enyhén emelkedtek. A forint az euróval szemben a 290-300 közötti sávban mozgott. A jegybank Monetáris Tanácsa a várakozásoknak megfelelően folytatta a kamatcsökkentési ciklust, január végén 25 bázisponttal vágta az irányadó kamatokat.

A csendesen csordogáló kereskedés a hazai állampapírpiacon február közepéig tartott ki, amikor a közel két évig szünetelő deviza-kibocsátás híre mozgatta meg a piacot. A dollárban denominált öt és tízéves kibocsátás hatalmas, közel 12 milliárd dolláros érdeklődést generált, végül másfél milliárd ötéves, és két milliárd tízéves kötvényt bocsátott ki az ÁKK. Ezzel lezárult a hosszú násztánc az IMF/EU párossal. Az ország bizonyította, hogy képes a piacról finanszírozni magát, így nem kényszerül a készenléti hitel felvételére. Ennek pozitív olvasata, hogy erősítettük gazdasági/finanszírozási szuverenitásunkat, negatív, hogy tágabb terünk lehet a nem kifejezetten piacbarát unortodox gazdaságpolitika folytatására, ezzel rontva növekedési kilátásainkat. A piac mindenesetre a forint állampapírok piacán is hozamcsökkenéssel díjazta a kibocsátás sikerét.

A forint is erősödni tudott, a kibocsátás sikere nyomán, a hónap közepén ismét 290 alá tudott erősödni az euróval szemben. Február végén az olasz választások után kialakult patthelyzet rontotta a nemzetközi befektetési hangulatot, ami kisebb gyengülést eredményezett.

Ezekben a hetekben fontos piacbefolyásoló tényező volt Simor András jegybank-elnök mandátumának lejárta március elején, és az új jegybank-elnök személye körüli

találgatások. A miniszterelnök végül az utolsó pillanatig kivárva március elsején nevezte meg jelöltjét, és Matolcsy György, korábbi gazdasági miniszter lett Simor követője. Így a piac által legnagyobb valószínűséggel várt jelölt lett a befutó. Matolcsy kinevezését óvatosan fogadta a piac, hiszen nevéhez köthető a sokak által bírált kormányzati gazdaságpolitika, amely bár az egyensúly irányába mozdította el az országot, de kétségkívül rombolta a növekedési potenciált, és a kiszámíthatóságot. Nem volt meglepő, hogy a forint gyengülésnek indult, átlépte a 300-es szintet az euróval szemben, és meg sem állt 308-ig.

A forint márciusi gyengülésében a jegybank-elnöki váltás mellett szerepet játszott a ciprusi válság is március közepén, amelynek az EU által kikényszerített megoldása a helyi bankok betéteseire óriási veszteségeket rótt. A betétesek bevonása a mentőcsomag költségeinek vállalásába megingatta az európai bankrendszerbe vetett bizalmat, ha a jövőben ez mintául szolgál, felgyorsíthatja a betétesek menekülését egy problémákkal küzdő bankból, országból, még sebezhetőbbé téve ezzel az euró-zóna periféria-országait és bankjait.

A gyengülés a forint mellett az állampapírokat is érintette, a hozamgörbe közepén és végén 20-30 bázisponttal emelkedtek a hozamok március eleje és közepe között. A 300 felett tartózkodó forint és a romló nemzetközi befektetési klíma sem akadályozta meg az MNB Monetáris Tanácsát abban, hogy február után márciusban is folytassa a kamatcsökkentést.

A ciprusi válság végső megoldása a befektetői bizalom visszatérését eredményezte április elejére, ami nagymértékű hozamcsökkenést eredményezett. A hozamcsökkenésben fontos szerepe volt annak is, hogy április közepén rendkívül kedvező inflációs adat látott napvilágot, növelve a valószínűségét a korábban beárazottnál nagyobb mértékű jegybanki kamatcsökkentésnek. Emellett fontos tényező volt az is, hogy a március elején belépő új jegybankelnök nem okozott felfordulást, a bejelentett hitelezés-élénkítő csomag (Növekedési Hitelprogram) kellően óvatos, elnyerte a befektetők tetszését. A külső környezet szintén támogatta a hozamok csökkenését, a japán jegybank óriási méretű likviditásbővítő programot jelentett be, estek a fejlett és fejlődő piaci hozamok, csökkentek a kockázati felárak, erős tőkebeáramlás volt megfigyelhető a fejlődő piacokra. A forint is jelentősen tudott erősödni, a március végi 304-es szintről május végére 286-ig erősödött az euróval szembeni jegyzés.

A május közepén publikált makro-adatok, mint a 40 éves rekord-alacsony szintre csökkenő infláció 1,7%-os adata, és a 0,7%-os negyedéves növekedést mutató GDP-adat - tovább növelte a vételi kedvet az állampapírpiacra. Kiszivárgott továbbá, hogy a kedvező fiskális folyamatok eredményeként az országnak jó esélye van arra, hogy az Európai Bizottság május 29-i ülésén a túlzottdeficit-eljárás megszüntetését javasolja Magyarországgal szemben, amivel 9 év után kerülhetnénk le a szegyenpadról. Május végére így a 3-5 éves hozamok 4,5%, a tízéves lejáratok hozama 5% alá csökkent, ezzel soha nem látott alacsony szintre zuhantak a forint állampapír-hozamok.

Az idillt azonban május végén megtörték a kedvező USA makro adatok nyomán felerősödő várakozások, miszerint a FED a korábban vártnál hamarabb kivezetheti likviditásbővítő programját (QE3). A várakozások hatására az amerikai állampapír-

hozamok gyors emelkedésbe kezdtek. A FED június 19-i ülésén Bernanke jegybankelnök tényleg utalt erre, így a következő napokban viharosan tovább emelkedtek a hozamok. Az amerikai tízéves állampapírhozam néhány hét alatt több mint 100 bázisponttal ugrott feljebb, ezzel pedig jelentősen csökkent a kockázatos eszközök vonzereje. A befektetők kockázati étvágyának csökkenése, a gyors tőkekivonás a kockázatos eszközökből a fejlődő piaci eszközöktől való elfordulást is jelentette. Gyengültek a devizák, a forint ismét 300 fölé került az euróval szemben. A hazai állampapírpiac három hét alatt 120-180 bázisponttal ugrottak a hozamok, a piacon már-már a pánik jelei mutatkoztak, jelentősen romlott a likviditás is. Szerencsére a piac június utolsó hetében megnyugodott, csökkent a volatilitás, 295-re jött vissza a forint a félév végére, és erősödtek a kötvények is, nagyjából 50 bázisponttal kerültek lejjebb a hozamok a csúcsokhoz képest június végére. Pozitív hír volt, hogy az Európai Bizottság május végi javaslatát jóváhagyta az EU pénzügyminisztereinek június végi ülése, az Ecofin is, így ténylegesen kikerült Magyarország a túlzottdeficit-eljárás alól.

A jegybank Monetáris Tanácsa a második negyedév során folytatta a tavaly augusztusban megkezdett kamat-csökkentési ciklust, minden ülésén 25 bázisponttal csökkentve az irányadó kamatot, amely így június végére 4,25%-ra esett.

A harmadik negyedév az állampapír-piacon úgy indult, ahogy a második véget ért: a június közepi FED-ülés utáni sokkot megnyugvás követte, csökkentek a hozamok, majd beállt a piac egy szűk sávba, a következő heteket unalom és oldalazó mozgás jellemezte. A forint árfolyama az euróval szemben már a 290-et közelítette. Az unalmas kereskedést egy miniszteri nyilatkozat törte meg, miszerint a kormány a lakossági devizahitelek végső rendezésére törekszik. Megindult a találgatás, hogy mindez mit jelenthet, és mekkora terhet róhat a bankrendszerre. A bizonytalanságot fokozta, hogy az OTP Bank elnök-vezérigazgatója nagy volumenű OTP részvényeladásba kezdett. A forint gyengüléssel reagált, és július végére ismét 300 közelébe emelkedett az árfolyam. Az állampapír-hozamok 40-80 bázisponttal, a hosszabb lejáratok nagyobb mértékben emelkedtek.

Augusztus elején a jegybank és a kormány előtörlesztette az IMF-hiteleket, így ismét demonstrálta, hogy az ország segítség nélkül, a piacról képes finanszírozni magát, és önálló gazdaságpolitikát kíván folytatni a nemzetközi szervezetek korlátozásai, tanácsai, segítsége nélkül. Az augusztus végén és szeptember elején kibontakozott szíriai válság, amely nemzetközi konfliktus kirobbanásával fenyegetett, valamint a FED QE3 programjának várt kivezetése kockázatkerülésre készítette a befektetőket, így a fejlődő piaci eszközök árai is megsínylették a válságot. Ennek köszönhetően tovább gyengült a forint, tartósan 300 felett ragadt az euróval szemben. Az állampapír-hozamok is tovább emelkedtek, az ötéves papírok hozama a 6%-ot közelítette szeptember elején, míg a tízévesé 6,70% fölé, a tizenöt évesé 7,20%-ra nőtt.

A szíriai válság szeptember közepére megoldódott, egyrészt Obama elnök nem tudott törvényhozási támogatást szerezni a támadáshoz, másrészt az orosz diplomácia olyan javaslattal állt elő a vegyi-fegyverek ellenőrzése kapcsán, amit minden fél elfogadott. A szeptember közepi FED-ülésen meglepetésre nem kezdtek meg a havi 85 milliárd dolláros mennyiségi lazítás kivezetését (tapering). A befektetők a vártnál lazább monetáris politikára pozitívan reagáltak, hiszen az olcsó

pénz tovább támogatja a kockázatos eszközök magas árazását. A forint stabilan 300 alá erősödött az euróval szemben szeptember végére, az állampapír-hozamok pedig 70-80 bázisponttal estek szeptember utolsó három hetében.

Az MNB Monetáris Tanácsa folytatta a kamatvágási ciklust a harmadik negyedév folyamán is. Júliusban 25 bázisponttal vágott a kamaton, amely így 4%-ra csökkent, és egyúttal jelezte, hogy ezt követően is folytatódhat a kamatcsökkentések sora, de kisebb ütemben. Augusztusban és szeptemberben így 20-20 bázisponttal csökkentették az irányadó kamatot, amely ezzel 3,6%-ra csökkent a harmadik negyedév végére. A szeptember végén megjelent inflációs jelentésében az MNB emelte az ide és jövő évre vonatkozó növekedési prognózisát, és csökkentette inflációs előrejelzését. A jegybank jelezte, hogy az alacsony inflációs nyomás lehetőséget biztosít a további kamatcsökkentésekre is.

A szeptemberi FED-döntés a tapering halasztásáról tartós vételi kedvet generált, globálisan jól teljesítettek a kockázatos eszközök, köztük a hazai állampapírok és a forint is. Az éven túli kötvények hozama szeptember közepe és október vége között 100-140 bázisponttal esett, míg a forint a 300 feletti euróval szembeni szintről 290 közelébe erősödött. A kamatkilátásokat tovább javította a kormány újabb bejelentése a rezsicsökkentés második köréről, amely szerint a januári 10%-os lakossági energia árcsökkentést követően novemberben újabb 11,1%-kal csökkennek az árak, ezzel a csökkentés mértéke összesen már 20%-ot tesz ki a 2012. végi árakhoz viszonyítva. Mindez hozzájárul ahhoz, hogy az infláció 40 éve nem látott alacsony szintre csökkent 2013-ban.

Novemberben kifulladt a pozitív lendület, kisebb korrekciót láthattunk a piacon. A befektetők kivártak a vételekkel, amihez hozzájárult a devizahitelekkel kapcsolatos bizonytalanság növekedése. A Kúria jogegységi döntése december elején született meg, amelyben kimondta ezen hitelek jogszerűségét és érvényességét. Csak ezt követően tudtak ismét csökkenni a hozamok az év utolsó heteiben, és erősödni a forint, amely így 300 alatt tudta zárni az évet, bár a piac likviditása az év utolsó heteiben már alacsony volt. Az év végi erősödést a FED december közepi döntése sem gátolta, amely a kedvező amerikai makro adatok hatására a mennyiségi élénkítés ütemének havi 10 milliárd dollárral való csökkentése mellett döntött.

A jegybank Monetáris Tanácsa a negyedik negyedévben is a várakozásoknak megfelelően lépett, mindhárom ülésén 20 bázisponttal vágta a kamatokat. Az irányadó kamat ezzel december végére 3%-ra csökkent. Mindezzel a hozamgörbe meredeksége is soha korábban nem látott szintre nőtt.

A külföldi befektetők állománya 2013-ban alig változott, az év végi 5000 milliárd forintos kezükben lévő állomány megegyezett az egy évvel korábbi mennyiséggel. Mindez azt is jelenti, hogy a lejáratot meghaladó többlet-kibocsátást hazai szereplők szívták fel, elsősorban a hazai bankrendszer növelte a kezében lévő állományt. Ők vélhetően a drasztikusan csökkenő jegybanki kamatok miatt eső kamatmarzsukat igyekeztek növelni azzal, hogy a meredekebbé váló hozamgörbén hosszabb lejáratú és magasabb hozamot biztosító állampapírokat vásároltak.

Hazánk javuló befektetői megítélését mutatja, hogy az ország CDS-felára enyhén csökkent 2013-ban. Az év eleji 278-ról 260 bázispontra esett december végére. A

német kötvények feletti hozam-felár szintén csökkent. Míg a magyar tízéves kötvények hozama 50 bázisponttal csökkent az év során, addig a tízéves német bund hozama 61 bázisponttal emelkedett, a spread ezzel 111 bázisponttal csökkent, az év eleji 479 bázisponttól december végére 368-ra szűkült.

A fent leírtak következtében az éven túli futamidejű állampapírok árfolyam alakulását mutató MAX index jelentős mértékben, 4,3 százalékponttal felülteljesítette az egy évnél rövidebb állampapírok mozgását leíró RMAX indexet 2013-ban.

2) Közép-kelet-európai részvénytőzsiatok

A közép-kelet-európai részvénytőzsiatok elmúlt évi teljesítménye élesen elvált a fejlett piacok által bejárt pályától. A régió részvénytőzsiatai közül egyedül a hazai tudott pozitív teljesítményt nyújtani az elmúlt évben. A leggyengébb teljesítményt a belpolitikai viszályoktól, tüntetésektől sújtott török piac nyújtotta, de szintén lemaradó volt a lengyel piac is, ahol a nyugdíjrendszer reformja okozott fejtörést a befektetőknek. Érzékenyen érintette a régiót a ciprusi válság, a szíriai események, illetve évvégén az amerikai monetáris politikát érintő huzavona, majd a lazítás csökkentése.

| | WIG20 | | PX | | BUX | CETOP20 | |
|---------------------|--------|---------|--------|---------|--------|---------|--------|
| | PLN | HUF | CZK | HUF | HUF | EUR | HUF |
| 2013. I. negyedév | -8,24% | -6,54% | -7,3% | -5,79% | -1,74% | -10,63% | -6,64% |
| 2013. II. negyedév | -5,25% | -11,27% | -8,79% | -12,11% | 6,53% | -6,77% | -9,57% |
| 2013. III. negyedév | 6,50% | 10,56% | 9,03% | 11,33% | -1,90% | 6,79% | 7,99% |
| 2013. IV. negyedév | 0,40% | 1,53% | 3,28% | -3,65% | -,53% | 1,20% | 0,66% |
| 2013. év | -7,05% | -6,92% | -4,78% | -11,17% | 2,15% | -9,96% | -8,22% |

A lengyel, cseh és magyar tőzsdéindexek nominális (nem évesített) hozamai

| | TR20I | | RDXUSD | | DJAFK | |
|---------------------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|
| | TRY | HUF | USD | HUF | USD | HUF |
| 2013 I. negyedév | 7,54% | 14,72% | -4,65% | 2,51% | -2,24% | 5,03% |
| 2013. II. negyedév | -10,88% | -20,1% | -9,09% | -13,2% | -10,94% | -14,96% |
| 2013. III. negyedév | -2,61% | -9,80% | 11,95% | 8,50% | 10,92% | 7,50% |
| 2013. IV. negyedév | -8,90% | -15,97% | 1,89% | -0,01% | 2,55% | 0,64% |
| 2013. év | -14,40% | -30,14% | -0,93% | -2,84% | -0,51% | -2,43% |

A török, az orosz és az afrikai tőzsdéindexek nominális (nem évesített) hozamai

Az első negyedévben a régió országaiban alapvetően kedvezőtlen makrogazdasági adatok láttak napvilágot. Ennek ellenére Magyarországon és Lengyelországban továbbra is rendületlenül folytatódott a monetáris lazítás, az irányadó jegybanki kamatok csökkentése. A politikai szintéren említésre méltó eseménynek a cseh elnökválasztás és a magyar jegybank elnökének kinevezése bizonyult. Milos Zeman,

a megválasztott új cseh elnök Európa párti politikusnak ismert, ugyanakkor ellenzi a közelmúltban elfogadott, a költségvetés egyensúlyba hozását célzó megszorító intézkedéseket. Gyakorlati beleszólása a gazdasági politikába azonban limitált. Nem úgy, mint az újonnan megválasztott magyar jegybankelnöknek, aki alapvetően a kormány gazdaságpolitikáját támogató monetáris politikát kíván folytatni és esetleges unortodox intézkedéseitől előre megijedtek a befektetők.

A negyedév végére a ciprusi bankválság és főleg annak megoldása borzolta fel a befektetők kedélyét. A betétesek bevonása a bankmentésbe olyan precedenst teremtett, ami kedvezőtlen körülmények között alááshatja a dél-európai országok bankjainak stabilitását és akár Európából történő jelentősebb tőkeáramláshoz is vezethet.

A negyedév gazdaságpolitikai jolly jokere Magyarországon a rezsicsökkentés volt. Ami egyszerre mérsékli az inflációt, teret engedve ezzel a bátrabb kamatvágásoknak és segíti a gazdasági növekedést, hiszen több elkölthető pénzt hagy a lakosságnál. Az intézkedés hosszabb távú hatásának elemzésétől most eltekintünk, a várt rövid távú pozitív gazdaságélénkítő hatást is veszélyben érezzük ugyanakkor a szokatlanul hideg márciusi időjárás miatt.

A török piacon megfigyelhető, számunkra is meglepő nagyságú emelkedés elképzelhető, hogy az ország második nagy hitelminősítő intézet általi felminősítésére vonatkozó várakozásoknak volt köszönhető. Ezzel szemben az orosz piac szépen induló teljesítményét a ciprusi események negatívan befolyásolták, ami nem meglepő ismerve az orosz cégek ciprusi kötődését.

A második negyedévben tovább folytatódott a fejlett és fejlődő piacok teljesítményének elválása. Ennek oka leginkább az egyes régiók növekedési prognózisában található eltérés. Míg az Egyesült Államokban a kedvező gazdasági adatok miatt a befektetők már a likviditásfokozó lépések visszafogására számítottak, addig a világ többi része továbbra is növekedési kihívásokkal szembesült. A világgazdasági trendek mellett egyedi tényezők is befolyásolták a régió teljesítményét. A cseh piac eséséhez a kormányfő ellen felhozott korrupciós vádak, és annak lemondása is mélyítette. Lengyelországban pedig a magán-nyugdíjpénztári rendszer tervezett reformja szomorította el a befektetőket. A török piac május végére új csúcsra emelkedett, utána azonban a tüntetések egyfajta katalizátorként felerősítették az amúgy is negatív hangulatot, amit az amerikai monetáris politikával kapcsolatos aggodalmak váltottak ki.

A harmadik negyedév egyik legjobban teljesítő piaca az orosz részvénytőzsdé volt. Ez egyrészt a szíriai konfliktus miatt magasan stabilizálódó kőolajáraknak, másrészt az ország minimális finanszírozási igényének volt köszönhető. Az utóbbi tulajdonság miatt az ország a feltörekvő piacok közül a legkevésbé érintett az amerikai pénzpumpa leállításának negatív következményeitől. Ami a régió többi piacát illeti, a befektetői figyelem középpontjába a lengyel nyugdíjpénztári rendszer reformja került. Úgy tűnik, a magyarországihoz hasonló államosítás helyett, valamivel piacbarátabb megoldás kerül megvalósításra, és a pénztárak vagyonából történő nettó tőkeáramlás csak egy-két év múlva várható.

A magyar piac alulteljesítéséért részben a kormányzati politika volt felelős, a devizahitelek bankok kárára történő megmentése a hitelfelvevők körében lényegesen népszerűbb ötletnek tűnt, mint az OTP befektetők számára. A MOL vezérigazgatója ellen kiadott letartóztatási parancs, illetve az INA irányítási jogáért folytatott vita pedig a másik magyar nagy súlyú cég árfolyam korrekciójáért volt felelős.

A fejlődő országok szuverén kötvényeinek az Egyesült Államok hasonló papírjaihoz viszonyított felárát mérő indikátor, az EMBI Plusz index értéke egész évben a tavalyi átlagérték fölött mozgott, ami részben a mennyiségi lazítás kivezetésétől való félelem, részben a geopolitikai konfliktusok eredménye volt.

A negyedik negyedévben zajlottak a cseh parlamenti választások, ahol a piac számára legrosszabb verziót, a szociáldemokrata-kommunista koalíciót sikerült elkerülni és végül a piacbarát ANO is bekerült a kormányba.

Eközben a hazai részvénypiaci folyamatokat továbbra is a devizahitelek veszteségének bankokra háritásától való félelem, a közszolgáltatások árának még választások előtti további csökkentésére irányuló ígéret és az amerikai mennyiségi lazítás kivezetésére vonatkozó várakozások mozgatták. Lengyelországban a legfőbb tőkepiaci esemény a nyugdíjpénztári reformra vonatkozó törvény elfogadása volt. Ennek alapján a pénztáraknak február 3-án vagyonuk 51,5%-át vissza kell transzferálniuk az államnak.

Törökországban az év utolsó negyedéve decemberig nem sok izgalmat tartogatott, enyhe lecsorgás jellemezte a többi fejlődő piaccal összhangban. Decemberben egy korrupciós ügy kapcsán robbant ki a botrány, amelynek hullámai a kormányt is elérték, több miniszter is leváltásra került. A májusi tüntetések után egy újabb belpolitikai zavar erőteljes reakciót váltott ki, a részvények és a török líra is esni kezdtek. Szerencsére az orosz piac, ami sok esetben a törökkel ellentétesen mozog, most is negatívan korrelált és emelkedni tudott.

3) Fejlett részvénypiacok

A fejlett részvénypiacok több mint egy évtizede nem zártak annyira kedvező évet, mint 2013-ban. Saját devizában mérve az amerikai tőzsde közel 30%, az európai piacok 15-20%, míg a japán piac 40%(!) fölötti emelkedést könyvelhetett el. Mindez a részvénypiacokra hosszútávon jellemző 15-20%-os éves volatilitást messze alulmúló, mindössze 10%-os évesített hozamingadozás mellett valósult meg.

A magas hozam, alacsony szórás kombinációja kétség kívül a fontosabb jegybankok által fenntartott likviditásbőségnek volt köszönhető. A monetáris expanzió a reálgazdaság élénkítésében is sikereket ért el, így egyfajta pozitív spirál jött létre az eszközárak és a reálgazdasági aktivitás között, amit a befektetők jegybankok által generált optimizmusa hozott létre. A várakozásokon keresztül tehát a monetáris politika mestereinek sikerült a gazdasági és tőkepiaci lendületet fenntartani.

Az év emelkedéssel kezdődött. Ez több tényezőnek volt köszönhető, amelyek közül talán a legfontosabb a várakozásoknál kedvezőbb amerikai makro adatok voltak. Az amerikai gazdaság erőre kapása ráadásul nem tántorította el a Federal Reserve-öt az ultra laza monetáris politikai fenntartásától, így az első negyedévben az amerikai részvénybefektetők a legideálisabb feltételek mellett kockáztathatták pénzüket. Ez csak részben volt elmondható az európai piacokról: az Európai Központi Bank ugyan szintén elkötelezte magát az ultra könnyű monetáris politikai mellett, azonban a Ciprusi bankrendszer összeomlása és az erre adott brüsszeli válasz elbizonytalanította a befektetőket az Uniós intézményrendszer megbízhatóságát illetően. A Japán Jegybank monetáris lazításának köszönhetően a szigetország részvénypiaca is jól teljesített, noha a gazdaság talpra állása még várat magára.

A második negyedévben a jegybankok által biztosított ultra-laza monetáris politikával kapcsolatos kérdések befolyásolták leginkább a fejlett részvénypiacok mozgását. Május folyamán a fejlett részvénypiacok egyik történelmi csúcstól a másik után döntöttek meg. A már-már eufórikus emelkedés a hónap közepén szakadt meg, amikor is a FED döntéshozói közül egyre többen nyilatkoztak úgy, hogy a kötvényvásárlási programot a korábban tervezettnél előbb is csökkenteni lehet, köszönhetően a javuló makro adatoknak. Ennek hatására a kötvényhozamok felfelé indultak, ami a múltban gyakran részvénypiaci korrekcióval járt együtt, dacára az érvelés mögött rejlő fundamentális javulásnak. Emellett az új kínai vezetés a túlterjeszkedő bankrendszer megrendszabályozása mellett döntött, és a bankközi piaci likviditás szűkítésével próbálta elérni a hitelezési aktivitás csökkentését. Ez a lépés azonban június folyamán a bankközi kamatszint drasztikus emelkedését és így kisebbfajta pánikot váltott ki bel- és külföldön egyaránt.

A harmadik negyedév elején a fejlett részvénypiacokon a májusban még domináns makro-aggodalmak (kínai lassulás, amerikai monetáris szigorítás) helyett a vállalati gyorsjelentések váltak a fő piacmozgató erővé. Az amerikai piacon főleg a kisebb cégek számoltak be kedvező eredményekről, ami a Russell 2000-es small cap index 200 bázispontos túlteljesítésében öltött testet az S&P500-hoz képest. Augusztusban aztán a FED által napirenden tartott, de még el nem kezdett monetáris szigorítással kapcsolatos befektetői aggodalmak, illetve a szíriai polgárháborúba való amerikai katonai beavatkozás lehetősége a kockázatok újraértékelésére készítette a befektetőket, ami az árfolyamok lemorzsolódását eredményezte. Szeptemberben ismét erőre kaptak a fejlett részvénypiacok. Ez részben a javuló európai és ázsiai makro adatoknak volt köszönhető, részben pedig annak, hogy a FED elállt a kötvény-visszavásárlási program májusban beharangozott csökkentésétől. Amikor azonban világossá vált, hogy a FED az amerikai hitelfelvételi plafon körüli várható politikai csatározásoktól és újabb fiskális szigorítástól tartva nem merte mérsékelni a kötvényvásárlások ütemét, a részvényárfolyamok ismét csökkeni kezdtek.

A negyedik negyedévben a fejlett piaci befektetőket az amerikai költségvetéssel kapcsolatos politikai huzavona, illetve az erre adandó monetáris politikai reakció tartotta lázban. A kialakult politikai patthelyzetben első nekifutásra nem sikerült az adósságplafon megemelésével biztosítani a szövetségi szintű adminisztráció finanszírozását, így az ezt követő kormányzati leállás érezhető idegességet okozott a részvénypiacokon. Amikor azonban világossá vált, hogy a választók ezért inkább a konzervatívokat, azon belül is a Tea Party-t teszik felelőssé, megtört a konzervatívok ellenállása és lehetővé vált a tárgyalások felújítása. Ezzel párhuzamosan a

részvénypiacok emelkedésnek indultak. December elején a két párti tárgyaló csoportnak sikerült mindkét fél számára elfogadható megoldást találnia, így elhárult annak a veszélye, hogy január közepén ismét lebénuljon a szövetségi szintű adminisztráció. Erre érdekes mód a részvénypiacok azonban eséssel reagáltak, ami azzal a mögöttes feltevessel volt magyarázható, hogy a fiskális probléma elhárulása lehetővé teszi a FED számára a monetáris lazítás óvatos visszavételét. Erre a FED december 18-án tartott ülésén sorkerült, és a piaci várakozásoknak megfelelően a FED a korábbi havi 85 milliárd dollárról 75 milliárdra csökkentette a kötvény-visszavásárlások ütemét elsősorban a javuló munkaerő-piaci statisztikákra hivatkozva. A jegyzőkönyvből az is kiderült, hogy a monetáris tanács tagjai tényleges kamatemelésre csak 2014. után látnak esélyt. Vélhetőleg ennek volt köszönhető, hogy a kötvény-visszavásárlási ütem csökkentése ellenére a részvénypiacok nagyon emelkedtek a bejelentést követően.

4) Feltörekvő részvénypiacok

A 2013-as év nem a feltörekvő részvénypiacokról szólt, a teljes régiót lefedő MSCI MXEF index -2,60%-os teljesítményt ért el az elmúlt évben. A piacokat számos megrázkódtatás érte, a kínai piac megtorpanásától kezdve, a ciprusi bankválságon át az amerikai monetáris lazítás szigorításáig.

A mögöttes folyamatok közül az első negyedévben a legnagyobb jelentőséggel a kínai gazdaság ismételt megtorpanása állt, de negatív tényezőt jelentett a cipruson kirobbanó válság is, amely ismét megmutatta az euró-zóna pénzügyi rendszerének a törékenységét és az összefogás politikai nehézségeit. Szintén negatívan hatott a részvénypiacokra a FED kommunikációjának megváltozása: nyáron ugyanis kilátásba helyezték az „ultra laza” monetáris politika szigorítását. Ez a várakozásokba is egyre jobban beépült és meg is indult a fejlődő piaci kötvényekből a pénzkiáramlás, magával rántva az országok devizáit is. Köszönhetően annak, hogy a szigorítás nem történt meg a harmadik negyedévben, ráadásul a kínai gazdaság is az élénkülés jeleit mutatta, két negyedévi lejtmenet után a feltörekvő piaci részvényindexek erősödést mutattak. A kedvező teljesítmény kitartott év végéig, az utolsó három hónap is az indexek erősödését hozta magával.

A kedvező teljesítményhez hozzájárult, hogy a kínai pártkongresszus igazán ígéretes reformokat helyezett kilátásba. Terveik szerint nagyobb szerepet szánnak majd a piaci mechanizmusoknak a jelenleg állami irányítás alatt álló gazdasági szegmensekben is, és a mindenáron való növekedés helyett a fenntarthatóságra helyezik a hangsúlyt. Hogy a gyakorlatban sikerül-e ezt kivitelezni, az a jövő nagy kérdése. A FED monetáris politikájával kapcsolatos kilátások is nagy jelentőséggel bírtak. Hosszas huzavona után év végén végül megindult a „likviditáspumpa” lassú leszerelése. A piac korábban ettől nagyon tartott, de úgy tűnik, a „fárasztás” sikeres volt, senkit nem ért már meglepetésként a lépések bejelentése, és egyáltalán nem okozott pánikreakciókat a kockázatos eszközök piacán

Az OTP befektetési alapok állandó adatai

1. Általános adatok

| | | |
|------------------------|-----------|--|
| Az alapkezelő társaság | neve | OTP Alapkezelő Zrt. |
| | székhelye | 1134 Budapest, Váci út 33. |
| A letétkezelő társaság | neve | OTP Bank Nyrt. |
| | székhelye | 1051 Budapest, Nádor u. 16. |
| A forgalmazó | neve | OTP Bank Nyrt. |
| | székhelye | 1051 Budapest, Nádor u. 16. |
| A könyvvizsgáló | neve | Deloitte Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft. |
| | székhelye | 1068 Budapest, Dózsa György út 84/c. |

2. Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások

Az OTP Alapkezelő Zrt. igazgatóságában a 2012. év során személyi változások nem történtek.

3. Az Alapkezelő személyi állománya

A Társaság 2013. december 31-én 32 főállású és 1 részmunkaidős munkatársat foglalkoztatott.

4. Az alapok hitelfelvételei

Az OTP Alapkezelő által kezelt befektetési alapok 2013-ban nem vettek fel hitelt.

Beszámoló a 2013. évről – OTP Tőkegarantált Pénzpiaci Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2005.01.20-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 315,681,026,338 | 1.580826 |
| 2013.02.28 | 320,591,192,569 | 1.585835 |
| 2013.03.28 | 327,205,068,130 | 1.590541 |
| 2013.03.29 | 327,440,597,847 | 1.590706 |
| 2013.04.30 | 329,527,586,750 | 1.595716 |
| 2013.05.31 | 325,618,389,634 | 1.600272 |
| 2013.06.28 | 333,082,447,756 | 1.604075 |
| 2013.07.31 | 332,283,382,436 | 1.608115 |
| 2013.08.30 | 331,029,383,150 | 1.611459 |
| 2013.09.30 | 324,101,653,881 | 1.614605 |
| 2013.10.31 | 313,098,198,429 | 1.617467 |
| 2013.11.29 | 306,722,974,158 | 1.619925 |
| 2013.12.31 | 298,142,276,983 | 1.622234 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 196,049,383,871

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 26 936 998 395 | 24 494 142 093 |
| 2013.február | 23 636 182 714 | 20 059 353 978 |
| 2013.március | 26 776 980 595 | 23 559 371 609 |
| 2013.április | 23 947 723 271 | 24 226 742 372 |
| 2013.május | 23 314 893 158 | 26 013 635 408 |
| 2013.június | 27 008 952 767 | 22 560 880 200 |
| 2013.július | 36 619 664 519 | 40 646 273 405 |
| 2013.augusztus | 20 886 657 602 | 19 599 378 315 |
| 2013.szeptember | 18 304 928 122 | 23 709 415 791 |
| 2013.október | 15 938 536 370 | 23 158 175 041 |
| 2013.november | 17 102 259 083 | 19 361 603 493 |
| 2013.december | 28 983 597 290 | 26 346 897 084 |
| Összesen: | 289 457 373 886 | 293 735 868 789 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 183,785,001,653

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2005/12/30 | 35,332,849,945 | 1.053890 |
| 2006/12/29 | 187,254,177,978 | 1.110391 |
| 2007/12/29 | 257,688,431,913 | 1.183780 |
| 2008/12/31 | 223,499,884,054 | 1.273240 |
| 2009/12/31 | 265,111,319,720 | 1.368862 |
| 2010/12/31 | 294,235,340,362 | 1.424963 |
| 2011/12/30 | 335,729,019,247 | 1.491647 |
| 2012/12/28 | 308,660,990,163 | 1.574404 |
| 2013/12/31 | 298,142,276,983 | 1.622234 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Tőkegarantált Pénzpiaci Alap, olyan befektetés, amellyel hazai bankbetétekbe, rövid lejáratú állampapírokba, jelzáloglevelekbe lehet elhelyezni. Az alap jellemző befektetéseit rövid lejáratú forint betétek alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 308,66 milliárd Ft-ról 298,14 milliárd Ft-ra csökkent. Az OTP Tőkegarantált Pénzpiaci Alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 3,04% lett.

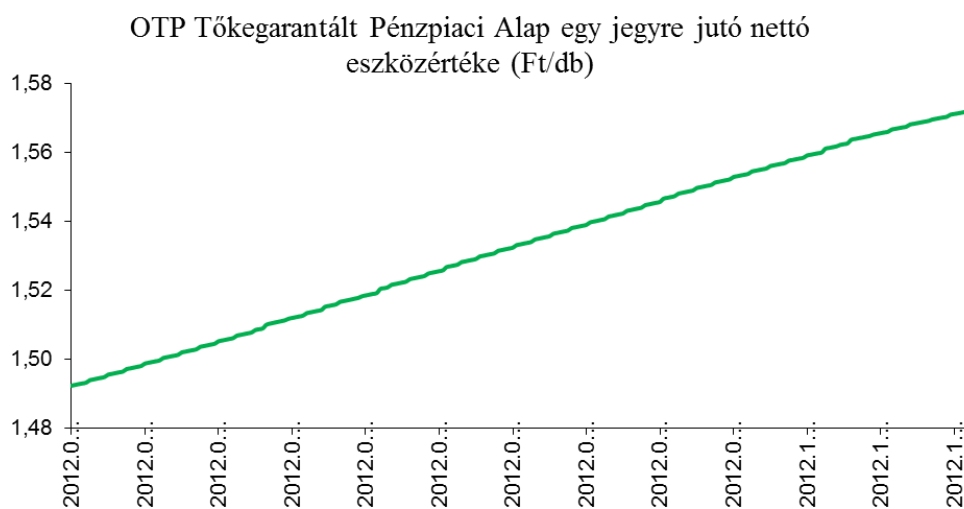
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 7 | 41 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. 0 - 1 hét | | | 7 055 250 | 155 548 300 | | 49,67% |
| OTP Bank Nyrt. 1 - 2 hét | | | 288 000 000 | 120 000 000 | | 38,32% |
| OTP Bank Nyrt. 3 hónap | | | 10 000 000 | 0 | | 0,00% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 305 055 257 | 275 548 341 | | 87,99% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Diszkont kincstárjegyek: | | 178 | | 2 239 | | 0,00% |
| D130220 | 2012.03.07 - 2013.02.20 | 178 | | 0 | | 0,00% |
| D140108 | 2013.01.09 - 2014.01.08 | 0 | | 2 239 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 5 107 445 | | 22 561 821 | | 7,20% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 3 082 286 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 2 025 159 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 6 570 378 | | 2,10% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 15 991 443 | | 5,10% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 5 107 623 | 0 | 22 564 060 | 0 | 7,20% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 14 971 706 | | 4,78% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 508 304 | 104 976 | | 0,03% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | 0 | | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 508 304 | 15 076 682 | | 4,81% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 310 671 184 | 313 189 083 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 392 430 | 386 243 | | 52,60% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 39 189 | | 5,34% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 19 460 | 20 416 | | 2,78% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 145 517 | 288 488 | | 39,28% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 557 407 | 734 336 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 310 113 777 | 312 454 747 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 196 875 724 479 | 192 597 229 576 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 1,57517529 | 1,62232212 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 199 318 580 781 | | 1,580643 |
| 2013. február 28. | 202 895 409 517 | | 1,585666 |
| 2013. március 29. | 206 113 018 503 | | 1,590380 |
| 2013. április 30. | 205 833 999 402 | | 1,595115 |
| 2013. május 31. | 203 135 257 152 | | 1,599991 |
| 2013. június 28. | 207 583 329 719 | | 1,603817 |
| 2013. július 31. | 203 556 720 833 | | 1,607880 |
| 2013. augusztus 30. | 204 844 000 120 | | 1,611132 |
| 2013. szeptember 30. | 199 439 512 451 | | 1,614123 |
| 2013. október 31. | 192 219 873 780 | | 1,617211 |
| 2013. november 29. | 189 960 529 370 | | 1,619684 |
| 2013. december 31. | 192 597 229 576 | 312 454 746 694 | 1,622322 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 5 107 623 | 100,00% | 22 564 060 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 5 107 623 | 100,00% | 22 564 060 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 5 107 623 | 100,00% | 22 564 060 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 14 535 599 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -4 836 520 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -84 128 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -405 |
| | felügyeleti díj: | -80 644 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -1 462 |
| f) | nettó jövedelem: | 9 532 440 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 9 532 440 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -7 187 360 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -4 110 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 22 032 643 | 14 536 218 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 2 903 | 619 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 4 838 485 | 5 002 644 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 476 | 515 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 17 190 779 | 9 532 440 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013.09.24-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.09.25 | 397,820,715 | 1.001306 |
| 2013.09.30 | 2,736,130,209 | 1.001543 |
| 2013.10.31 | 16,071,107,326 | 1.00409 |
| 2013.11.29 | 24,646,299,104 | 1.006306 |
| 2013.12.31 | 35,809,286,458 | 1.007976 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az induláskori befektetési jegy állománya (db)
397,301,755

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Viszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| 2013.szeptember | 4 012 567 478 | 5 512 094 |
| 2013.október | 13 890 482 208 | 1 336 056 343 |
| 2013.november | 10 628 331 816 | 1 836 769 701 |
| 2013.december | 14 358 861 779 | 3 530 011 487 |
| Összesen: | 42 890 243 281 | 6 708 349 625 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 35,525,933,796

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 szeptemberében indította el az OTP Alapkezelő második forintban denominált pénzpiaci alapját, amely hosszabb lejáratú szerkezettel bíró portfóliót tart a magasabb várható hozam elérése érdekében. Az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alap, olyan befektetés, amellyel a megtakarításokat döntően hazai rövid lejáratú állampapírokba, jelzáloglevelekbe, illetve bankbetétekbe lehet elhelyezni. Az alap vagyona az indulástól 2013. év végére 35,8 milliárd Ft-ra nőtt.

3. Vagyonkimutatás

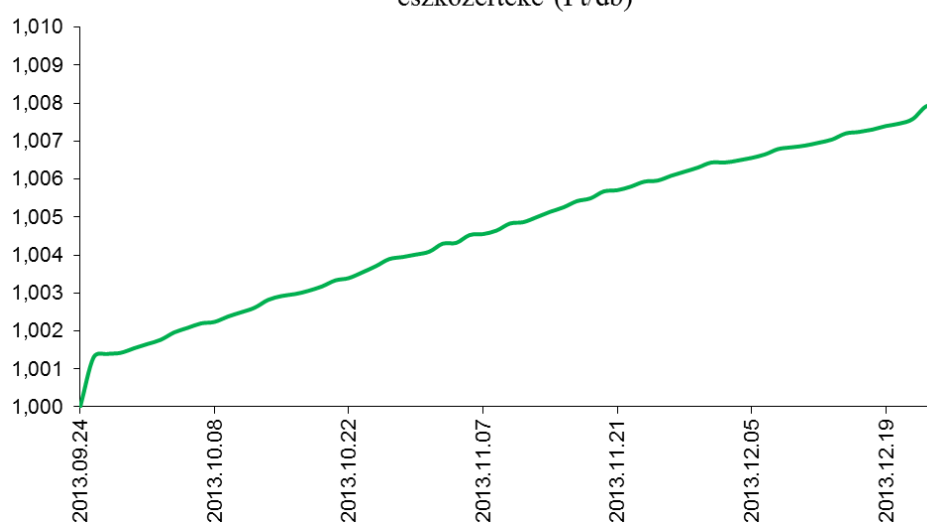
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-----------------|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.09.24 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 200 000 | 30 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | 4 999 970 | | 12,27% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 200 000 | 5 000 000 | | 12,27% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 0 | | 1 066 177 | 2,61% |
| 2014/C | 2003.06.19 - | 2014.02.12 | 0 | | 420 715 | 1,03% |
| 2014/D | 2011.01.19 - | 2014.08.22 | 0 | | 645 462 | 1,58% |
| Diszkont kincstárjegyek: | | | 0 | | 18 711 569 | 45,92% |
| D140108 | 2013.01.09 - | 2014.01.08 | 0 | | 163 628 | 0,40% |
| D140115 | 2013.10.16 - | 2014.01.15 | 0 | | 1 314 082 | 3,22% |
| D140205 | 2013.11.06 - | 2014.02.05 | 0 | | 2 019 889 | 4,96% |
| D140305 | 2013.03.06 - | 2014.03.05 | 0 | | 48 744 | 0,12% |
| D140326 | 2013.12.30 - | 2014.03.26 | 0 | | 4 788 000 | 11,75% |
| D140409 | 2014.01.08 - | 2014.04.09 | 0 | | 4 043 119 | 9,92% |
| D140430 | 2013.05.02 - | 2014.04.30 | 0 | | 39 926 | 0,10% |
| D140625 | 2013.06.26 - | 2014.06.25 | 0 | | 2 220 683 | 5,45% |
| D141015 | 2013.10.16 - | 2014.10.15 | 0 | | 3 878 954 | 9,52% |
| D141126 | 2013.12.11 - | 2014.11.26 | 0 | | 194 544 | 0,48% |
| MNB Kötvények: | | | 0 | | 15 675 537 | 38,47% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | 0 | | 5 924 464 | 14,54% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | | 9 751 073 | 23,93% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 0 | 0 | 35 453 283 | 87,00% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | 295 630 | 0,73% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 0 | 425 | 0,00% |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 0 | 296 055 | 0,73% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 200 000 | | 40 749 338 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 0 | | 33 333 | 0,82% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 2 578 | 0,06% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 0 | | 1 352 | 0,03% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 0 | | 4 045 831 | 99,09% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 0 | | 4 083 094 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 200 000 | | 36 666 244 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 200 000 000 | | 36 381 893 656 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | | 1,00 | | 1,01 |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013.szeptember 9. | 200 000 000 | 200 000 000 | 1,000000 |
| 2013. szeptember 30. | 4 207 055 384 | | 1,001543 |
| 2013. október 31. | 16 761 481 249 | | 1,004090 |
| 2013. november 29. | 25 553 043 364 | | 1,006306 |
| 2013.december 31. | 36 381 893 656 | 36 666 244 352 | 1,007816 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.09.24 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 35 453 283 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 34 387 106 | 96,99% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 35 453 283 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 86 146 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -65 342 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -2 591 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -47 |
| | felügyeleti díj: | -1 233 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -133 |
| f) | nettó jövedelem: | 16 800 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 16 800 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 36 345 994 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 103 450 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|----|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | | Tárgyév |
| | | | 2013.09.24-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 86 146 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 0 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 69 337 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 9 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | 16 800 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Euró Pénzpiaci Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2001.12.13-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (EUR) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR) |
|------------|----------------------------|---|
| 2013.01.31 | 225,231,525 | 0.014096 |
| 2013.02.28 | 238,266,091 | 0.014117 |
| 2013.03.28 | 219,482,337 | 0.014135 |
| 2013.03.29 | 218,120,415 | 0.014135 |
| 2013.04.30 | 217,837,073 | 0.014160 |
| 2013.05.31 | 227,581,426 | 0.014181 |
| 2013.06.28 | 206,638,413 | 0.014197 |
| 2013.07.31 | 210,844,942 | 0.014215 |
| 2013.08.30 | 207,382,188 | 0.014227 |
| 2013.09.30 | 221,906,576 | 0.014240 |
| 2013.10.31 | 246,136,841 | 0.014252 |
| 2013.11.29 | 251,220,122 | 0.014263 |
| 2013.12.31 | 233,446,585 | 0.014274 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 13,661,889,410

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 4 156 302 444 | 1 591 509 432 |
| 2013.február | 2 756 816 662 | 1 915 298 414 |
| 2013.március | 1 237 994 256 | 2 790 212 820 |
| 2013.április | 2 368 549 376 | 2 595 948 044 |
| 2013.május | 2 160 081 748 | 1 416 311 043 |
| 2013.június | 964 717 563 | 2 242 712 962 |
| 2013.július | 2 708 282 644 | 2 362 428 303 |
| 2013.augusztus | 1 453 255 224 | 1 558 707 340 |
| 2013.szeptember | 1 836 526 644 | 856 203 083 |
| 2013.október | 3 475 264 713 | 1 745 859 157 |
| 2013.november | 1 312 950 385 | 1 490 702 370 |
| 2013.december | 2 220 113 158 | 2 505 649 290 |
| Összesen: | 26 650 854 817 | 23 071 542 258 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 16,354,960,163

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (EUR) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR) |
|----------------|------------------------------------|--|
| 2003/12/31 | 16,779,730 | 0.010741 |
| 2004/12/31 | 13,984,124 | 0.010894 |
| 2005/12/30 | 11,338,084 | 0.011011 |
| 2006/12/29 | 29,532,142 | 0.011228 |
| 2007/12/28 | 57,961,989 | 0.011627 |
| 2008/12/31 | 37,840,215 | 0.012016 |
| 2009/12/31 | 62,476,836 | 0.012868 |
| 2010/12/31 | 69,434,483 | 0.013179 |
| 2011/12/30 | 86,443,811 | 0.013603 |
| 2012/12/28 | 192,223,310 | 0.014070 |
| 2013/12/31 | 233,446,585 | 0.014274 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Euró Pénzpiaci Alap olyan befektetés, amellyel döntően rövid lejáratú euró bankbetétekbe lehet pénzt elhelyezni.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 192,22 millió euróról 233,45 millió euróra nőtt. Az OTP Euró Pénzpiaci Alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 1,45% lett.

3. Vagyonkimutatás

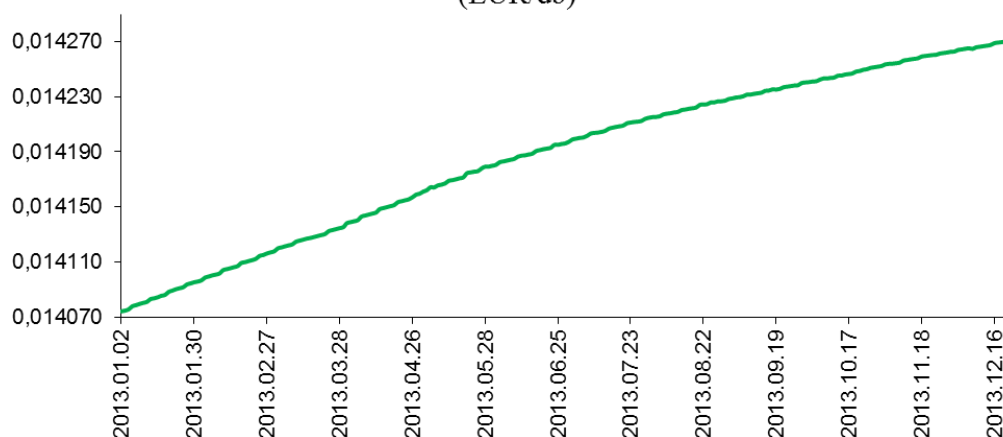
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 0 | 4 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 38 | 912 128 | 1,28% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 1 hónap | | 1 460 819 | 4 602 105 | 6,46% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2 hónap | | 0 | 7 422 750 | 10,41% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 3 hónap | | 8 738 700 | 11 727 945 | 16,45% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 4 hónap | | 11 069 020 | 29 691 000 | 41,65% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 5 hónap | | 11 651 600 | 10 985 670 | 15,41% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 6 hónap | | 19 309 614 | 1 484 550 | 2,08% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 52 229 791 | 66 826 152 | 93,74% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 1 986 671 | | 2 606 719 | 3,66% |
| REPHUN 1.67 03/18/1 | 2006.03.17 - 2013.03.18 | 1 293 012 | | 0 | 0,00% |
| REPHUN 4.5 01/14 | 2004.01.29 - 2014.01.29 | 0 | | 2 606 719 | 3,66% |
| REPHUN 4.5 02/13 | 2003.02.06 - 2013.02.06 | 693 659 | | 0 | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 1 986 671 | 0 | 2 606 719 | 3,66% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 227 051 | 1 628 629 | 2,29% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 324 446 | 224 215 | 0,31% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 160 427 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 711 924 | 1 852 844 | 2,60% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 54 928 386 | | 71 285 715 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 24 092 | 29 511 | 67,65% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 8 992 | 20,61% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 3 505 | 5 121 | 11,74% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 27 597 | 43 624 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 54 900 789 | | 71 242 091 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 13 392 179 758 | | 16 971 492 317 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (EUR/jegy): | | 0,01407349 | | 0,01413812 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR/db) | |
|----------------------|--|------------------------------------|--|----------|
| 2013. január 31. | 15 956 972 770 | | 0,014096 | |
| 2013. február 28. | 16 798 491 018 | | 0,014117 | |
| 2013. március 28. | 15 246 272 454 | | 0,014135 | |
| 2013. április 29. | 15 018 873 786 | | 0,014159 | |
| 2013. május 30. | 15 762 644 491 | | 0,014180 | |
| 2013. június 27. | 14 484 649 092 | | 0,014196 | |
| 2013. július 30. | 14 830 503 433 | | 0,014215 | |
| 2013. augusztus 29. | 14 725 051 317 | | 0,014227 | |
| 2013. szeptember 27. | 15 705 374 878 | | 0,014238 | |
| 2013. október 30. | 17 434 780 434 | | 0,014252 | |
| 2013. november 28. | 17 257 028 449 | | 0,014263 | |
| 2013. december 31. | 16 971 492 317 | | 71 242 091 114 | 0,014138 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Euró Pénzpiaci Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (EUR/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 986 671 | 100,00% | 2 606 719 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 1 986 671 | 100,00% | 2 606 719 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 1 812 000 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -331 248 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -17 412 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -98 |
| | felügyeleti díj: | -16 606 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -681 |
| f) | nettó jövedelem: | 1 445 955 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 1 445 955 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 14 931 570 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -36 223 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|--------------------------|----------------|
| | adatok | | határidő ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | JPY | -484 140 | | -1 243 234 | | -1 243 234 |
| | EUR | 4 821 | | 1 403 662 | | 1 403 662 |
| | Összesen: | | | | | 160 428 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | | | |
|---------------------|-------|---------------------------------|--|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | | | |
| A tétel megnevezése | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | | | c. | d. | |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | | 17 421 391 | 8 337 997 | |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 16 023 223 | 6 525 997 | |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | | 0 | 0 | |
| 04. | IV. | Működési költségek | | 196 585 | 366 022 | |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | | 22 | 23 | |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | | 0 | 0 | |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 | 0 | |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | | 1 201 561 | 1 445 955 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Dollár Pénzpiaci Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2001.12.13-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (USD) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (USD) |
|------------|----------------------------|---|
| 2013.01.31 | 72,838,442 | 0.012949 |
| 2013.02.28 | 77,861,248 | 0.012972 |
| 2013.03.28 | 70,233,430 | 0.012991 |
| 2013.03.29 | 70,047,156 | 0.012992 |
| 2013.04.30 | 65,614,781 | 0.013019 |
| 2013.05.31 | 74,961,369 | 0.013041 |
| 2013.06.28 | 74,435,817 | 0.013057 |
| 2013.07.31 | 73,382,158 | 0.013074 |
| 2013.08.30 | 79,178,178 | 0.013086 |
| 2013.09.30 | 87,184,718 | 0.013098 |
| 2013.10.31 | 108,303,320 | 0.013110 |
| 2013.11.29 | 108,940,706 | 0.013121 |
| 2013.12.31 | 117,722,083 | 0.013131 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 5,366,502,107

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 678 924 927 | 353 245 435 |
| 2013.február | 879 116 280 | 554 387 070 |
| 2013.március | 376 960 697 | 979 182 629 |
| 2013.április | 453 809 502 | 739 775 963 |
| 2013.május | 955 796 253 | 489 711 868 |
| 2013.június | 702 988 538 | 630 137 583 |
| 2013.július | 857 939 395 | 808 847 898 |
| 2013.augusztus | 799 041 431 | 211 572 682 |
| 2013.szeptember | 873 479 611 | 409 871 847 |
| 2013.október | 1 811 073 057 | 233 249 807 |
| 2013.november | 449 117 260 | 455 713 392 |
| 2013.december | 1 401 743 889 | 706 043 677 |
| Összesen: | 10 239 990 840 | 6 571 739 851 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 8,965,283,918

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (USD) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (USD) |
|----------------|------------------------------------|--|
| 2003/12/31 | 12,077,092 | 0.010513 |
| 2004/12/31 | 7,728,211 | 0.010518 |
| 2005/12/30 | 5,548,900 | 0.010722 |
| 2006/12/29 | 8,288,100 | 0.011159 |
| 2007/12/28 | 12,700,884 | 0.011699 |
| 2008/12/31 | 8,484,411 | 0.011979 |
| 2009/12/31 | 82,121,782 | 0.012162 |
| 2010/12/31 | 60,456,526 | 0.012261 |
| 2011/12/30 | 23,321,147 | 0.012533 |
| 2012/12/28 | 69,346,309 | 0.012922 |
| 2013/12/31 | 117,722,083 | 0.013131 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Dollár Pénzpiaci Alap olyan befektetés, amellyel döntően rövid lejáratú dollár bankbetétekbe lehet pénzt elhelyezni.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 69,35 millió dollárról 117,72 millió dollárra nőtt. Az OTP Dollár Pénzpiaci Alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 1,62% lett.

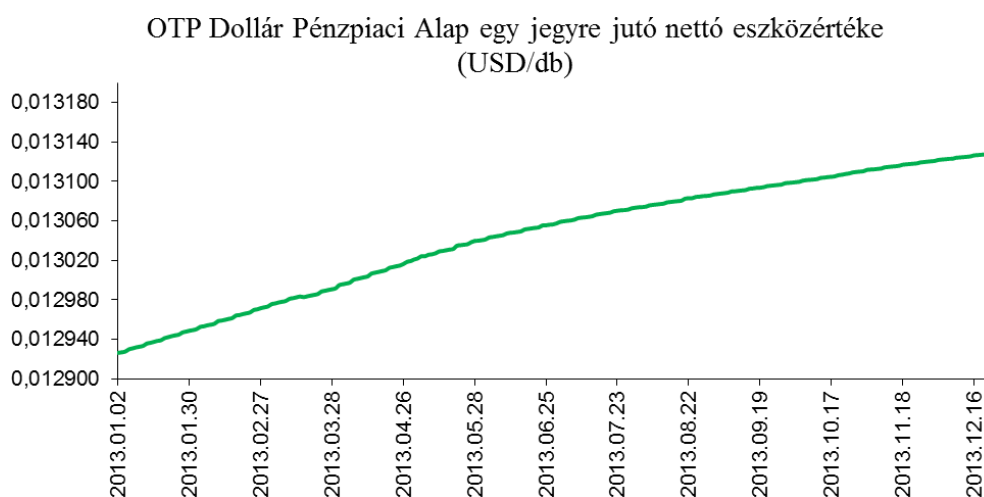
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|--------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 0 | | 1 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | 24 | | 787 280 | | 3,09% |
| OTP Bank Nyrt. USD 1 hónap | | | 995 732 | | 1 725 360 | | 6,76% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2 hónap | | | 0 | | 5 715 255 | | 22,40% |
| OTP Bank Nyrt. USD 3 hónap | | | 2 651 160 | | 7 117 110 | | 27,90% |
| OTP Bank Nyrt. USD 4 hónap | | | 7 997 666 | | 6 966 141 | | 27,31% |
| OTP Bank Nyrt. USD 5 hónap | | | 1 988 370 | | 1 941 030 | | 7,61% |
| OTP Bank Nyrt. USD 6 hónap | | | 1 104 650 | | 862 680 | | 3,38% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 14 737 602 | | 25 114 857 | | 98,45% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 517 204 | | 309 770 | | 1,22% |
| REPHUN 1.67 03/18/1 | 2006.03.17 - | 2013.03.18 | 517 204 | | 0 | | 0,00% |
| REPHUN 4.5 01/14 | 2004.01.29 - | 2014.01.29 | 0 | | 309 770 | | 1,22% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 517 204 | 0 | 309 770 | 0 | 1,22% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 13 838 | | 0,05% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 60 920 | | 70 581 | | 0,28% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 53 656 | | 398 | | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 114 576 | | 84 817 | | 0,33% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 15 369 382 | | 25 509 444 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 6 345 | | 10 425 | | 68,12% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 2 898 | | 18,93% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 838 | | 1 982 | | 12,95% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 127 597 | | 0 | | 0,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 134 780 | | 15 305 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 15 234 602 | | 25 494 139 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 5 334 928 987 | | 9 003 179 976 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (USD/jegy): | | | 0,01292551 | | 0,01312970 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (USD/db) | |
|----------------------|--|------------------------------------|--|----------|
| 2013. január 31. | 5 660 608 479 | | 0,012949 | |
| 2013. február 28. | 5 985 337 689 | | 0,012972 | |
| 2013. március 28. | 5 383 115 757 | | 0,012991 | |
| 2013. április 29. | 5 097 149 296 | | 0,013018 | |
| 2013. május 30. | 5 563 233 681 | | 0,013040 | |
| 2013. június 27. | 5 636 084 636 | | 0,013056 | |
| 2013. július 30. | 5 685 176 133 | | 0,013073 | |
| 2013. augusztus 29. | 6 272 644 882 | | 0,013085 | |
| 2013. szeptember 27. | 6 736 252 646 | | 0,013097 | |
| 2013. október 30. | 8 314 075 896 | | 0,013110 | |
| 2013. november 28. | 8 307 479 764 | | 0,013120 | |
| 2013. december 31. | 9 003 179 976 | | 25 494 139 099 | 0,013130 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| Az Alap értékpapír portfóliójának összetételével kapcsolatos további adatok (2011.évi CXCVIII. törvény 6.melléklet): | | | | |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 517 204 | 100,00% | 309 770 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 517 204 | 100,00% | 309 770 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 299 091 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -91 873 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -5 158 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -35 |
| | felügyeleti díj: | -4 592 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -562 |
| f) | nettó jövedelem: | 196 871 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 196 871 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 10 068 094 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -5 428 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|---------------------------|-----------|-----------------------------|---------------|---------------|
| | adatok | határidős ügylet | | határidős ügylet | | eredmény |
| | ezerben | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | JPY | -193 656 | | -497 294 | | -497 294 |
| | USD | 2 495 | | 550 949 | | 550 949 |
| | Összesen: | | | | | 53 656 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -1 045 | | -310 219 | | -310 219 |
| | USD | 1 440 | | 310 617 | | 310 617 |
| | Összesen: | | | | | 398 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---|------------------------|--|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | Előző év | | Tárgyév |
| | 2012.01.01-2012.12.31. | | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | d. |
| | c. | | |
| 01. I. Pénzügyi műveletek bevételei | 6 652 475 | | 4 182 643 |
| 02. II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 6 401 576 | | 3 883 552 |
| 03. III. Egyéb bevételek | 1 | | 0 |
| 04. IV. Működési költségek | 45 723 | | 102 215 |
| 05. V. Egyéb ráfordítások | 7 | | 5 |
| 06. VI. Rendkívüli bevételek | 0 | | 0 |
| 07. VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | | 0 |
| 08. VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | | 0 |
| 09. IX. Tárgyévi eredmény | 205 170 | | 196 871 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Optima Nyíltvégű Értékpapír Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 1996.04.17-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 137,561,421,565 | 5.627102 |
| 2013.02.28 | 161,160,174,861 | 5.658208 |
| 2013.03.28 | 195,439,009,061 | 5.692376 |
| 2013.03.29 | 196,935,781,404 | 5.691346 |
| 2013.04.30 | 231,624,812,671 | 5.735845 |
| 2013.05.31 | 261,468,811,917 | 5.759559 |
| 2013.06.28 | 264,630,943,969 | 5.765793 |
| 2013.07.31 | 259,986,877,176 | 5.796754 |
| 2013.08.30 | 261,494,519,743 | 5.808643 |
| 2013.09.30 | 260,189,444,928 | 5.850432 |
| 2013.10.31 | 260,402,282,234 | 5.863425 |
| 2013.11.29 | 269,397,032,105 | 5.896635 |
| 2013.12.31 | 288,162,801,114 | 5.915735 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 20,925,573,669

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 5 876 562 594 | 2 283 175 062 |
| 2013.február | 6 321 659 940 | 2 072 671 182 |
| 2013.március | 9 155 848 821 | 3 120 384 383 |
| 2013.április | 9 291 806 452 | 3 252 290 412 |
| 2013.május | 8 398 462 132 | 4 045 294 653 |
| 2013.június | 5 764 602 038 | 5 611 485 179 |
| 2013.július | 7 099 909 467 | 7 923 204 268 |
| 2013.augusztus | 3 365 006 735 | 3 312 618 287 |
| 2013.szeptember | 3 182 295 385 | 3 514 902 829 |
| 2013.október | 3 621 618 067 | 3 618 159 375 |
| 2013.november | 4 384 051 012 | 3 034 711 513 |
| 2013.december | 6 935 971 863 | 3 984 312 223 |
| Összesen: | 73 397 794 506 | 45 773 209 366 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 48,711,240,555

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2003/12/31 | 347,215,629,817 | 2.813896 |
| 2004/12/31 | 317,953,733,503 | 3.129410 |
| 2005/12/30 | 411,871,407,504 | 3.361696 |
| 2006/12/29 | 136,519,747,387 | 3.501682 |
| 2007/12/28 | 144,893,075,395 | 3.689811 |
| 2008/12/31 | 56,338,264,065 | 3.694098 |
| 2009/12/31 | 98,812,427,439 | 4.471500 |
| 2010/12/31 | 125,292,883,752 | 4.807574 |
| 2011/12/30 | 93,905,175,790 | 4.975204 |
| 2012/12/28 | 116,639,719,166 | 5.574027 |
| 2013/12/31 | 288,162,801,114 | 5.915735 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Optima Alap, olyan befektetés, amellyel döntően rövid lejáratú állampapírokba, jelzáloglevelekbe lehet elhelyezni. Az alap jellemző befektetéseit diszkont kincstárjegyek, államkötvények, jelzáloglevelek alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 116,64 milliárdról 288,16 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 6,13% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | | |
|--|-------------------------|---------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | folyószámla | | | 59 | 55 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | folyószámla | | | 2 | 62 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | folyószámla | | | 21 | 57 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. GBP | folyószámla | | | 0 | 2 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.02 | | | 1 849 109 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.21 - 2013.01.02 | | | 19 808 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.28 - 2013.01.09 | | | 7 423 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.31 - 2014.01.08 | | | 0 | 2 969 308 | | 1,02% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | | | 0 | 214 072 | | 0,07% |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | 0 | 50 000 000 | | 17,21% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | 60 000 000 | | 20,65% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | | | 0 | 70 524 | | 0,02% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 1 876 422 | 113 254 080 | | 38,97% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | | 43 367 898 | | 85 814 795 | 29,53% |
| 2013/D | 2002.01.17 - 2013.02.12 | | | 1 557 | | 0 | 0,00% |
| 2013/E | 2009.09.02 - 2013.10.24 | | | 20 818 | | 0 | 0,00% |
| 2014/C | 2003.06.19 - 2014.02.12 | | | 5 508 886 | | 3 581 574 | 1,23% |
| 2014/D | 2011.01.19 - 2014.08.22 | | | 2 108 160 | | 2 882 593 | 0,99% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | | | 2 865 403 | | 2 447 381 | 0,84% |
| 2015/B | 2010.03.31 - 2015.12.22 | | | 8 879 409 | | 10 817 608 | 3,72% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | | | 2 587 978 | | 3 962 681 | 1,36% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | | | 50 414 | | 105 101 | 0,04% |
| 2016/D | 2013.01.16 - 2016.12.22 | | | 0 | | 7 270 155 | 2,50% |
| 2017/A | 2001.11.15 - 2017.11.24 | | | 50 388 | | 52 656 | 0,02% |
| 2017/B | 2006.10.04 - 2017.02.24 | | | 3 057 413 | | 4 071 958 | 1,40% |
| 2018/A | 2013.01.16 - 2018.12.20 | | | 0 | | 2 624 531 | 0,90% |
| 2019/A | 2008.02.06 - 2019.06.24 | | | 1 764 447 | | 2 068 976 | 0,71% |
| 2019/B | 2013.01.23 - 2019.05.20 | | | 0 | | 3 347 634 | 1,15% |
| 2020/A | 2004.02.11 - 2020.11.12 | | | 1 030 580 | | 1 979 209 | 0,68% |
| 2022/A | 2011.01.19 - 2022.06.24 | | | 32 983 | | 1 883 169 | 0,65% |
| 2023/A | 2007.01.10 - 2023.11.24 | | | 0 | | 82 905 | 0,03% |
| 2028/A | 2011.03.02 - 2028.10.22 | | | 377 359 | | 369 204 | 0,13% |
| DK2015/02 | 2012.06.11 - 2015.08.24 | | | 4 764 327 | | 4 901 230 | 1,69% |
| DK2016/01 | 2013.03.12 - 2016.12.22 | | | 0 | | 205 569 | 0,07% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | | | 0 | | 24 239 272 | 8,34% |
| POLAND 3.75 01/23 | 2012.06.18 - 2023.01.19 | | | 1 918 659 | | 1 998 662 | 0,69% |
| REPHUN 1.67 03/18/1 | 2006.03.17 - 2013.03.18 | | | 5 172 045 | | 0 | 0,00% |
| REPHUN 4.5 01/14 | 2004.01.29 - 2014.01.29 | | | 2 154 352 | | 5 266 098 | 1,81% |
| REPHUN 4.5 02/13 | 2003.02.06 - 2013.02.06 | | | 121 534 | | 0 | 0,00% |
| REPHUN 5.5 06/14 | 2004.05.06 - 2014.05.06 | | | 743 452 | | 1 498 899 | 0,52% |
| REPHUN 6.75 07/14 | 2009.07.28 - 2014.07.28 | | | 157 734 | | 157 730 | 0,06% |

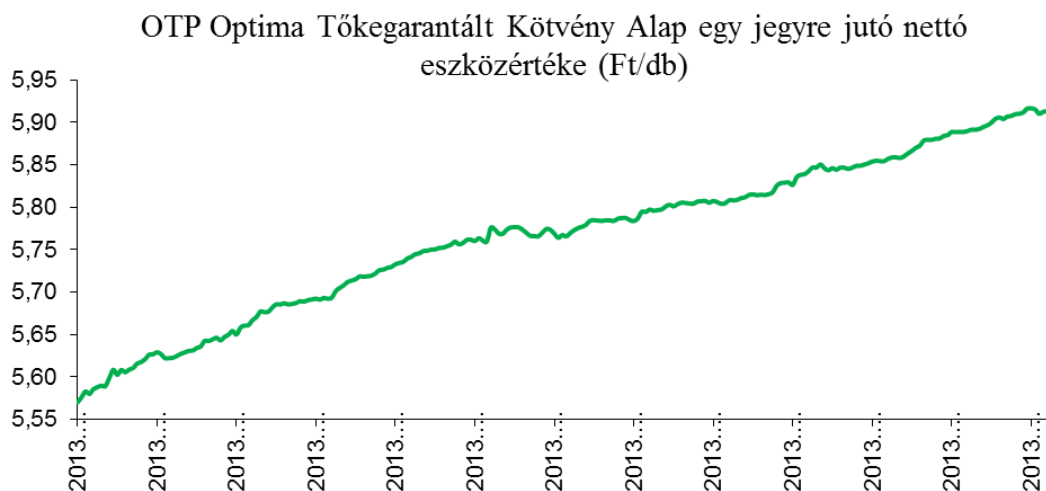
| | | | | | |
|---|--------------|------------|--------------------|----------------------|-----------------|
| Diszkont kincstárjegyek: | | | 138 020 | 8 003 349 | 2,77% |
| D130220 | 2012.03.07 - | 2013.02.20 | 6 541 | 0 | 0,00% |
| D130227 | 2012.11.28 - | 2013.02.27 | 89 241 | 0 | 0,00% |
| D130529 | 2012.05.30 - | 2013.05.29 | 7 900 | 0 | 0,00% |
| D130724 | 2012.07.25 - | 2013.07.24 | 34 338 | 0 | 0,00% |
| D140108 | 2013.01.09 - | 2014.01.08 | 0 | 161 739 | 0,06% |
| D140305 | 2013.03.06 - | 2014.03.05 | 0 | 24 387 | 0,01% |
| D140430 | 2013.05.02 - | 2014.04.30 | 0 | 1 038 866 | 0,36% |
| D140625 | 2013.06.26 - | 2014.06.25 | 0 | 6 757 355 | 2,33% |
| D140806 | 2013.08.21 - | 2014.08.06 | 0 | 373 | 0,00% |
| D141015 | 2013.10.16 - | 2014.10.15 | 0 | 20 629 | 0,01% |
| MNB Kötvények: | | | 46 206 483 | 57 847 664 | 19,91% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | 15 844 368 | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | 30 362 115 | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | 0 | 33 825 659 | 11,64% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | 24 022 005 | 8,27% |
| Kötvények: | | | 13 727 247 | 17 879 375 | 6,16% |
| AZUR 2007-1X CE10 | 2007.05.15 - | 2017.08.15 | 484 738 | 540 961 | 0,19% |
| BNP 4.5 11/27/2016 | 2013.11.27 - | 2016.11.27 | 0 | 1 004 513 | 0,35% |
| BTEL2013/A | 2011.10.17 - | 2013.02.12 | 154 551 | 0 | 0,00% |
| BTEL2014/A | 2011.07.01 - | 2014.08.22 | 21 685 | 21 074 | 0,01% |
| BTEL2014/C | 2013.02.12 - | 2014.02.12 | 0 | 139 341 | 0,05% |
| E-STAR 2016/C | 2011.05.30 - | 2016.05.30 | 58 826 | 0 | 0,00% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - | 2014.09.25 | 2 179 843 | 0 | 0,00% |
| MAEXIM 5.5 02/12/1 | 2012.12.12 - | 2018.02.12 | 672 527 | 682 122 | 0,23% |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - | 2016.05.31 | 0 | 2 931 237 | 1,01% |
| MAGYAR 6.25 10/21 | 2013.10.21 - | 2020.10.21 | 0 | 449 945 | 0,15% |
| MOLHB 6.25 09/19 | 2012.09.26 - | 2019.09.26 | 3 470 034 | 3 323 215 | 1,14% |
| OPUS VAR 49-16 | 2007.10.31 - | 2016.10.31 | 2 151 631 | 3 798 918 | 1,31% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - | 2016.09.19 | 700 479 | 2 289 309 | 0,79% |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - | 2015.03.04 | 1 950 663 | 2 184 145 | 0,75% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - | 2016.11.07 | 0 | 514 595 | 0,18% |
| RFV 2014/A | 2010.10.04 - | 2014.02.12 | 44 870 | 0 | 0,00% |
| RIVIERA DPI HUF | 2006.12.05 - | 2013.12.10 | 1 837 400 | 0 | 0,00% |
| Belföldi részvények: | | | 0 | 228 384 | 0,08% |
| E-STAR | | | 0 | 228 384 | 0,08% |
| Jelzáloglevelek: | | | 10 258 821 | 5 619 507 | 1,93% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - | 2015.09.14 | 3 475 398 | 3 664 531 | 1,26% |
| FJ15NF04 | 2012.11.14 - | 2015.01.26 | 733 650 | 792 240 | 0,27% |
| FJ15ZF02 | 2005.05.18 - | 2015.05.18 | 496 876 | 575 588 | 0,20% |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - | 2017.12.14 | 0 | 562 532 | 0,19% |
| OJB2013/II | 2002.12.20 - | 2013.08.31 | 5 552 897 | 0 | 0,00% |
| OJB2014/I | 2003.11.14 - | 2014.02.12 | 0 | 24 616 | 0,01% |
| Befektetési jegyek: | | | 1 505 445 | 1 429 706 | 0,49% |
| PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. | | | 1 505 445 | 1 429 706 | 0,49% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 115 203 914 | 0 176 822 780 | 0 60,87% |

| | | | |
|---|--|-----------------------|----------------------------|
| Egyéb eszközök | | | |
| Követelések | | 515 431 | 0 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 18 878 | 50 237 0,02% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 465 978 | 404 120 0,14% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 1 000 287 | 454 357 0,16% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | |
| | | 118 080 623 | 290 531 217 100,00% |
| Kötelezettségek | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 143 307 | 357 603 19,58% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 33 778 1,85% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 6 493 | 16 695 0,91% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 0 | 1 418 528 77,66% |
| Kötelezettségek összesen: | | 149 800 | 1 826 604 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | |
| | | 117 930 823 | 288 704 613 |
| | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 21 166 086 625 | 48 790 671 765 |
| | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 5,57168762 | 5,91720922 |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 24 759 474 157 | | 5,627102 |
| 2013. február 28. | 29 008 462 915 | | 5,658208 |
| 2013. március 28. | 35 043 927 353 | | 5,692376 |
| 2013. április 29. | 41 083 443 393 | | 5,734473 |
| 2013. május 30. | 45 436 610 872 | | 5,760863 |
| 2013. június 27. | 45 589 727 731 | | 5,767374 |
| 2013. július 30. | 44 766 432 930 | | 5,795943 |
| 2013. augusztus 29. | 44 818 821 378 | | 5,808202 |
| 2013. szeptember 27. | 44 486 213 934 | | 5,846841 |
| 2013. október 30. | 44 489 672 626 | | 5,860065 |
| 2013. november 28. | 45 839 012 125 | | 5,894659 |
| 2013. december 31. | 48 790 671 765 | 288 704 612 816 | 5,917209 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|-------------|-------------|-------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 115 203 914 | 100,00% | 176 822 780 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 46 344 503 | 40,23% | 65 851 013 | 37,24% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 113 698 469 | 98,69% | 175 164 690 | 99,06% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|--|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 13 504 117 |
| b) egyéb bevétel: | | 1 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -3 476 918 |
| d) a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -69 344 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| bizományosi díj: | | -11 |
| bankköltség: | | -302 |
| felügyeleti díj: | | -57 711 |
| egyéb költség és ráfordítás: | | -1 753 |
| f) nettó jövedelem: | | 9 898 079 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| újra befektetett jövedelem: | | 9 898 079 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 157 856 870 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 3 018 841 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|------------|---------------------------|--------------------------|--------------------------|----------------|
| | adatok | | határidő ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | JPY | -1 950 000 | 5 616 390 | -5 007 452 | 5 549 031 | 541 579 |
| | USD | -15 000 | 3 363 750 | -3 311 555 | 3 319 217 | 7 663 |
| | Összesen: | | | | | 549 242 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -50 000 | 15 197 500 | -14 844 778 | 15 188 640 | 343 862 |
| | USD | -20 000 | 4 376 000 | -4 313 191 | 4 373 449 | 60 258 |
| | Összesen: | | | | | 404 120 |

| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 58 112 032 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -141 375 960 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | -83 263 928 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 142 564 340 | 142 956 000 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 11 855 813 | 17 240 980 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 2 920 008 | 3 736 863 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 1 | 1 |
| 04. | IV. Működési költségek | 1 392 392 | 3 605 358 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 168 | 681 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 7 543 246 | 9 898 079 |

Beszámoló a 2013. évről - OTP Maxima Kötvény Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap
Az alap futamideje: 2000.12.21-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 6,480,950,778 | 2.795321 |
| 2013.02.28 | 6,753,029,577 | 2.829048 |
| 2013.03.28 | 7,510,961,100 | 2.848039 |
| 2013.03.29 | 7,521,002,189 | 2.848663 |
| 2013.04.30 | 8,460,663,156 | 2.898303 |
| 2013.05.31 | 9,826,621,085 | 2.921879 |
| 2013.06.28 | 9,419,582,633 | 2.902205 |
| 2013.07.31 | 9,371,255,269 | 2.924037 |
| 2013.08.30 | 9,478,902,095 | 2.913621 |
| 2013.09.30 | 9,732,913,526 | 2.990177 |
| 2013.10.31 | 10,303,509,831 | 3.031509 |
| 2013.11.29 | 11,181,222,160 | 3.016798 |
| 2013.12.31 | 11,788,224,408 | 3.048928 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 2,213,926,293

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 175 691 823 | 84 906 730 |
| 2013.február | 127 470 448 | 77 284 779 |
| 2013.március | 347 310 930 | 70 800 643 |
| 2013.április | 349 867 661 | 54 438 316 |
| 2013.május | 487 656 133 | 49 870 498 |
| 2013.június | 219 689 078 | 360 001 764 |
| 2013.július | 311 671 570 | 337 568 774 |
| 2013.augusztus | 213 208 254 | 178 081 856 |
| 2013.szeptember | 129 433 761 | 112 078 830 |
| 2013.október | 266 211 206 | 83 251 798 |
| 2013.november | 342 510 305 | 71 923 355 |
| 2013.december | 279 128 834 | 108 231 730 |
| Összesen: | 3 249 850 003 | 1 588 439 073 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 3,866,350,758

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2003/12/31 | 8,409,850,420 | 1.224361 |
| 2004/12/31 | 5,872,075,974 | 1.403589 |
| 2005/12/30 | 21,681,082,383 | 1.511389 |
| 2006/12/29 | 8,694,107,992 | 1.587298 |
| 2007/12/28 | 19,951,693,126 | 1.676131 |
| 2008/12/31 | 7,656,715,775 | 1.711211 |
| 2009/12/31 | 7,066,924,855 | 2.039842 |
| 2010/12/31 | 6,573,534,322 | 2.224935 |
| 2011/12/30 | 5,399,566,875 | 2.265273 |
| 2012/12/28 | 6,129,488,042 | 2.768605 |
| 2013/12/31 | 11,788,224,408 | 3.048928 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Maxima Alap, olyan befektetés, amellyel döntően hosszú lejáratú állampapírokba, jelzáloglevelekbe lehet elhelyezni. Az alap jellemző befektetéseit hazai hosszú lejáratú államkötvények, jelzáloglevelek alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 6,13 milliárdról 11,79 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 10,13% lett.

3. Vagyonkimutatás

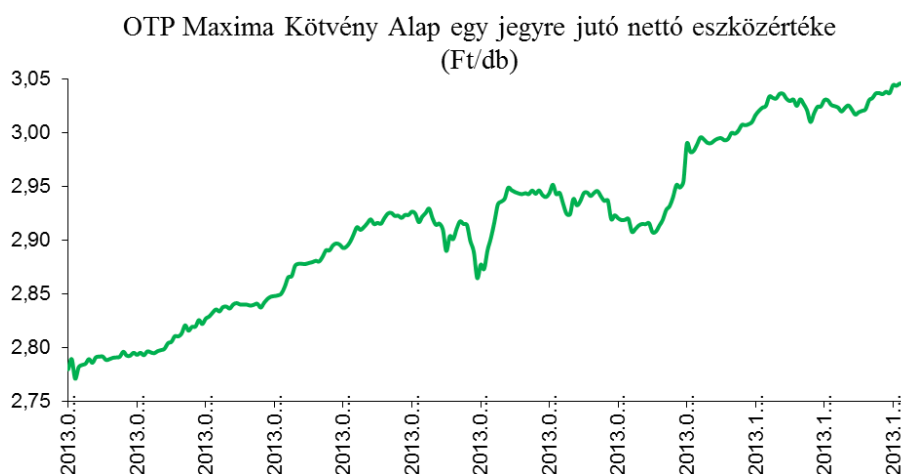
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 21 | 27 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 6 | 100 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | 0 | 70 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 45 724 | | 0,38% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 7 764 | | 0,07% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.31 - 2014.01.08 | | 0 | 296 910 | | 2,50% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 27 | 350 595 | | 2,95% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 4 071 036 | | 8 560 671 | 72,09% |
| 2014/D | 2011.01.19 - 2014.08.22 | | 308 861 | 0 | | 0,00% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | | 2 971 | 0 | | 0,00% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | | 583 371 | 844 987 | | 7,12% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | | 22 721 | 458 438 | | 3,86% |
| 2016/D | 2013.01.16 - 2016.12.22 | | 0 | 523 193 | | 4,41% |
| 2017/A | 2001.11.15 - 2017.11.24 | | 984 468 | 1 699 941 | | 14,31% |
| 2017/B | 2006.10.04 - 2017.02.24 | | 272 178 | 735 210 | | 6,19% |
| 2018/A | 2013.01.16 - 2018.12.20 | | 0 | 351 056 | | 2,96% |
| 2019/A | 2008.02.06 - 2019.06.24 | | 792 036 | 909 079 | | 7,65% |
| 2020/A | 2004.02.11 - 2020.11.12 | | 488 901 | 422 650 | | 3,56% |
| 2022/A | 2011.01.19 - 2022.06.24 | | 0 | 822 830 | | 6,93% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | | 0 | 1 793 287 | | 15,10% |
| REPHUN 4.5 01/14 | 2004.01.29 - 2014.01.29 | | 615 529 | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | | 470 386 | | 946 441 | 7,97% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 386 177 | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 84 209 | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | 524 154 | | 4,41% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | 422 287 | | 3,56% |
| Kötvények: | | | 1 041 172 | | 1 730 589 | 14,56% |
| BNP 4.5 11/27/2016 | 2013.11.27 - 2016.11.27 | | 0 | 602 708 | | 5,07% |
| BTEL2013/A | 2011.10.17 - 2013.02.12 | | 158 095 | 0 | | 0,00% |
| BTEL2014/A | 2011.07.01 - 2014.08.22 | | 10 651 | 10 351 | | 0,09% |
| MAEXIM 5.5 02/12/1 | 2012.12.12 - 2018.02.12 | | 224 176 | 227 374 | | 1,91% |
| MAGYAR 6.25 10/21 | 2013.10.21 - 2020.10.21 | | 0 | 224 973 | | 1,89% |
| MOLHB 6.25 09/19 | 2012.09.26 - 2019.09.26 | | 231 335 | 225 303 | | 1,90% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | | 145 027 | 154 370 | | 1,30% |
| OTPHB FLOAT 03/1: | 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 254 988 | 285 510 | | 2,40% |
| RFV 2014/A | 2010.10.04 - 2014.02.12 | | 16 900 | 0 | | 0,00% |
| Belföldi részvények: | | | 0 | | 40 348 | 0,34% |
| E-STAR | | | 0 | 40 348 | | 0,34% |
| Jelzáloglevelek: | | | 613 832 | | 211 951 | 1,78% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - 2015.09.14 | | 0 | 211 951 | | 1,78% |
| OJB2013/II | 2002.12.20 - 2013.08.31 | | 613 832 | 0 | | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 6 196 426 | 0 | 11 490 000 | 96,74% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | 10 | | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | -8 150 | 36 588 | | 0,31% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | -8 150 | 36 598 | | 0,31% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 6 188 303 | 11 877 193 | | 100,00% |

| Kötelezettségek | | | | |
|---|--|----------------------|----------------------|----------------|
| Alapkezelői díj miatt | | 7 718 | 14 592 | 51,18% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 1 350 | 4,74% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 370 | 1 177 | 4,13% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 21 542 | 11 390 | 39,95% |
| Kötelezettségek összesen: | | 29 630 | 28 509 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | | |
| | | 6 158 673 | 11 848 684 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | |
| | | 2 223 596 218 | 3 885 007 148 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | | |
| | | 2,76969060 | 3,04984837 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 2 314 381 311 | | 2,795321 |
| 2013. február 28. | 2 364 566 980 | | 2,829048 |
| 2013. március 28. | 2 641 077 267 | | 2,848039 |
| 2013. április 29. | 2 936 506 612 | | 2,894143 |
| 2013. május 30. | 3 374 292 247 | | 2,916783 |
| 2013. június 27. | 3 233 979 561 | | 2,890406 |
| 2013. július 30. | 3 208 082 357 | | 2,924557 |
| 2013. augusztus 29. | 3 243 208 755 | | 2,910243 |
| 2013. szeptember 27. | 3 260 563 686 | | 2,990536 |
| 2013. október 30. | 3 443 523 094 | | 3,036082 |
| 2013. november 28. | 3 714 110 044 | | 3,021508 |
| 2013. december 31. | 3 885 007 148 | 11 848 682 711 | 3,049848 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 6 196 426 | 100,00% | 11 490 000 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 470 386 | 7,59% | 946 441 | 8,24% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 6 196 426 | 100,00% | 11 449 652 | 99,65% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|--|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 730 619 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -134 957 |
| d) a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -2 641 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| bizományosi díj: | | -100 |
| bankköltség: | | -217 |
| felügyeleti díj: | | -2 237 |
| egyéb költség és ráfordítás: | | -683 |
| f) nettó jövedelem: | | 589 784 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| újra befektetett jövedelem: | | 589 784 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 4 877 034 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 223 193 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|---|-----------|---|---------------|---------------|
| | adatok ezerben | határidős ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diskontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -1 000 | 287 250 | -291 241 | 286 883 | -4 358 |
| | USD | -1 000 | 217 403 | -220 918 | 217 126 | -3 792 |
| | Összesen: | | | | | -8 150 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -4 000 | 1 215 840 | -1 187 582 | 1 215 131 | 27 549 |
| | USD | -3 000 | 656 400 | -646 979 | 656 017 | 9 039 |
| | Összesen: | | | | | 36 588 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 1 517 417 | 1 055 234 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 908 261 | 324 615 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 86 631 | 140 735 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 2 | 100 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 522 523 | 589 784 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP EMEA Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. december 15.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 6,576,955,592 | 1.272118 |
| 2013.02.28 | 6,549,742,112 | 1.288903 |
| 2013.03.28 | 8,151,050,936 | 1.297204 |
| 2013.04.30 | 8,758,683,598 | 1.306130 |
| 2013.05.31 | 10,047,767,546 | 1.313629 |
| 2013.06.28 | 10,046,296,058 | 1.307073 |
| 2013.07.31 | 9,720,552,716 | 1.313124 |
| 2013.08.30 | 9,957,364,898 | 1.322141 |
| 2013.09.30 | 9,936,059,649 | 1.313506 |
| 2013.10.31 | 9,478,153,196 | 1.310229 |
| 2013.11.29 | 9,762,160,090 | 1.321785 |
| 2013.12.31 | 9,127,304,193 | 1.320004 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 4,818,582,338

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 531 609 857 | 194 700 278 |
| 2013.február | 308 800 312 | 382 577 582 |
| 2013.március | 1 548 195 194 | 349 158 095 |
| 2013.április | 698 463 559 | 268 440 161 |
| 2013.május | 1 183 339 052 | 218 740 484 |
| 2013.június | 434 972 044 | 569 428 058 |
| 2013.július | 653 071 046 | 831 784 196 |
| 2013.augusztus | 418 427 663 | 268 159 410 |
| 2013.szeptember | 396 986 503 | 292 516 741 |
| 2013.október | 213 517 897 | 643 718 903 |
| 2013.november | 501 176 097 | 349 189 091 |
| 2013.december | 233 023 244 | 657 851 731 |
| Összesen: | 7 121 582 468 | 5 026 264 730 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 6,914,601,586

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 979,290,290 | 1.011347 |
| 2012/12/28 | 6,090,580,955 | 1.263978 |
| 2013/12/31 | 9,127,304,193 | 1.320004 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 decemberében indult az OTP EMEA Alap, amely egy meghatározott földrajzi szegmens (Európa, Közel-Kelet, Afrika) fejlődő piacainak kötvény kibocsátásaira fókuszál. Az alap portfóliójának összeállításakor elsősorban olyan kötvényekre fókuszálunk, amelyek a választott földrajzi szegmensen belül jó minősítésűek, esődkockázatuk és kamatkockázatuk mérsékeltnek tekinthető. Az alap befektetéseit elsősorban régiós külföldi devizákban kibocsátott állampapírok, vállalati kötvények és átváltható kötvények alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 6,09 milliárdról 9,13 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 4,43% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 24 | 28 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 72 | 8 113 | | 0,09% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 585 | 1 236 | | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.28 - 2013.01.09 | | 13 690 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 174 774 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 441 860 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 220 930 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.21 - 2013.01.02 | | 149 128 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 786 812 | | 8,57% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 1 509 690 | | 16,44% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 140 185 | | 1,52% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1 001 063 | 2 446 064 | | 26,63% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 262 097 | | 602 979 | 6,57% |
| CROATI 6 01/26/24 2013.11.26 - 2024.01.26 | | 0 | | 453 374 | 4,94% |
| MONGOL 5.125 12/04 2012.12.05 - 2022.12.05 | | 60 920 | | 75 952 | 0,83% |
| MONTEN 7.25 04/16 2011.04.08 - 2016.04.08 | | 70 163 | | 73 653 | 0,80% |
| SERBTB 0 08/09/13 2010.10.04 - 2014.02.12 | | 47 854 | | 0 | 0,00% |
| SLOREP 5.125 03/26 2011.03.30 - 2026.03.30 | | 83 160 | | 0 | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 4 015 859 | | 5 324 988 | 57,98% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 1 798 336 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 2 217 523 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 2 639 721 | 28,74% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 2 685 267 | 29,24% |
| Kötvények: | | 868 745 | | 127 686 | 1,39% |
| HTC 9.5 12/15/16 2009.08.12 - 2016.12.15 | | 16 370 | | 0 | 0,00% |
| HUSTHO 4.4 09/14 2009.09.25 - 2014.09.25 | | 88 373 | | 0 | 0,00% |
| MAGNOLIA VAR 03 2006.03.20 - 2016.03.20 | | 20 935 | | 0 | 0,00% |
| MOLHB 6.25 09/19 2012.09.26 - 2019.09.26 | | 69 401 | | 0 | 0,00% |
| OPUS VAR 49-16 2007.10.31 - 2016.10.31 | | 26 303 | | 0 | 0,00% |
| OTPHB FLOAT 03/16 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 152 994 | | 42 826 | 0,46% |
| OTPHB VAR 49-16 2006.11.07 - 2016.11.07 | | 468 517 | | 0 | 0,00% |
| RFV 2014/A 2010.10.04 - 2014.02.12 | | 2 299 | | 0 | 0,00% |
| URBIMM 9.5 01/21/2 2010.01.19 - 2020.01.21 | | 0 | | 8 014 | 0,09% |
| VESTAS WYND SYS 2010.03.23 - 2015.03.23 | | 23 553 | | 0 | 0,00% |
| ZAGHLD 5.5 07/17 2007.07.10 - 2017.07.10 | | 0 | | 76 846 | 0,84% |
| Belföldi részvények: | | 0 | | 6 093 | 0,07% |
| E-STAR | | 0 | | 6 093 | 0,07% |
| Befektetési jegyek: | | 0 | | 665 229 | 7,24% |
| PARTNERS GROUP MEZZANINE 2008 S. | | 0 | | 665 229 | 7,24% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 5 146 701 | 0 | 6 726 975 | 73,25% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 0 | | 122 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | -16 349 | | 11 148 | 0,12% |
| Egyéb eszközök összesen: | | -16 349 | | 11 270 | 0,12% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 6 131 415 | | 9 184 309 | 100,00% |

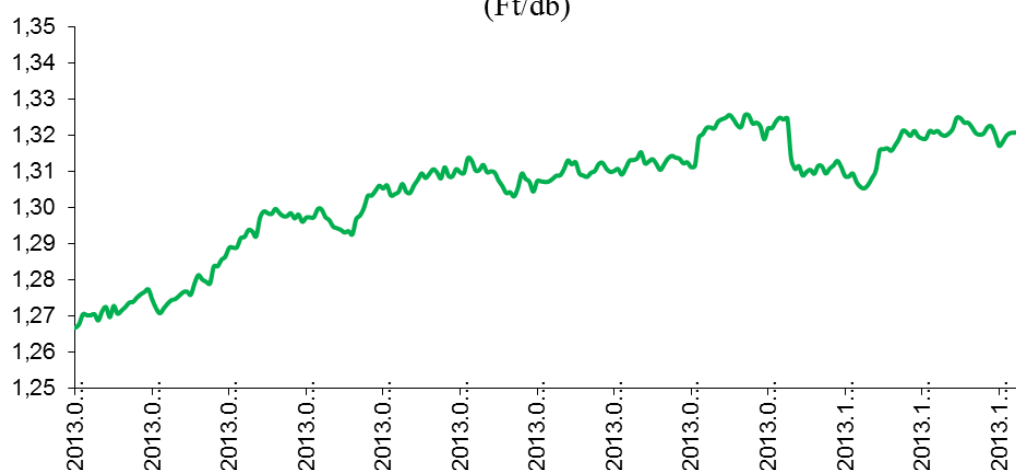
| Kötelezettségek | | | |
|---|--|----------------------|-----------------------|
| Alapkezelői díj miatt | | 7 852 | 11 925 24,08% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 1 211 2,44% |
| Költségmentés egyéb tétel miatt | | 377 | 1 113 2,25% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 22 842 | 35 274 71,23% |
| Kötelezettségek összesen: | | 31 071 | 49 523 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | |
| | | 6 100 344 | 9 134 786 |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | |
| | | 4 824 207 243 | 6 919 524 981 |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | |
| | | 1,26452771 | 1,32014643 |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 5 161 116 822 | | 1,272118 |
| 2013. február 28. | 5 087 339 552 | | 1,288903 |
| 2013. március 28. | 6 286 376 651 | | 1,297204 |
| 2013. április 30. | 6 716 400 049 | | 1,306130 |
| 2013. május 31. | 7 680 998 617 | | 1,313629 |
| 2013. június 28. | 7 546 542 603 | | 1,307073 |
| 2013. július 31. | 7 367 829 453 | | 1,313124 |
| 2013. augusztus 30. | 7 518 097 706 | | 1,322141 |
| 2013. szeptember 30. | 7 622 567 468 | | 1,313506 |
| 2013. október 31. | 7 192 366 462 | | 1,310229 |
| 2013. november 29. | 7 344 353 468 | | 1,321785 |
| 2013. december 31. | 6 919 524 981 | 9 134 786 196 | 1,320146 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP EMEA Kötvény Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 5 146 701 | 100,00% | 6 726 975 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 4 015 859 | 78,03% | 5 324 988 | 79,16% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 5 146 701 | 100,00% | 6 055 653 | 90,02% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 611 120 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -133 415 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -2 559 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -204 |
| | felügyeleti díj: | -2 220 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -623 |
| f) nettó jövedelem: | | 472 099 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 472 099 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 2 713 888 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -151 545 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|--------------------------|----------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -3 000 | 860 475 | -873 811 | 857 462 | -16 349 |
| | Összesen: | | | | | -16 349 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -4 999 | 1 496 201 | -1 484 181 | 1 495 328 | 11 147 |
| | Összesen: | | | | | 11 147 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 1 493 964 | 1 198 741 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 824 687 | 587 621 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 54 473 | 138 918 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 30 | 103 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 614 774 | 472 099 | |

Beszámoló a 2013. évről - OTP Paletta Nyíltvégű Értékpapír Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 1997.11.17-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 5,370,075,009 | 3.749443 |
| 2013.02.28 | 5,415,281,438 | 3.802237 |
| 2013.03.28 | 6,191,336,592 | 3.820720 |
| 2013.04.30 | 6,027,429,173 | 3.802432 |
| 2013.05.31 | 6,797,219,539 | 3.803586 |
| 2013.06.28 | 6,509,452,789 | 3.690932 |
| 2013.07.31 | 6,449,372,332 | 3.733754 |
| 2013.08.30 | 6,294,139,424 | 3.705623 |
| 2013.09.30 | 6,660,749,569 | 3.833586 |
| 2013.10.31 | 6,477,244,565 | 3.887125 |
| 2013.11.29 | 6,976,120,067 | 3.933137 |
| 2013.12.31 | 6,833,653,683 | 3.878973 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,373,189,777

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Viszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| 2013.január | 77 742 765 | 17 541 045 |
| 2013.február | 20 302 609 | 29 725 546 |
| 2013.március | 210 905 080 | 27 398 165 |
| 2013.április | 6 733 162 | 30 032 281 |
| 2013.május | 223 909 188 | 20 206 477 |
| 2013.június | 89 817 898 | 146 817 460 |
| 2013.július | 56 840 644 | 58 816 314 |
| 2013.augusztus | 40 871 089 | 72 063 125 |
| 2013.szeptember | 69 818 480 | 30 643 546 |
| 2013.október | 71 114 413 | 92 318 822 |
| 2013.november | 116 027 883 | 59 829 453 |
| 2013.december | 66 907 532 | 75 510 026 |
| Összesen: | 1 050 990 743 | 660 902 260 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,761,717,217

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2003/12/31 | 2,638,558,660 | 1.707855 |
| 2004/12/31 | 2,549,229,099 | 2.177318 |
| 2005/12/30 | 9,369,344,977 | 2.650244 |
| 2006/12/29 | 12,323,742,437 | 2.927658 |
| 2007/12/28 | 14,403,651,769 | 3.148008 |
| 2008/12/31 | 7,302,595,786 | 2.401669 |
| 2009/12/31 | 7,654,260,889 | 3.140748 |
| 2010/12/31 | 7,259,993,295 | 3.483019 |
| 2011/12/30 | 5,316,623,519 | 3.559650 |
| 2012/12/28 | 5,098,574,590 | 3.712942 |
| 2013/12/31 | 6,833,653,683 | 3.878973 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Paletta Alap, olyan befektetés, amely magyar, cseh és lengyel részvényeket is tartalmaz, de a kockázatok csökkentése érdekében közel kétharmad részben magyar állampapírokból áll. Az alap jellemző befektetéseit hazai állampapírok és közép-európai részvények alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 5,10 milliárdról 6,83 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 4,47% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 13 | 29 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 438 | 960 | 0,01% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 61 | 5 940 | 0,09% | |
| OTP Bank Nyrt. TRY folyószámla | | 787 | 37 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. PLN folyószámla | | 0 | 91 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. RON folyószámla | | 0 | 2 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 33 802 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 110 465 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 11 652 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 129 402 | 1,90% | |
| OTP Bank Nyrt. TRY 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 8 290 | 0,12% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 46 021 | 0,68% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 157 218 | 190 772 | 2,80% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 128 381 | | 375 081 | 5,52% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | 9 913 | | 9 943 | 0,15% |
| 2015/B | 2010.03.31 - 2015.12.22 | 78 642 | | 325 561 | 4,79% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | 30 354 | | 29 739 | 0,44% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | 9 472 | | 9 838 | 0,14% |
| MNB Kötvények: | | 1 289 685 | | 1 452 302 | 21,38% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 608 015 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 681 670 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 44 834 | 0,66% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 1 407 468 | 20,72% |
| Kötvények: | | 1 392 603 | | 1 111 005 | 16,36% |
| BTEL2013/A | 2011.10.17 - 2013.02.12 | 110 393 | | 0 | 0,00% |
| E-STAR 2016/C | 2011.05.30 - 2016.05.30 | 21 511 | | 0 | 0,00% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - 2014.09.25 | 265 116 | | 0 | 0,00% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - 2016.03.20 | 293 093 | | 395 036 | 5,82% |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | 150 945 | | 162 846 | 2,40% |
| OPUS VAR 49-16 | 2007.10.31 - 2016.10.31 | 551 545 | | 0 | 0,00% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | 0 | | 91 697 | 1,35% |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 0 | | 57 102 | 0,84% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | 0 | | 404 324 | 5,95% |
| Belföldi részvények: | | 164 909 | | 298 317 | 4,39% |
| ÁLLAMI NYOMDA - 98 | | 2 777 | | 0 | 0,00% |
| BIF TÖRZS-100 | | 4 321 | | 4 752 | 0,07% |
| CIG PANNONIA | | 0 | | 99 220 | 1,46% |
| DANUBIUS TÖRZS | | 2 721 | | 2 067 | 0,03% |
| ENEFI | | 0 | | 37 765 | 0,56% |
| EGIS TÖRZS | | 52 755 | | 0 | 0,00% |
| FOTEX 0.42 EUR | | 1 947 | | 0 | 0,00% |
| GRAPHISOFT PARK SE | | 2 180 | | 0 | 0,00% |
| MAGYAR TELEKOM | | 33 750 | | 6 280 | 0,09% |
| MASTERPLAST | | 0 | | 34 754 | 0,51% |
| MOL TÖRZS | | 0 | | 36 665 | 0,54% |
| OTP TÖRZS (100) | | 25 210 | | 63 140 | 0,93% |
| PANNERGY | | 1 648 | | 979 | 0,01% |
| RICHTER G. TÖRZS | | 25 347 | | 0 | 0,00% |
| SYNERGON | | 6 121 | | 0 | 0,00% |
| TVK TÖRZS II. | | 6 132 | | 12 695 | 0,19% |
| Külföldi részvények: | | 1 631 582 | | 2 546 097 | 37,46% |
| AKBANK | | 35 260 | | 39 423 | 0,58% |
| AKRON | | 0 | | 79 807 | 1,17% |
| ALBARAKA TURK | | 8 384 | | 11 953 | 0,18% |
| ANADOLU EFES | | 0 | | 3 526 | 0,05% |
| ANEL ELEKTRIK | | 43 382 | | 16 701 | 0,25% |
| ASYA | | 5 449 | | 21 110 | 0,31% |

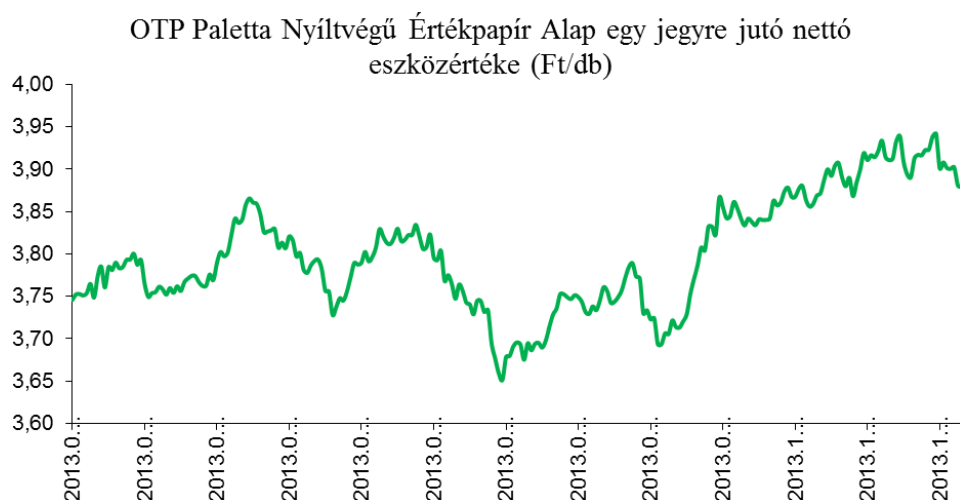
| | | | | | | |
|------------------------------|--|--------|--|---------|--|-------|
| CAT OIL AG | | 19 633 | | 0 | | 0,00% |
| CELEBI HAVA SERVISI | | 12 452 | | 0 | | 0,00% |
| CEZ | | 50 934 | | 50 697 | | 0,75% |
| DIXY GROUP | | 58 117 | | 89 573 | | 1,32% |
| DOGAN HOLDING | | 0 | | 14 558 | | 0,21% |
| EMLAK KONUT | | 7 809 | | 66 368 | | 0,98% |
| ENKA INSAAT | | 0 | | 5 425 | | 0,08% |
| ERSTE BANK STAMM | | 67 813 | | 37 604 | | 0,55% |
| ETALON GROUP | | 24 081 | | 34 292 | | 0,50% |
| EURASIA DRILLIN - GDR REGS | | 0 | | 14 558 | | 0,21% |
| EVRAZ PLC | | 9 201 | | 19 960 | | 0,29% |
| FIBERWEB | | 22 874 | | 0 | | 0,00% |
| FOSCHINI | | 0 | | 29 093 | | 0,43% |
| GARANTI BANKASI | | 26 259 | | 74 095 | | 1,09% |
| GARANTI YATIRIM ORTAKLIGI | | 0 | | 31 341 | | 0,46% |
| GAZPROM GDR | | 31 350 | | 28 158 | | 0,41% |
| GLOBAL TELECOM HOLDING - GDR | | 0 | | 18 063 | | 0,27% |
| HALK BANKASI | | 35 169 | | 97 163 | | 1,43% |
| HMS GDR | | 33 564 | | 35 586 | | 0,52% |
| HRVATSKI TELEKOM | | 2 942 | | 10 743 | | 0,16% |
| IMMOFINANZ AG | | 15 378 | | 16 622 | | 0,24% |
| IS BANKASI-C | | 0 | | 24 916 | | 0,37% |
| KDD GROUP NV | | 1 288 | | 0 | | 0,00% |
| KENYA COMMERCIAL BANK | | 8 795 | | 0 | | 0,00% |
| KGHM | | 59 747 | | 37 158 | | 0,55% |
| KOC HOLDING | | 16 800 | | 0 | | 0,00% |
| KOMERCNI | | 20 549 | | 21 134 | | 0,31% |
| KOZA METAL | | 0 | | 6 735 | | 0,10% |
| KRKA | | 29 770 | | 36 413 | | 0,54% |
| LINAS AGRO | | 4 981 | | 1 600 | | 0,02% |
| LSR GROUP GDR | | 0 | | 3 591 | | 0,05% |
| LUKOIL ADR | | 52 612 | | 60 013 | | 0,88% |
| M VIDEO | | 0 | | 90 598 | | 1,33% |
| MAGNIT | | 42 047 | | 67 170 | | 0,99% |
| MAILRU GDR | | 0 | | 18 276 | | 0,27% |
| MANGO GIDA | | 12 324 | | 523 | | 0,01% |
| MASTERPLAST | | 66 658 | | 0 | | 0,00% |
| MECHEL PREF | | 5 099 | | 1 012 | | 0,01% |
| MECHEL PREF RU | | 5 184 | | 1 385 | | 0,02% |
| MEGAFON-GDR | | 0 | | 14 450 | | 0,21% |
| MMK GDR | | 24 115 | | 16 165 | | 0,24% |
| NORILSK NICKEL ADR | | 19 748 | | 21 507 | | 0,32% |
| NOVATEK | | 0 | | 33 636 | | 0,50% |
| NOVATEK GDR | | 32 291 | | 0 | | 0,00% |
| OGK4 | | 0 | | 6 193 | | 0,09% |
| OJSC RN HOLDING | | 0 | | 32 181 | | 0,47% |
| OMV PETROM SA | | 0 | | 140 144 | | 2,06% |
| ORASCOM TELECOM - GDR | | 17 332 | | 0 | | 0,00% |
| PARK ELEKTRIK | | 0 | | 12 435 | | 0,18% |
| PEKAO | | 39 438 | | 0 | | 0,00% |
| PETKIM PETROKIMYA | | 0 | | 3 864 | | 0,06% |
| PGE | | 29 479 | | 26 392 | | 0,39% |
| PINAR ET | | 17 290 | | 5 899 | | 0,09% |
| PKN | | 10 589 | | 22 580 | | 0,33% |
| PKO BANK | | 53 224 | | 10 367 | | 0,15% |
| PLAZA CENTERS | | 28 228 | | 26 603 | | 0,39% |
| POLYTEC HOLDING AG | | 17 399 | | 47 039 | | 0,69% |
| PROTEK | | 0 | | 74 376 | | 1,09% |
| PZU | | 58 898 | | 65 415 | | 0,96% |
| ROMGAZ - GDR | | 0 | | 15 921 | | 0,23% |
| ROSNEFT GDR | | 49 999 | | 29 841 | | 0,44% |
| SABANCI HOLDING | | 8 457 | | 61 146 | | 0,90% |
| SBERBANK SPONSORED ADR | | 40 218 | | 3 073 | | 0,05% |
| SELCUK ECZA | | 0 | | 23 129 | | 0,34% |
| SEVERSTAL GDR | | 20 738 | | 39 235 | | 0,58% |
| SISTEMA | | 25 286 | | 33 920 | | 0,50% |
| SOLAR COMPANY S.A. | | 21 567 | | 12 303 | | 0,18% |
| SOLLERS | | 0 | | 50 361 | | 0,74% |

| | | | | | |
|---|-------------------------|----------------------|----------------------|-----------------|--------------|
| SURGUTNEFTEGAS ADR | | 24 982 | 0 | 0,00% | |
| SURGUTNEFTEGAS PREF | | 0 | 46 617 | 0,69% | |
| TATNEFT PREF | | 37 695 | 69 674 | 1,03% | |
| TEKFEN | | 0 | 19 754 | 0,29% | |
| TELEFONICA O2 C.R. | | 11 375 | 9 673 | 0,14% | |
| TMK GDR | | 0 | 108 448 | 1,60% | |
| TPSA | | 19 726 | 0 | 0,00% | |
| TRAKYA CAM | | 0 | 32 099 | 0,47% | |
| TRANSGAZ SA MEDIAS | | 0 | 33 034 | 0,49% | |
| TSKB | | 0 | 47 012 | 0,69% | |
| TUPRAS | | 20 408 | 23 420 | 0,34% | |
| TURK HAVA | | 13 892 | 5 860 | 0,09% | |
| TURK TELEKOM | | 15 699 | 13 256 | 0,20% | |
| TURKCELL | | 30 901 | 11 474 | 0,17% | |
| URALKALI GDR | | 35 118 | 0 | 0,00% | |
| VAKIFBANK | | 0 | 21 319 | 0,31% | |
| VIG AV | | 0 | 38 322 | 0,57% | |
| VTB BANK GDR | | 22 551 | 0 | 0,00% | |
| X5 RETAIL GROUP GDR | | 26 225 | 9 584 | 0,14% | |
| YAPI KREDI BANKASI | | 0 | 11 433 | 0,17% | |
| ZENITH BANK | | 22 809 | 0 | 0,00% | |
| Jelzáloglevelek: | | 88 434 | 0 | 0,00% | |
| OJB2013/II | 2002.12.20 - 2013.08.31 | 88 434 | 0 | 0,00% | |
| Befektetési jegyek: | | 279 238 | 818 021 | 12,06% | |
| OTP EUROGÖL | | 0 | 5 423 | 0,08% | |
| OTP FELTÖREKVŐ PIACI IX | | 0 | 715 | 0,01% | |
| OTP REÁL AKTIV | | 0 | 5 425 | 0,08% | |
| OTP SZINERGIA | | 0 | 1 074 | 0,02% | |
| OTP SZINERGIA III | | 0 | 2 002 | 0,03% | |
| OTP SZINERGIA IV | | 0 | 1 783 | 0,03% | |
| OTP SZINERGIA PLUSZ | | 0 | 20 002 | 0,30% | |
| OTP TRENDVADÁSZ I. | | 0 | 1 891 | 0,03% | |
| RECONCEPT I. ALAP | | 279 238 | 583 926 | 8,60% | |
| ALLIANZ CHINA A-SHARES | | 0 | 23 650 | 0,35% | |
| ETFS DAILY SHORT BRENT CRUDE | | 0 | 172 130 | 2,53% | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 4 974 832 | 0 6 600 823 | 0 97,17% | |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 9 789 | 6 500 | 0,10% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 7 427 | 1 679 | 0,03% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | -8 858 | -6 507 | -0,10% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 8 358 | 1 672 | 0,03% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 5 140 408 | 6 793 267 | 100,00% | |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 6 369 | 9 225 | 6,10% | |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 854 | 0,57% | |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | 311 | 423 | 0,28% | |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 11 060 | 62 153 | 41,12% | |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | | 26 662 | 78 490 | 51,93% | |
| Kötelezettségek összesen: | | 44 402 | 151 145 | 100,00% | |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 5 096 006 | 6 642 122 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma: | | 1 372 297 018 | 1 762 385 501 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 3,71348623 | 3,76882538 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) | |
|----------------------|--|------------------------------------|---|----------|
| 2013. január 31. | 1 432 498 738 | | 3,749443 | |
| 2013. február 28. | 1 423 075 801 | | 3,802237 | |
| 2013. március 28. | 1 606 582 716 | | 3,820720 | |
| 2013. április 30. | 1 583 283 597 | | 3,802432 | |
| 2013. május 31. | 1 786 986 308 | | 3,803586 | |
| 2013. június 28. | 1 729 986 746 | | 3,690932 | |
| 2013. július 31. | 1 728 011 076 | | 3,733754 | |
| 2013. augusztus 30. | 1 696 819 040 | | 3,705623 | |
| 2013. szeptember 30. | 1 735 993 974 | | 3,833586 | |
| 2013. október 31. | 1 714 789 565 | | 3,887125 | |
| 2013. november 29. | 1 770 987 995 | | 3,933137 | |
| 2013. december 31. | 1 762 385 501 | | 6 642 123 200 | 3,768825 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 4 974 832 | 100,00% | 6 600 823 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 1 289 685 | 25,92% | 1 452 302 | 22,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 899 103 | 58,28% | 2 938 388 | 44,52% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 493 476 |
| b) | egyéb bevétel: | 3 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -173 159 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 735 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | -2 256 |
| | bankköltség: | -406 |
| | felügyeleti díj: | -1 567 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -510 |
| f) | nettó jövedelem: | 313 846 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 313 846 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 1 501 014 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -268 744 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|--|-----------|--|---------------|---------------|
| | adatok ezerben | határidő ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -500 | 145 435 | -145 606 | 144 237 | -1 369 |
| | TRY | 480 | -58 548 | 58 985 | -58 353 | 632 |
| | EUR | -1 030 | 294 250 | -299 948 | 291 827 | -8 121 |
| | Összesen: | | | | | -8 858 |
| 2013.12.31-én: | TRY | 2 000 | -216 000 | 201 963 | -215 910 | -13 947 |
| | RON | -464 | 31 554 | -30 751 | 31 541 | 790 |
| | USD | -150 | 33 560 | -32 350 | 33 546 | 1 196 |
| | TRY | -950 | 98 934 | -95 932 | 98 893 | 2 961 |
| | TRY | -1 050 | 110 185 | -106 030 | 110 139 | 4 109 |
| | USD | -500 | 112 613 | -107 831 | 112 566 | 4 735 |
| | RBL | 52 000 | -344 084 | 338 182 | -343 058 | -4 876 |
| | USD | -1 750 | 387 538 | -377 409 | 387 376 | 9 967 |
| | EUR | -1 200 | 359 028 | -356 280 | 358 878 | 2 598 |
| | EUR | -1 900 | 564 167 | -564 109 | 563 932 | -177 |
| | Összesen: | | | | | 7 354 |

| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 0 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | 0 | -13 860 351 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 0 | -13 860 351 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 0 | 50 743 111 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 1 011 550 | 1 102 878 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 495 976 | 609 402 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 3 |
| 04. | IV. Működési költségek | 115 476 | 179 557 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 7 | 76 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 400 091 | 313 846 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP G10 Euró Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2008. január 10.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 2,763,739,397 | 1.761508 |
| 2013.02.28 | 2,965,461,623 | 1.898460 |
| 2013.03.28 | 3,643,134,685 | 1.959614 |
| 2013.04.30 | 3,648,546,125 | 1.920448 |
| 2013.05.31 | 4,290,973,085 | 2.014039 |
| 2013.06.28 | 4,405,056,612 | 2.049328 |
| 2013.07.31 | 4,653,220,346 | 2.044074 |
| 2013.08.30 | 5,200,306,816 | 2.089543 |
| 2013.09.30 | 5,426,329,145 | 1.959259 |
| 2013.10.31 | 5,188,331,591 | 1.84934 |
| 2013.11.29 | 5,512,556,795 | 1.921734 |
| 2013.12.31 | 5,417,574,398 | 1.819976 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 964,443,437

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás me nnyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|----------------------------------|
| 2013.január | 194 828 706 | 106 016 477 |
| 2013.február | 44 396 863 | 56 166 924 |
| 2013.március | 343 422 825 | 43 508 974 |
| 2013.április | 96 932 584 | 38 148 499 |
| 2013.május | 252 582 175 | 45 180 113 |
| 2013.június | 103 485 114 | 288 122 037 |
| 2013.július | 185 476 920 | 84 438 158 |
| 2013.augusztus | 230 915 915 | 30 536 047 |
| 2013.szeptember | 356 919 470 | 188 012 837 |
| 2013.október | 213 618 842 | 185 951 221 |
| 2013.november | 65 770 993 | 67 428 839 |
| 2013.december | 127 729 529 | 60 006 611 |
| Összesen: | 2 216 079 936 | 1 193 516 737 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|-------------------------------------|------------------|----------------|
| 2013.január | 61 324 | 60 503 |
| 2013.február | 31 103 | 11 066 |
| 2013.március | 61 308 | 66 946 |
| 2013.április | 23 691 | 94 530 |
| 2013.május | 167 798 | 55 559 |
| 2013.június | 605 217 | 100 613 |
| 2013.július | 647 092 | 333 526 |
| 2013.augusztus | 183 239 | 38 319 |
| 2013.szeptember | 291 146 | 19 920 |
| 2013.október | 265 990 | 29 994 |
| 2013.november | 183 565 | 37 545 |
| 2013.december | 133 496 | 23 050 |
| Összesen: | 2 654 969 | 871 571 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,985,413,705

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2008/12/31 | 608,731,591 | 1.007168 |
| 2009/12/31 | 726,977,814 | 1.380294 |
| 2010/12/31 | 998,008,734 | 1.480490 |
| 2011/12/30 | 1,245,089,438 | 1.853085 |
| 2012/12/28 | 2,776,631,664 | 1.879045 |
| 2013/12/31 | 5,417,574,398 | 1.819976 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP G10 Euró Származtatott Alap elsősorban fejlett piaci devizákba és vállalati kötvényekbe, valamint az ezekre szóló származtatott eszközökbe fekteti a vagyonát, azonban a portfólióba korlátozottan részvény és árupiaci eszközök is kerülhetnek. Ennek legfőbb célja, hogy a befektetendő eszközök szélesebb palettájáról válogatva az alap még versenyképesebb hozamot kínálhasson befektetőinek.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 2,78 milliárdról 5,42 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után -3,14% lett.

3. Vagyonkimutatás

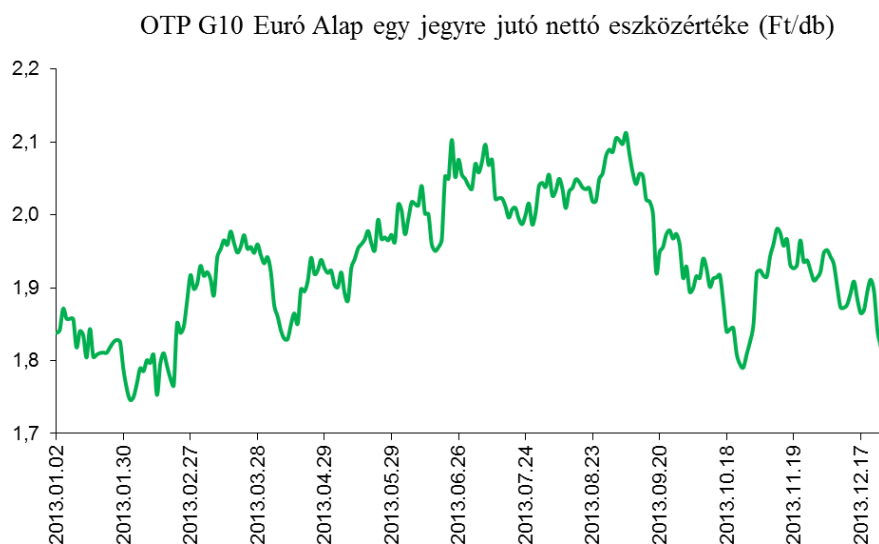
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 25 | 27 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 2 592 | 38 704 | 0,64% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 1 858 | 19 676 | 0,32% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 209 729 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.20 - 2013.01.02 | | 87 387 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 582 580 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 883 720 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 178 953 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 71 258 | 1,17% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 4 313 400 | 70,91% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 431 340 | 7,09% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1 946 844 | 4 874 405 | 80,13% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 354 967 | | 166 446 | 2,74% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 354 967 | | 0 | 0,00% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 166 446 | 2,74% |
| Kötvények: | | 61 802 | | 0 | 0,00% |
| OTPHB FLOAT 03/15 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 38 249 | | 0 | 0,00% |
| VESTAS WYND SYS 2010.03.23 - 2015.03.23 | | 23 553 | | 0 | 0,00% |
| Külföldi részvények: | | 127 861 | | 60 188 | 0,99% |
| BANK OF IRELAND | | 21 585 | | 0 | 0,00% |
| FR_TELECOM | | 85 017 | | 0 | 0,00% |
| JC PENNEY CO INC | | 0 | | 60 188 | 0,99% |
| NOKIA OYJ | | 109 | | 0 | 0,00% |
| VESTAS | | 21 150 | | 0 | 0,00% |
| Befektetési jegyek: | | 417 155 | | 1 062 320 | 17,46% |
| BNP VOL EDGE | | 4 835 | | 773 | 0,01% |
| ETF NATURAL GAS | | 62 634 | | 0 | 0,00% |
| ETFS COFFEE DE | | 0 | | 17 473 | 0,29% |
| ETFS COFFEE GB | | 0 | | 135 743 | 2,23% |
| IPATH DJ-UBS COFFEE | | 0 | | 305 400 | 5,02% |
| IPATH VIX ETN | | 59 736 | | 58 199 | 0,96% |
| PARTNERS GROUP MEZZANINE 2008 S. | | 122 463 | | 189 583 | 3,12% |
| PROSHARES ULTRASHORT 20 | | 122 658 | | 0 | 0,00% |
| PROSHARES ULTRASHORT S&P 500 | | 44 829 | | 23 988 | 0,39% |
| SPDR GOLD TRUST | | 0 | | 178 812 | 2,94% |
| UNITED STATES OIL FUND LP | | 0 | | 152 349 | 2,50% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 961 785 | 0 | 1 288 954 | 21,19% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 469 | 238 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 34 566 | -80 574 | -1,32% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 35 035 | -80 336 | -1,32% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 943 664 | | 6 083 023 | 100,00% |

| Kötelezettségek | | | |
|---|--|----------------------|------------------------|
| Alapkezelői díj miatt | | 3 328 | 9 424 1,46% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 688 0,11% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 155 | 706 0,11% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 154 751 | 632 605 98,32% |
| Kötelezettségek összesen: | | 158 234 | 643 423 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | |
| | | 2 785 430 | 5 439 600 |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | |
| | | 1 469 351 551 | 2 981 459 377 |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | |
| | | 1,89568648 | 1,82447557 |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|---|--|
| 2013. január 31. | 1 558 384 629 | | 1,761508 |
| 2013. február 28. | 1 552 004 521 | | 1,898460 |
| 2013. március 28. | 1 850 401 750 | | 1,959614 |
| 2013. április 30. | 1 890 130 144 | | 1,920448 |
| 2013. május 31. | 2 127 724 497 | | 2,014039 |
| 2013. június 28. | 2 078 826 050 | | 2,049328 |
| 2013. július 31. | 2 264 214 066 | | 2,044074 |
| 2013. augusztus 30. | 2 503 577 414 | | 2,089543 |
| 2013. szeptember 30. | 2 745 443 841 | | 1,959259 |
| 2013. október 31. | 2 836 594 386 | | 1,849340 |
| 2013. november 29. | 2 874 215 920 | | 1,921734 |
| 2013. december 31. | 2 981 459 377 | 5 439 599 808 | 1,824476 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 961 785 | 100,00% | 1 288 954 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 354 967 | 36,91% | 166 446 | 12,91% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 416 769 | 43,33% | 166 446 | 12,91% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 265 157 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -87 169 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 350 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | -602 |
| | bankköltség: | -238 |
| | felügyeleti díj: | -1 080 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -459 |
| f) nettó jövedelem: | | 174 259 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 174 259 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 2 899 272 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -419 361 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|---|-----------|--|---------------|----------------|
| | adatok ezerben | határidős ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| | | 2012.12.31-én: | USD | -3 000 | | |
| | JPY | 251 655 | | 646 627 | | 646 627 |
| | | | | | | -16 126 |
| | EUR | -1 000 | | -291 241 | | -291 241 |
| | JPY | 110 550 | | 284 058 | | 284 058 |
| | | | | | | -7 184 |
| | AUD | -11 000 | | -2 520 347 | | -2 520 347 |
| | USD | 11 558 | | 2 553 301 | | 2 553 301 |
| | | | | | | 32 954 |
| | SEK | -8 152 | | -275 948 | | -275 948 |
| | USD | 1 230 | | 271 729 | | 271 729 |
| | | 0 | | 0 | | -4 219 |
| | HUF | -1 434 175 | | -1 429 153 | | -1 429 153 |
| | EUR | 5 000 | | 1 456 352 | | 1 456 352 |
| | | | | | | 27 199 |
| | NOK | -5 557 | | -219 264 | | -219 264 |
| | USD | 1 000 | | 220 918 | | 220 918 |
| | | | | | | 1 653 |
| | EUR | -5 000 | | -1 456 207 | | -1 456 207 |
| | USD | 6 581 | | 1 453 959 | | 1 453 959 |
| | | | | | | -2 248 |
| | Összesen: | | | | | 32 029 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -5 000 | | -1 484 406 | | -1 484 406 |
| | USD | 6 837 | | 1 474 409 | | 1 474 409 |
| | | | | | | -9 997 |
| | EUR | -2 000 | | -593 762 | | -593 762 |
| | JPY | 283 270 | | 581 860 | | 581 860 |
| | | | | | | -11 903 |
| | AUD | -5 000 | | -960 752 | | -960 752 |
| | USD | 4 461 | | 962 010 | | 962 010 |
| | | | | | | 1 259 |
| | EUR | -32 800 | | -9 737 701 | | -9 737 701 |
| | USD | 45 159 | | 9 738 574 | | 9 738 574 |
| | | 0 | | 0 | | 873 |
| | GBP | -4 000 | | -1 426 832 | | -1 426 832 |
| | USD | 6 527 | | 1 407 498 | | 1 407 498 |
| | | | | | | -19 334 |
| | CHF | -3 547 | | -858 824 | | -858 824 |
| | USD | 4 000 | | 862 596 | | 862 596 |
| | | | | | | 3 772 |
| | SVK | -37 433 | | -1 258 106 | | -1 258 106 |
| | NOK | 35 000 | | 1 240 348 | | 1 240 348 |
| | | | | | | -17 759 |
| | HUF | -1 406 757 | | -1 405 937 | | -1 405 937 |
| | EUR | 4 700 | | 1 395 409 | | 1 395 409 |
| | | | | | | -10 528 |
| | SVK | -15 466 | | -519 822 | | -519 822 |
| | NOK | 2 350 | | 506 775 | | 506 775 |
| | | | | | | -13 047 |
| | HUF | -151 165 | | -151 152 | | -151 152 |
| | USD | 700 | | 151 822 | | 151 822 |
| | | | | | | 670 |
| | Összesen: | | | | | -75 993 |

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | Előző év | Tárgyév |
|---|--|--|---------------------------|---------------------------|
| | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | 11 937 380 | 0 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | 1 714 317 | 0 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -10 223 063 | 0 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 980 047 | 296 906 927 |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -157 360 | -301 488 112 |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 822 687 | -4 581 185 |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 0 | 5 753 924 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 2 655 850 | 5 088 092 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 2 653 805 | 4 822 935 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 28 008 | 90 804 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 87 | 94 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -26 050 | 174 259 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP EMDA Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2008. május 15.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 6,720,884,722 | 2.647648 |
| 2013.02.28 | 7,503,030,694 | 2.873478 |
| 2013.03.28 | 9,852,307,542 | 3.025604 |
| 2013.04.30 | 10,959,865,329 | 2.974034 |
| 2013.05.31 | 12,483,337,634 | 3.038907 |
| 2013.06.28 | 11,583,621,376 | 2.978912 |
| 2013.07.31 | 11,406,129,609 | 2.900159 |
| 2013.08.30 | 12,401,208,613 | 2.918167 |
| 2013.09.30 | 12,476,510,302 | 2.730894 |
| 2013.10.31 | 11,372,698,120 | 2.522153 |
| 2013.11.29 | 12,559,231,036 | 2.698150 |
| 2013.12.31 | 12,362,103,620 | 2.475810 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 2,415,901,072

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 375 902 775 | 246 416 899 |
| 2013.február | 257 014 499 | 191 647 380 |
| 2013.március | 821 756 756 | 117 194 977 |
| 2013.április | 505 523 656 | 124 510 638 |
| 2013.május | 510 198 840 | 85 761 865 |
| 2013.június | 310 245 508 | 618 835 292 |
| 2013.július | 487 009 639 | 369 053 091 |
| 2013.augusztus | 417 204 962 | 73 648 108 |
| 2013.szeptembe | 624 066 320 | 327 948 110 |
| 2013.október | 451 553 695 | 464 530 618 |
| 2013.november | 384 489 795 | 281 757 796 |
| 2013.december | 544 805 488 | 190 979 660 |
| Összesen: | 5 689 771 933 | 3 092 284 434 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 4,993,156,183

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2008/12/31 | 505,672,303 | 1.099252 |
| 2009/12/31 | 916,053,222 | 1.567514 |
| 2010/12/31 | 2,419,626,995 | 1.964572 |
| 2011/12/30 | 2,050,436,944 | 2.446353 |
| 2012/12/28 | 6,565,987,879 | 2.717822 |
| 2013/12/31 | 12,362,103,620 | 2.475810 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP EMDA Származtatott Alap elsősorban fejlődő piaci devizákba és vállalati kötvényekbe, valamint az ezekre szóló származtatott eszközökbe fekteti a vagyont, azonban a portfólióba a korlátozottan részvény és árupiaci eszközök is kerülhetnek. Ennek legfőbb célja, hogy a befektetendő eszközök szélesebb palettájáról válogatva az alap még versenyképesebb hozamot kínálhasson befektetőinek.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 6,56 milliárdról 12,36 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után -8,90% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|---------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 29 | 23 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 19 | 1 166 | | | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 110 | 6 576 | | | 0,05% |
| OTP Bank Nyrt. CZK folyószámla | | 0 | 1 653 | | | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. PLN folyószámla | | 0 | 275 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. TRY folyószámla | | 0 | 88 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 262 161 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 873 870 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.28 - 2013.01.02 | 13 982 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.28 - 2013.01.09 | 79 977 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 2 430 230 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 444 069 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.21 - 2013.01.02 | 141 395 | 0 | | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 6 470 100 | | | 50,31% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 1 294 020 | | | 10,06% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 118 619 | | | 0,92% |
| OTP Bank Nyrt. TRY | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 39 429 | | | 0,31% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 279 095 | | | 2,17% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 1 781 460 | | | 13,85% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 4 245 842 | 9 992 504 | | | 77,69% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | 414 320 | | 781 657 | | 6,08% |
| CROATI 6 01/26/24 | 2013.11.26 - 2024.01.26 | 0 | | 604 499 | | 4,70% |
| HELLENIC REP GGB | 2012.03.12 - 2042.10.15 | 228 | | 942 | | 0,01% |
| MONGOL 5.125 12/05 | 2012.12.05 - 2022.12.05 | 60 921 | | 97 653 | | 0,76% |
| MONTEN 7.25 04/16 | 2011.04.08 - 2016.04.08 | 155 920 | | 78 563 | | 0,61% |
| SERBTB 0 08/09/13 | 2010.10.04 - 2014.02.12 | 119 636 | | 0 | | 0,00% |
| SLOREP 5.125 03/26 | 2011.03.30 - 2026.03.30 | 77 615 | | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 610 492 | | 616 166 | | 4,79% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 563 819 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 46 673 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 469 327 | | 3,65% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 146 839 | | 1,14% |
| Kötvények: | | 631 697 | | 140 475 | | 1,10% |
| CEDC 8.875 12/16 | 2009.12.02 - 2016.12.01 | 18 105 | | 0 | | 0,00% |
| EFSFTB 0 06/17/13 | 2012.12.17 - 2013.06.17 | 2 388 | | 0 | | 0,00% |
| HTC 9.5 12/15/16 | 2009.08.12 - 2016.12.15 | 24 557 | | 0 | | 0,00% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - 2016.03.20 | 104 676 | | 0 | | 0,00% |
| OGXPBZ 8 1/2 06/01/ | 2011.01.19 - 2018.06.01 | 65 759 | | 13 986 | | 0,11% |
| OTPHB FLOAT 03/1: | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 50 998 | | 0 | | 0,00% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | 361 766 | | 0 | | 0,00% |
| RFV 2014/A | 2010.10.04 - 2014.02.12 | 3 448 | | 0 | | 0,00% |
| URBIMM 9.5 01/21/2 | 2010.01.19 - 2020.01.21 | 0 | | 11 219 | | 0,09% |
| ZAGHLD 5.5 07/17 | 2007.07.10 - 2017.07.10 | 0 | | 115 270 | | 0,90% |
| Belföldi részvények: | | 198 221 | | 1 011 183 | | 7,86% |
| CIG PANNONIA | | 0 | | 102 850 | | 0,80% |
| ENEFI | | 780 | | 58 615 | | 0,46% |
| MAGYAR TELEKOM | | 172 331 | | 662 781 | | 5,15% |
| MASTERPLAST | | 25 110 | | 114 562 | | 0,89% |
| MOL TÖRZS | | 0 | | 72 375 | | 0,56% |

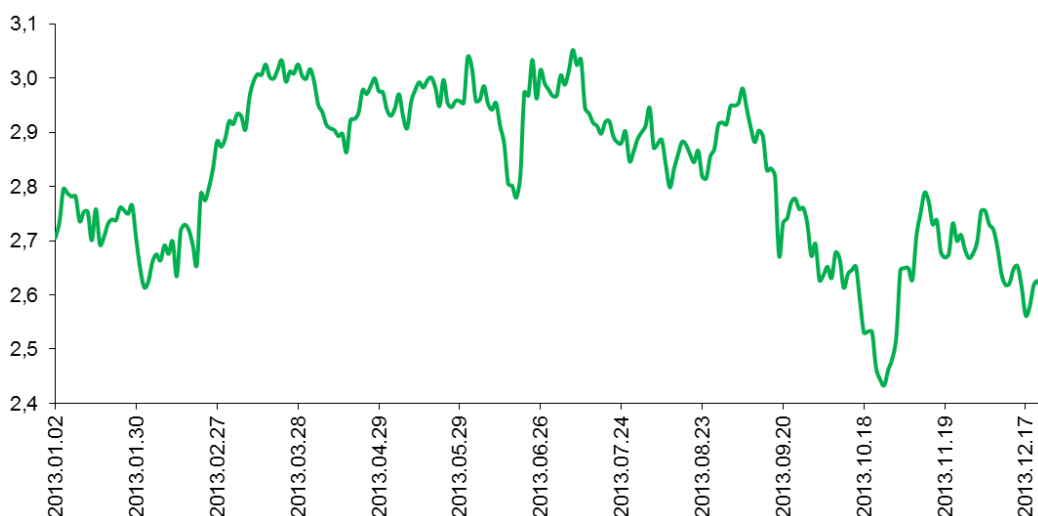
| | | | | | |
|---|----------------------|----------------------|------------------|-----------------|----------------|
| Külföldi részvények: | 168 948 | 368 804 | 2,87% | | |
| AKRON | 0 | 41 964 | 0,33% | | |
| BANK OF CYPRUS | 7 428 | 6 146 | 0,05% | | |
| FONDUL PROPRIETATEA SA | 32 497 | 0 | 0,00% | | |
| HMS GDR | 39 160 | 72 994 | 0,57% | | |
| NOVA KREDITNA BANKA MARIBOR | 46 987 | 0 | 0,00% | | |
| PLAZA CENTERS | 42 876 | 184 131 | 1,43% | | |
| TMK GDR | 0 | 63 569 | 0,49% | | |
| Befektetési jegyek: | 480 808 | 618 601 | 4,82% | | |
| DB X-TRACKERS CHINA | 270 040 | 290 305 | 2,26% | | |
| ETF INDIA SMALL-CAP | 31 938 | 170 918 | 1,33% | | |
| IPATH VIX ETN | 136 690 | 111 957 | 0,87% | | |
| PROSHARES ULTRASHORT S&P 500 | 42 140 | 22 549 | 0,18% | | |
| VIETNAM INFRASTRUCTURE | 0 | 22 872 | 0,18% | | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 2 504 486 | 0 | 3 536 886 | 0 | 27,52% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 1 084 | | 508 | 0,00% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | -12 619 | | -669 652 | -5,21% |
| Egyéb eszközök összesen: | | -11 535 | | -669 144 | -5,21% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 6 738 793 | 12 860 246 | 100,00% | | |
| Kötelezettségek | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | 7 692 | | 21 475 | 6,87% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 1 551 | 0,49% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | 360 | | 1 278 | 0,41% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 141 571 | | 288 451 | 92,23% |
| Kötelezettségek összesen: | | 149 623 | | 312 755 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 6 589 170 | 12 547 491 | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 2 414 110 581 | 5 011 598 080 | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | 2,72943995 | 2,50369060 | | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 2 543 596 457 | | 2,647648 |
| 2013. február 28. | 2 608 963 576 | | 2,873478 |
| 2013. március 28. | 3 313 525 355 | | 3,025604 |
| 2013. április 30. | 3 694 538 373 | | 2,974034 |
| 2013. május 31. | 4 118 975 348 | | 3,038907 |
| 2013. június 28. | 3 810 385 564 | | 2,978912 |
| 2013. július 31. | 3 928 342 112 | | 2,900159 |
| 2013. augusztus 30. | 4 271 898 966 | | 2,918167 |
| 2013. szeptember 30. | 4 568 017 176 | | 2,730894 |
| 2013. október 31. | 4 555 040 253 | | 2,522153 |
| 2013. november 29. | 4 657 772 252 | | 2,698150 |
| 2013. december 31. | 5 011 598 080 | 12 547 490 999 | 2,503691 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP EMDA Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| Az Alap értékpapír portfóliójának összetételével kapcsolatos további adatok (2011.évi CXCI. törvény 6.melléklet): | | | | |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 504 486 | 100,00% | 3 536 886 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 610 492 | 24,38% | 616 166 | 17,42% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 1 656 509 | 66,14% | 1 538 298 | 43,49% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | -303 251 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -216 732 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -3 175 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | -1 531 |
| | bankköltség: | | -311 |
| | felügyeleti díj: | | -2 688 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -633 |
| f) | nettó jövedelem: | | -528 321 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -528 321 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 7 518 979 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -1 032 337 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|---------------------------|-----------|--------------------------|-----------|-----------------|
| | adatok ezerben | határidő ügylet | | határidős ügylet | | eredmény |
| | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizában | forintban | |
| 2013.12.31-én: | HUF | -1 327 330 | | -1 325 783 | | -1 325 783 |
| | TRY | 12 731 | | 1 282 882 | | 1 282 882 |
| | | | | | | -42 901 |
| | HUF | -1 038 070 | | -1 036 860 | | -1 036 860 |
| | TRY | 10 000 | | 1 007 687 | | 1 007 687 |
| | | | | | | -29 173 |
| | HUF | 5 000 | | 1 078 245 | | 1 078 245 |
| | USD | -1 089 225 | | -1 087 956 | | -1 087 956 |
| | | | | | | -9 711 |
| | RON | -15 009 | | -994 335 | | -994 335 |
| | USD | 4 625 | | 997 377 | | 997 377 |
| | | | | | | 3 042 |
| | CZK | -234 606 | | -2 543 112 | | -2 543 112 |
| | USD | 11 720 | | 2 527 407 | | 2 527 407 |
| | | | | | | -15 705 |
| | PLN | -166 296 | | -11 895 714 | | -11 895 714 |
| | USD | 54 550 | | 11 763 655 | | 11 763 655 |
| | | | | | | -132 059 |
| | HUF | -11 219 209 | | -11 206 136 | | -11 206 136 |
| | USD | 50 890 | | 10 974 379 | | 10 974 379 |
| | | | | | | -231 757 |
| | HUF | -2 934 694 | | -2 931 274 | | -2 931 274 |
| | TRY | 27 269 | | 2 747 864 | | 2 747 864 |
| | | | | | | -183 410 |
| | KRW | -14 910 000 | | -3 041 120 | | -3 041 120 |
| | USD | 14 000 | | 3 019 057 | | 3 019 057 |
| | | | | | | -22 063 |
| | HUF | -1 079 625 | | -1 078 367 | | -1 078 367 |
| | USD | 5 000 | | 1 078 245 | | 1 078 245 |
| | | | | | | -122 |
| | USD | 2 000 | | 431 334 | | 431 334 |
| | HUF | -431 500 | | -431 428 | | -431 428 |
| | | | | | | -94 |
| | Összesen: | | | | | -663 953 |

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 14 934 868 | 771 872 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 2 614 044 | 494 622 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -12 320 824 | -277 250 |
| | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 49 063 200 | 542 313 218 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -37 772 300 | -548 506 338 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 11 290 900 | -6 193 120 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 0 | 10 565 419 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------------|-------------------------------|
| | | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban | |
| | A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 4 605 109 | 17 184 637 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 4 208 131 | 17 487 888 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 62 421 | 225 064 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 6 | 6 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | 334 551 | -528 321 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Supra Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2008. május 15.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 38,750,877,777 | 3.431856 |
| 2013.02.28 | 41,914,104,146 | 3.445652 |
| 2013.03.28 | 49,649,607,283 | 3.466869 |
| 2013.03.29 | 49,810,367,126 | 3.466650 |
| 2013.04.30 | 53,035,095,602 | 3.506568 |
| 2013.05.31 | 59,387,260,349 | 3.562574 |
| 2013.06.28 | 62,615,723,869 | 3.526369 |
| 2013.07.31 | 63,180,387,641 | 3.584602 |
| 2013.08.30 | 70,440,821,886 | 3.593079 |
| 2013.09.30 | 77,818,382,325 | 3.60866 |
| 2013.10.31 | 79,916,517,262 | 3.635992 |
| 2013.11.29 | 84,722,124,721 | 3.668689 |
| 2013.12.31 | 87,818,097,680 | 3.647727 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 8,759,029,411

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 2 812 217 634 | 208 683 128 |
| 2013.február | 1 194 986 985 | 403 449 523 |
| 2013.március | 2 598 948 775 | 356 295 845 |
| 2013.április | 1 183 850 577 | 472 681 779 |
| 2013.május | 2 071 621 013 | 414 683 995 |
| 2013.június | 1 785 993 562 | 901 827 947 |
| 2013.július | 3 018 028 279 | 2 412 214 483 |
| 2013.augusztus | 2 267 609 016 | 885 381 239 |
| 2013.szeptember | 2 577 482 227 | 690 344 914 |
| 2013.október | 1 521 366 473 | 1 061 123 540 |
| 2013.november | 1 838 517 544 | 713 326 977 |
| 2013.december | 2 071 510 188 | 1 080 076 281 |
| Összesen: | 24 942 132 273 | 9 600 089 651 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 24,074,745,916

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2008/12/31 | 539,257,415 | 1.146677 |
| 2009/12/31 | 1,074,448,928 | 1.514502 |
| 2010/12/31 | 7,166,186,948 | 2.101703 |
| 2011/12/30 | 5,815,414,555 | 2.544677 |
| 2012/12/28 | 29,551,265,717 | 3.373806 |
| 2013/12/31 | 87,818,097,680 | 3.647727 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Supra Származtatott Alap, olyan befektetés, amellyel döntően hosszú lejáratú állampapírokba, vállalati kötvényekbe lehet pénzt elhelyezni. Az alap jellemző befektetéseit államkötvények, vállalati kötvények alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 29,55 milliárdról 87,82 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 8,12% lett.

3. Vagyonkimutatás

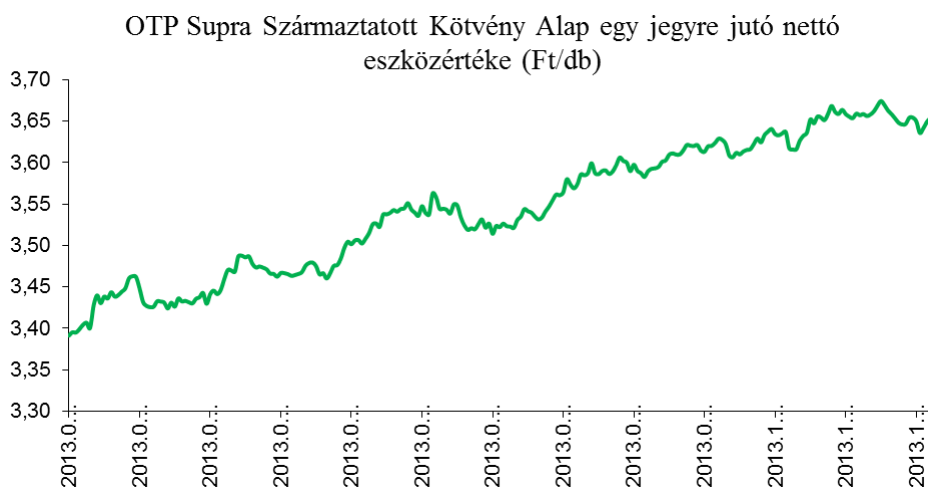
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 21 | 311 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 25 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 59 | 22 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | 0 | 8 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. PLN folyószámla | | 0 | 1 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. CHF folyószámla | | 4 | 2 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 127 256 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. CHF | 2012.12.06 - 2013.01.09 | 38 666 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.05 - 2013.01.09 | 13 341 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.02 | 6 156 094 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.31 - 2014.01.08 | 0 | 5 641 290 | 6,35% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 9 695 893 | 10,92% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 46 318 | 0,05% | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 4 302 401 | 4,85% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 6 335 466 | 19 686 246 | 22,17% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 8 417 411 | | 8 692 596 | 9,79% |
| REPHUN 4.125 02/18 | 2013.02.19 - 2018.02.19 | 0 | | 220 993 | 0,25% |
| REPHUN 4.5 01/14 | 2004.01.29 - 2014.01.29 | 1 846 587 | | 1 858 623 | 2,09% |
| REPHUN 4.5 02/13 | 2003.02.06 - 2013.02.06 | 759 592 | | 0 | 0,00% |
| REPHUN 5.375 02/23 | 2013.02.19 - 2023.02.21 | 0 | | 218 060 | 0,25% |
| REPHUN 5.5 06/14 | 2004.05.06 - 2014.05.06 | 3 122 868 | | 3 897 513 | 4,39% |
| REPHUN 5.75 06/18 | 2008.06.11 - 2018.06.11 | 933 201 | | 997 884 | 1,12% |
| REPHUN 6 01/11/19 | 2011.05.11 - 2019.01.11 | 1 281 960 | | 1 026 328 | 1,16% |
| REPHUN 6.75 07/14 | 2009.07.28 - 2014.07.28 | 473 203 | | 473 195 | 0,53% |
| MNB Kötvények: | | 7 230 320 | | 43 088 525 | 48,52% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 2 302 064 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 4 928 256 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 24 899 755 | 28,04% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 18 188 770 | 20,48% |
| Kötvények: | | 6 476 839 | | 10 237 338 | 11,53% |
| BNP 4.5 11/27/2016 | 2013.11.27 - 2016.11.27 | 0 | | 1 004 513 | 1,13% |
| BTEL2013/A | 2011.10.17 - 2013.02.12 | 149 704 | | 0 | 0,00% |
| BTEL2014/A | 2011.07.01 - 2014.08.22 | 4 399 | | 4 274 | 0,01% |
| BTEL2014/C | 2013.02.12 - 2014.02.12 | 0 | | 139 341 | 0,16% |
| FIAT 6.625 03/15/18 | 2013.03.15 - 2018.03.15 | 0 | | 337 018 | 0,38% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - 2014.09.25 | 706 975 | | 0 | 0,00% |
| MAEXIM 5.5 02/12/1 | 2012.12.12 - 2018.02.12 | 672 526 | | 682 123 | 0,77% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - 2016.03.20 | 628 056 | | 846 507 | 0,95% |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | 452 836 | | 488 539 | 0,55% |
| MAGYAR 6.25 10/21 | 2013.10.21 - 2020.10.21 | 0 | | 1 124 865 | 1,27% |
| MOLHB 6.25 09/19 | 2012.09.26 - 2019.09.26 | 2 082 021 | | 2 816 284 | 3,17% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | 0 | | 802 725 | 0,90% |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 1 274 943 | | 1 427 545 | 1,61% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | 454 679 | | 563 604 | 0,63% |
| RFV 2014/A | 2010.10.04 - 2014.02.12 | 50 700 | | 0 | 0,00% |
| Belföldi részvények: | | 377 926 | | 1 091 941 | 1,24% |
| E-STAR | | 0 | | 121 042 | 0,14% |
| MASTERPLAST | | 111 600 | | 87 200 | 0,10% |
| MOL TÖRZS | | 266 326 | | 883 699 | 1,00% |

| | | | | | | |
|---|-------------------------|----------------------|-----------------|-----------------------|----------|----------------|
| Külföldi részvények: | | 841 062 | | 3 162 902 | | 3,55% |
| PKO BANK | | 0 | | 797 631 | | 0,90% |
| ROMGAZ - GDR | | 0 | | 235 103 | | 0,26% |
| SBERBANK | | 131 142 | | 128 669 | | 0,14% |
| UNICREDIT SPA | | 647 713 | | 1 682 621 | | 1,89% |
| VESTAS | | 62 207 | | 318 878 | | 0,36% |
| Jelzáloglevelek: | | 876 841 | | 933 387 | | 1,05% |
| FJ15ZF02 | 2005.05.18 - 2015.05.18 | 876 841 | | 933 387 | | 1,05% |
| Befektetési jegyek: | | 0 | | 1 514 978 | | 1,71% |
| DB CRUDE OIL 2X SHORT | | 0 | | 152 996 | | 0,17% |
| PROSHARES ULTRASHORT CRUDE OIL | | 0 | | 681 086 | | 0,77% |
| PARTNERS GROUP SECONDARY 2008 S. | | 0 | | 680 896 | | 0,77% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 24 220 399 | 0 | 68 721 667 | 0 | 77,39% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 95 090 | | 0,11% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 1 326 | 849 | | 0,00% |
| Számmutatott ügyletek értékelési különbözete | | | -189 021 | 289 135 | | 0,33% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | -187 695 | 385 074 | | 0,44% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 30 368 170 | | 88 792 987 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 36 274 | 148 529 | | 20,47% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 10 427 | | 1,44% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 1 571 | 5 154 | | 0,71% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 116 346 | 266 011 | | 36,65% |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | | | 555 113 | 295 621 | | 40,73% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 709 304 | 725 742 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 29 658 866 | | 88 067 245 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 8 798 978 068 | | 24 141 020 690 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 3,37071712 | 3,64803322 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 11 402 512 574 | | 3,431856 |
| 2013. február 28. | 12 194 050 036 | | 3,445652 |
| 2013. március 28. | 14 436 702 966 | | 3,466869 |
| 2013. április 29. | 15 147 871 764 | | 3,506168 |
| 2013. május 30. | 16 804 808 782 | | 3,537391 |
| 2013. június 27. | 17 688 974 397 | | 3,522055 |
| 2013. július 30. | 18 294 788 193 | | 3,585606 |
| 2013. augusztus 29. | 19 677 015 970 | | 3,592445 |
| 2013. szeptember 27. | 21 564 153 283 | | 3,622441 |
| 2013. október 30. | 22 024 396 216 | | 3,632302 |
| 2013. november 28. | 23 149 586 783 | | 3,661821 |
| 2013. december 31. | 24 141 020 690 | 88 067 245 371 | 3,648033 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 24 220 399 | 100,00% | 68 721 667 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 7 230 320 | 29,85% | 43 088 525 | 62,70% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 23 001 411 | 94,97% | 62 951 846 | 91,60% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 3 651 394 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -1 543 892 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -19 654 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -401 |
| | felügyleti díj: | -15 445 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -748 |
| f) | nettó jövedelem: | 2 071 254 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 2 071 254 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 54 269 289 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 2 067 836 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|--|------------|-----------------------------|---------------------------|----------------|
| | adatok | határidős ügylet | | határidős ügylet | | |
| | ezerben | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | HUF | -2 807 065 | | -2 803 483 | | -2 803 483 |
| | PLN | 41 000 | | 2 928 773 | | 2 928 773 |
| | | | | | | 125 290 |
| | GBP | -5 038 | | -1 790 194 | | -1 790 194 |
| | EUR | 6 200 | | 1 805 697 | | 1 805 697 |
| | | | | | | 15 503 |
| | CHF | -44 339 | | -10 546 984 | | -10 546 984 |
| | EUR | 36 600 | | 10 517 898 | | 10 517 898 |
| | | | | | | -29 085 |
| | EUR | -46 | | -13 155 | | -13 155 |
| | GBP | 37 | | 13 126 | | 13 126 |
| | | 4 821 | | 1 403 662 | | -29 |
| | Összesen: | | | | | 111 679 |
| 2013.12.31-én: | EUR | 30 000 | -8 911 200 | 8 906 867 | -8 906 005 | 862 |
| | EUR | 30 000 | -8 889 900 | 8 906 867 | -8 884 717 | 22 150 |
| | | | | | | 23 012 |
| | CHF | -30 510 | | -7 387 699 | | -7 387 699 |
| | EUR | 25 000 | | 7 422 389 | | 7 422 389 |
| | | 0 | | 0 | | 34 691 |
| | CHF | -121 995 | | -29 539 859 | | -29 539 859 |
| | EUR | 100 000 | | 29 687 259 | | 29 687 259 |
| | | 0 | | 0 | | 147 401 |
| | CHF | -91 547 | | -22 167 091 | | -22 167 091 |
| | EUR | 75 000 | | 22 267 168 | | 22 267 168 |
| | | | | | | 100 077 |
| | GBP | -6 582 | | -2 348 023 | | -2 348 023 |
| | USD | 10 813 | | 2 331 978 | | 2 331 978 |
| | | | | | | -16 045 |
| | Összesen: | | | | | 289 135 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | 309 720 000 | 0 | |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | -610 420 000 | 0 | |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | -300 700 000 | 0 | |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | 628 424 658 | 623 287 671 | |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | | | |
|--------------------------|-------|---------------------------------|--|------------------------|--|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | | | | |
| A tétel megnevezése | | | | Előző év | | Tárgyév |
| | | | | 2012.01.01-2012.12.31. | | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | | c. | | d. |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | | 8 323 569 | | 11 669 906 |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 4 888 758 | | 8 018 512 |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | | 0 | | 0 |
| 04. | IV. | Működési költségek | | 780 770 | | 1 580 088 |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | | 35 | | 52 |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | | 0 | | 0 |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | | 0 | | 0 |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 | | 0 |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | | 2 654 006 | | 2 071 254 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Abszolút Hozam Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Típusa: nyilvános nyíltvégű értékpapír befektetési alap

Futamideje: 2006.07.11-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 6,085,129,736 | 1.301234 |
| 2013.02.28 | 6,193,952,290 | 1.326258 |
| 2013.03.28 | 7,266,040,465 | 1.343722 |
| 2013.04.30 | 7,430,149,044 | 1.344909 |
| 2013.05.31 | 8,241,446,305 | 1.370314 |
| 2013.06.28 | 7,598,936,244 | 1.373456 |
| 2013.07.31 | 7,646,404,502 | 1.413297 |
| 2013.08.30 | 7,811,188,963 | 1.416815 |
| 2013.09.30 | 8,380,045,163 | 1.451242 |
| 2013.10.31 | 7,213,894,291 | 1.447761 |
| 2013.11.29 | 8,556,759,334 | 1.490217 |
| 2013.12.31 | 9,404,867,361 | 1.50163 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 3,874,986,773

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|----------------------------|------------------------------|
| 2013.január | 357 202 340 | 76 044 811 |
| 2013.február | 257 260 576 | 287 536 891 |
| 2013.március | 808 948 937 | 84 699 683 |
| 2013.április | 461 199 382 | 158 038 689 |
| 2013.május | 579 648 254 | 101 564 864 |
| 2013.június | 251 791 315 | 864 612 835 |
| 2013.július | 269 220 765 | 1 693 706 017 |
| 2013.augusztus | 145 550 937 | 43 043 734 |
| 2013.szeptember | 171 387 056 | 509 763 903 |
| 2013.október | 251 258 074 | 68 048 245 |
| 2013.november | 421 005 847 | 18 968 469 |
| 2013.december | 526 474 020 | 132 365 388 |
| Összesen: | 4 500 947 503 | 4 038 393 529 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 4,298,885,761

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2006/12/29 | 9,704,402,734 | 1.053613 |
| 2007/12/28 | 18,313,886,292 | 1.144035 |
| 2008/12/31 | 12,502,390,398 | 0.977283 |
| 2009/12/31 | 10,718,551,659 | 1.151584 |
| 2010/12/31 | 9,509,418,871 | 1.247173 |
| 2011/12/30 | 6,656,304,383 | 1.310071 |
| 2012/12/28 | 5,621,488,974 | 1.278685 |
| 2013/12/31 | 9,404,867,361 | 1.50163 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Abszolút Hozam Alap olyan befektetés, amely a változó tőkepiaci körülményekhez igazodva mozgathatja tőkéjét a kockázatmentes, illetve alacsony kockázatú pénz- és kötvénypiaci eszközök, illetve a magasabb kockázatú részvény típusú befektetések között. Az alap jellemző befektetéseit hazai és fejlett piaci részvények, állampapírok és bankbetétek alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 5,61 milliárdról 9,4 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 16,14% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|--------------|------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 17 | | 28 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 24 | | 1 929 | | 0,02% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | 217 | | 292 112 | | 2,88% |
| OTP Bank Nyrt. CHF folyószámla | | | 0 | | 1 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | | 0 | | 1 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.28 - | 2013.01.09 | 131 453 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.21 - | 2013.01.02 | 285 000 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.21 - | 2013.01.02 | 441 860 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - | 2013.01.02 | 462 743 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 890 730 | | 8,78% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 296 910 | | 2,93% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 148 812 | | 1,47% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.31 - | 2014.01.08 | 0 | | 1 164 618 | | 11,48% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 1 078 350 | | 10,63% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 321 314 | | 3 873 491 | | 38,19% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | | Futamidó | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | | 1 058 742 | | 1 879 546 | | 18,53% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | 1 058 742 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | 0 | | 752 871 | | 7,42% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | | 1 126 675 | | 11,11% |
| Kötvények: | | | 1 188 290 | | 593 357 | | 5,85% |
| MOLHB 6.25 09/19 | 2012.09.26 - | 2019.09.26 | 416 404 | | 0 | | 0,00% |
| OPUS VAR 49-16 | 2007.10.31 - | 2016.10.31 | 0 | | 348 312 | | 3,43% |
| OTPHB FLOAT 03/15 | 2005.03.04 - | 2015.03.04 | 127 494 | | 0 | | 0,00% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - | 2016.11.07 | 593 059 | | 245 045 | | 2,42% |
| RFV 2014/A | 2010.10.04 - | 2014.02.12 | 4 225 | | 0 | | 0,00% |
| VESTAS WYND SYS | 2010.03.23 - | 2015.03.23 | 47 108 | | 0 | | 0,00% |
| Belföldi részvények: | | | 252 226 | | 510 471 | | 5,03% |
| BIF TÖRZS-100 | | | 26 309 | | 28 931 | | 0,28% |
| CIG PANNONIA | | | 0 | | 62 920 | | 0,62% |
| ENEFI | | | 0 | | 10 086 | | 0,10% |
| EGIS TÖRZS | | | 52 755 | | 0 | | 0,00% |
| MAGYAR TELEKOM | | | 0 | | 216 660 | | 2,14% |
| MASTERPLAST | | | 64 531 | | 48 373 | | 0,48% |
| OTP TÖRZS (100) | | | 0 | | 143 501 | | 1,41% |
| RICHTER G. TÖRZS | | | 108 631 | | 0 | | 0,00% |
| Külföldi részvények: | | | 927 101 | | 1 217 083 | | 12,01% |
| 21VIANET GROUP INC | | | 0 | | 28 093 | | 0,28% |
| ALLETE INC | | | 0 | | 27 970 | | 0,28% |
| AMEREN CORPORATION | | | 0 | | 27 295 | | 0,27% |
| AMEREN CORPORATION | | | 23 754 | | 0 | | 0,00% |
| AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | | | 24 262 | | 0 | | 0,00% |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | | | 0 | | 28 254 | | 0,28% |
| AMKOR TECHNOLOGY INC | | | 0 | | 27 763 | | 0,27% |
| APOLLO GROUP INC | | | 462 | | 0 | | 0,00% |
| AVAGO TECHNOLOGIES | | | 4 895 | | 0 | | 0,00% |
| BOB EVANS FARMS INC/DE | | | 16 | | 0 | | 0,00% |
| CALPINE CORP | | | 0 | | 438 | | 0,00% |
| CANADIAN SOLAR INC | | | 0 | | 27 654 | | 0,27% |
| CARPENTER TECHNOLOGY ORD | | | 14 828 | | 0 | | 0,00% |
| CERNER CORP | | | 8 562 | | 0 | | 0,00% |

| | | | |
|---------------------------------|--------|--------|-------|
| CHARTER COMMUNICATIONS INC | 28 634 | 0 | 0,00% |
| CHICO'S FAS INC | 26 102 | 0 | 0,00% |
| CHILDREN'S PLACE | 0 | 29 489 | 0,29% |
| CIGNA CORP | 0 | 32 074 | 0,32% |
| CNH GLOBAL NV | 21 363 | 0 | 0,00% |
| Comerica | 26 142 | 0 | 0,00% |
| CONMED CORP | 618 | 0 | 0,00% |
| CR BRAND INC | 25 912 | 0 | 0,00% |
| CRESTWOOD EQUITY PARTNERS LP | 0 | 14 615 | 0,14% |
| CRESTWOOD MIDSTREAM PARTNERS LP | 0 | 11 364 | 0,11% |
| CUMMINS INC | 0 | 30 403 | 0,30% |
| DELUXE CORP | 10 684 | 0 | 0,00% |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 73 | 0 | 0,00% |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 0 | 29 252 | 0,29% |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 26 688 | 0 | 0,00% |
| EDISON INTERNATIONAL | 26 956 | 0 | 0,00% |
| EPR PROPERTIES | 0 | 27 566 | 0,27% |
| EQT CORP | 26 061 | 0 | 0,00% |
| ESTEE LAUDER COS INC | 0 | 29 239 | 0,29% |
| EXPEDIA INC | 75 | 0 | 0,00% |
| F5 NETWORKS INC | 10 625 | 0 | 0,00% |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST | 0 | 27 850 | 0,27% |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 0 | 29 569 | 0,29% |
| FUEL SYSTEMS | 522 | 0 | 0,00% |
| GERDAU SA | 0 | 27 561 | 0,27% |
| GT ADVANCED | 66 942 | 0 | 0,00% |
| HEALTHSOUTH CORP | 20 055 | 0 | 0,00% |
| HERMAN MILLER INC | 26 551 | 0 | 0,00% |
| HIBBETT SPORTS INC | 15 136 | 0 | 0,00% |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 4 434 | 0 | 0,00% |
| HMS GDR | 56 406 | 32 620 | 0,32% |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 0 | 28 929 | 0,29% |
| HYPERDYNAMICS CORP | 0 | 42 133 | 0,42% |
| INERGY LP | 19 692 | 0 | 0,00% |
| INSULET CORP | 0 | 32 005 | 0,32% |
| INTEL CORPORATION | 37 356 | 45 901 | 0,45% |
| INTUIT INC | 14 454 | 0 | 0,00% |
| ITC HOLDINGS CORP | 0 | 28 931 | 0,29% |
| JACK IN THE BOX INC | 0 | 29 127 | 0,29% |
| LIBERTY GLOBAL INC | 0 | 76 779 | 0,76% |
| LIBERTY MEDIA CORP | 27 953 | 0 | 0,00% |
| LOWE'S COS | 0 | 28 854 | 0,28% |
| MB FINANCIAL INC | 9 163 | 0 | 0,00% |
| MDU RESOURCES GROUP INC | 0 | 28 991 | 0,29% |
| NETSUITE INC | 0 | 11 109 | 0,11% |
| NICE SYSTEMS LTD-SPONS ADR | 0 | 28 268 | 0,28% |
| NORTHEAST UTILITIES | 0 | 28 341 | 0,28% |
| NVIDIA CORP | 8 126 | 0 | 0,00% |
| OWENS & MINOR INC | 26 455 | 0 | 0,00% |
| PIER 1 IMPORTS INC | 26 512 | 0 | 0,00% |
| POST PROPERTIES INC | 27 588 | 0 | 0,00% |
| POWER INTEGRATIONS INC | 0 | 190 | 0,00% |
| QUESTAR CORP | 0 | 27 766 | 0,27% |
| REGENCY CENTERS CORP | 26 025 | 0 | 0,00% |
| RLI CORP | 25 713 | 0 | 0,00% |
| ROSS STORES INC | 1 195 | 0 | 0,00% |
| SALESFORCE.COM INC | 0 | 23 805 | 0,23% |
| SANOFI ADR | 0 | 28 915 | 0,29% |

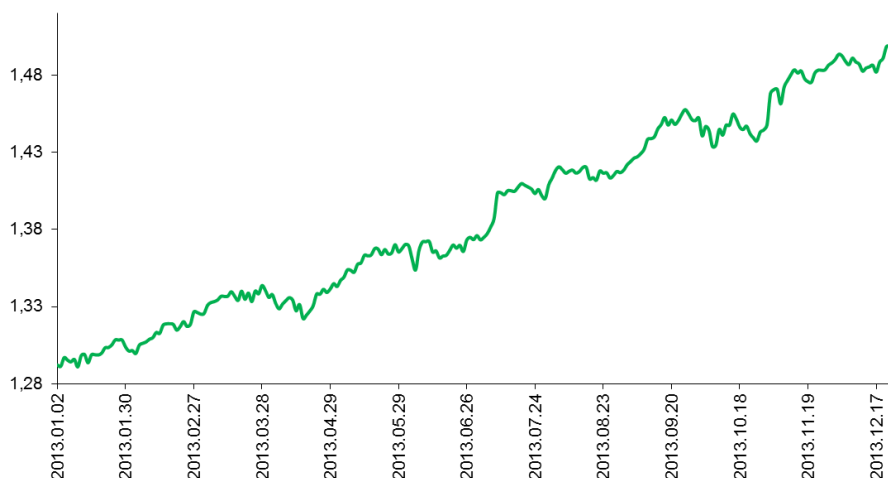
| | | | | | |
|---|----------------------|----------------------|------------------|---------------|---------------|
| SCHOLASTIC CORP | 653 | 0 | 0,00% | | |
| SEARS CANADA INC | 42 | 0 | 0,00% | | |
| SEARS HOLDINGS CORP | 550 | 0 | 0,00% | | |
| SIRIUS XM RADIO INC | 26 178 | 0 | 0,00% | | |
| SOLARCITY CORP | 0 | 28 655 | 0,28% | | |
| SOURCEFIRE INC | 402 | 0 | 0,00% | | |
| SPECTRA ENERGY PARTNERS LP | 12 419 | 0 | 0,00% | | |
| SPRINT CORP | 0 | 7 419 | 0,07% | | |
| ST JOE CO | 22 038 | 0 | 0,00% | | |
| STANDARD PACIFIC | 163 | 0 | 0,00% | | |
| STERIS CORP | 26 855 | 0 | 0,00% | | |
| STONE ENERGY CORP | 0 | 29 095 | 0,29% | | |
| STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC | 0 | 28 940 | 0,29% | | |
| TOLL BROTHERS INC | 25 000 | 27 930 | 0,28% | | |
| UIL HOLDINGS CORP | 0 | 28 414 | 0,28% | | |
| VALENT PHARMACEUTICALS | 0 | 30 384 | 0,30% | | |
| VERISIGN INC | 747 | 0 | 0,00% | | |
| VERISK ANALYTICS CL A ORD | 22 522 | 0 | 0,00% | | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 0 | 30 446 | 0,30% | | |
| WESCO INTERNATIONAL INC | 26 815 | 0 | 0,00% | | |
| WESTAR ENERGY | 11 312 | 0 | 0,00% | | |
| WEYERHAEUSER CO | 4 415 | 0 | 0,00% | | |
| WHITING PETROLEUM CORP | 0 | 26 687 | 0,26% | | |
| Befektetési jegyek: | 596 874 | 801 725 | 7,91% | | |
| OTP TREND B SOROZAT | 596 874 | 801 725 | 7,91% | | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 4 023 233 | 0 | 5 002 182 | 0 | 49,33% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 864 640 | 1 129 427 | 11,14% | |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 559 | 4 325 | 0,04% | |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | 131 701 | 1,30% | |
| Egyéb eszközök összesen: | | 865 199 | 1 265 453 | 12,48% | |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 6 209 746 | 10 141 126 | 100,00% | | |
| Kötelezettségek | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | 7 701 | 12 662 | 1,82% | | |
| Letétkezelői díj miatt | 0 | 1 032 | 0,15% | | |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | 334 | 508 | 0,07% | | |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | 580 691 | 480 509 | 69,22% | | |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | 0 | 199 492 | 28,74% | | |
| Kötelezettségek összesen: | 588 726 | 694 203 | 100,00% | | |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 5 621 020 | 9 446 923 | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 4 389 916 942 | 6 295 372 082 | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | 1,28043885 | 1,50061398 | | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 4 674 974 000 | | 1,301234 |
| 2013. február 28. | 4 663 110 506 | | 1,326258 |
| 2013. március 28. | 5 422 292 009 | | 1,343722 |
| 2013. április 30. | 5 524 110 332 | | 1,344909 |
| 2013. május 31. | 6 013 890 111 | | 1,370314 |
| 2013. június 28. | 6 837 076 755 | | 1,373456 |
| 2013. július 31. | 5 412 576 413 | | 1,413297 |
| 2013. augusztus 30. | 5 639 966 143 | | 1,416815 |
| 2013. szeptember 30. | 4 841 670 961 | | 1,451242 |
| 2013. október 31. | 5 365 758 586 | | 1,447761 |
| 2013. november 29. | 5 901 263 450 | | 1,490217 |
| 2013. december 31. | 6 295 372 082 | 9 446 923 354 | 1,500614 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Abszolút Hozam Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 4 023 233 | 100,00% | 5 002 182 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 1 058 742 | 26,32% | 1 879 546 | 37,57% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 247 032 | 55,85% | 2 472 903 | 49,44% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|-----------------------------------|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 1 063 894 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -323 220 |
| d) | a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -2 099 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | -13 355 |
| | bankköltség: | | -295 |
| | felügyeleti díj: | | -1 878 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -911 |
| f) | nettó jövedelem: | | 722 136 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 722 136 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 2 726 840 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 376 927 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|--|-----------|--|---------------|----------------|
| | adatok ezerben | határidő ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -1 000 | 300 520 | -296 896 | 300 345 | 3 449 |
| | USD | -1 000 | 224 410 | -215 660 | 224 279 | 8 620 |
| | EUR | -4 000 | 1 213 360 | -1 187 582 | 1 212 653 | 25 070 |
| | USD | -13 000 | 2 906 670 | -2 803 574 | 2 904 975 | 101 402 |
| | USD | 1 000 | -214 100 | 215 660 | -213 975 | 1 684 |
| | USD | 2 000 | -440 100 | 431 319 | -439 843 | -8 524 |
| | Összesen: | | | | | 131 701 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 2 508 551 | 2 792 209 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 2 774 412 | 1 728 315 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 10 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 111 124 | 341 361 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 9 | 397 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -376 984 | 722 136 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Föld Kincsei Árupiaci Alapok Alapja

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2009. február 04.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 2,044,606,120 | 1.199346 |
| 2013.02.28 | 1,862,535,166 | 1.164887 |
| 2013.03.28 | 2,245,104,635 | 1.156964 |
| 2013.04.30 | 2,288,163,814 | 1.174854 |
| 2013.05.31 | 2,708,847,153 | 1.202423 |
| 2013.06.28 | 2,525,226,733 | 1.237686 |
| 2013.07.31 | 2,458,530,137 | 1.232957 |
| 2013.08.30 | 2,649,993,797 | 1.246146 |
| 2013.09.30 | 2,852,576,476 | 1.248871 |
| 2013.10.31 | 3,360,399,812 | 1.233161 |
| 2013.11.29 | 3,929,388,504 | 1.276533 |
| 2013.12.31 | 3,659,911,461 | 1.234069 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,267,033,779

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 376 677 014 | 32 140 233 |
| 2013.február | 141 282 197 | 245 259 602 |
| 2013.március | 349 199 707 | 16 619 303 |
| 2013.április | 34 006 808 | 18 271 008 |
| 2013.május | 325 102 086 | 24 224 855 |
| 2013.június | 120 683 693 | 384 333 492 |
| 2013.július | 57 798 666 | 49 945 663 |
| 2013.augusztus | 120 440 945 | 491 568 |
| 2013.szeptember | 1 094 981 082 | 249 599 514 |
| 2013.október | 121 101 032 | 335 267 600 |
| 2013.november | 506 025 884 | 176 923 294 |
| 2013.december | 221 397 986 | 330 841 460 |
| Összesen: | 3 468 697 100 | 1 863 917 592 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|-------------------------------------|----------------|----------------|
| 2013.január | 1 634 | 9 306 |
| 2013.február | 311 | 5 012 |
| 2013.március | 1 053 | 842 |
| 2013.április | 4 521 | 9 075 |
| 2013.május | 19 185 | 1 320 |
| 2013.június | 1 110 | 7 505 |
| 2013.július | 10 360 | 8 798 |
| 2013.augusztus | 41 244 | 3 049 |
| 2013.szeptember | 877 | 6 396 |
| 2013.október | 0 | 13 420 |
| 2013.november | 49 253 | 60 753 |
| 2013.december | 9 540 | 20 000 |
| Összesen: | 139 088 | 145 476 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 2,873,793,379

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2009/12/31 | 2,197,636,867 | 1.062034 |
| 2010/12/31 | 2,554,341,286 | 1.063126 |
| 2011/12/30 | 1,395,777,074 | 1.127049 |
| 2012/12/28 | 1,580,626,223 | 1.161470 |
| 2013/12/31 | 3,659,911,461 | 1.234069 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Föld Kincsei Alapok Alapja olyan befektetés, amely lehetőséget nyújt a nemzetközi áruipiacok teljesítményéből való részesedésre alacsony költségek mellett. Az alap tágran értelmezett áruipiaci kitétséget kínál (beleértve a nemesfémeket, mezőgazdasági növényeket és állatokat, ipari fémeket, kőolajszármazékokat, stb.) a nemzetközi áruipiacokhoz kötődő befektetésekkel rendelkező külföldi alapkezelők befektetési alapjaiból összeállított portfólióján keresztül.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 1,58 milliárdról 3,66 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 6,25% lett.

3. Vagyonkimutatás

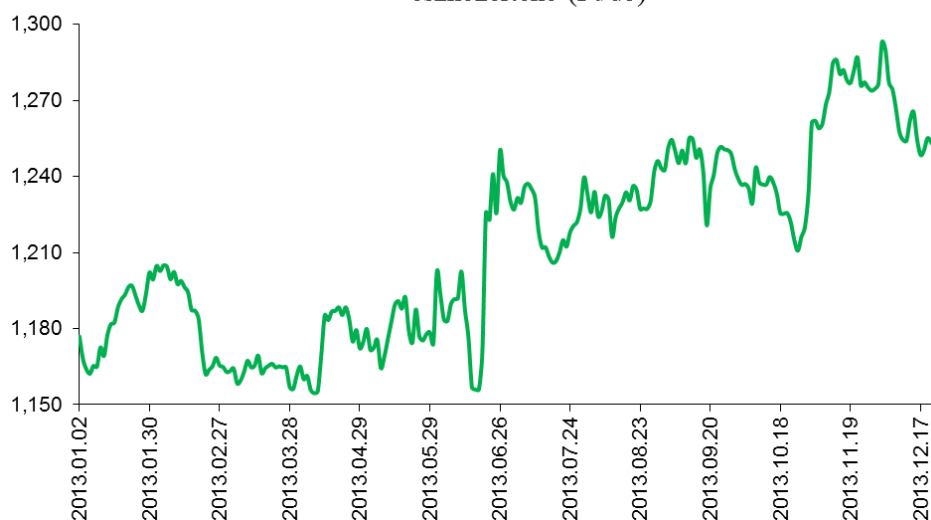
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-----------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 28 | 24 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 138 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 59 | 44 726 | 1,21% | |
| OTP Bank Nyrt. CHF folyószámla | | 82 | 15 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.28 - 2013.01.08 | | 2 430 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 647 010 | 17,47% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 2 599 | 691 913 | 18,68% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 73 781 | | 805 030 | 21,73% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 6 878 | 0 | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 66 903 | 0 | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | 494 682 | 0 | 13,35% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | 310 348 | 0 | 8,38% |
| Befektetési jegyek: | | 1 548 374 | | 2 216 508 | 59,85% |
| DB CRUDE OIL 2X SHORT | | 0 | 114 747 | 0 | 3,10% |
| DB HERMES ABS RETURN COMMODITY | | 94 220 | 0 | 0 | 0,00% |
| DB PLATINUM V HERMES BETA COMM | | 158 044 | 0 | 0 | 0,00% |
| DIAPASON REL VAL PET IN-US-A | | 0 | 202 472 | 0 | 5,47% |
| ETF NATURAL GAS | | 62 634 | 0 | 0 | 0,00% |
| ETFS BRENT 1MTH | | 116 156 | 0 | 0 | 0,00% |
| ETFS COFFEE | | 14 969 | 67 871 | 0 | 1,83% |
| ETFS CORN | | 20 060 | 0 | 0 | 0,00% |
| ETFS DAILY SHORT BRENT CRUDE | | 0 | 363 387 | 0 | 9,81% |
| ETFS DLY SHT MTL DJ-UBSCISM | | 0 | 154 975 | 0 | 4,18% |
| ETFS PHYSICAL PALLADIUM SHARES | | 68 817 | 0 | 0 | 0,00% |
| ETFS SHORT COPPER | | 143 059 | 356 589 | 0 | 9,63% |
| ETFS SHORT CRUDE OIL | | 80 684 | 152 436 | 0 | 4,12% |
| ETFS SHORT NATURAL GAS | | 0 | 392 514 | 0 | 10,60% |
| ETFS SHORT SILVER | | 0 | 38 454 | 0 | 1,04% |
| IPATH DJ-UBS COFFEE | | 0 | 185 054 | 0 | 5,00% |
| POWERSHARE DB OIL FUND | | 151 870 | 0 | 0 | 0,00% |
| POWERSHARES DB BASE METALS FUND | | 34 075 | 0 | 0 | 0,00% |
| POWERSHARES DB COMMODITY FUND | | 374 383 | 0 | 0 | 0,00% |
| PROSHARES ULTRASHORT GOLD | | 131 973 | 100 477 | 0 | 2,71% |
| PROSHARES ULTRASHORT SILVER | | 97 430 | 87 532 | 0 | 2,36% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 1 622 155 | 0 | 3 021 538 | 0 |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 1 | 32 | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | -22 743 | -9 445 | 0 | -0,26% |
| Egyéb eszközök összesen: | | -22 742 | -9 413 | -9 413 | -0,26% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 1 602 012 | 3 704 038 | 3 704 038 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 1 042 | 2 641 | 0 | 6,10% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 470 | 0 | 1,08% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 91 | 598 | 0 | 1,38% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 10 988 | 39 623 | 0 | 91,44% |
| Kötelezettségek összesen: | | 12 121 | 43 332 | 43 332 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 1 589 891 | 3 660 706 | 3 660 706 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 1 362 726 896 | 2 965 590 004 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 1,16669844 | 1,23439387 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 1 704 962 077 | | 1,199346 |
| 2013. február 28. | 1 599 574 372 | | 1,164887 |
| 2013. március 28. | 1 932 218 076 | | 1,156964 |
| 2013. április 30. | 1 946 587 676 | | 1,174854 |
| 2013. május 31. | 2 252 824 407 | | 1,202423 |
| 2013. június 28. | 1 987 256 108 | | 1,237686 |
| 2013. július 31. | 1 995 577 711 | | 1,232957 |
| 2013. augusztus 30. | 2 126 985 588 | | 1,246146 |
| 2013. szeptember 30. | 2 970 711 456 | | 1,248871 |
| 2013. október 31. | 2 752 518 888 | | 1,233161 |
| 2013. november 29. | 3 078 171 478 | | 1,276533 |
| 2013. december 31. | 2 965 590 004 | 3 660 706 122 | 1,234394 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Föld Kincsei Árupiaci Alapok Alapja egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

Az Alap értékpapír portfóliójának összetételével kapcsolatos további adatok (2011.évi CXCVIII. törvény 6.melléklet):

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1.622.155 | 100,00% | 3.021.538 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 73.781 | 4,55% | 805.030 | 26,64% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 73.781 | 4,55% | 805.030 | 26,64% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 312 335 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -21 706 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -825 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | -1 452 |
| | bankköltség: | -276 |
| | felügyeleti díj: | -673 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -113 000 |
| f) | nettó jövedelem: | 174 403 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 174 403 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 1 972 072 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -75 660 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|--------------------------------|-------------------|---|-----------|--|---------------|----------------|
| | adatok ezerben | határidős ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -870 | 246 776 | -253 410 | 246 146 | -7 263 |
| | USD | -5 000 | 1 093 550 | -1 104 547 | 1 090 762 | -13 785 |
| | USD | -400 | 86 796 | -88 364 | 86 575 | -1 789 |
| | USD | -400 | 88 684 | -88 364 | 88 458 | 94 |
| | Összesen: | | | | | -22 743 |
| 2013.12.31-én: | HUF | -870 720 | | -870 067 | | -870 067 |
| | USD | 4 000 | | 862 626 | | 862 626 |
| | | | | | | -7 441 |
| | EZÜST | -22 | | -92 252 | | -92 252 |
| | USD | 441 | | 95 007 | | 95 007 |
| | | | | | | 2 755 |
| | ARANY | -1 | | -129 942 | | -129 942 |
| | USD | 616 | | 132 813 | | 132 813 |
| | | | | | | 2 872 |
| | COPPER | 0 | | -238 609 | | -238 609 |
| | USD | 1 088 | | 234 448 | | 234 448 |
| | | | | | | -4 161 |
| | COPPER | 0 | | -119 305 | | -119 305 |
| | USD | 538 | | 115 841 | | 115 841 |
| | | | | | | -3 464 |
| | KCH4ComF. | 0 | | -6 | | -6 |
| | Összesen: | | | | | -9 445 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|--------------------------|-------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | c. | d. |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | 434 096 | 854 433 |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | 310 186 | 542 098 |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. | Működési költségek | 11 866 | 137 926 |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | 6 | 6 |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | 112 038 | 174 403 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Új Európa Alap

1. Általános adatok:

Típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Futamideje: 2007.11.12-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 2,465,173,689 | 1.396184 |
| 2013.02.28 | 2,464,419,739 | 1.415571 |
| 2013.03.28 | 3,141,483,649 | 1.413879 |
| 2013.04.30 | 3,220,281,441 | 1.423792 |
| 2013.05.31 | 3,641,537,800 | 1.429759 |
| 2013.06.28 | 3,426,634,001 | 1.417674 |
| 2013.07.31 | 3,465,692,229 | 1.437998 |
| 2013.08.30 | 4,100,997,188 | 1.442853 |
| 2013.09.30 | 4,606,242,512 | 1.475413 |
| 2013.10.31 | 4,221,571,053 | 1.486446 |
| 2013.11.29 | 4,632,499,133 | 1.511243 |
| 2013.12.31 | 5,170,023,631 | 1.517455 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,634,371,164

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 156 546 120 | 26 295 739 |
| 2013.február | 34 102 995 | 59 701 626 |
| 2013.március | 489 572 844 | 12 020 880 |
| 2013.április | 131 299 576 | 87 831 121 |
| 2013.május | 350 179 986 | 63 944 426 |
| 2013.június | 157 044 541 | 374 961 526 |
| 2013.július | 194 050 062 | 108 357 400 |
| 2013.augusztus | 544 657 303 | 49 689 203 |
| 2013.szeptember | 518 748 259 | 389 130 821 |
| 2013.október | 167 395 697 | 290 744 399 |
| 2013.november | 275 447 708 | 119 089 583 |
| 2013.december | 448 187 396 | 110 122 491 |
| Összesen: | 3 467 232 487 | 1 691 889 215 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|------------------------------|----------------|----------------|
| 2013.január | 73 | 43 469 |
| 2013.február | 16 450 | 4 758 |
| 2013.március | 20 | 36 488 |
| 2013.április | 1 672 | 5 043 |
| 2013.május | 23 212 | 24 308 |
| 2013.június | 2 983 | 8 766 |
| 2013.július | 243 | 7 586 |
| 2013.augusztus | 15 843 | 40 724 |
| 2013.szeptember | 15 499 | 1 094 |
| 2013.október | 24 672 | 8 620 |
| 2013.november | 12 571 | 5 511 |
| 2013.december | 189 319 | 8 155 |
| Összesen: | 302 557 | 194 522 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 3,407,035,328

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2007/12/28 | 415914192 | 1.133536 |
| 2008/12/31 | 961,099,197 | 0.926808 |
| 2009/12/31 | 1,535,703,476 | 1.295891 |
| 2010/12/31 | 2,524,576,351 | 1.492425 |
| 2011/12/30 | 1,824,859,812 | 1.232783 |
| 2012/12/28 | 2,462,424,720 | 1.368059 |
| 2013/12/31 | 5,170,023,631 | 1.517455 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Új Európa Alap abszolút hozam szemléletben, aktívan kezelt, így teljesítménye és hozama nem benchmarkhoz kötött. Az alap a tágran értelmezett közép- és kelet-európai térség államainak kedvező befektetési lehetőségei közül válogat, és a térség alulértékelt vállalati részvényei közül vásárol a portfolióba.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 2,46 milliárdról 5,17 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 10,92% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--------------|------------|---------------------------------------|---------------|--------------------------------------|----------------|------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | | 59 | | 23 | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | | 227 | | 71 443 | 1,21% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | | 2 058 | | 2 022 | 0,03% |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | | | 2 | | 835 | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. TRY folyószámla | | | | 95 | | 101 | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. RON folyószámla | | | | 0 | | 2 | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.27 - 2013.01.07 | | | | 7 573 | | 0 | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.06 | | | | 0 | | 64 701 | 1,10% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 10 014 | | 139 127 | 2,35% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| | | | Tőzsdei | | Tőzsdei | | |
| | | | értékpapír | | értékpapír | | |
| Értékpapír neve | | | Futamidő | | Tőzsdén kívüli | | |
| | | | értékpapír | | értékpapír | | |
| MNB Kötvények: | | | 1 186 911 | | 2 923 795 | | 49,49% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | | 435 760 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | | 751 151 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | | 0 | | 1 294 825 | 21,92% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | | 0 | | 1 628 970 | 27,57% |
| Kötvények: | | | 581 014 | | 694 473 | | 11,75% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - | 2014.09.25 | | 117 830 | | 0 | 0,00% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - | 2016.03.20 | | 104 676 | | 253 951 | 4,30% |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - | 2016.05.31 | | 90 568 | | 97 708 | 1,65% |
| OPUS VAR 49-16 | 2007.10.31 - | 2016.10.31 | | 58 393 | | 0 | 0,00% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - | 2016.09.19 | | 0 | | 92 623 | 1,57% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - | 2016.11.07 | | 209 547 | | 250 191 | 4,23% |
| Belföldi részvények: | | | 167 019 | | 163 785 | | 2,77% |
| ÁLLAMI NYOMDA - 98 | | | | 9 099 | | 1 793 | 0,03% |
| BIF TÖRZS-100 | | | | 3 841 | | 6 200 | 0,10% |
| CIG PANNONIA | | | | 0 | | 70 422 | 1,19% |
| EGIS TÖRZS | | | | 43 963 | | 0 | 0,00% |
| GRAPHISOFT PARK SE | | | | 10 431 | | 0 | 0,00% |
| MAGYAR TELEKOM | | | | 18 750 | | 0 | 0,00% |
| MASTERPLAST | | | | 35 048 | | 18 339 | 0,31% |
| OTP TÖRZS (100) | | | | 0 | | 24 600 | 0,42% |
| RICHTER G. TÖRZS | | | | 23 536 | | 0 | 0,00% |
| SYNERGON | | | | 1 857 | | 0 | 0,00% |
| TVK TÖRZS II. | | | | 20 494 | | 42 431 | 0,72% |
| Külföldi részvények: | | | 673 579 | | 1 181 154 | | 20,01% |
| AKBANK | | | | 47 738 | | 9 483 | 0,16% |
| AKRON | | | | 0 | | 47 472 | 0,80% |
| ALBARAKA TURK | | | | 0 | | 7 093 | 0,12% |
| ALLIANZ CHINA A-SHARES | | | | 0 | | 23 649 | 0,40% |
| ANEL ELEKTRIK | | | | 26 261 | | 10 110 | 0,17% |
| CAT OIL AG | | | | 19 633 | | 0 | 0,00% |
| CEZ | | | | 15 803 | | 22 417 | 0,38% |
| DIXY GROUP | | | | 37 775 | | 64 247 | 1,09% |
| DOGAN HOLDING | | | | 0 | | 9 463 | 0,16% |
| EMLAK KONUT | | | | 0 | | 46 708 | 0,79% |
| EVRAZ PLC | | | | 9 201 | | 11 977 | 0,20% |
| FBN HOLDINGS PLC | | | | 11 083 | | 0 | 0,00% |
| FIBERWEB | | | | 24 517 | | 0 | 0,00% |
| FOSCHINI | | | | 0 | | 19 343 | 0,33% |

| | | | |
|-----------------------------------|----------------|----------------|---------------|
| GARANTI YATIRIM ORTAKLIGI | 0 | 18 804 | 0,32% |
| GLOBAL TELECOM HOLDING - GDR | 0 | 10 838 | 0,18% |
| HALK BANKASI | 0 | 45 450 | 0,77% |
| HMS GDR | 29 461 | 22 430 | 0,38% |
| KDD GROUP NV | 309 | 0 | 0,00% |
| KRKA | 14 565 | 17 815 | 0,30% |
| LINAS AGRO | 8 302 | 2 668 | 0,05% |
| LSR GROUP GDR | 0 | 2 522 | 0,04% |
| M VIDEO | 0 | 62 083 | 1,05% |
| MANGO GIDA | 12 429 | 537 | 0,01% |
| MECHEL PREF | 4 877 | 967 | 0,02% |
| MYTILINEOS | 17 767 | 0 | 0,00% |
| NOSTRUM OIL & GAS | 0 | 12 617 | 0,21% |
| OJSC RN HOLDING | 0 | 22 184 | 0,38% |
| OMV | 23 905 | 0 | 0,00% |
| OMV PETROM SA | 0 | 93 429 | 1,58% |
| ORASCOM TELECOM - GDR | 10 399 | 0 | 0,00% |
| ORSU METALS CORPORATION | 38 | 19 | 0,00% |
| PARK ELEKTRIK | 0 | 34 819 | 0,59% |
| PINAR ET | 8 236 | 0 | 0,00% |
| PLAZA CENTERS | 44 046 | 41 510 | 0,70% |
| POLYTEC HOLDING AG | 7 608 | 26 057 | 0,44% |
| PROTEK | 0 | 63 628 | 1,08% |
| REYSAS LOGISTIC | 13 566 | 5 113 | 0,09% |
| ROMGAZ - GDR | 0 | 11 004 | 0,19% |
| SBERBANK SPONSORED ADR | 0 | 824 | 0,01% |
| SEVERSTAL GDR | 7 560 | 25 169 | 0,43% |
| SISTEMA | 31 377 | 30 340 | 0,51% |
| SOLAR COMPANY S.A. | 7 842 | 4 473 | 0,08% |
| SOLLERS | 0 | 39 730 | 0,67% |
| SURGUTNEFTEGAS PREF | 14 460 | 28 055 | 0,47% |
| TALLINK | 25 938 | 15 079 | 0,26% |
| TATNEFT PREF | 79 194 | 65 926 | 1,12% |
| TEKFEN | 0 | 15 196 | 0,26% |
| TMK GDR | 0 | 72 468 | 1,23% |
| TORUNLAR | 0 | 9 192 | 0,16% |
| TOTAL PRODUCE | 43 693 | 48 693 | 0,82% |
| TRAKYA CAM | 0 | 21 828 | 0,37% |
| TRANSGAZ SA MEDIAS | 0 | 24 818 | 0,42% |
| VAKIFBANK | 39 786 | 0 | 0,00% |
| VIG AV | 0 | 12 907 | 0,22% |
| X5 RETAIL GROUP GDR | 11 831 | 0 | 0,00% |
| ZENITH BANK | 13 741 | 0 | 0,00% |
| ZHAIKMUNAI | 10 638 | 0 | 0,00% |
| Befektetési jegyek: | 177 929 | 764 830 | 12,93% |
| OTP EUROGÖL BEFJEGY | 0 | 4 158 | 0,07% |
| OTP FELTÖREKVŐ PIACI IX BEFJEGY | 0 | 5 610 | 0,09% |
| OTP REÁL III HOZAMV SZÁRM BEFJEGY | 0 | 2 159 | 0,04% |
| OTP SZINERGIA BEFJEGY | 0 | 11 379 | 0,19% |
| OTP SZINERGIA II BEFJEGY | 0 | 2 736 | 0,05% |
| OTP SZINERGIA III BEFJEGY | 0 | 13 795 | 0,23% |
| OTP SZINERGIA IV BEFJEGY | 0 | 6 196 | 0,10% |
| OTP SZINERGIA PLUSZ BEFJEGY | 0 | 12 691 | 0,21% |
| OTP TRENDVADÁSZ I. BEFJEGY | 0 | 13 386 | 0,23% |
| OTP TRENDVADÁSZ II. BEFJEGY | 0 | 6 154 | 0,10% |

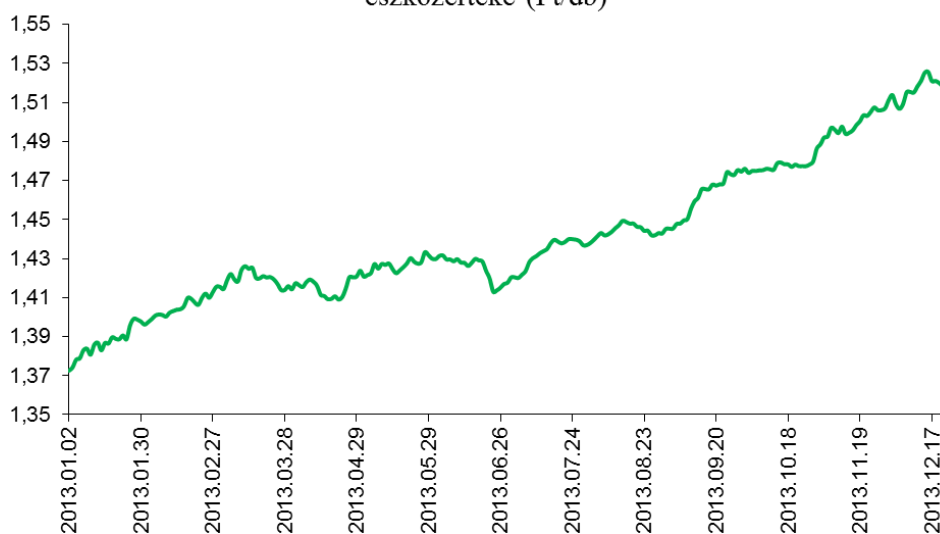
| | | | | | | |
|---|--|----------------------|----------------|----------------------|----------------|----------------|
| OTP VILÁGJÁTÉKOK BEFJEGY | | 0 | | 3 217 | | 0,05% |
| RECONCEPT I. ALAP | | 112 692 | | 380 703 | | 6,44% |
| ETFS DAILY SHORT BRENT CRUDE | | 0 | | 234 289 | | 3,97% |
| FONDUL PROPRIETATEA SA | | 40 440 | | 32 937 | | 0,56% |
| SIF 1 BANAT-CRISANA | | 1 435 | | 1 882 | | 0,03% |
| SIF 2 MOLDOVA | | 11 459 | | 14 337 | | 0,24% |
| SIF 3 TRANSILVANIA | | 856 | | 815 | | 0,01% |
| SIF 4 MUNTENIA | | 1 296 | | 1 496 | | 0,03% |
| SIF 5 OLTENIA | | 9 751 | | 16 890 | | 0,29% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 786 452 | 0 | 5 728 037 | 0 | 96,95% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 7 402 | | 26 884 | 0,46% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 2 | | 1 127 | 0,02% |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | -8 515 | | 12 728 | 0,22% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | -1 111 | | 40 739 | 0,70% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 795 355 | | 5 907 903 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 2 931 | | 7 043 | 1,34% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 606 | 0,11% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | | 136 | | 299 | 0,06% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 295 527 | | 465 485 | 88,64% |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | | | 15 891 | | 51 707 | 9,85% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 314 485 | | 525 140 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 480 870 | | 5 382 763 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 1 800 970 048 | | 3 603 754 210 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 1,37751874 | | 1,49365435 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 1 920 197 845 | | 1,396184 |
| 2013. február 28. | 1 897 568 982 | | 1,415571 |
| 2013. március 28. | 2 365 858 074 | | 1,413879 |
| 2013. április 30. | 2 408 470 295 | | 1,423792 |
| 2013. május 31. | 2 694 427 471 | | 1,429759 |
| 2013. június 28. | 2 475 041 604 | | 1,417674 |
| 2013. július 31. | 2 558 869 144 | | 1,437998 |
| 2013. augusztus 30. | 3 047 517 470 | | 1,442853 |
| 2013. szeptember 30. | 3 180 793 778 | | 1,475413 |
| 2013. október 31. | 3 061 522 284 | | 1,486446 |
| 2013. november 29. | 3 219 673 649 | | 1,511243 |
| 2013. december 31. | 3 603 754 210 | 5 382 763 168 | 1,493654 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Új Európa Nyíltvégű Értékpapír Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 786 452 | 100,00% | 5 728 037 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 1 186 911 | 42,60% | 2 923 795 | 51,04% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 1 767 925 | 63,45% | 3 618 268 | 63,17% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 419 717 |
| b) egyéb bevétel: | | 10 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -109 686 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 164 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | -1 269 |
| | bankköltség: | -412 |
| | felügyeleti díj: | -953 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -398 |
| f) nettó jövedelem: | | 305 845 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 305 845 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 2 607 233 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -11 185 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|---------------------------|-----------|-----------------------------|---------------|---------------|
| | adatok ezerben | határidő ügylet | | határidős ügylet | | eredmény |
| | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -230 | 66 900 | -66 979 | 66 349 | -630 |
| | EUR | -1 000 | 285 680 | -291 212 | 283 327 | -7 885 |
| | Összesen: | | | | | -8 515 |
| 2013.12.31-én: | RBL | 36 000 | -238 212 | 234 126 | -237 502 | -3 376 |
| | EUR | -1 100 | 326 623 | -326 590 | 326 487 | -103 |
| | USD | -700 | 153 874 | -150 964 | 153 810 | 2 846 |
| | USD | -100 | 22 429 | -21 566 | 22 420 | 853 |
| | USD | -100 | 22 373 | -21 566 | 22 364 | 797 |
| | USD | -100 | 22 037 | -21 566 | 22 028 | 462 |
| | EUR | -800 | 239 352 | -237 520 | 239 252 | 1 733 |
| | EUR | -76 | 22 708 | -22 446 | 22 699 | 253 |
| | USD | -1 500 | 332 175 | -323 494 | 332 037 | 8 543 |
| | EUR | -42 | 12 710 | -12 470 | 12 704 | 235 |
| | RON | -285 | 19 381 | -18 888 | 19 373 | 485 |
| | Összesen: | | | | | 12 728 |

| Az Alap által kölcsönbe kapott értékpapírok bemutatása (nyitott kölcsönök) | | | | | | |
|--|--|--|------------------------------|-------------------|------------------------------|--------------------|
| Értékpapír megnevezése | | | A kölcsön várható lejárat | Névérték | Szerz.szerinti érték (Ft) | Piaci érték (Ft) |
| ARCELIK | | | 2014.03.04 | 13 730 | 19 608 664 | 19 608 664 |
| BIM | | | 2014.04.02 | 6 200 | 27 362 231 | 27 203 988 |
| ERSTE BANK STAMM | | | 2014.01.24 | 5 000 | 36 277 326 | 37 603 652 |
| NLMK GDR | | | 2014.03.03 | 10 195 | 37 396 300 | 4 677 160 |
| PEKAO | | | 2014.02.11 | 4 700 | 63 835 142 | 60 405 340 |
| PKN | | | 2014.01.10 | 5 464 | 17 104 527 | 16 040 118 |
| PKO BANK | | | 2014.03.06 | 15 000 | 42 525 255 | 42 337 080 |
| ROSNEFT GDR | | | 2014.03.18 | 26 000 | 40 407 094 | 42 700 503 |
| TATNEFT ADR | | | 2014.01.08 | 6 590 | 56 132 008 | 174 141 |
| URALKALI GDR | | | 2014.03.17 | 9 200 | 51 576 367 | 52 778 762 |
| VTB BANK GDR | | | 2014.03.03 | 77 000 | 48 321 720 | 49 736 737 |
| Összesen: | | | | 179 079 | 440 546 634 | 353 266 145 |
| Az Alap adott óvadékának bemutatása 2013.12.31-ével | | | | | | |
| Értékpapír megnevezése | | | | Névérték | | Óvadékérték (Ft) |
| MAGMO VAR 49 16 | | | | 300 000 | | 84 650 657 |
| Magyar 5.875 05/16 | | | | 295 000 | | 96 079 416 |
| OTP HBFIXED 071116 | | | | 1 010 000 | | 247 495 784 |
| Reconcept Turn Around Property | | | | 76 000 000 | | 128 470 400 |
| Összesen: | | | | 77 605 000 | | 556 696 257 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| | A tétel megnevezése | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | c. | d. |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 720 296 | 861 236 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 632 356 | 441 519 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 1 | 10 |
| 04. | IV. Működési költségek | 47 788 | 113 850 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 20 | 32 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 40 133 | 305 845 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Ázsiai Ingatlan Alapok Alapja

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2008. április 30.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 943,688,181 | 1.514616 |
| 2013.02.28 | 1,071,735,294 | 1.598065 |
| 2013.03.28 | 1,266,158,221 | 1.701511 |
| 2013.04.30 | 1,755,650,993 | 1.721556 |
| 2013.05.31 | 1,641,551,769 | 1.608330 |
| 2013.06.28 | 1,327,724,217 | 1.515639 |
| 2013.07.31 | 1,306,892,820 | 1.512877 |
| 2013.08.30 | 1,219,711,401 | 1.463309 |
| 2013.09.30 | 1,287,942,293 | 1.534499 |
| 2013.10.31 | 1,255,401,201 | 1.514423 |
| 2013.11.29 | 1,219,162,020 | 1.505783 |
| 2013.12.31 | 1,118,252,439 | 1.432389 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a befektetési jegy tárgyidőszaki nyitó állománya (db) 529,462,387

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 67 768 539 | 35 825 242 |
| 2013.február | 51 603 156 | 9 003 859 |
| 2013.március | 122 464 899 | 36 669 988 |
| 2013.április | 319 055 253 | 61 187 195 |
| 2013.május | 141 023 094 | 163 827 539 |
| 2013.június | 25 677 445 | 160 621 666 |
| 2013.július | 72 171 116 | 81 740 604 |
| 2013.augusztus | 16 790 818 | 48 773 017 |
| 2013.szeptember | 20 180 954 | 19 743 843 |
| 2013.október | 21 558 136 | 21 692 915 |
| 2013.november | 9 724 989 | 19 832 036 |
| 2013.december | 10 860 923 | 30 411 330 |
| Összesen: | 878 879 322 | 689 329 234 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|------------------------------|----------------|----------------|
| 2013.január | 36 847 | 12 255 |
| 2013.február | 18 662 | 1 558 |
| 2013.március | 30 558 | 35 954 |
| 2013.április | 107 329 | 12 007 |
| 2013.május | 82 845 | 15 786 |
| 2013.június | 4 339 | 91 556 |
| 2013.július | 28 189 | 21 169 |
| 2013.augusztus | 14 929 | 10 966 |
| 2013.szeptember | 10 896 | 5 484 |
| 2013.október | 7 770 | 18 153 |
| 2013.november | 1 697 | 44 785 |
| 2013.december | 0 | 44 169 |
| Összesen: | 344 061 | 313 842 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 717,443,077

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2008/12/31 | 157,561,226 | 0.654034 |
| 2009/12/31 | 252,902,719 | 0.910761 |
| 2010/12/31 | 908,608,820 | 1.186834 |
| 2011/12/30 | 754,162,632 | 1.150975 |
| 2012/12/28 | 874,236,953 | 1.498181 |
| 2013/12/31 | 1,118,252,439 | 1.432389 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Ázsiai Ingatlan Alapok Alapja, olyan befektetés, amely döntően ázsiai ingatlanpiaci részvényekből áll. Az alap jellemző befektetéseit ázsiai ingatlan és infrastruktúra piacokra befektető alapok befektetési jegyei alkotják.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 0,87 milliárdról 1,12 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után -4,39% lett.

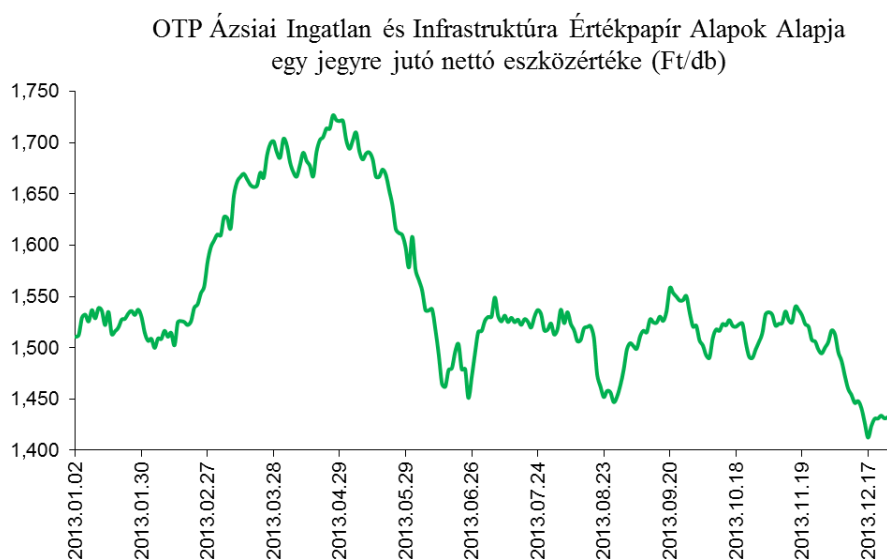
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|--|---------------------------------------|--|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | | 20 | 22 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | | 48 | 43 582 | | 3,88% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | | 109 | 867 | | 0,08% |
| OTP Bank Nyrt. USD 2011.12.27 - 2012.01.09 | | | | 6 628 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2011.12.27 - 2012.01.09 | | | | 72 823 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.28 - 2013.01.02 | | | | 14 564 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.31 - 2014.01.08 | | | | 0 | 32 350 | | 2,88% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 94 192 | 76 821 | | 6,84% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | | | 50 304 | | 15 089 | 1,34% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | | 32 320 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | | | 17 984 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | | 0 | | 11 484 | 1,02% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | | 0 | | 3 605 | 0,32% |
| Befektetési jegyek: | | | | 734 311 | | 1 030 175 | 91,82% |
| ABERDEEN ASIAN PROPERTY FUND A2 | | | | 162 875 | | 225 279 | 20,08% |
| AMADEUS ASIAN REAL ESTATE | | | | 147 296 | | 292 688 | 26,09% |
| B&I ASIAN REAL ESTATE FUND | | | | 134 402 | | 333 575 | 29,73% |
| FORTIS REAL ESTATE ASIA | | | | 122 746 | | 0 | 0,00% |
| PARVEST REAL EST SEC PACC-CC | | | | 0 | | 81 689 | 7,28% |
| SCHROEDER ASIA PACIFIC | | | | 166 992 | | 96 944 | 8,64% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | | 784 615 | 0 | 1 045 264 | 93,16% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 17 | | 1 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 17 | | 1 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | | 878 824 | | 1 122 086 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | | 567 | | 774 | 16,64% |
| Letétkezelői díj miatt | | | | 0 | | 153 | 3,29% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | | 49 | | 325 | 6,98% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | | 5 815 | | 3 400 | 73,09% |
| Kötelezettségek összesen: | | | | 6 431 | | 4 652 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | | 872 393 | | 1 117 434 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | 583 019 045 | | 780 184 321 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | | 1,49633660 | | 1,43227001 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 621 159 526 | | 1,514616 |
| 2013. február 28. | 668 069 031 | | 1,598065 |
| 2013. március 28. | 752 504 150 | | 1,701511 |
| 2013. április 30. | 1 034 393 352 | | 1,721556 |
| 2013. május 31. | 1 028 487 775 | | 1,608330 |
| 2013. június 28. | 871 564 870 | | 1,515639 |
| 2013. július 31. | 863 764 422 | | 1,512877 |
| 2013. augusztus 30. | 832 780 899 | | 1,463309 |
| 2013. szeptember 30. | 834 581 834 | | 1,534499 |
| 2013. október 31. | 831 830 539 | | 1,514423 |
| 2013. november 29. | 810 865 316 | | 1,505783 |
| 2013. december 31. | 780 184 321 | 1 117 434 606 | 1,432270 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| Az Alap értékpapír portfóliójának összetételével kapcsolatos további adatok (2011.évi CXCVIII. törvény 6.melléklet): | | | | |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 784 615 | 100,00% | 1 045 264 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 50 304 | 6,41% | 15 089 | 1,44% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 50 304 | 6,41% | 15 089 | 1,44% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 213 108 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -10 273 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -318 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -201 |
| | felügyeleti díj: | -320 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -278 |
| f) | nettó jövedelem: | 201 718 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 201 718 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 368 249 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -324 926 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

Az időszakban az Alapnak nem voltak származtatott ügyletei.

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. I. | Pénzügyi műveletek bevételei | 69 926 | 277 275 |
| 02. II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | 22 597 | 64 167 |
| 03. III. | Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. IV. | Működési költségek | 6 406 | 11 360 |
| 05. V. | Egyéb ráfordítások | 10 | 30 |
| 06. VI. | Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. VII. | Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. IX. | Tárgyévi eredmény | 40 913 | 201 718 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Omega Alapok Alapja

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap
Az alap futamideje: 1999.12.14-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 7,932,497,886 | 1.079963 |
| 2013.02.28 | 8,213,711,817 | 1.121581 |
| 2013.03.28 | 8,556,522,388 | 1.186150 |
| 2013.04.30 | 8,343,616,054 | 1.173714 |
| 2013.05.31 | 8,397,114,158 | 1.187534 |
| 2013.06.28 | 7,980,079,960 | 1.136569 |
| 2013.07.31 | 8,332,260,467 | 1.198385 |
| 2013.08.30 | 8,257,982,975 | 1.187691 |
| 2013.09.30 | 8,427,780,818 | 1.223219 |
| 2013.10.31 | 8,489,089,650 | 1.228642 |
| 2013.11.29 | 8,893,634,640 | 1.278893 |
| 2013.12.31 | 8,894,082,672 | 1.26999 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 7,254,171,038

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Viszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| 2013.január | 10 268 723 | 80 719 492 |
| 2013.február | 4 928 652 | 41 713 181 |
| 2013.március | 15 341 094 | 121 667 032 |
| 2013.április | 24 254 883 | 136 127 589 |
| 2013.május | 10 033 166 | 32 507 538 |
| 2013.június | 12 737 093 | 54 354 954 |
| 2013.július | 31 691 148 | 98 440 823 |
| 2013.augusztus | 37 349 306 | 40 379 885 |
| 2013.szeptember | 46 764 550 | 87 323 049 |
| 2013.október | 42 690 773 | 32 095 753 |
| 2013.november | 56 334 780 | 24 645 378 |
| 2013.december | 93 250 594 | 52 058 815 |
| Összesen: | 385 644 762 | 802 033 489 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | | |
|-------------------------------------|--|----------------|----------------|
| 2013.január | | 18 722 | 9 587 |
| 2013.február | | 44 909 | 11 399 |
| 2013.március | | 21 248 | 37 778 |
| 2013.április | | 51 868 | 27 312 |
| 2013.május | | 34 811 | 86 417 |
| 2013.június | | 17 229 | 73 971 |
| 2013.július | | 31 101 | 4 489 |
| 2013.augusztus | | 20 022 | 8 931 |
| 2013.szeptember | | 3 357 | 80 945 |
| 2013.október | | 44 814 | 22 571 |
| 2013.november | | 52 162 | 5 642 |
| 2013.december | | 65 635 | 7 821 |
| Összesen: | | 405 878 | 376 863 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 6,829,196,696

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2003/12/31 | 10,099,524,291 | 0.788345 |
| 2004/12/31 | 19,605,345,139 | 0.815933 |
| 2005/12/30 | 25,517,172,837 | 1.014561 |
| 2006/12/29 | 37,475,495,675 | 1.117716 |
| 2007/12/28 | 28,296,658,397 | 1.098288 |
| 2008/12/31 | 6,585,500,377 | 0.652724 |
| 2009/12/31 | 11,035,584,608 | 0.876664 |
| 2010/12/31 | 16,480,125,695 | 0.961521 |
| 2011/12/30 | 8,463,112,799 | 0.976229 |
| 2012/12/28 | 7,783,645,693 | 1.048724 |
| 2013/12/31 | 8,894,082,672 | 1.26999 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Omega Alapok Alapja a globális fejlett részvénypiacokra fókuszál, nemzetközi vagyonkezelők részvényalapjain keresztül. A megnövekedett mozgástérrel várhatóan nagyobb fokú kockázatmegosztás válik lehetővé.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 7,78 milliárdról 8,90 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 21,10% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 19 | 20 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 430 | 4 156 | 0,05% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 1 200 | 4 078 | 0,05% | |
| OTP Bank Nyrt. CHF folyószámla | | 0 | 1 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | 0 | 1 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2011.12.27 - 2012.01.02 | | 88 593 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2011.12.27 - 2012.01.09 | | 220 930 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 50 475 | 0,57% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 311 172 | 58 731 | 0,67% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 1 380 | | 426 024 | 4,77% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 1 380 | 0 | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | 189 170 | 189 170 | 2,12% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | 236 854 | 236 854 | 2,65% |
| Befektetési jegyek: | | 7 488 954 | | 8 446 890 | 94,56% |
| OTP KLÍMAVÁLTOZÁS A SOROZAT | | 73 728 | 477 214 | 477 214 | 5,34% |
| ABERDEEN GL-EUROPEAN EQU-I-2 | | 512 288 | 604 775 | 604 775 | 6,77% |
| ACATIS-GLOBAL | | 684 676 | 823 263 | 823 263 | 9,22% |
| ALLIANZ RCM US EQUITY | | 176 729 | 0 | 0 | 0,00% |
| BNP BEST SELECTION EU | | 1 029 389 | 0 | 0 | 0,00% |
| ETF ISHARES MSCI AUSTRALIA | | 36 102 | 34 164 | 34 164 | 0,38% |
| FAST-EUR OPPORTUNITIES-Y ACC | | 0 | 349 461 | 349 461 | 3,91% |
| FIDELITY ACTIVE STR US-YA-US | | 0 | 657 086 | 657 086 | 7,36% |
| PARVEST EQY BST SELECT EU-IC | | 0 | 1 271 822 | 1 271 822 | 14,24% |
| RCM EUROPE EQUITY GROWTH | | 1 429 351 | 1 461 858 | 1 461 858 | 16,37% |
| UBS (CH) EQ-SML CAPS EUROPE | | 378 701 | 496 801 | 496 801 | 5,56% |
| UBS (CH) INSTITUTIONAL FUND-EQ PAC. | | 295 155 | 356 523 | 356 523 | 3,99% |
| UBS (LUX) EUROPEAN GROWTH B | | 459 130 | 0 | 0 | 0,00% |
| UBS IF - KEY SELECTION GLOBAL EQ | | 1 474 200 | 1 418 679 | 1 418 679 | 15,88% |
| UBS LUX EQTY-USA GROWTH | | 538 423 | 495 244 | 495 244 | 5,54% |
| UBS LUX IF - EURO EQUITY | | 401 082 | 0 | 0 | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 7 490 334 | 0 | 8 872 914 | 99,33% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 77 | 31 | 31 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 77 | 31 | 31 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 7 801 583 | 8 931 676 | 8 931 676 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | 8 182 | 9 816 | 9 816 | 39,35% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 1 086 | 1 086 | 4,35% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 473 | 538 | 538 | 2,16% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 12 167 | 13 503 | 13 503 | 54,14% |
| Kötelezettségek összesen: | | 20 822 | 24 943 | 24 943 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 7 780 761 | 8 906 733 | 8 906 733 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 7 418 971 143 | 7 010 474 496 | 7 010 474 496 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 1,04876557 | 1,27048940 | 1,27048940 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) | |
|----------------------|---|------------------------------------|---|----------|
| 2013. január 31. | 7 351 005 094 | | 1,079963 | |
| 2013. február 28. | 7 323 335 285 | | 1,121581 | |
| 2013. március 28. | 7 212 513 187 | | 1,186150 | |
| 2013. április 30. | 7 107 319 713 | | 1,173714 | |
| 2013. május 31. | 7 070 808 509 | | 1,187534 | |
| 2013. június 28. | 7 013 756 824 | | 1,136569 | |
| 2013. július 31. | 6 954 245 613 | | 1,198385 | |
| 2013. augusztus 30. | 6 954 231 786 | | 1,187691 | |
| 2013. szeptember 30. | 6 892 569 351 | | 1,223219 | |
| 2013. október 31. | 6 909 214 467 | | 1,228642 | |
| 2013. november 29. | 6 953 557 309 | | 1,278893 | |
| 2013. december 31. | 7 010 474 496 | | 8 906 733 526 | 1,270489 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Omega Fejlett Piaci Részvény Alapok Alapja egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 7 490 334 | 100,00% | 8 872 914 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 1 380 | 0,02% | 426 024 | 4,80% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 1 380 | 0,02% | 426 024 | 4,80% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 647 075 |
| b) | egyéb bevétel: | 16 342 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -102 439 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -2 213 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -333 |
| | felügyeleti díj: | -2 083 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -605 |
| f) | nettó jövedelem: | 555 744 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 555 744 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -463 129 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 1 033 357 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámoló időszakában az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 519 228 | 701 881 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 254 252 | 54 806 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 16 342 |
| 04. | IV. Működési költségek | 101 852 | 107 579 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 21 | 94 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 163 103 | 555 744 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Trend Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. december 23.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2013.01.31 | 645,557,932 | 10373.908178 |
| 2013.02.28 | 671,112,348 | 10776.593304 |
| 2013.03.28 | 716,629,230 | 11503.800144 |
| 2013.04.30 | 715,304,711 | 11347.198690 |
| 2013.05.31 | 749,025,444 | 11767.693265 |
| 2013.06.28 | 731,605,356 | 11502.686288 |
| 2013.07.31 | 786,182,340 | 12059.861022 |
| 2013.08.30 | 839,547,508 | 11898.517666 |
| 2013.09.30 | 933,962,056 | 12698.155783 |
| 2013.10.31 | 1,514,370,220 | 12476.788630 |
| 2013.11.29 | 1,976,103,837 | 13153.593665 |
| 2013.12.31 | 2,174,423,263 | 13308.911458 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,202

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 10.000 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|----------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 10 | 5 |
| 2013.február | 46 | 0 |
| 2013.március | 70 | 50 |
| 2013.április | 1 033 | 66 |
| 2013.május | 431 | 42 |
| 2013.június | 321 | 369 |
| 2013.július | 2 521 | 934 |
| 2013.augusztus | 5 376 | 0 |
| 2013.szeptember | 40 056 | 0 |
| 2013.október | 11 088 | 335 |
| 2013.november | 29 169 | 311 |
| 2013.december | 16 139 | 1 460 |
| Összesen: | 106 260 | 3 572 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 102,359

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 414,887,282 | 10351.995658 |
| 2012/12/28 | 628,261,487 | 10096.771133 |
| 2013/12/31 | 2,174,423,263 | 13308.911458 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Trend Alap célja, hogy trendkövető stratégiát folytasson, azaz arra törekszik, hogy akkor fektessen részvényekbe, illetve a már meglévő részvénykitettséget akkor növelje, amikor az Alapkezelő úgy ítéli meg, hogy a vezető részvényindexek emelkedő trendben vannak. Ugyanakkor az Alapkezelő az emelkedő trend megkérdőjeleződése esetén csökkenti a részvénykitettséget, sőt akár teljesen le is építheti a részvényportfoliót.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 0,63 milliárdról 2,17 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 32,26% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--|---------------------------------------|--|--------------------------------------|--------------------|--------------------------------------|--|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 20 | | 23 | | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 963 | | 152 | | 0,01% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 202 | | 203 | | 0,01% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.21 - 2013.01.02 | | 23 303 | | 0 | | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 24 488 | | 378 | | 0,02% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | | Tőzsdei értékpapír | | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| MNB Kötvények: | | 5 915 | | 484 434 | | 21,85% | |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 3 589 | | 0 | | 0,00% | |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 2 326 | | 0 | | 0,00% | |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 374 722 | | 16,90% | |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 109 712 | | 4,95% | |
| Külföldi részvények: | | 609 040 | | 1 732 913 | | 78,13% | |
| ADIDAS AG | | 14 906 | | 21 730 | | 0,98% | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | | 15 365 | | 0 | | 0,00% | |
| ALLIANZ AG | | 15 568 | | 0 | | 0,00% | |
| AMAZON.COM INC | | 0 | | 43 004 | | 1,94% | |
| BAIDU INC/CHINA | | 0 | | 45 653 | | 2,06% | |
| BAYER AG | | 30 574 | | 44 195 | | 1,99% | |
| BAYERISCHE MOTOR WERKE AG | | 0 | | 42 509 | | 1,92% | |
| BEIERSDORF AG | | 30 642 | | 0 | | 0,00% | |
| BIOGEN IDEC INC | | 0 | | 39 795 | | 1,79% | |
| CANCOM SE | | 0 | | 47 005 | | 2,12% | |
| CATAMARAN CORP | | 15 193 | | 0 | | 0,00% | |
| CELESIO AG | | 0 | | 20 555 | | 0,93% | |
| CELGENE CORP | | 0 | | 43 730 | | 1,97% | |
| COMCAST | | 15 352 | | 0 | | 0,00% | |
| CONTINENTAL AG | | 0 | | 87 083 | | 3,93% | |
| DAIMLER AG | | 0 | | 43 328 | | 1,95% | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | | 0 | | 22 342 | | 1,01% | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG | | 32 354 | | 0 | | 0,00% | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | | 0 | | 22 513 | | 1,01% | |
| DeutschPost | | 15 474 | | 43 118 | | 1,94% | |
| DRILLISCH AG | | 0 | | 20 700 | | 0,93% | |
| DUERR AG | | 0 | | 20 782 | | 0,94% | |
| EBA Y INC | | 11 267 | | 0 | | 0,00% | |
| EQUINIX INC | | 15 490 | | 0 | | 0,00% | |
| FACEBOOK INC | | 0 | | 98 061 | | 4,42% | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | | 14 715 | | 0 | | 0,00% | |
| GILEAD SCIENCES INC | | 34 402 | | 83 993 | | 3,79% | |
| GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS | | 0 | | 46 758 | | 2,11% | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | | 0 | | 20 304 | | 0,91% | |
| HENKEL | | 28 808 | | 21 278 | | 0,96% | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | | 0 | | 44 052 | | 1,99% | |
| LEONI AG | | 0 | | 41 618 | | 1,88% | |
| LIBERTY GLOBAL INC | | 15 301 | | 0 | | 0,00% | |
| LIBERTY MEDIA CORP | | 15 247 | | 0 | | 0,00% | |
| LPKF LASER & ELECTRONICS AG | | 0 | | 42 146 | | 1,90% | |
| MERCK KGAA | | 28 789 | | 0 | | 0,00% | |
| METRO | | 0 | | 20 066 | | 0,90% | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | | 0 | | 85 748 | | 3,87% | |

| | | | | |
|---|------------------|----------------|------------------|------------------------|
| MORPHOSYS AG | | 0 | 41 788 | 1,88% |
| MUENCHENER RUECKER | 30 900 | 0 | | 0,00% |
| MYLAN INC | 0 | 40 997 | | 1,85% |
| NETFLIX INC | 0 | 84 167 | | 3,79% |
| NORDEX SE | 0 | 39 000 | | 1,76% |
| PRICELINE.COM INC | 0 | 31 337 | | 1,41% |
| QSC AG | 0 | 44 557 | | 2,01% |
| REGENERON PHARMACEUTICALS INC | 15 497 | 0 | | 0,00% |
| SANDISK CORP | 19 221 | 0 | | 0,00% |
| SAP AG | 29 876 | 0 | | 0,00% |
| SBA COMMUNICATIONS | 29 795 | 0 | | 0,00% |
| SEAGATE TECHNOLOGY PLC | 28 143 | 0 | | 0,00% |
| SIEMENS AG | 0 | 21 226 | | 0,96% |
| SIRIUS XM RADIO INC | 30 009 | 0 | | 0,00% |
| SKY DEUTSCHELAND AG | 0 | 45 652 | | 2,06% |
| TESLA MOTORS INC | 0 | 98 627 | | 4,45% |
| THYSSENKRUPP AG | 0 | 19 224 | | 0,87% |
| VIRGIN MEDIA INC | 30 041 | 0 | | 0,00% |
| VOLKSWAGEN AG | 31 091 | 21 821 | | 0,98% |
| WESTERN DIGITAL CORP | 15 020 | 45 236 | | 2,04% |
| YAHOO! INC | 0 | 87 215 | | 3,93% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 614 955 | 0 | 2 217 347 | 0 99,98% |
| Egyéb eszközök | | | | |
| Követelések | | 161 328 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 11 | 115 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 161 339 | 115 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 800 782 | | 2 217 840 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | 16 | | 1 621 | 4,41% |
| Letétkezelői díj miatt | 0 | | 443 | 1,21% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | 36 | | 106 | 0,29% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | 168 570 | | 0 | 0,00% |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | 0 | | 34 554 | 94,09% |
| Kötelezettségek összesen: | 168 622 | | 36 724 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 632 160 | | 2 181 116 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 62 224 | | 164 912 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | 10 159,43 | | 13 225,94 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 62 229 | | 10 373,91 |
| 2013. február 28. | 62 275 | | 10 776,59 |
| 2013. március 28. | 62 295 | | 11 503,80 |
| 2013. április 30. | 63 262 | | 11 347,20 |
| 2013. május 31. | 63 651 | | 11 767,69 |
| 2013. június 28. | 63 603 | | 11 502,69 |
| 2013. július 31. | 65 190 | | 12 059,86 |
| 2013. augusztus 30. | 70 566 | | 11 898,52 |
| 2013. szeptember 30. | 110 622 | | 12 698,16 |
| 2013. október 31. | 121 375 | | 12 476,79 |
| 2013. november 29. | 150 233 | | 13 153,59 |
| 2013. december 31. | 164 912 | 2 181 115 712 | 13 225,94 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 614 955 | 100,00% | 2 217 347 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 5 915 | 0,96% | 484 434 | 21,85% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 5 915 | 0,96% | 484 434 | 21,85% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 197 587 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -38 662 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -892 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | -302 |
| | bankköltség: | -213 |
| | felügyeleti díj: | -247 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -1 725 |
| f) | nettó jövedelem: | 155 546 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 155 546 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 1 289 173 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 104 237 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámoló időszakában az alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 134 645 | 272 892 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 201 427 | 75 305 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 16 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 1 359 | 40 317 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 103 | 1 724 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -68 228 | 155 546 |

Beszámoló a 2013. évről - OTP Planéta Alapok Alapja

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2007.07.02-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,093,508,104 | 1.016433 |
| 2013.02.28 | 2,061,636,004 | 1.042089 |
| 2013.03.28 | 2,001,256,809 | 1.082305 |
| 2013.04.30 | 1,930,927,558 | 1.052660 |
| 2013.05.31 | 1,841,718,483 | 1.033282 |
| 2013.06.28 | 1,647,464,890 | 0.946765 |
| 2013.07.31 | 1,608,014,088 | 0.963962 |
| 2013.08.30 | 1,589,964,087 | 0.957162 |
| 2013.09.30 | 1,557,998,603 | 1.015176 |
| 2013.10.31 | 1,577,181,360 | 1.038381 |
| 2013.11.29 | 1,526,405,284 | 1.058722 |
| 2013.12.31 | 1,422,182,797 | 1.032687 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,951,106,365

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 15 336 721 | 179 631 371 |
| 2013.február | 10 401 302 | 98 518 268 |
| 2013.március | 14 842 292 | 140 996 751 |
| 2013.április | 19 409 906 | 35 561 164 |
| 2013.május | 22 384 269 | 70 418 663 |
| 2013.június | 9 555 099 | 35 582 014 |
| 2013.július | 67 118 972 | 145 445 678 |
| 2013.augusztus | 13 203 281 | 16 384 968 |
| 2013.szeptember | 15 186 830 | 75 479 325 |
| 2013.október | 5 749 211 | 22 294 133 |
| 2013.november | 6 944 673 | 60 299 831 |
| 2013.december | 6 177 626 | 69 786 229 |
| Összesen: | 206 310 182 | 950 398 395 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|------------------------------|---------------|----------------|
| 2013.január | 19 405 | 21 993 |
| 2013.február | 2 522 | 6 604 |
| 2013.március | 3 966 | 4 658 |
| 2013.április | 13 388 | 10 930 |
| 2013.május | 6 411 | 35 790 |
| 2013.június | 2 182 | 44 954 |
| 2013.július | 8 945 | 91 |
| 2013.augusztus | 1 470 | 6 051 |
| 2013.szeptember | 7 747 | 276 994 |
| 2013.október | 229 | 2 |
| 2013.november | 598 | 96 150 |
| 2013.december | 3 750 | 7 945 |
| Összesen: | 70 613 | 512 162 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,203,627,704

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2007/12/28 | 35,017,824,038 | 1.087114 |
| 2008/12/31 | 27,955,487,274 | 0.477210 |
| 2009/12/31 | 43,473,027,620 | 0.837238 |
| 2010/12/31 | 4,736,493,576 | 1.041329 |
| 2011/12/30 | 3,100,051,646 | 0.915086 |
| 2012/12/28 | 2,259,373,078 | 1.011690 |
| 2013/12/31 | 1,422,182,797 | 1.032687 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Planéta Alapok Alapja a globális fejlett részvénypiacokra fókuszál, nemzetközi vagyonkezelők alapjain keresztül. A megnövekedett mozgástérrel várhatóan nagyobb fokú kockázatmegosztás válik lehetővé.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 2,26 milliárdról 1,42 milliárd Ft-ra csökkent. Az OTP Planéta Alapok Alapja 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 2,08% lett.

3. Vagyonkimutatás

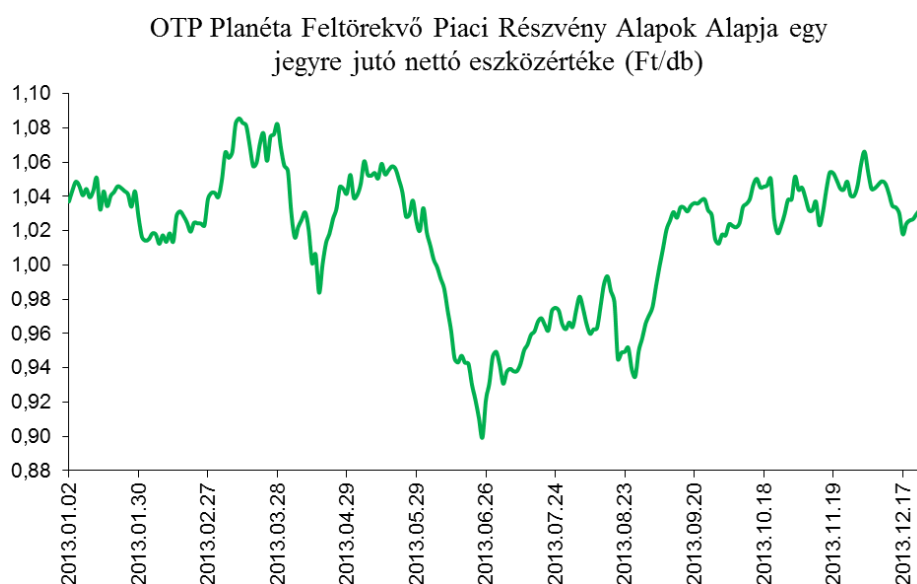
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|---------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 19 | 8 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 48 | 7 104 | 0,49% | | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 243 | 2 652 | 0,18% | | |
| OTP Bank Nyrt. TRY folyószámla | | 0 | 68 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2011.12.28 - 2012.01.02 | 11 652 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2011.12.27 - 2012.01.09 | 72 822 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.28 - 2013.01.09 | 7 733 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.27 - 2013.01.07 | 154 651 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 10 616 | 0,74% | | |
| OTP Bank Nyrt. TRY | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 129 402 | 8,97% | | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.10.09 - 2014.01.08 | 0 | 161 753 | 11,21% | | |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.02 | 0 | 73 328 | 5,08% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 247 168 | 384 931 | 26,67% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | 258 602 | | 0 | | 0,00% |
| REPHUN 1.67 03/18/1 | 2006.03.17 - 2013.03.18 | 258 602 | | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 54 282 | | 2 848 | | 0,20% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 53 953 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 329 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 2 848 | | 0,20% |
| Kötvények: | | 396 888 | | 338 094 | | 23,44% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - 2014.09.25 | 29 457 | | 0 | | 0,00% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - 2016.03.20 | 83 741 | | 141 084 | | 9,78% |
| MAGYAR 5.875 05/10 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | 51 321 | | 55 368 | | 3,84% |
| OTPHB FLOAT 03/13 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 114 746 | | 57 102 | | 3,96% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | 117 623 | | 84 540 | | 5,86% |
| Belföldi részvények: | | 20 482 | | 8 200 | | 0,57% |
| MAGYAR TELEKOM | | 20 482 | | 0 | | 0,00% |
| OTP TÖRZS (100) | | 0 | | 8 200 | | 0,57% |
| Külföldi részvények: | | 331 806 | | 166 702 | | 11,55% |
| AKRON | | 0 | | 8 533 | | 0,59% |
| ANEL ELEKTRIK | | 7 616 | | 2 932 | | 0,20% |
| A VENG | | 4 664 | | 0 | | 0,00% |
| DIXY GROUP | | 8 718 | | 7 998 | | 0,55% |
| ÉTALON GROUP | | 19 001 | | 8 894 | | 0,62% |
| EVRAZ PLC | | 11 318 | | 6 227 | | 0,43% |
| FIBERWEB | | 18 392 | | 0 | | 0,00% |
| FONDUL PROPRIETATEA SA | | 22 842 | | 0 | | 0,00% |
| HMS GDR | | 24 521 | | 14 181 | | 0,98% |
| IG SEISMIC SERVICE-REG S WI | | 2 708 | | 4 174 | | 0,29% |
| INTEGRA | | 2 967 | | 0 | | 0,00% |
| IS LEASING | | 11 972 | | 120 | | 0,01% |
| LINAS AGRO | | 16 603 | | 5 336 | | 0,37% |
| LSR GROUP GDR | | 4 601 | | 138 | | 0,01% |
| M VIDEO | | 0 | | 18 605 | | 1,29% |
| MANGO GIDA | | 8 802 | | 611 | | 0,04% |
| MECHEL PREF | | 9 158 | | 1 817 | | 0,13% |
| MECHEL PREF RU | | 4 184 | | 1 117 | | 0,08% |
| MECHEL RU | | 7 420 | | 2 181 | | 0,15% |
| NORDEN | | 26 113 | | 22 691 | | 1,57% |
| REYSAS LOGISTIC | | 9 764 | | 3 286 | | 0,23% |
| SELCUK ECZA | | 5 972 | | 4 401 | | 0,31% |
| SEVERSTAL GDR | | 6 157 | | 0 | | 0,00% |
| SURGUTNEFTEGAS PREF | | 10 845 | | 12 713 | | 0,88% |
| TALLINK | | 19 118 | | 7 927 | | 0,55% |

| | | | | | | |
|---|--|----------------------|----------------|----------------------|---------------|----------------|
| TATNEFT PEF | | 13 091 | | 18 383 | | 1,27% |
| TNK-BP | | 2 958 | | 0 | | 0,00% |
| TNK-BP PEF | | 2 866 | | 0 | | 0,00% |
| TOTAL PRODUCE | | 11 937 | | 14 437 | | 1,00% |
| VESTEL BEYAZ | | 15 414 | | 0 | | 0,00% |
| X5 RETAIL GROUP GDR | | 22 084 | | 0 | | 0,00% |
| Befektetési jegyek: | | 902 320 | | 530 476 | | 36,78% |
| OTP AFRIKA RÉSZVÉNY B SOROZAT | | 24 911 | | 30 228 | | 2,10% |
| OTP OROSZ RÉSZVÉNY B SOROZAT | | 64 681 | | 31 381 | | 2,18% |
| OTP TÖRÖK RÉSZVÉNY B SOROZAT | | 38 425 | | 27 980 | | 1,94% |
| ABERDEEN GL-BRAZIL EQTY-I2A | | 0 | | 57 856 | | 4,01% |
| ABERDEEN GL-INDIA EQTY-I2 | | 0 | | 44 093 | | 3,06% |
| ALLIANZ CHINA A-SHARES | | 0 | | 37 839 | | 2,62% |
| ALLIANZ RCM CHINA | | 67 512 | | 0 | | 0,00% |
| CHINA PANDA FUND | | 42 630 | | 38 171 | | 2,65% |
| DWS INVEST CHINESE EQUITY-FC | | 84 546 | | 9 892 | | 0,69% |
| EM EQUITIES | | 202 710 | | 0 | | 0,00% |
| ETF BRAZIL EWZ | | 68 839 | | 0 | | 0,00% |
| ETF EM ISHARES CORE | | 0 | | 6 661 | | 0,46% |
| ETF EM VANGUARD VWO | | 77 474 | | 0 | | 0,00% |
| ETF INDIA SMALL-CAP | | 34 394 | | 23 928 | | 1,66% |
| ETF INDIA WISDOMTREE | | 66 545 | | 0 | | 0,00% |
| ETF KOREA | | 90 276 | | 30 099 | | 2,09% |
| ETF SOUTH AFRICA | | 39 377 | | 0 | | 0,00% |
| FIDELITY FAST ASIA Y | | 0 | | 32 162 | | 2,23% |
| FIDELITY FAST EM Y CLASS | | 0 | | 110 145 | | 7,63% |
| FIDELITY GREATER CHINA Y | | 0 | | 28 610 | | 1,98% |
| FIDELITY TAIWAN Y | | 0 | | 21 431 | | 1,48% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 1 964 380 | 0 | 1 046 320 | 0 | 72,54% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 56 239 | | 10 476 | 0,73% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 451 | | 652 | 0,04% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 59 878 | | 322 | 0,02% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 116 568 | | 11 450 | 0,79% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 328 116 | | 1 442 701 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 2 652 | | 1 735 | 4,50% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 193 | 0,50% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 139 | | 386 | 1,00% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 64 040 | | 36 246 | 94,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 66 831 | | 38 560 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 261 285 | | 1 404 141 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 2 229 314 773 | | 1 376 605 506 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 1,01434088 | | 1,02000205 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 2 064 383 475 | | 1,016433 |
| 2013. február 28. | 1 975 262 337 | | 1,042089 |
| 2013. március 28. | 1 848 937 646 | | 1,082305 |
| 2013. április 30. | 1 833 391 056 | | 1,052660 |
| 2013. május 31. | 1 778 129 428 | | 1,033282 |
| 2013. június 28. | 1 741 580 601 | | 0,946765 |
| 2013. július 31. | 1 665 431 979 | | 0,963962 |
| 2013. augusztus 30. | 1 661 123 366 | | 0,957162 |
| 2013. szeptember 30. | 1 534 596 109 | | 1,015176 |
| 2013. október 31. | 1 518 107 029 | | 1,038381 |
| 2013. november 29. | 1 441 246 079 | | 1,058722 |
| 2013. december 31. | 1 376 605 506 | 1 404 140 437 | 1,020002 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 964 380 | 100,00% | 1 046 320 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 54 282 | 2,76% | 2 848 | 0,27% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 709 772 | 36,13% | 340 942 | 32,58% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 90 856 |
| b) | egyéb bevétel: | | 3 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -24 774 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -415 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | -95 |
| | bankköltség: | | -259 |
| | felügyeleti díj: | | -444 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -324 |
| f) | nettó jövedelem: | | 64 548 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 64 548 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -871 144 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -50 548 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|--|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|---------------|
| | adatok | | határidő ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | JPY | -99 000 | | -254 277 | | -254 277 |
| | USD | 1 188 | | 262 424 | | 262 424 |
| | | | | | | 8 147 |
| | EUR | -1 085 | | -315 965 | | -315 965 |
| | USD | 1 417 | | 312 925 | | 312 925 |
| | | | | | | -3 040 |
| | EUR | -60 | | -17 473 | | -17 473 |
| | USD | 79 | | 17 461 | | 17 461 |
| | | | | | | -12 |
| | Összesen: | | | | | 5 095 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -1 100 | | -326 590 | | -326 590 |
| | USD | 1 485 | | 320 283 | | 320 283 |
| | Összesen: | | | | | -6 307 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | 54 783 161 | 6 629 256 | |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | 0 | 0 | |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | 54 783 161 | 6 629 256 | |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | 12 645 588 | 89 887 566 | |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|--------------------------|------------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban | |
| A tétel megnevezése | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | c. | d. |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | 375 873 | 616 887 |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | 457 758 | 526 031 |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | 0 | 3 |
| 04. | IV. | Működési költségek | 36 944 | 26 277 |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | 12 | 34 |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | -118 841 | 64 548 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Klímaváltozás 130/30 Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2008. január 10.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 862,714,086 | 0.525590 |
| 2013.02.28 | 957,080,153 | 0.565975 |
| 2013.03.28 | 1,050,475,717 | 0.590231 |
| 2013.04.30 | 986,475,737 | 0.566192 |
| 2013.05.31 | 1,033,034,421 | 0.598729 |
| 2013.06.28 | 993,704,323 | 0.576312 |
| 2013.07.31 | 1,126,520,159 | 0.644509 |
| 2013.08.30 | 1,206,594,443 | 0.625869 |
| 2013.09.30 | 1,083,710,824 | 0.703935 |
| 2013.10.31 | 1,351,218,915 | 0.687770 |
| 2013.11.29 | 1,547,618,068 | 0.710989 |
| 2013.12.31 | 1,500,658,872 | 0.684728 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,580,492,782

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Viszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| 2013.január | 12 730 917 | 19 199 501 |
| 2013.február | 51 601 275 | 8 893 709 |
| 2013.március | 99 945 731 | 24 123 893 |
| 2013.április | 93 628 184 | 114 350 221 |
| 2013.május | 12 602 465 | 24 937 565 |
| 2013.június | 25 632 325 | 27 073 690 |
| 2013.július | 122 795 493 | 77 851 621 |
| 2013.augusztus | 180 549 801 | 49 302 953 |
| 2013.szeptember | 1 211 670 923 | 1 628 022 144 |
| 2013.október | 560 101 719 | 214 098 955 |
| 2013.november | 394 255 846 | 163 918 620 |
| 2013.december | 160 108 554 | 138 429 379 |
| Összesen: | 2 925 623 233 | 2 490 202 251 |

| "B" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|------------------------------|----------------|----------------|
| 2013.január | 3 149 | 15 817 |
| 2013.február | 21 033 | 0 |
| 2013.március | 17 003 | 27 612 |
| 2013.április | 10 320 | 13 258 |
| 2013.május | 9 787 | 31 103 |
| 2013.június | 5 721 | 2 769 |
| 2013.július | 19 396 | 7 470 |
| 2013.augusztus | 108 042 | 964 |
| 2013.szeptember | 183 146 | 11 520 |
| 2013.október | 187 141 | 39 162 |
| 2013.november | 81 572 | 19 310 |
| 2013.december | 34 706 | 49 757 |
| Összesen: | 681 016 | 218 742 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 2,004,067,635

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2008/12/31 | 1,150,232,174 | 0.628773 |
| 2009/12/31 | 1,336,100,432 | 0.710181 |
| 2010/12/31 | 1,511,268,446 | 0.809212 |
| 2011/12/30 | 1,007,745,975 | 0.565524 |
| 2012/12/28 | 807,622,970 | 0.489058 |
| 2013/12/31 | 1,500,658,872 | 0.684728 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Klímaváltozás 130/30 Alap olyan befektetés, amely lehetőséget nyújt a globális „klímaváltozás iparág” vállalatának teljesítményéből való részesedésre alacsony költségek mellett. Az alap különlegessége a 130/30 stratégiában rejlik, melynek lényege, hogy a várhatóan legjobb teljesítményt nyújtó vállalatok papírjaiba az alap vagyonának 130%-ig fektethet, miközben a várhatóan gyenge teljesítményt nyújtó részvényeket a vagyon 30%-áig eladja. A szóban forgó vállalatok részvényárfolyamára egyrészt iparág-specifikus, másrészt pedig általában a fejlett részvénypiacokon megfigyelhető tendenciák vannak hatással.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 0,8 milliárdról 1,5 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 40,01% lett.

3. Vagyonkimutatás

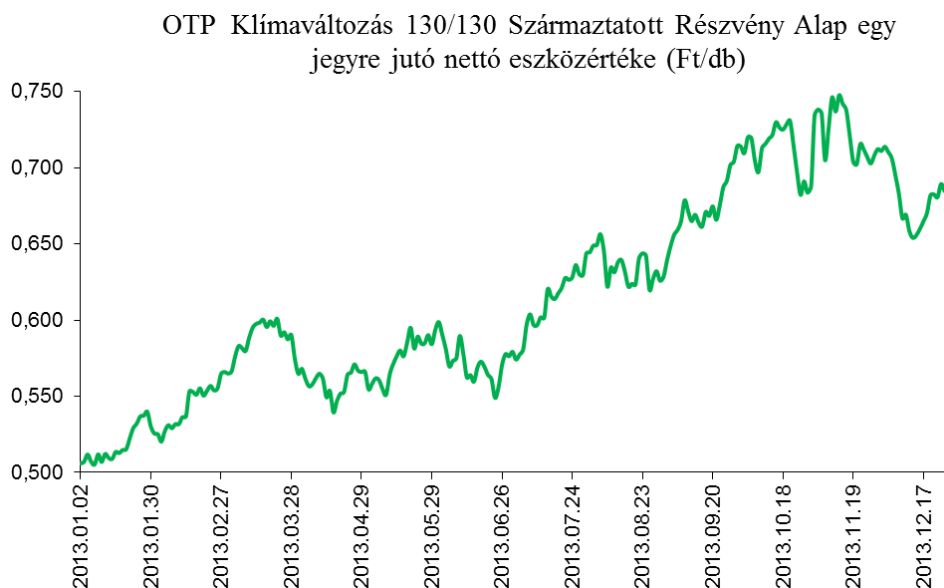
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 16 | 25 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 126 | 1 613 | 0,11% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 331 | 787 | 0,05% | |
| OTP Bank Nyrt. CHF folyószámla | | 0 | 1 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | 0 | 1 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.28 - 2013.01.09 | | 26 216 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 62 351 | 4,12% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 26 689 | 64 778 | 4,28% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 6 842 | | 77 763 | 5,14% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 1 160 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 5 682 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 6 846 | 0,45% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 70 917 | 4,69% |
| Belföldi részvények: | | 35 660 | | 26 830 | 1,77% |
| MASTERPLAST | | 35 660 | | 26 830 | 1,77% |
| Külföldi részvények: | | 753 923 | | 1 343 071 | 88,78% |
| ADOBE SYSTEMS INC | | 24 985 | | 0 | 0,00% |
| ADVANCED EMISSIONS SOLUTIONS | | 0 | | 86 549 | 5,72% |
| AEROVIRONMENT | | 0 | | 44 621 | 2,95% |
| ANDRITZ AG | | 48 074 | | 0 | 0,00% |
| ARCADIS | | 25 013 | | 0 | 0,00% |
| BUREAU VERITAS SA | | 49 316 | | 0 | 0,00% |
| CREE INC | | 48 046 | | 0 | 0,00% |
| EATON CORP PLC | | 25 137 | | 0 | 0,00% |
| EDP RENOVAVEIS SA | | 26 525 | | 0 | 0,00% |
| EMCOR | | 48 936 | | 0 | 0,00% |
| ENERNOC | | 23 363 | | 0 | 0,00% |
| ESCO TECHNOLOGIES INC | | 24 795 | | 0 | 0,00% |
| FIRST SOLAR | | 27 267 | | 41 245 | 2,73% |
| FOSTER WHEELER AG | | 25 253 | | 0 | 0,00% |
| GAMESA | | 0 | | 95 875 | 6,34% |
| GENERAL ELECTRIC CO | | 25 041 | | 0 | 0,00% |
| GT ADVANCED | | 4 686 | | 80 446 | 5,32% |
| JA SOLAR HOLDINGS CO LTD | | 0 | | 84 645 | 5,60% |
| KINGSPAN GROUP | | 25 469 | | 47 090 | 3,11% |
| MASTEC | | 49 570 | | 0 | 0,00% |
| MEMC SOLAR | | 24 751 | | 0 | 0,00% |
| MONSANTO CO | | 25 093 | | 0 | 0,00% |
| ROCKWOOL | | 0 | | 45 861 | 3,03% |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA | | 51 108 | | 0 | 0,00% |
| SEMPRA ENERGY | | 25 077 | | 0 | 0,00% |
| SIEMENS AG | | 26 339 | | 0 | 0,00% |
| SMA SOLAR TECHNOLOGY AG | | 0 | | 72 260 | 4,78% |
| SUNEDISON INC | | 0 | | 91 190 | 6,03% |
| SUNPOWER CORP | | 0 | | 88 721 | 5,86% |
| TESLA MOTORS INC | | 0 | | 110 306 | 7,29% |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | | 50 727 | | 0 | 0,00% |
| TREX COMPANY INC | | 49 352 | | 0 | 0,00% |

| | | | | |
|---|----------------------|----------------|----------------------|----------------|
| TRINA SOLAR LTD | | 0 | 87 968 | 5,81% |
| US SILICA HOLDINGS INC | | 0 | 89 749 | 5,93% |
| VESTAS | | 0 | 94 388 | 6,24% |
| WACKER CHEMIE AG | | 0 | 95 462 | 6,31% |
| YINGLI GREEN ENERGY HOLDING CO | | 0 | 86 695 | 5,73% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 796 425 | 0 | 1 447 664 | 95,69% |
| Egyéb eszközök | | | | |
| Követelések | | 260 195 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 839 | 384 | 0,03% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 261 034 | 384 | 0,03% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 1 084 148 | | 1 512 826 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | 1 382 | 2 538 | 75,97% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 178 | 5,33% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 50 | 247 | 7,39% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 266 531 | 378 | 11,31% |
| Kötelezettségek összesen: | | 267 963 | 3 341 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 816 185 | | 1 509 485 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 1 652 665 151 | | 2 205 503 729 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 0,49385982 | 0,68441715 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 1 642 978 895 | | 0,525590 |
| 2013. február 28. | 1 691 028 843 | | 0,565975 |
| 2013. március 28. | 1 764 155 995 | | 0,590231 |
| 2013. április 30. | 1 742 687 706 | | 0,566192 |
| 2013. május 31. | 1 724 938 342 | | 0,598729 |
| 2013. június 28. | 1 724 246 785 | | 0,576312 |
| 2013. július 31. | 1 772 219 861 | | 0,644509 |
| 2013. augusztus 30. | 1 930 664 521 | | 0,625869 |
| 2013. szeptember 30. | 1 557 906 304 | | 0,703935 |
| 2013. október 31. | 1 941 495 734 | | 0,687770 |
| 2013. november 29. | 2 187 647 508 | | 0,710989 |
| 2013. december 31. | 2 205 503 729 | 1 509 484 584 | 0,684417 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 796 425 | 100,00% | 1 447 664 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 6 842 | 0,86% | 77 763 | 5,37% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 6 842 | 0,86% | 77 763 | 5,37% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 317 522 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -22 512 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -334 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | -3 341 |
| | bankköltség: | -342 |
| | felügyeleti díj: | -280 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -168 |
| f) nettó jövedelem: | | 290 545 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 290 545 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 369 836 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 32 919 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámoló időszakában az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 290 189 | 597 702 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 493 743 | 280 180 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 20 973 | 26 968 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 597 | 9 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -225 124 | 290 545 |

Beszámoló a 2013. évről - OTP Quality Nyíltvégű Részvény Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 1997.08.28-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 21,054,226,317 | 2.805885 |
| 2013.02.28 | 20,785,471,194 | 2.785486 |
| 2013.03.28 | 20,141,829,217 | 2.707578 |
| 2013.04.30 | 20,000,074,874 | 2.703812 |
| 2013.05.31 | 20,472,179,828 | 2.774236 |
| 2013.06.28 | 19,173,138,599 | 2.595962 |
| 2013.07.31 | 20,808,741,424 | 2.684459 |
| 2013.08.30 | 21,118,764,375 | 2.734702 |
| 2013.09.30 | 21,531,484,490 | 2.769687 |
| 2013.10.31 | 22,175,966,803 | 2.878790 |
| 2013.11.29 | 22,886,561,421 | 2.913248 |
| 2013.12.31 | 22,092,575,920 | 2.822689 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 2,879,410,969

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 3 421 748 | 0 |
| 2013.február | 5 277 627 | 0 |
| 2013.március | 20 320 439 | 0 |
| 2013.április | 1 858 184 | 0 |
| 2013.május | 14 401 004 | 127 300 000 |
| 2013.június | 11 152 270 | 0 |
| 2013.július | 393 057 918 | 22 734 083 |
| 2013.augusztus | 13 626 264 | 0 |
| 2013.szeptember | 16 216 404 | 95 747 941 |
| 2013.október | 14 842 778 | 0 |
| 2013.november | 44 499 977 | 0 |
| 2013.december | 13 456 736 | 0 |
| Összesen: | 552 131 349 | 245 782 024 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 2,797,829,617

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2003/12/31 | 20,896,618,332 | 1.271339 |
| 2004/12/31 | 29,568,278,924 | 1.847079 |
| 2005/12/30 | 48,516,460,590 | 2.588714 |
| 2006/12/29 | 75,771,622,822 | 3.035917 |
| 2007/12/28 | 89,714,838,329 | 3.312560 |
| 2008/12/31 | 53,371,202,440 | 1.774118 |
| 2009/12/31 | 83,878,069,875 | 2.625480 |
| 2010/12/31 | 87,819,029,573 | 3.027082 |
| 2011/12/30 | 19,401,915,173 | 2.412425 |
| 2012/12/28 | 21,607,942,559 | 2.842397 |
| 2013/12/31 | 22,092,575,920 | 2.822689 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Quality Alap olyan befektetés, amely döntően magyar, cseh, és lengyel részvényekből áll. Az alap teljesítményének alakulására ennek köszönhetően a közép-kelet európai részvénytőzsdéken megfigyelhető tendenciák vannak hatással.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 21,6 milliárdról 22,09 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után -1,60% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | | |
|--|--------------|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 65 | | 28 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 278 | | 1 552 | | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | 167 | | 141 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | | 0 | | 1 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. PLN folyószámla | | | 36 | | 1 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. CZK folyószámla | | | 0 | | 13 158 | | 0,06% |
| OTP Bank Nyrt. RON folyószámla | | | 0 | | 4 883 | | 0,02% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - | 2013.01.02 | 3 787 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.28 - | 2013.01.02 | 14 802 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 279 095 | | 1,25% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 593 820 | | 2,66% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | 0 | | 72 250 | | 0,32% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 19 135 | | 964 929 | | 4,32% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 243 967 | | 0 | | 0,00% |
| 2015/B | 2010.03.31 - | 2015.12.22 | 243 967 | | 0 | | 0,00% |
| Diszkont kincstárjegyek: | | | 254 028 | | 109 363 | | 0,49% |
| D130220 | 2012.03.07 - | 2013.02.20 | 195 244 | | 0 | | 0,00% |
| D130724 | 2012.07.25 - | 2013.07.24 | 58 784 | | 0 | | 0,00% |
| D140625 | 2013.06.26 - | 2014.06.25 | 0 | | 109 363 | | 0,49% |
| MNB Kötvények: | | | 246 456 | | 1 764 441 | | 7,90% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | 45 275 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | 201 181 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | | 1 764 441 | | 7,90% |
| Kötvények: | | | 1 437 481 | | 882 530 | | 3,95% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - | 2014.09.25 | 736 433 | | 0 | | 0,00% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - | 2016.03.20 | 209 352 | | 282 169 | | 1,26% |
| OPUS VAR 49-16 | 2007.10.31 - | 2016.10.31 | 7 364 | | 0 | | 0,00% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - | 2016.11.07 | 484 332 | | 600 361 | | 2,69% |
| Belföldi részvények: | | | 5 999 407 | | 5 348 080 | | 23,96% |
| ÁLLAMI NYOMDA - 98 | | | 55 571 | | 42 011 | | 0,19% |
| BIF TÖRZS-100 | | | 17 353 | | 19 083 | | 0,08% |
| CIG PANNONIA | | | 0 | | 174 644 | | 0,78% |
| DANUBIUS TÖRZS | | | 19 433 | | 32 511 | | 0,14% |
| EGIS TÖRZS | | | 181 055 | | 0 | | 0,00% |
| ÉMÁSZ TÖRZS | | | 40 | | 51 | | 0,00% |
| FHB A-100 | | | 9 242 | | 14 621 | | 0,07% |
| FOTEX 0.42 EUR | | | 10 652 | | 0 | | 0,00% |
| GRAPHISOFT PARK SE | | | 38 304 | | 38 851 | | 0,17% |
| MAGYAR TELEKOM | | | 567 203 | | 455 358 | | 2,04% |
| MASTERPLAST | | | 88 171 | | 66 147 | | 0,30% |
| MOL TÖRZS | | | 1 953 707 | | 1 740 431 | | 7,80% |
| OTP TÖRZS (100) | | | 1 903 888 | | 1 928 337 | | 8,64% |
| PANNERGY | | | 38 350 | | 22 785 | | 0,10% |
| RICHTER G. TÖRZS | | | 1 036 801 | | 702 476 | | 3,15% |
| SYNERGON | | | 32 519 | | 19 337 | | 0,09% |
| TVK TÖRZS II. | | | 41 266 | | 85 436 | | 0,38% |
| ZWACK RT. TÖRZS | | | 5 852 | | 6 001 | | 0,03% |

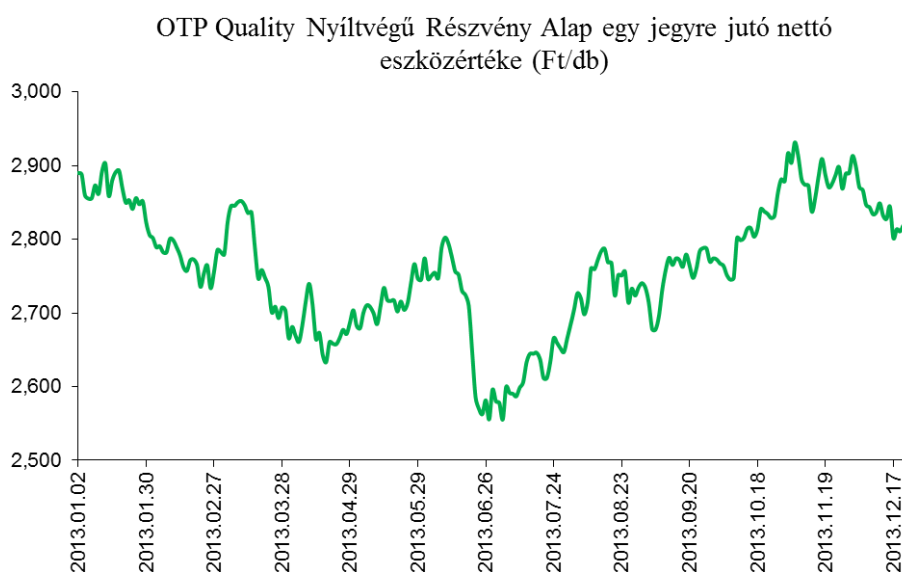
| | | | | | | |
|---|--|-------------------|----------|-------------------|----------|---------------|
| Külföldi részvények: | | 13 617 966 | | 11 820 603 | | 52,97% |
| AAA AUTO GROUP N.V. | | 15 124 | | 0 | | 0,00% |
| AGORA | | 1 594 | | 1 506 | | 0,01% |
| CEZ | | 1 357 376 | | 943 323 | | 4,23% |
| DIXY GROUP | | 14 529 | | 13 329 | | 0,06% |
| ERSTE BANK STAMM | | 1 922 411 | | 1 850 611 | | 8,29% |
| FIBERWEB | | 49 098 | | 0 | | 0,00% |
| GLOBAL TELECOM HOLDING - GDR | | 0 | | 25 287 | | 0,11% |
| HRVATSKI TELEKOM | | 200 442 | | 215 835 | | 0,97% |
| IMMOFINANZ AG | | 57 534 | | 60 795 | | 0,27% |
| KDD GROUP NV | | 4 061 | | 0 | | 0,00% |
| KGHM | | 1 695 544 | | 1 086 600 | | 4,87% |
| KOMERCNI | | 653 139 | | 680 851 | | 3,05% |
| KRKA | | 360 544 | | 380 502 | | 1,70% |
| LINAS AGRO | | 75 307 | | 20 769 | | 0,09% |
| MECHEL PREF | | 6 693 | | 1 328 | | 0,01% |
| MECHEL PREF RU | | 13 128 | | 3 505 | | 0,02% |
| MMK GDR | | 6 378 | | 4 276 | | 0,02% |
| MYTILINEOS | | 4 781 | | 0 | | 0,00% |
| NOSTRUM OIL & GAS | | 0 | | 53 834 | | 0,24% |
| NWR | | 124 120 | | 20 829 | | 0,09% |
| OMV | | 15 937 | | 0 | | 0,00% |
| OMV PETROM SA | | 0 | | 33 151 | | 0,15% |
| ORASCOM TELECOM - GDR | | 24 264 | | 0 | | 0,00% |
| PEKAO | | 1 188 272 | | 1 237 178 | | 5,54% |
| PGE | | 792 790 | | 709 757 | | 3,18% |
| PGNIG | | 0 | | 278 546 | | 1,25% |
| PKN | | 949 535 | | 648 559 | | 2,91% |
| PKO BANK | | 1 506 313 | | 1 436 195 | | 6,44% |
| PLAZA CENTERS | | 12 865 | | 12 124 | | 0,05% |
| PZU | | 1 583 366 | | 1 453 749 | | 6,51% |
| SOLAR COMPANY S.A. | | 21 567 | | 12 303 | | 0,06% |
| TELEFONICA O2 C.R. | | 330 159 | | 283 818 | | 1,27% |
| TOTAL PRODUCE | | 36 230 | | 30 969 | | 0,14% |
| TPSA | | 546 317 | | 0 | | 0,00% |
| UNIPETROL | | 3 158 | | 2 828 | | 0,01% |
| VIG AV | | 0 | | 318 246 | | 1,43% |
| ZHAIKMUNAI | | 45 390 | | 0 | | 0,00% |
| | | | | | | |
| Befektetési jegyek: | | 397 815 | | 647 948 | | 2,92% |
| OTP BUX ETF ALAP BEFJEGY | | 48 672 | | 49 607 | | 0,22% |
| RECONCEPT I. ALAP | | 168 478 | | 402 573 | | 1,80% |
| CARION CAPITAL KOCKÁZATI TŐKEALAP I | | 12 929 | | 16 001 | | 0,07% |
| FONDUL PROPRIETATEA SA | | 84 217 | | 81 476 | | 0,37% |
| SIF 1 BANAT-CRISANA | | 5 413 | | 5 816 | | 0,03% |
| SIF 2 MOLDOVA | | 36 305 | | 37 131 | | 0,17% |
| SIF 3 TRANSILVANIA | | 6 048 | | 5 758 | | 0,03% |
| SIF 4 MUNTENIA | | 5 233 | | 6 046 | | 0,03% |
| SIF 5 OLTENIA | | 30 520 | | 43 540 | | 0,20% |
| | | | | | | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 22 197 120 | 0 | 20 572 965 | 0 | 92,19% |

| | | | | |
|---|--|----------------------|----------------------|----------------|
| Egyéb eszközök | | | | |
| Követelések | | 0 | 780 336 | 3,49% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 3 | 48 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | -21 753 | -360 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | -21 750 | 780 024 | 3,49% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 22 194 505 | 22 317 918 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 22 343 | 23 512 | 5,76% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 2 784 | 0,68% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 2 541 | 1 381 | 0,34% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 682 929 | 380 382 | 93,22% |
| Kötelezettségek összesen: | | 707 813 | 408 059 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 21 486 692 | 21 909 859 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 7 596 086 571 | 7 826 939 991 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 2,82865286 | 2,79928802 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 7 496 519 964 | | 2,805885 |
| 2013. február 28. | 7 460 588 130 | | 2,785486 |
| 2013. március 28. | 7 438 629 553 | | 2,707578 |
| 2013. április 30. | 7 396 653 075 | | 2,703812 |
| 2013. május 31. | 7 251 707 351 | | 2,774236 |
| 2013. június 28. | 7 415 810 695 | | 2,595962 |
| 2013. július 31. | 7 748 029 333 | | 2,684459 |
| 2013. augusztus 30. | 7 720 273 514 | | 2,734702 |
| 2013. szeptember 30. | 7 771 360 596 | | 2,769687 |
| 2013. október 31. | 7 701 941 029 | | 2,878790 |
| 2013. november 29. | 7 855 220 896 | | 2,913248 |
| 2013. december 31. | 7 826 939 991 | 21 909 859 350 | 2,799288 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 22 197 120 | 100,00% | 20 572 965 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 500 484 | 2,25% | 1 873 804 | 9,11% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 181 932 | 9,83% | 2 756 334 | 13,40% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 436 461 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -254 537 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -5 589 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | -6 827 |
| | bankköltség: | -384 |
| | felügyeleti díj: | -4 000 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -690 |
| f) | nettó jövedelem: | 164 434 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 164 434 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 608 591 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -349 858 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|--|-----------|--|---------------|----------------|
| | adatok ezerben | határidő ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -3 600 | 1 028 880 | -1 048 338 | 1 026 585 | -21 753 |
| | Összesen: | | | | | -21 753 |
| 2013.12.31-én: | PLN | 738 | -52 835 | 52 843 | -52 808 | 35 |
| | EUR | -3 600 | 1 071 288 | -1 068 578 | 1 068 183 | -395 |
| | Összesen: | | | | | -360 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 1 657 797 | 2 651 971 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 1 967 147 | 2 215 510 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 274 568 | 271 993 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 10 | 34 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -583 928 | 164 434 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Közép - Európai Részvény Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2005. december 21.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (EUR) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR) |
|------------|----------------------------|---|
| 2013.01.31 | 1,657,286 | 1.039497 |
| 2013.02.28 | 1,621,645 | 1.021233 |
| 2013.03.28 | 1,530,443 | 0.968307 |
| 2013.04.30 | 1,506,617 | 0.976409 |
| 2013.05.31 | 1,558,291 | 1.009839 |
| 2013.06.28 | 1,471,973 | 0.953210 |
| 2013.07.31 | 1,472,328 | 0.965586 |
| 2013.08.30 | 1,463,599 | 0.987183 |
| 2013.09.30 | 1,515,737 | 1.021404 |
| 2013.10.31 | 1,586,886 | 1.085964 |
| 2013.11.29 | 1,506,105 | 1.073884 |
| 2013.12.31 | 1,450,915 | 1.038510 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,664,912

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 178 | 70 700 |
| 2013.február | 85 | 6 546 |
| 2013.március | 991 | 8 385 |
| 2013.április | 1 409 | 38 926 |
| 2013.május | 28 467 | 28 376 |
| 2013.június | 1 606 | 487 |
| 2013.július | 10 572 | 29 997 |
| 2013.augusztus | 604 | 42 806 |
| 2013.szeptember | 4 438 | 3 065 |
| 2013.október | 13 071 | 65 242 |
| 2013.november | 5 663 | 35 501 |
| 2013.december | 491 | 5 344 |
| Összesen: | 67 575 | 335 375 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,397,112

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (EUR) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR) |
|----------------|------------------------------------|--|
| 2005/12/30 | 785,849 | 0.995376 |
| 2006/12/29 | 1,680,554 | 1.187669 |
| 2007/12/28 | 4,732,678 | 1.319124 |
| 2008/12/31 | 2,287,005 | 0.683744 |
| 2009/12/31 | 3,362,922 | 1.040597 |
| 2010/12/31 | 4,056,414 | 1.242225 |
| 2011/12/30 | 1,857,476 | 0.896070 |
| 2012/12/28 | 1,753,524 | 1.053223 |
| 2013/12/31 | 1,450,915 | 1.038510 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Közép-Európai Részvény Alap olyan euró alapú befektetés, amely döntően magyar, cseh és lengyel részvényekből áll.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 1,75 millió euróról 1,45 millió euróra csökkent. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után -1,40% lett.

3. Vagyonkimutatás

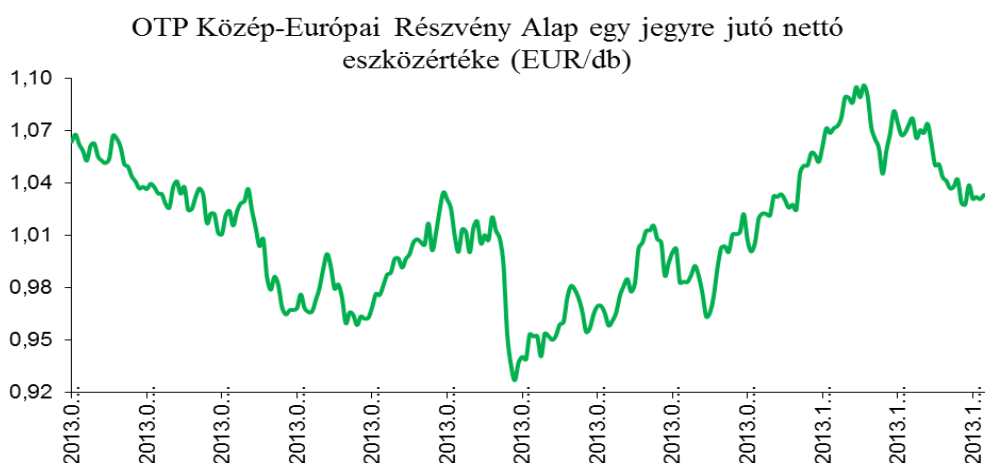
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-----------------|-------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|---------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 13 | 8 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 18 | 18 405 | | 4,21% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | 357 | 201 | | 0,05% |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | | 0 | 1 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. PLN folyószámla | | | 0 | 14 175 | | 3,24% |
| OTP Bank Nyrt. CZK folyószámla | | | 0 | 13 961 | | 3,19% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.28 - | 2013.01.09 | 7 807 | 0 | | 0,00% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 8 195 | 46 751 | | 10,69% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| MNB Kötvények: | | | 12 363 | 50 | | 0,01% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | 9 477 | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | 2 886 | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | 0 | 50 | | 0,01% |
| Belföldi részvények: | | | 160 185 | 141 712 | | 32,40% |
| ÁLLAMI NYOMDA - 98 | | | 2 486 | 3 442 | | 0,79% |
| BIF TÖRZS-100 | | | 169 | 186 | | 0,04% |
| EGIS TÖRZS | | | 11 079 | 0 | | 0,00% |
| FHB A-100 | | | 150 | 237 | | 0,05% |
| FOTEX 0.42 EUR | | | 2 754 | 0 | | 0,00% |
| GRAPHISOFT PARK SE | | | 135 | 179 | | 0,04% |
| MAGYAR TELEKOM | | | 18 492 | 15 484 | | 3,54% |
| MOL TÖRZS | | | 40 837 | 33 293 | | 7,61% |
| OTP TÖRZS (100) | | | 45 650 | 36 490 | | 8,34% |
| RICHTER G. TÖRZS | | | 28 606 | 34 752 | | 7,95% |
| SYNERGON | | | 1 302 | 0 | | 0,00% |
| TVK TÖRZS II. | | | 8 525 | 17 649 | | 4,04% |
| Külföldi részvények: | | | 303 466 | 242 931 | | 55,55% |
| ANALOG DEVICES INC | | | 410 | 0 | | 0,00% |
| ASSECO POLAND SA | | | 3 567 | 3 621 | | 0,83% |
| BRE | | | 3 963 | 0 | | 0,00% |
| CEZ | | | 25 838 | 18 326 | | 4,19% |
| ERSTE BANK STAMM | | | 28 693 | 33 572 | | 7,68% |
| FIBERWEB | | | 8 711 | 0 | | 0,00% |
| FONDUL PROPRIETATEA SA | | | 7 222 | 11 051 | | 2,53% |
| GET BANK | | | 1 648 | 2 401 | | 0,55% |
| GETIN HOLDING SA | | | 887 | 1 188 | | 0,27% |
| GLOBE TRADE CENTRE SPÓLKA AKC. | | | 3 093 | 2 331 | | 0,53% |
| HMS GDR | | | 5 594 | 3 235 | | 0,74% |
| IMMOFINANZ AG | | | 4 926 | 5 326 | | 1,22% |
| KGHM | | | 30 838 | 19 178 | | 4,38% |
| KOMERCNI | | | 24 696 | 20 607 | | 4,71% |
| LOTOS | | | 3 535 | 3 046 | | 0,70% |
| MBANK SA | | | 0 | 6 086 | | 1,39% |
| MECHEL PREF RU | | | 2 592 | 692 | | 0,16% |
| NWR | | | 4 795 | 1 042 | | 0,24% |
| PBG | | | 128 | 54 | | 0,01% |
| PEKAO | | | 20 959 | 13 495 | | 3,09% |
| PGE | | | 7 954 | 7 121 | | 1,63% |
| PHILIP MORRIS | | | 5 471 | 5 046 | | 1,15% |
| PKN | | | 10 136 | 8 408 | | 1,92% |

| | | | | | | |
|--|--|------------------|---------------|------------------|------------|----------------|
| PKO BANK | | 19 656 | | 21 027 | | 4,81% |
| POLIMEX MOSTOSTAL SA | | 5 572 | | 5 725 | | 1,31% |
| POLIMEX SA - 0.04 | | 786 | | 165 | | 0,04% |
| PZU | | 23 434 | | 19 286 | | 4,41% |
| REYSAS LOGISTIC | | 3 550 | | 2 628 | | 0,60% |
| REYSAS REIT | | 2 446 | | 1 323 | | 0,30% |
| TAURON PE | | 5 094 | | 4 693 | | 1,07% |
| TELEFONICA O2 C.R. | | 19 061 | | 11 413 | | 2,61% |
| TPSA | | 9 619 | | 7 703 | | 1,76% |
| UNIPETROL | | 8 592 | | 3 142 | | 0,72% |
| Befektetési jegyek: | | 4 974 | | 5 899 | | 1,35% |
| SIF 1 BANAT-CRISANA | | 358 | | 385 | | 0,09% |
| SIF 2 MOLDOVA | | 2 272 | | 2 324 | | 0,53% |
| SIF 3 TRANSILVANIA | | 215 | | 204 | | 0,05% |
| SIF 4 MUNTENIA | | 188 | | 217 | | 0,05% |
| SIF 5 OLTENIA | | 1 941 | | 2 769 | | 0,63% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 480 988 | 0 | 390 592 | 0 | 89,31% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 33 270 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 1 | | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 33 271 | | 0 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 522 454 | | 437 343 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 864 | | 732 | 89,82% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 33 | | 55 | 6,75% |
| Költséggént elszámolt egyéb tétel miatt | | | 5 556 | | 28 | 3,43% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 6 453 | | 815 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 516 001 | | 436 528 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 1 664 912 | | 1 397 112 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (EUR/jegy): | | 1,06398235 | | 1,05234051 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|--|
| 2013. január 31. | 1 594 390 | | 1,039497 |
| 2013. február 28. | 1 587 929 | | 1,021233 |
| 2013. március 28. | 1 580 535 | | 0,968307 |
| 2013. április 30. | 1 543 018 | | 0,976409 |
| 2013. május 31. | 1 543 109 | | 1,009839 |
| 2013. június 28. | 1 544 228 | | 0,953210 |
| 2013. július 31. | 1 524 803 | | 0,965586 |
| 2013. augusztus 30. | 1 482 601 | | 0,987183 |
| 2013. szeptember 30. | 1 483 974 | | 1,021404 |
| 2013. október 31. | 1 431 803 | | 1,085964 |
| 2013. november 29. | 1 401 965 | | 1,073884 |
| 2013. december 31. | 1 397 112 | 436 528 231 | 1,052341 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 480 988 | 100,00% | 390 592 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 12 363 | 2,57% | 50 | 0,01% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 12 363 | 2,57% | 50 | 0,01% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 26 589 |
| b) | egyéb bevétel: | 2 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -9 185 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -79 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | -57 |
| | bankköltség: | -403 |
| | felügyeleti díj: | -115 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -32 |
| f) | nettó jövedelem: | 16 720 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 16 720 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -72 135 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -24 058 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámoló időszakában az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 239 476 | 94 952 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 227 136 | 68 363 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 2 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 11 163 | 9 839 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 111 | 32 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 1 066 | 16 720 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Tőzsdén Kereskedett BUX Indexkövető Alap

1. Általános adatok:

Típusa: tiszta részvény alap

Futamideje: 2006.12.04-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2 693 619 768 | 804,065602 |
| 2013.02.28 | 2 616 904 743 | 781,165595 |
| 2013.03.28 | 2 483 449 786 | 741,328294 |
| 2013.04.30 | 2 542 651 615 | 759,000482 |
| 2013.05.31 | 2 676 514 671 | 798,959603 |
| 2013.06.28 | 2 640 910 509 | 788,331495 |
| 2013.07.31 | 2 478 922 395 | 768,658107 |
| 2013.08.30 | 2 430 403 046 | 753,613348 |
| 2013.09.30 | 2 491 456 965 | 772,544795 |
| 2013.10.31 | 2 479 623 617 | 780,983816 |
| 2013.11.29 | 2 473 980 662 | 779,206508 |
| 2013.12.31 | 2 441 618 265 | 769,013627 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 3,450,000

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 0 | 125 000 |
| 2013.június | 0 | 100 000 |
| 2013.július | 0 | 25 000 |
| 2013.október | 0 | 50 000 |
| Összesen: | 0 | 300 000 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 3,175,000

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2006.12.29 | 1 268 637 662 | 1057,198052 |
| 2007.12.28 | 4 745 512 091 | 1116,591080 |
| 2008.12.31 | 2 069 637 528 | 520,663529 |
| 2009.12.31 | 3 444 060 481 | 894,561164 |
| 2010.12.31 | 3 391 747 934 | 892,565246 |
| 2011.12.30 | 2 541 529 695 | 721,001332 |
| 2012.12.28 | 2 603 088 207 | 754,518321 |
| 2013.12.31 | 2 441 618 265 | 769,013627 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Tőzsdén Kereskedett BUX Indexkövető Alap egy tőzsdén kereskedett alap, amelynek befektetési stratégiája, hogy minél jobban kövesse a BUX Index összetételét.

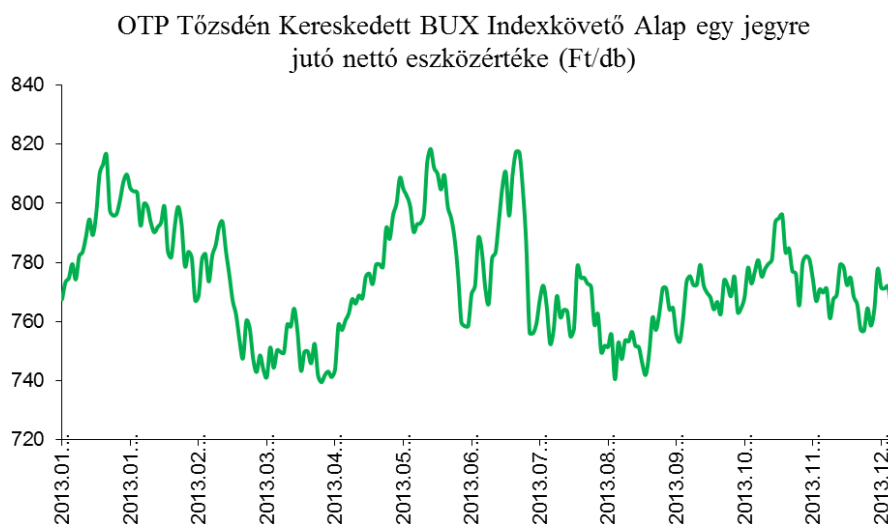
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 61 | 27 | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 61 | 27 | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 13 890 | | 185 187 | 7,57% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 13 890 | 0 | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | 5 616 | 5 616 | 0,23% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | 179 571 | 179 571 | 7,34% |
| Belföldi részvények: | | 2 588 627 | | 2 239 188 | 91,58% |
| ÁLLAMI NYOMDA - 98 | | 0 | 9 081 | 9 081 | 0,37% |
| APPENINN | | 412 | 674 | 674 | 0,03% |
| CIG PANNONIA | | 15 175 | 19 258 | 19 258 | 0,79% |
| DANUBIUS TÖRZS | | 0 | 15 053 | 15 053 | 0,62% |
| EGIS TÖRZS | | 117 011 | 0 | 0 | 0,00% |
| EST MEDIA -200 | | 208 | 0 | 0 | 0,00% |
| FHB A-100 | | 17 418 | 20 142 | 20 142 | 0,82% |
| MAGYAR TELEKOM | | 277 563 | 218 571 | 218 571 | 8,94% |
| MOL TÖRZS | | 861 490 | 685 015 | 685 015 | 28,02% |
| OTP TÖRZS (100) | | 795 443 | 692 026 | 692 026 | 28,30% |
| PANNERGY | | 11 595 | 6 299 | 6 299 | 0,26% |
| RÁBA | | 0 | 6 889 | 6 889 | 0,28% |
| RICHTER - 100 | | 488 292 | 563 886 | 563 886 | 23,06% |
| SYNERGON | | 4 020 | 2 294 | 2 294 | 0,09% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 602 517 | 0 | 2 424 375 | 99,15% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 22 719 | 20 676 | 20 676 | 0,85% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 0 | 0 | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 22 719 | 20 676 | 20 676 | 0,85% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 625 297 | 2 445 078 | 2 445 078 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 1 438 | 1 035 | 1 035 | 49,08% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | 309 | 309 | 14,65% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | 166 | 487 | 487 | 23,09% |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | | 233 | 278 | 278 | 13,18% |
| Kötelezettségek összesen: | | 1 837 | 2 109 | 2 109 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 623 460 | 2 442 969 | 2 442 969 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 3 475 000 | 3 175 000 | 3 175 000 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 754,9524 | 769,4388 | 769,4388 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 3 350 000 | | 804,07 |
| 2013. február 28. | 3 350 000 | | 781,17 |
| 2013. március 28. | 3 350 000 | | 741,33 |
| 2013. április 30. | 3 350 000 | | 759,00 |
| 2013. május 31. | 3 350 000 | | 798,96 |
| 2013. június 28. | 3 250 000 | | 788,33 |
| 2013. július 31. | 3 225 000 | | 768,66 |
| 2013. augusztus 30. | 3 225 000 | | 753,61 |
| 2013. szeptember 30. | 3 225 000 | | 772,54 |
| 2013. október 31. | 3 175 000 | | 780,98 |
| 2013. november 29. | 3 175 000 | | 779,21 |
| 2013. december 31. | 3 175 000 | 2 442 968 246 | 769,44 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 602 517 | 100,00% | 2 424 375 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 13 890 | 0,53% | 185 187 | 7,64% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 13 890 | 0,53% | 185 187 | 7,64% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 169 254 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -12 701 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -590 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | -229 |
| | bankköltség: | | -77 |
| | felügyeleti díj: | | -636 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -1 199 |
| f) | nettó jövedelem: | | 153 822 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 153 822 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -234 354 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -99 959 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Nyitott kölcsönök

| Az Alap által kölcsönbe adott értékpapírok bemutatása (nyitott kölcsönök) | | | | | | |
|---|--|--|------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
| Értékpapír megnevezése | | | A kölcsön várható lejáratára | Névérték | Szerz.szerinti érték (Ft) | Piaci érték (Ft) |
| ÁLLAMI NYOMDA - 98 | | | 2014.01.06 | 14 700 | 73 500 | 88 049 |
| APPENINN | | | 2014.01.06 | 25 000 | 58 201 | 59 249 |
| CIG PANNONIA | | | 2014.01.06 | 28 800 | 504 751 | 174 239 |
| DANUBIUS TÖRZS | | | 2014.01.06 | 25 000 | 102 500 | 127 874 |
| FHB A-100 | | | 2014.01.06 | 40 900 | 535 790 | 252 352 |
| MAGYAR TELEKOM | | | 2014.01.06 | 600 000 | 3 309 967 | 1 883 999 |
| MOL TÖRZS | | | 2014.01.06 | 380 000 | 8 306 800 | 5 500 499 |
| OTP TÖRZS (100) | | | 2014.01.06 | 150 000 | 2 921 876 | 6 149 999 |
| PANNERGY | | | 2014.01.06 | 3 400 | 137 096 | 58 479 |
| RÁBA | | | 2014.01.06 | 50 000 | 44 059 | 63 149 |
| RICHTER - 100 | | | 2014.01.06 | 125 000 | 4 656 521 | 5 498 749 |
| SYNERGON | | | 2014.01.06 | 14 000 | 29 996 | 19 179 |
| Összesen: | | | | 1 456 800 | 20 681 057 | 19 728 518 |
| Az Alap kapott óvadékanak bemutatása 2013.12.31-ével | | | | | | |
| Értékpapír megnevezése | | | | Névérték | | Óvadékérték (Ft) |
| 2019/A | | | | 23 080 000 | | 25 701 975 |
| Összesen: | | | | 23 080 000 | | 25 701 975 |

10. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 110 452 | 257 924 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 102 771 | 88 670 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 13 934 | 14 568 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 1 461 | 864 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -7 714 | 153 822 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Orosz Részvény Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. augusztus 9.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 4,643,062,379 | 1.179820 |
| 2013.02.28 | 6,133,928,935 | 1.183219 |
| 2013.03.28 | 6,135,237,397 | 1.189678 |
| 2013.04.30 | 7,340,082,448 | 1.127165 |
| 2013.05.31 | 7,950,183,319 | 1.095145 |
| 2013.06.28 | 7,778,589,190 | 1.055984 |
| 2013.07.31 | 8,057,359,683 | 1.076127 |
| 2013.08.30 | 7,868,409,487 | 1.073938 |
| 2013.09.30 | 8,194,428,888 | 1.143876 |
| 2013.10.31 | 8,173,699,968 | 1.159629 |
| 2013.11.29 | 5,745,240,727 | 1.152258 |
| 2013.12.31 | 5,740,011,344 | 1.169776 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján tárgyidőszaki nyitó befektetési jegy állománya (db) 950,904,217

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 30 591 222 | 107 254 642 |
| 2013.február | 61 200 498 | 24 567 385 |
| 2013.március | 37 468 964 | 80 214 431 |
| 2013.április | 101 558 869 | 30 157 931 |
| 2013.május | 753 401 577 | 34 211 710 |
| 2013.június | 385 212 473 | 290 320 604 |
| 2013.július | 252 022 354 | 103 871 591 |
| 2013.augusztus | 58 592 819 | 224 862 590 |
| 2013.szeptember | 228 136 665 | 97 015 068 |
| 2013.október | 50 518 320 | 165 670 529 |
| 2013.november | 130 207 110 | 103 465 335 |
| 2013.december | 21 025 686 | 122 628 039 |
| Összesen: | 2 109 936 557 | 1 384 239 855 |

| "C" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|------------------------------|----------------|----------------|
| 2013.január | 30 100 | 33 957 |
| 2013.február | 43 352 | 13 384 |
| 2013.március | 8 087 | 21 306 |
| 2013.április | 1 216 | 14 753 |
| 2013.május | 6 309 | 16 942 |
| 2013.június | 6 511 | 11 669 |
| 2013.július | 42 265 | 25 713 |
| 2013.augusztus | 12 894 | 15 098 |
| 2013.szeptember | 1 280 | 748 |
| 2013.október | 1 837 | 3 558 |
| 2013.november | 6 709 | 22 020 |
| 2013.december | 1 064 | 2 631 |
| Összesen: | 161 624 | 181 779 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,680,781,447

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2010/12/31 | 10,615,519,849 | 1.134673 |
| 2011/12/30 | 3,862,613,557 | 1.048625 |
| 2012/12/28 | 4,577,617,598 | 1.143378 |
| 2013/12/31 | 5,740,011,344 | 1.169776 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Orosz Részvény Alap célja, hogy a hosszabb távra rendelkezésre álló pénzeszközök számára rugalmas, bármikor hozzáférhető az orosz részvénypiac teljesítményéből részesedő befektetési lehetőséget nyújtson.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 4,58 milliárd forintról 5,74 milliárd forintra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 2,10% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-----------------|-------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------|---------------|
| Vagyonelem, ill. értékpapír fajta | | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | | 27 | | 29 | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | | 20 | | 3 483 | 0,06% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | | 21 | | 16 778 | 0,29% |
| OTP Bank Nyrt. RBL folyószámla | | | | 100 | | 989 | 0,02% |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | | | 0 | | 248 | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - | 2014.01.08 | | 0 | | 107 835 | 1,85% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 168 | | 129 362 | 2,22% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | | |
| MNB Kötvények: | | | | 15 465 | | 14 362 | 0,25% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | | 15 465 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | | 0 | | 14 362 | 0,25% |
| Kötvények: | | | | 104 774 | | 80 864 | 1,39% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - | 2016.11.07 | | 104 774 | | 80 864 | 1,39% |
| Külföldi részvények: | | | | 4 401 797 | | 5 336 180 | 91,69% |
| AKRON | | | | 0 | | 97 137 | 1,67% |
| CAT OIL AG | | | | 28 831 | | 0 | 0,00% |
| DIXY GROUP | | | | 84 269 | | 82 375 | 1,42% |
| ETALON GROUP | | | | 36 122 | | 43 182 | 0,74% |
| EURASIA DRILLIN - GDR REGS | | | | 0 | | 92 199 | 1,58% |
| EVRAZ PLC | | | | 12 882 | | 0 | 0,00% |
| GAZPROM GDR | | | | 343 282 | | 443 938 | 7,63% |
| HMS GDR | | | | 62 230 | | 28 979 | 0,50% |
| IG SEISMIC SERVICE-REG S WI | | | | 4 655 | | 7 176 | 0,12% |
| INTEGRA | | | | 5 103 | | 0 | 0,00% |
| LSR GROUP GDR | | | | 0 | | 63 077 | 1,08% |
| LUKOIL ADR | | | | 432 005 | | 540 658 | 9,29% |
| M VIDEO | | | | 0 | | 90 735 | 1,56% |
| MAGNIT | | | | 343 382 | | 543 468 | 9,34% |
| MAIL.RU GDR | | | | 64 787 | | 131 971 | 2,27% |
| MECHEL PREF | | | | 9 871 | | 1 752 | 0,03% |
| MECHEL PREF RU | | | | 0 | | 9 805 | 0,17% |
| MEGAFON-GDR | | | | 0 | | 127 571 | 2,19% |
| MMK | | | | 20 030 | | 12 840 | 0,22% |
| MMK GDR | | | | 22 185 | | 42 400 | 0,73% |
| MOSTOTREST | | | | 18 407 | | 0 | 0,00% |
| NLMK GDR | | | | 45 611 | | 0 | 0,00% |
| NORILSK NICKEL | | | | 58 282 | | 0 | 0,00% |
| NORILSK NICKEL ADR | | | | 136 253 | | 334 295 | 5,74% |
| NOVATEK | | | | 0 | | 328 249 | 5,64% |
| NOVATEK GDR | | | | 349 502 | | 0 | 0,00% |
| OGK4 | | | | 22 441 | | 53 292 | 0,92% |
| PROTEK | | | | 39 746 | | 64 223 | 1,10% |
| ROSNEFT GDR | | | | 397 623 | | 325 171 | 5,59% |
| RUSHYDRO | | | | 22 005 | | 0 | 0,00% |
| RUSHYDRO ADR | | | | 44 852 | | 0 | 0,00% |
| SBERBANK | | | | 104 967 | | 0 | 0,00% |
| SBERBANK PREF | | | | 63 556 | | 0 | 0,00% |
| SBERBANK SPONSORED ADR | | | | 264 331 | | 580 274 | 9,97% |
| SEVERSTAL | | | | 27 883 | | 22 010 | 0,38% |
| SEVERSTAL GDR | | | | 77 777 | | 38 109 | 0,65% |
| SISTEMA | | | | 106 331 | | 80 135 | 1,38% |
| SISTEMA GDR | | | | 0 | | 70 658 | 1,21% |
| SOLLERS | | | | 0 | | 67 148 | 1,15% |
| SOLLERS | | | | 25 299 | | 0 | 0,00% |
| SURGUTNEFTEGAS | | | | 20 240 | | 0 | 0,00% |

| | | | |
|---|----------------------|----------------------|-----------------|
| SURGUTNEFTEGAS ADR | 206 278 | 161 593 | 2,78% |
| SURGUTNEFTEGAS PREF | 0 | 71 264 | 1,22% |
| TATNEFT PREF | 237 016 | 315 820 | 5,43% |
| TMK GDR | 16 912 | 104 253 | 1,79% |
| TNK-BP | 19 017 | 0 | 0,00% |
| TNK-BP PREF | 21 971 | 0 | 0,00% |
| URALKALI GDR | 325 556 | 124 965 | 2,15% |
| VTB BANK GDR | 170 419 | 134 315 | 2,31% |
| X5 RETAIL GROUP GDR | 109 888 | 101 143 | 1,74% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 4 522 036 | 0 5 431 406 | 0 93,33% |
| Egyéb eszközök | | | |
| Követelések | 51 282 | 253 025 | 4,35% |
| Aktív időbeli elhatárolások | 7 059 | 5 679 | 0,10% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | -2 839 | -23 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | 55 502 | 258 681 | 4,45% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 4 577 706 | 5 819 449 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | |
| Alapkezelői díj miatt | 3 753 | 5 176 | 7,65% |
| Letétkezelői díj miatt | 0 | 873 | 1,29% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | 262 | 761 | 1,12% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | 5 925 | 8 087 | 11,95% |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | 606 | 52 795 | 77,99% |
| Kötelezettségek összesen: | 10 546 | 67 692 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 4 567 160 | 5 751 757 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 4 006 394 108 | 4 905 395 302 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | 1,13996788 | 1,17253703 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 3 872 074 530 | | 1,179820 |
| 2013. február 28. | 5 185 037 952 | | 1,183219 |
| 2013. március 28. | 5 138 604 384 | | 1,189678 |
| 2013. április 30. | 6 516 555 976 | | 1,127165 |
| 2013. május 31. | 7 232 991 684 | | 1,095145 |
| 2013. június 28. | 7 326 444 471 | | 1,055984 |
| 2013. július 31. | 7 479 213 242 | | 1,076127 |
| 2013. augusztus 30. | 7 326 552 605 | | 1,073938 |
| 2013. szeptember 30. | 7 163 110 245 | | 1,143876 |
| 2013. október 31. | 6 987 614 024 | | 1,159629 |
| 2013. november 29. | 4 985 787 316 | | 1,152258 |
| 2013. december 31. | 4 905 395 302 | 5 751 757 637 | 1,172537 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 4 522 036 | 100,00% | 5 431 406 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 15 465 | 0,34% | 14 362 | 0,26% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 120 239 | 2,66% | 95 226 | 1,75% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 373 173 |
| b) egyéb bevétel: | | 1 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -121 768 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 753 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | -6 292 |
| | bankköltség: | -321 |
| | felügyeleti díj: | -1 758 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -333 |
| f) nettó jövedelem: | | 240 949 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 240 949 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 973 255 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -29 607 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|---------------------------|-----------|-----------------------------|---------------|---------------|
| | adatok | határidő ügylet | | határidős ügylet | | |
| | ezerben | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -360 | 102 845 | -104 836 | 101 998 | -2 839 |
| | Összesen: | | | | | -2 839 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -250 | 74 233 | -74 225 | 74 202 | -23 |
| | Összesen: | | | | | -23 |

Az Alap által kölcsönbe adott értékpapírok bemutatása (nyitott kölcsönök)

| Értékpapír megnevezése | A kölcsön lejárat | Névérték | Szerz.szer. érték (Ft) | Piaci érték (Ft) |
|------------------------|----------------------|----------|---------------------------|---------------------|
| TATNEFT PREF | 2014.01.08 | 6 590 | 20 169 700 | 5 244 487 |
| VTB BANK GDR | 2014.03.03 | 77 000 | 10 432 722 | 49 736 737 |
| NLMK GDR | 2014.03.03 | 10 195 | 24 135 646 | 37 136 983 |
| URALKALI GDR | 2014.03.17 | 9 200 | 36 688 744 | 52 778 762 |
| ROSNEFT GDR | 2014.03.18 | 26 000 | 44 061 457 | 42 700 503 |
| Összesen: | | | 135 488 269 | 187 597 472 |

Az Alap kapott óvadékanak bemutatása 2013.12.31-ével

| Értékpapír megnevezése | Névérték | Óvadékérték |
|------------------------|------------|--------------------|
| RECONCEPT I. ALAP | 62 000 000 | 104 804 800 |
| Magyar 5.875 05/16 | 225 000 | 73 280 911 |
| OTPHB VAR 49-16 | 460 000 | 112 720 852 |
| Összesen: | | 290 806 563 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 609 743 | 1 208 643 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 517 725 | 835 470 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 2 | 1 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 49 154 | 132 217 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 15 | 8 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 42 851 | 240 949 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Török Részvény Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. augusztus 9.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,684,733,013 | 1.125834 |
| 2013.02.28 | 2,557,837,574 | 1.162024 |
| 2013.03.28 | 2,756,458,554 | 1.278054 |
| 2013.04.30 | 2,791,490,802 | 1.262652 |
| 2013.05.31 | 2,881,561,258 | 1.205996 |
| 2013.06.28 | 2,479,764,620 | 1.044806 |
| 2013.07.31 | 2,560,308,730 | 1.001402 |
| 2013.08.30 | 2,401,074,451 | 0.879520 |
| 2013.09.30 | 2,611,278,493 | 0.960514 |
| 2013.10.31 | 2,679,909,642 | 0.991688 |
| 2013.11.29 | 2,800,748,808 | 0.989666 |
| 2013.12.31 | 2,446,843,516 | 0.821541 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszaki nyitó befektetési jegy állománya (db) 704,444,467

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 318 589 752 | 165 025 813 |
| 2013.február | 68 965 612 | 211 181 360 |
| 2013.március | 81 553 227 | 123 686 234 |
| 2013.április | 120 708 069 | 67 651 036 |
| 2013.május | 400 377 535 | 103 644 071 |
| 2013.június | 196 832 059 | 186 913 686 |
| 2013.július | 298 253 225 | 136 818 101 |
| 2013.augusztus | 142 659 555 | 53 159 560 |
| 2013.szeptember | 91 148 056 | 117 430 483 |
| 2013.október | 55 692 286 | 59 969 814 |
| 2013.november | 44 443 910 | 56 398 688 |
| 2013.december | 92 774 702 | 37 463 896 |
| Összesen: | 1 911 997 988 | 1 319 342 742 |

| "C" sorozat (névérték 1 EUR) | | |
|------------------------------|----------------|----------------|
| 2013.január | 144 118 | 75 219 |
| 2013.február | 66 661 | 141 548 |
| 2013.március | 15 113 | 54 412 |
| 2013.április | 23 169 | 8 363 |
| 2013.május | 127 831 | 44 713 |
| 2013.június | 42 306 | 68 897 |
| 2013.július | 110 085 | 20 029 |
| 2013.augusztus | 111 122 | 21 625 |
| 2013.szeptember | 24 217 | 5 248 |
| 2013.október | 41 476 | 61 355 |
| 2013.november | 10 945 | 20 146 |
| 2013.december | 7 219 | 17 952 |
| Összesen: | 724 262 | 539 507 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,284,737,873

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2010/12/31 | 3,606,867,321 | 1.041462 |
| 2011/12/30 | 2,657,849,213 | 0.755444 |
| 2012/12/28 | 2,516,632,920 | 1.136167 |
| 2013/12/31 | 2,446,843,516 | 0.821541 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Török Részvény Alap célja, hogy a hosszabb távra rendelkezésre álló pénzeszközök számára rugalmas, bármikor hozzáférhető a török részvényiac teljesítményéből részesedő befektetési lehetőséget nyújtson.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 2,52 milliárd forintról 2,45 milliárd forintra csökkent. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után -27,70% lett.

3. Vagyonkimutatás

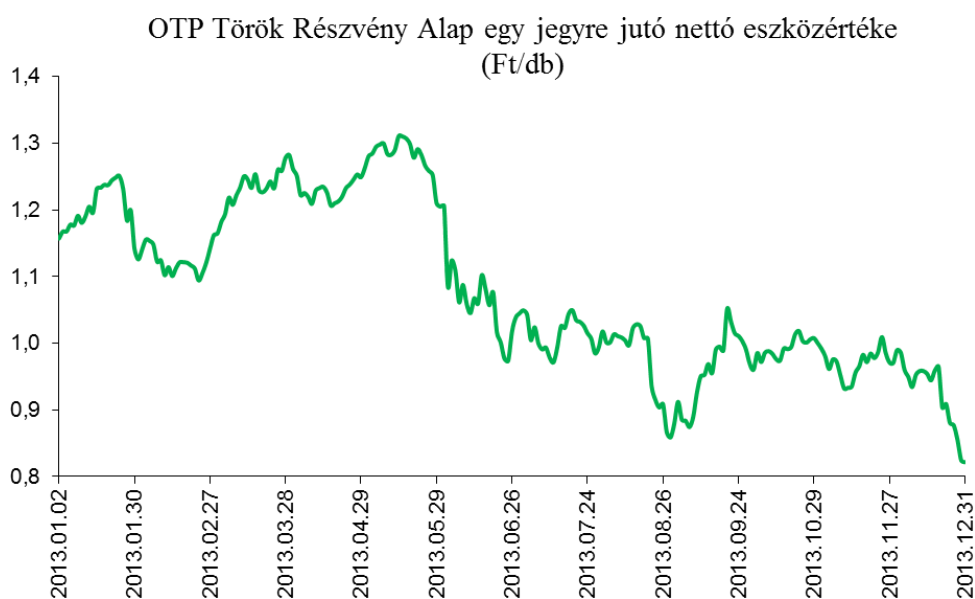
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 58 | 24 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 4 | 16 175 | | 0,65% |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | | 48 | 16 557 | | 0,66% |
| OTP Bank Nyrt. TRY folyószámla | | | 43 760 | 79 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.28 - 2013.01.09 | | 6 407 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 17 477 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2012.12.21 - 2013.01.02 | | 18 934 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. USD | 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 107 835 | | 4,30% |
| OTP Bank Nyrt. TRY | 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 9 908 | | 0,39% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 86 688 | 150 578 | | 6,00% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | | 84 717 | | 19 711 | 0,78% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 35 159 | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 49 558 | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | 6 127 | | 0,24% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | 13 584 | | 0,54% |
| Kötvények: | | | 59 306 | | 470 309 | 18,73% |
| MAGNOLIA VAR 03 | 2006.03.20 - 2016.03.20 | | 0 | 112 868 | | 4,50% |
| MAGYAR 5.875 05/10 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | | 0 | 91 194 | | 3,63% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | | 0 | 61 748 | | 2,46% |
| OTPHB FLOAT 03/10 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 0 | 85 653 | | 3,41% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | | 59 306 | 118 846 | | 4,73% |
| Külföldi részvények: | | | 2 061 597 | | 1 800 010 | 71,69% |
| AKBANK | | | 230 487 | 152 096 | | 6,06% |
| ALBARAKA TURK | | | 0 | 17 053 | | 0,68% |
| ANADOLU EFES | | | 92 541 | 41 149 | | 1,64% |
| ANEL ELEKTRIK | | | 24 843 | 9 564 | | 0,38% |
| ARCELIK | | | 19 373 | 0 | | 0,00% |
| ASELSAN ELEKTRONIK | | | 1 393 | 1 169 | | 0,05% |
| ASYA | | | 22 887 | 28 484 | | 1,13% |
| BIM | | | 158 946 | 82 713 | | 3,29% |
| BIZIM TOPTAN | | | 20 565 | 0 | | 0,00% |
| CELEBI HA VA SERVISI | | | 12 452 | 0 | | 0,00% |
| DOGAN HOLDING | | | 0 | 12 375 | | 0,49% |
| EMLAK KONUT | | | 45 506 | 84 372 | | 3,36% |
| ENKA INSAAT | | | 33 143 | 28 463 | | 1,13% |
| EREGLI | | | 70 188 | 26 083 | | 1,04% |
| EVRAZ PLC | | | 4 601 | 12 376 | | 0,49% |
| GARANTI BANKASI | | | 158 131 | 165 084 | | 6,58% |
| GARANTI YATIRIM ORTAKLIGI | | | 0 | 12 537 | | 0,50% |
| HALK BANKASI | | | 201 813 | 148 186 | | 5,90% |
| IS BANKASI-C | | | 78 589 | 99 736 | | 3,97% |
| IS LEASING | | | 9 880 | 0 | | 0,00% |
| IS REIT | | | 0 | 21 443 | | 0,85% |
| KOC HOLDING | | | 112 048 | 67 047 | | 2,67% |
| KOZA METAL | | | 0 | 6 117 | | 0,24% |
| MANGO GIDA | | | 12 722 | 556 | | 0,02% |
| MARTI REIT | | | 9 782 | 5 751 | | 0,23% |
| PARK ELEKTRIK | | | 0 | 12 436 | | 0,50% |
| PETKIM PETROKIMYA | | | 0 | 16 560 | | 0,66% |

| | | | | | | |
|---|--|----------------------|----------------|----------------------|---------------|----------------|
| PINAR ET | | 13 705 | | 16 487 | | 0,66% |
| REYSAS LOGISTIC | | 23 877 | | 8 805 | | 0,35% |
| SABANCI HOLDING | | 45 727 | | 124 037 | | 4,94% |
| SELCUK ECZA | | 0 | | 23 435 | | 0,93% |
| SEVERSTAL GDR | | 12 312 | | 27 700 | | 1,10% |
| SINPAS | | 0 | | 13 347 | | 0,53% |
| TEKFEN | | 0 | | 34 789 | | 1,39% |
| TORUNLAR | | 0 | | 9 766 | | 0,39% |
| TRAKYA CAM | | 13 537 | | 24 516 | | 0,98% |
| TSKB | | 0 | | 20 794 | | 0,83% |
| TUPRAS | | 119 592 | | 82 949 | | 3,30% |
| TURK HAVA | | 75 815 | | 21 252 | | 0,85% |
| TURK TELEKOM | | 102 414 | | 48 168 | | 1,92% |
| TURKCELL | | 189 688 | | 152 051 | | 6,06% |
| VAKIFBANK | | 56 714 | | 80 748 | | 3,22% |
| VESTEL BEYAZ | | 24 251 | | 0 | | 0,00% |
| YAPI KREDI BANKASI | | 64 075 | | 59 816 | | 2,38% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 205 620 | 0 | 2 290 030 | 0 | 91,20% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 142 745 | | 164 075 | 6,54% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 14 | | 8 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | -958 | | -93 953 | -3,74% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 141 801 | | 70 130 | 2,80% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 434 109 | | 2 510 738 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 2 190 | | 2 529 | 6,14% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 339 | 0,82% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | | 143 | | 417 | 1,01% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 8 251 | | 37 928 | 92,03% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 10 584 | | 41 213 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 423 525 | | 2 469 525 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 2 212 413 156 | | 2 988 928 398 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 1,09542184 | | 0,82622419 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|---------------------|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | | 1,125834 |
| 2013. február 28. | | 1,162024 |
| 2013. március 28. | | 1,278054 |
| 2013. április 30. | | 1,262652 |
| 2013. május 31. | | 1,205996 |
| 2013. június 28. | | 1,044806 |
| 2013. július 31. | | 1,001402 |
| 2013. szeptember 3. | | 0,885220 |
| 2013. október 2. | | 0,971826 |
| 2013. november 11. | | 0,932159 |
| 2013. december 9. | | 0,958433 |
| 2013. december 31. | 2 469 524 947 | 0,826224 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 205 620 | 100,00% | 2 290 030 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: a fentiekből: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 84 717 | 3,84% | 19 711 | 0,86% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 144 023 | 6,53% | 490 020 | 21,40% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 166 745 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -29 847 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -466 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | -3 497 |
| | bankköltség: | | -268 |
| | felügyeleti díj: | | -665 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -280 |
| f) | nettó jövedelem: | | 131 722 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 131 722 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 810 055 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -895 777 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|--|-----------|--|---------------|----------------|
| | adatok ezerben | határidő ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -205 | | -59 698 | | -59 698 |
| | HUF | 58 564 | | 58 082 | | 58 082 |
| | | | | | | -1 616 |
| | HUF | -60 988 | | -60 784 | | -60 784 |
| | TRY | 500 | | 61 443 | | 61 443 |
| | | | | | | 659 |
| | Összesen: | | | | | -958 |
| 2013.12.31-én: | TRY | -400 | | -40 393 | | -40 393 |
| | HUF | 42 900 | | 42 882 | | 42 882 |
| | | | | | | 2 490 |
| | HUF | -151 200 | | -151 137 | | -151 137 |
| | TRY | 1 400 | | 141 374 | | 141 374 |
| | | | | | | -9 763 |
| | TRY | -500 | | -50 491 | | -50 491 |
| | HUF | 52 071 | | 52 049 | | 52 049 |
| | | | | | | 1 558 |
| | EUR | -200 | | -59 380 | | -59 380 |
| | USD | 268 | | 57 887 | | 57 887 |
| | | | | | | -1 493 |
| | EUR | -1 425 | | -423 082 | | -423 082 |
| | USD | 1 924 | | 414 911 | | 414 911 |
| | | | | | | -8 171 |
| | | | | | | -15 379 |

| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|---|--|---------------------------|---------------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 0 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | 0 | -78 574 116 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 0 | -78 574 116 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 0 | 290 072 789 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | adatok ezer Ft-ban | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 659 084 | 981 359 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 465 189 | 814 614 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 29 934 | 34 991 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 20 222 | 32 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 143 739 | 131 722 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Afrika Részvény Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. december 21.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,570,867,567 | 1.075310 |
| 2013.02.28 | 1,635,203,330 | 1.118053 |
| 2013.03.28 | 1,714,042,964 | 1.153635 |
| 2013.04.30 | 1,715,125,069 | 1.102301 |
| 2013.05.31 | 1,931,654,451 | 1.120051 |
| 2013.06.28 | 1,792,961,774 | 1.017848 |
| 2013.07.31 | 1,872,655,070 | 1.080849 |
| 2013.08.30 | 1,894,869,855 | 1.085084 |
| 2013.09.30 | 1,922,906,861 | 1.112068 |
| 2013.10.31 | 1,949,350,800 | 1.128347 |
| 2013.11.29 | 1,952,457,969 | 1.126620 |
| 2013.12.31 | 1,943,631,192 | 1.119843 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszaki nyitó befektetési jegy állománya (db) 135,191,941

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| "A" sorozat (névérték 1 Ft) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 15 461 374 | 11 404 938 |
| 2013.február | 9 543 430 | 12 083 716 |
| 2013.március | 38 054 184 | 8 284 353 |
| 2013.április | 60 317 340 | 617 933 |
| 2013.május | 179 937 167 | 15 410 217 |
| 2013.június | 40 457 837 | 39 736 426 |
| 2013.július | 52 965 138 | 52 320 164 |
| 2013.augusztus | 18 117 634 | 8 356 515 |
| 2013.szeptember | 39 169 767 | 18 449 545 |
| 2013.október | 4 570 617 | 6 407 031 |
| 2013.november | 4 921 325 | 1 977 262 |
| 2013.december | 4 956 139 | 14 245 942 |
| Összesen: | 468 471 952 | 189 294 042 |

| "C" sorozat (névérték 1 EUR) | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 6 315 | 13 227 |
| 2013.február | 14 769 | 1 019 |
| 2013.március | 16 180 | 6 299 |
| 2013.április | 7 859 | 3 745 |
| 2013.május | 7 350 | 13 398 |
| 2013.június | 871 | 621 |
| 2013.július | 1 365 | 599 |
| 2013.szeptember | 3 957 | 1 365 |
| 2013.október | 2 715 | 5 842 |
| 2013.november | 829 | 0 |
| 2013.december | 0 | 3 043 |
| Összesen: | 62 210 | 49 158 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 417,283,937

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 1,068,440,411 | 0.912829 |
| 2012/12/28 | 1,371,903,376 | 1.086331 |
| 2013/12/31 | 1,943,631,192 | 1.119843 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Afrika Részvény Alap célja, hogy a hosszabb távra rendelkezésre álló pénzeszközök számára rugalmas, bármikor hozzáférhető, az afrikai kontinens részvénypiacainak teljesítményéből részesedő befektetési lehetőséget nyújtson.

Az alap vagyona 2013-ban az év elejei 1,37 milliárd forintról 1,94 milliárd forintra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 2,92% lett.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 28 | 24 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 2 543 | 3 804 | 0,19% | |
| OTP Bank Nyrt. USD folyószámla | | 824 | 6 478 | 0,33% | |
| OTP Bank Nyrt. GBP folyószámla | | 6 | 2 727 | 0,14% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 110 465 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. USD 2013.12.30 - 2014.01.06 | | 0 | 64 701 | 3,30% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 113 866 | 77 734 | 3,96% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 38 904 | | 86 775 | 4,42% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 26 581 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 12 323 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 12 622 | 0,64% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 74 153 | 3,78% |
| Kötvények: | | 59 307 | | 58 811 | 3,00% |
| OTPHB VAR 49-16 2006.11.07 - 2016.11.07 | | 59 307 | | 58 811 | 3,00% |
| Külföldi részvények: | | 1 175 916 | | 1 702 115 | 86,68% |
| ABSA GROUP | | 8 618 | | 0 | 0,00% |
| ACCESS BANK NIGERIA | | 22 469 | | 0 | 0,00% |
| AFREN | | 12 766 | | 49 740 | 2,53% |
| AFRICA PRUDENTIAL REGISTRARS | | 0 | | 1 002 | 0,05% |
| AFRICAN MINERALS LTD | | 0 | | 15 560 | 0,79% |
| AFRICAN RAINBOW | | 33 128 | | 17 150 | 0,87% |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | | 0 | | 6 903 | 0,35% |
| ATTIJARIWABA BANK | | 41 558 | | 38 216 | 1,95% |
| A VENG | | 8 310 | | 16 469 | 0,84% |
| BANQUE CENTRALE POPULAIRE | | 0 | | 18 898 | 0,96% |
| BANQUE MAROCAINE | | 11 970 | | 15 384 | 0,78% |
| BARCLAYS AFRICA GROUP LTD | | 0 | | 10 926 | 0,56% |
| COMM INTL BANK EGYPT | | 53 263 | | 61 923 | 3,15% |
| DANGOTE CEMENT PLC | | 0 | | 15 575 | 0,79% |
| DIAMOND BANK | | 28 558 | | 8 334 | 0,42% |
| EAST AFRICAN BREWERIES LTD | | 0 | | 20 253 | 1,03% |
| COBANK TRANSNATIONAL INC | | 0 | | 8 907 | 0,45% |
| EFG-HERMES | | 10 757 | | 9 184 | 0,47% |
| EGYPTIAN KUWAITI HOLDING | | 14 681 | | 10 189 | 0,52% |
| EQUITY BANK LTD | | 12 097 | | 11 785 | 0,60% |
| FBN HOLDINGS PLC | | 49 872 | | 64 247 | 3,27% |
| FIRST QUANTUM MINERALS | | 36 127 | | 133 496 | 6,80% |
| FIRSTSTRAND | | 0 | | 20 852 | 1,06% |
| FOSCHINI | | 0 | | 23 274 | 1,19% |
| GB AUTO | | 19 158 | | 22 300 | 1,14% |
| GLOBAL TELECOM HOLDING - GDR | | 0 | | 35 778 | 1,82% |
| GUARANTY TRUST BANK | | 41 218 | | 46 549 | 2,37% |
| HIKMA PHARMACEUTICALS | | 10 277 | | 16 282 | 0,83% |
| HOUSING FINANCE | | 7 677 | | 0 | 0,00% |
| IMPALA PLATINUM | | 36 221 | | 11 818 | 0,60% |
| KOZA METAL | | 0 | | 11 989 | 0,61% |
| LUKOIL ADR | | 0 | | 13 517 | 0,69% |
| MAROC TELECOM | | 17 187 | | 15 652 | 0,80% |
| MTN GROUP | | 92 210 | | 83 312 | 4,24% |

| | | | |
|---|----------------------|----------------------|-----------------|
| NASPERS | 38 074 | 92 255 | 4,70% |
| NEVSUN RESOURCES LTD | 0 | 22 313 | 1,14% |
| NIGERIAN BREWERIES | 48 133 | 36 982 | 1,88% |
| NSGB | 2 657 | 0 | 0,00% |
| OLD MUTUAL | 63 128 | 170 668 | 8,69% |
| ORASCOM CONSTRUCTION | 65 271 | 0 | 0,00% |
| ORASCOM TELECOM - GDR | 34 332 | 0 | 0,00% |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 22 913 | 0 | 0,00% |
| RANDGOLD RESOURCES | 35 525 | 17 002 | 0,87% |
| RANDGOLD RESOURCES ADR | 0 | 38 390 | 1,96% |
| REMGRO LTD | 0 | 5 973 | 0,30% |
| SASOL | 32 964 | 58 095 | 2,96% |
| SEMAFO | 0 | 24 249 | 1,23% |
| SIX OF OCTOBER | 12 580 | 0 | 0,00% |
| STANDARD BANK GROUP | 13 641 | 28 191 | 1,44% |
| SUBSEA 7 SA | 20 970 | 78 816 | 4,01% |
| TALAAAT MOUSTAFA | 25 055 | 15 051 | 0,77% |
| TELECOM EGYPT | 13 887 | 18 285 | 0,93% |
| TULLOW OIL | 74 168 | 118 504 | 6,04% |
| UBA CAPITAL PLC | 0 | 1 875 | 0,10% |
| UNITED BANK FOR AFRICA | 23 445 | 32 332 | 1,65% |
| VERIPOS INC | 347 | 3 218 | 0,16% |
| WOOLWORTHS | 15 974 | 13 282 | 0,68% |
| ZENITH BANK | 64 730 | 91 170 | 4,64% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | 1 274 127 | 0 1 847 701 | 0 94,10% |
| Egyéb eszközök | | | |
| Követelések | 0 | 38 548 | 1,96% |
| Aktív időbeli elhatárolások | 623 | 858 | 0,04% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | 1 419 | -1 253 | -0,06% |
| Egyéb eszközök összesen: | 2 042 | 38 153 | 1,94% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | 1 390 035 | 1 963 588 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | |
| A lapkezelői díj miatt | 1 178 | 1 800 | 6,89% |
| Letétkezelői díj miatt | 0 | 975 | 3,73% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | 83 | 412 | 1,58% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | 3 378 | 2 934 | 11,23% |
| 4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás: | 11 497 | 19 997 | 76,57% |
| Kötelezettségek összesen: | 16 136 | 26 118 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | 1 373 899 | 1 937 470 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | 1 266 928 127 | 1 736 765 228 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | 1,08443271 | 1,11556289 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő jegyek teljes névértéke Ft-ban | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|---|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 1 463 791 410 | | 1,075310 |
| 2013. február 28. | 1 465 046 124 | | 1,118053 |
| 2013. március 28. | 1 497 543 111 | | 1,153635 |
| 2013. április 30. | 1 558 377 982 | | 1,102301 |
| 2013. május 31. | 1 728 914 624 | | 1,120051 |
| 2013. június 28. | 1 734 525 998 | | 1,017848 |
| 2013. július 31. | 1 735 382 388 | | 1,080849 |
| 2013. augusztus 30. | 1 749 228 492 | | 1,085084 |
| 2013. szeptember 30. | 1 733 210 329 | | 1,112068 |
| 2013. október 31. | 1 732 800 312 | | 1,128347 |
| 2013. november 29. | 1 735 973 179 | | 1,126620 |
| 2013. december 31. | 1 736 765 228 | 1 937 470 844 | 1,115563 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Afrika Részvény Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| Az Alap értékpapír portfóliójának összetételével kapcsolatos további adatok (2011.évi CXCVIII. törvény 6.melléklet): | | | | |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 274 127 | 100,00% | 1 847 701 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 38 904 | 3,05% | 86 775 | 4,70% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 98 211 | 7,71% | 145 586 | 7,88% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|-----------------------------------|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 111 916 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -39 383 |
| d) | a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 972 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | -4 047 |
| | bankköltség: | | -268 |
| | felügyeleti díj: | | -450 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -4 924 |
| f) | nettó jövedelem: | | 60 872 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 60 872 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 519 358 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -16 659 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | 180 | -51 422 | 52 418 | -50 999 | 1 419 |
| | Összesen: | | | | | 1 419 |
| 2013.12.31-én: | EUR | 53 447 | -180 | 53 425 | -53 442 | -17 |
| | USD | 2 500 | -244 | 51 289 | -52 525 | -1 237 |
| | Összesen: | | | | | -1 253 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | c. | d. |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | 127 897 | 246 062 |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | 90 890 | 134 146 |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | 2 | 0 |
| 04. | IV. | Működési költségek | 27 330 | 46 412 |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | 9 | 4 632 |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | 9 670 | 60 872 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Prémium Klasszikus Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2006. december 13.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 3,205,132,390 | 1.666846 |
| 2013.02.28 | 3,337,606,763 | 1.685686 |
| 2013.03.28 | 3,441,512,332 | 1.698439 |
| 2013.04.30 | 3,557,864,664 | 1.704379 |
| 2013.05.31 | 3,781,155,659 | 1.717161 |
| 2013.06.28 | 4,134,961,775 | 1.715241 |
| 2013.07.31 | 4,730,118,599 | 1.722653 |
| 2013.08.30 | 5,168,781,456 | 1.727280 |
| 2013.09.30 | 5,591,760,368 | 1.733129 |
| 2013.10.31 | 5,727,553,423 | 1.730703 |
| 2013.11.29 | 6,181,080,050 | 1.748734 |
| 2013.12.31 | 6,573,435,019 | 1.734573 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,847,747,793

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 88 661 600 | 16 386 905 |
| 2013.február | 84 076 134 | 27 618 810 |
| 2013.március | 67 654 938 | 37 849 977 |
| 2013.április | 116 230 086 | 33 477 508 |
| 2013.május | 163 669 262 | 12 331 540 |
| 2013.június | 258 586 383 | 54 252 386 |
| 2013.július | 416 774 109 | 79 607 425 |
| 2013.augusztus | 271 632 398 | 42 731 510 |
| 2013.szeptember | 283 385 461 | 59 506 517 |
| 2013.október | 198 554 870 | 126 109 599 |
| 2013.november | 311 514 524 | 51 392 863 |
| 2013.december | 355 600 939 | 83 619 122 |
| Összesen: | 2 616 340 704 | 624 884 162 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 3,789,656,025

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2006/12/29 | 488,885,586 | 1.003895 |
| 2007/12/28 | 10,094,731,407 | 1.059526 |
| 2008/12/31 | 3,438,944,087 | 1.065367 |
| 2009/12/31 | 2,604,337,182 | 1.315490 |
| 2010/12/31 | 3,451,454,064 | 1.438435 |
| 2011/12/30 | 2,820,491,410 | 1.484783 |
| 2012/12/28 | 3,062,787,448 | 1.657579 |
| 2013/12/31 | 6,573,435,019 | 1.734573 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az alap befektetési politikáját alapvetően meghatározza, hogy egy alapok alapja konstrukció. Eszközei között – a szükséges likviditást biztosító rövid papírokon kívül – csak a Tájékoztatóban megjelölt befektetési jegyeket tartja az alábbi megcélzott összetételben: 20% pénzügyi eszközök, 55% kötvény alapok, 20% abszolút hozam alapok, 5% árupiaci alapok.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 3,06 milliárdról 6,57 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 4,64% lett.

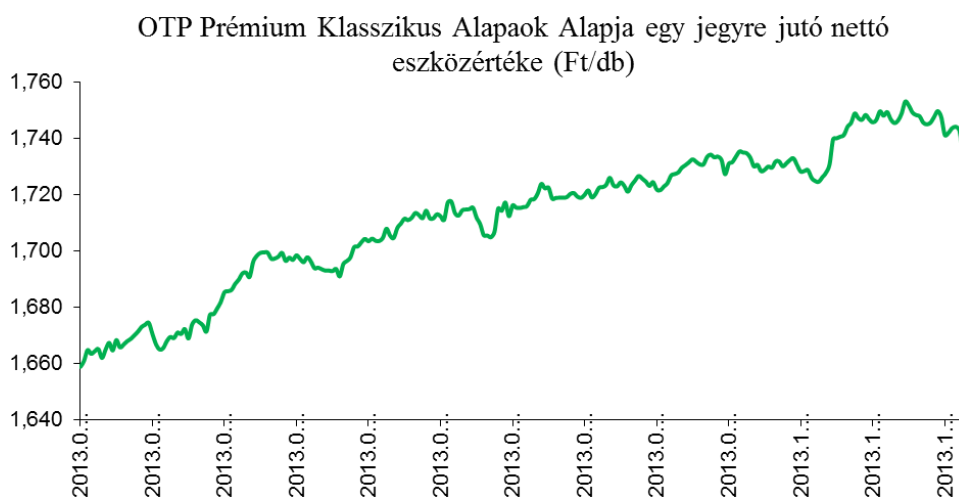
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | | | | | |
| Lekötési idő | | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 27 | 21 | | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 27 | 21 | | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | | 191 932 | | 1 094 058 | 16,26% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 122 471 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 69 461 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 419 135 | 6,23% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 674 923 | 10,03% |
| Befektetési jegyek: | | | 2 889 448 | | 5 636 603 | 83,74% |
| OTP ABSZOLÚT HOZAM B | | | 118 561 | | 0 | 0,00% |
| OTP EMDA | | | 109 286 | | 257 398 | 3,82% |
| OTP EMEA | | | 227 602 | | 164 922 | 2,45% |
| OTP FÖLD KINCSEI A | | | 87 479 | | 189 176 | 2,81% |
| OTP GI0 EURÓ A | | | 147 091 | | 201 644 | 3,00% |
| OTP MAXIMA | | | 122 318 | | 280 153 | 4,16% |
| OTP OPTIMA | | | 1 389 115 | | 2 953 089 | 43,88% |
| OTP OROSZ RÉSZVÉNY B | | | 48 699 | | 109 949 | 1,63% |
| OTP PALETTA | | | 78 931 | | 316 569 | 4,70% |
| OTP PÉNZPIACI | | | 288 787 | | 380 396 | 5,65% |
| OTP SUPRA | | | 114 775 | | 224 420 | 3,33% |
| OTP TÖRÖK RÉSZVÉNY B SOROZAT | | | 0 | | 109 406 | 1,63% |
| OTP ÚJ EURÓPA A | | | 156 804 | | 449 481 | 6,68% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 3 081 380 | 0 | 6 730 661 | 100,00% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 3 081 407 | | 6 730 682 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 1 282 | | 3 077 | 5,29% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 756 | 1,30% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 186 | | 374 | 0,64% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 4 898 | | 53 973 | 92,77% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 6 366 | | 58 180 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 3 075 041 | | 6 672 502 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 1 855 201 264 | | 3 846 657 806 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 1,65752455 | | 1,73462324 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 1 927 475 959 | | 1,666846 |
| 2013. február 28. | 1 983 933 283 | | 1,685686 |
| 2013. március 28. | 2 013 738 244 | | 1,698439 |
| 2013. április 30. | 2 096 490 822 | | 1,704379 |
| 2013. május 31. | 2 247 828 544 | | 1,717161 |
| 2013. június 28. | 2 452 162 541 | | 1,715241 |
| 2013. július 31. | 2 789 329 225 | | 1,722653 |
| 2013. augusztus 30. | 3 018 230 113 | | 1,727280 |
| 2013. szeptember 30. | 3 242 109 057 | | 1,733129 |
| 2013. október 31. | 3 314 554 328 | | 1,730703 |
| 2013. november 29. | 3 574 675 989 | | 1,748734 |
| 2013. december 31. | 3 846 657 806 | 6 672 502 020 | 1,734623 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 3 081 380 | 100,00% | 6 730 661 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 191 932 | 6,23% | 1 094 058 | 16,25% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 191 932 | 6,23% | 1 094 058 | 16,25% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 78 885 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -22 469 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 377 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -92 |
| | felügyeleti díj: | -1 115 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -354 |
| f) | nettó jövedelem: | 53 478 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 53 478 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 3 431 454 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 112 529 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 122 777 | 78 885 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 1 322 | 0 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 15 029 | 25 404 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 1 | 3 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 106 425 | 53 478 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Prémium Kiegyensúlyozott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2006. december 13.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,462,931,392 | 1.343336 |
| 2013.02.28 | 1,505,172,580 | 1.365749 |
| 2013.03.28 | 1,541,131,118 | 1.383669 |
| 2013.04.30 | 1,550,441,757 | 1.372928 |
| 2013.05.31 | 1,584,998,962 | 1.381192 |
| 2013.06.28 | 1,570,469,100 | 1.341956 |
| 2013.07.31 | 1,645,940,485 | 1.359042 |
| 2013.08.30 | 1,707,636,547 | 1.352834 |
| 2013.09.30 | 1,770,068,131 | 1.381581 |
| 2013.10.31 | 1,805,965,669 | 1.387725 |
| 2013.11.29 | 1,985,919,558 | 1.407581 |
| 2013.12.31 | 2,094,032,036 | 1.377809 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 1,057,966,227

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 42 337 194 | 8 773 337 |
| 2013.február | 15 938 733 | 8 821 331 |
| 2013.március | 21 922 760 | 7 459 570 |
| 2013.április | 31 259 073 | 20 659 901 |
| 2013.május | 40 326 686 | 8 926 882 |
| 2013.június | 44 399 888 | 30 477 140 |
| 2013.július | 104 252 678 | 55 781 584 |
| 2013.augusztus | 71 840 727 | 14 765 591 |
| 2013.szeptember | 26 540 134 | 21 407 991 |
| 2013.október | 50 301 501 | 22 447 796 |
| 2013.november | 153 615 461 | 25 854 874 |
| 2013.december | 130 378 996 | 27 468 204 |
| Összesen: | 733 113 831 | 252 844 201 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 1,519,827,237

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2006/12/29 | 674,528,433 | 1.008691 |
| 2007/12/28 | 4,303,736,522 | 1.053519 |
| 2008/12/31 | 2,149,872,320 | 0.784106 |
| 2009/12/31 | 2,349,894,763 | 1.074390 |
| 2010/12/31 | 2,203,382,132 | 1.223079 |
| 2011/12/30 | 1,630,708,460 | 1.156976 |
| 2012/12/28 | 1,407,260,806 | 1.330157 |
| 2013/12/31 | 2,094,032,036 | 1.377809 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az alap befektetési politikáját alapvetően meghatározza, hogy egy alapok alapja konstrukció. Eszközei között – a szükséges likviditást biztosító rövid papírokon kívül – csak a Tájékoztatóban megjelölt befektetési jegyeket tartja az alábbi megcélzott összetételben: 5% pénzüpiaci alapok, 25% kötvény alapok, 20% abszolút hozam alapok, 5% árupiaci alapok, 45% részvényalapok.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 1,41 milliárdról 2,09 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 3,58% lett.

3. Vagyonkimutatás

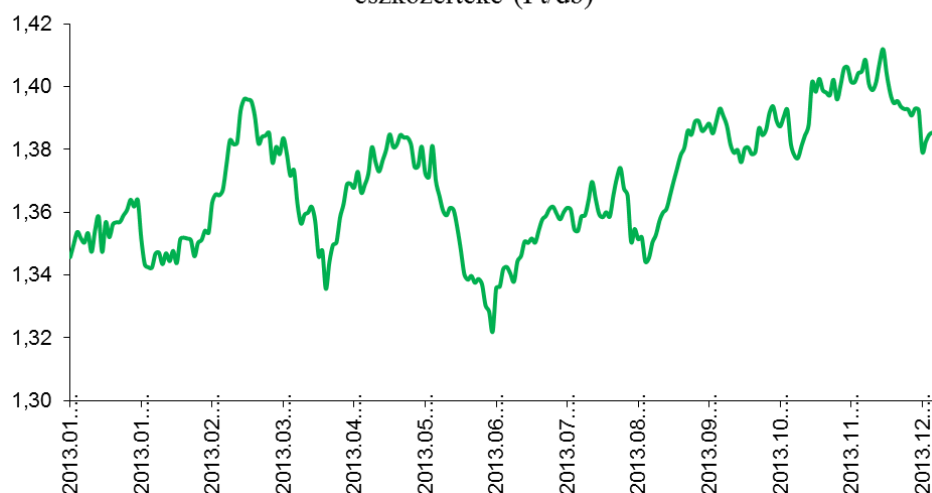
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 25 | 30 | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 25 | 30 | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 65 955 | | 408 634 | 18,93% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 53 453 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 12 502 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 121 509 | 5,63% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 287 125 | 13,30% |
| Befektetési jegyek: | | 1 348 948 | | 1 750 006 | 81,07% |
| OTP ABSZOLÚT HOZAM B | | 50 729 | | 0 | 0,00% |
| OTP AFRIKA RÉSZVÉNY B | | 43 023 | | 63 443 | 2,94% |
| OTP BUX ETF ALAP | | 47 950 | | 56 531 | 2,62% |
| OTP EMDA | | 55 991 | | 78 150 | 3,62% |
| OTP EMEA | | 144 762 | | 83 353 | 3,86% |
| OTP FÖLD KINCSEI A | | 30 302 | | 50 776 | 2,35% |
| OTP GIO EURÓ A | | 40 696 | | 60 450 | 2,80% |
| OTP II. ZK FELTÖREKŐ PIACI RV | | 157 191 | | 0 | 0,00% |
| OTP KLÍMA VÁLTOZÁS A | | 20 205 | | 32 439 | 1,50% |
| OTP MAXIMA | | 87 918 | | 124 831 | 5,78% |
| OTP OMEGA A | | 28 677 | | 0 | 0,00% |
| OTP OPTIMA | | 57 817 | | 145 355 | 6,74% |
| OTP OROSZ RÉSZVÉNY B | | 129 542 | | 149 932 | 6,95% |
| OTP PALETTA | | 57 344 | | 102 824 | 4,76% |
| OTP PÉNZPIACI | | 64 | | 66 | 0,00% |
| OTP QUALITY | | 85 857 | | 100 205 | 4,64% |
| OTP SUPRA | | 57 545 | | 82 730 | 3,83% |
| OTP TÖRÖK RÉSZVÉNY B | | 43 491 | | 124 653 | 5,78% |
| OTP ÚJ EURÓPA A | | 153 069 | | 207 049 | 9,59% |
| OTP ZK FEJLETT PIACI RV | | 56 775 | | 0 | 0,00% |
| ACATIS-GLOBAL | | 0 | | 123 490 | 5,72% |
| FIDELITY FAST EM Y CLASS | | 0 | | 163 729 | 7,59% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 1 414 903 | 0 | 2 158 640 | 100,00% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 0 | | 0 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 1 414 928 | | 2 158 670 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 707 | | 1 292 | 3,85% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 241 | 0,72% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 86 | | 119 | 0,35% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 1 532 | | 31 933 | 95,08% |
| Kötelezettségek összesen: | | 2 325 | | 33 585 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 1 412 603 | | 2 125 085 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | | |
| | | 1 062 035 178 | | 1 542 304 808 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | | | |
| | | 1,330090 | | 1,377863 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 1 095 599 035 | | 1,343336 |
| 2013. február 28. | 1 102 716 437 | | 1,365749 |
| 2013. március 28. | 1 117 179 627 | | 1,383669 |
| 2013. április 30. | 1 127 778 799 | | 1,372928 |
| 2013. május 31. | 1 159 178 603 | | 1,381192 |
| 2013. június 28. | 1 173 101 351 | | 1,341956 |
| 2013. július 31. | 1 221 572 445 | | 1,359042 |
| 2013. augusztus 30. | 1 278 647 581 | | 1,352834 |
| 2013. szeptember 30. | 1 283 779 724 | | 1,381581 |
| 2013. október 31. | 1 311 633 429 | | 1,387725 |
| 2013. november 29. | 1 439 394 016 | | 1,407581 |
| 2013. december 31. | 1 542 304 808 | 2 125 084 754 | 1,377863 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Prémium Kiegyensúlyozott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 414 903 | 100,00% | 2 158 640 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 65 955 | 4,66% | 408 634 | 18,93% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 65 955 | 4,66% | 408 634 | 18,93% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 69 704 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -9 987 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -453 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -88 |
| | felügyeleti díj: | -414 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -241 |
| f) | nettó jövedelem: | 58 521 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 58 521 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 663 520 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -9 559 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 131 008 | 69 727 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 22 960 | 23 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 9 064 | 11 182 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 1 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 98 984 | 58 521 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Prémium Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. április 20.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,055,023,462 | 1.318012 |
| 2013.02.28 | 1,248,134,648 | 1.339637 |
| 2013.03.28 | 1,576,668,042 | 1.352974 |
| 2013.04.30 | 1,924,994,218 | 1.357234 |
| 2013.05.31 | 2,361,008,343 | 1.381971 |
| 2013.06.28 | 3,013,861,988 | 1.385454 |
| 2013.07.31 | 4,147,504,872 | 1.392841 |
| 2013.08.30 | 5,278,730,349 | 1.403156 |
| 2013.09.30 | 6,480,145,015 | 1.396492 |
| 2013.10.31 | 6,671,782,442 | 1.376516 |
| 2013.11.29 | 6,877,221,704 | 1.417415 |
| 2013.12.31 | 7,090,196,940 | 1.388423 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 790,087,134

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 45 791 371 | 28 874 606 |
| 2013.február | 130 924 381 | 5 094 727 |
| 2013.március | 260 380 624 | 8 631 286 |
| 2013.április | 280 737 234 | 21 020 240 |
| 2013.május | 349 282 043 | 18 731 134 |
| 2013.június | 481 048 288 | 28 679 895 |
| 2013.július | 1 129 922 793 | 198 227 144 |
| 2013.augusztus | 764 221 051 | 32 577 827 |
| 2013.szeptember | 847 920 853 | 24 500 726 |
| 2013.október | 325 532 396 | 169 592 311 |
| 2013.november | 303 630 909 | 247 787 164 |
| 2013.december | 556 276 483 | 288 099 305 |
| Összesen: | 5 475 668 426 | 1 071 816 365 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 5,106,653,893

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 399,118,628 | 1.188900 |
| 2012/12/28 | 1,032,462,685 | 1.306771 |
| 2013/12/31 | 7,090,196,940 | 1.388423 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Prémium Származtatott Alap az OTP Alapkezelő által kezelt, abszolút hozam alapokból összeállított portfóliójával lehetőséget teremt befektetőinek, hogy egyetlen alap megvásárlásával több abszolút hozamra törekvő stratégia hozamából részesedjenek. Mindezt persze az OTP Prémium Válogatás Alapok már jól ismert előnyei mellett, mint a diverzifikáció, illetve a költséghatékonyság.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 1,03 milliárdról 7,09 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 6,25% lett.

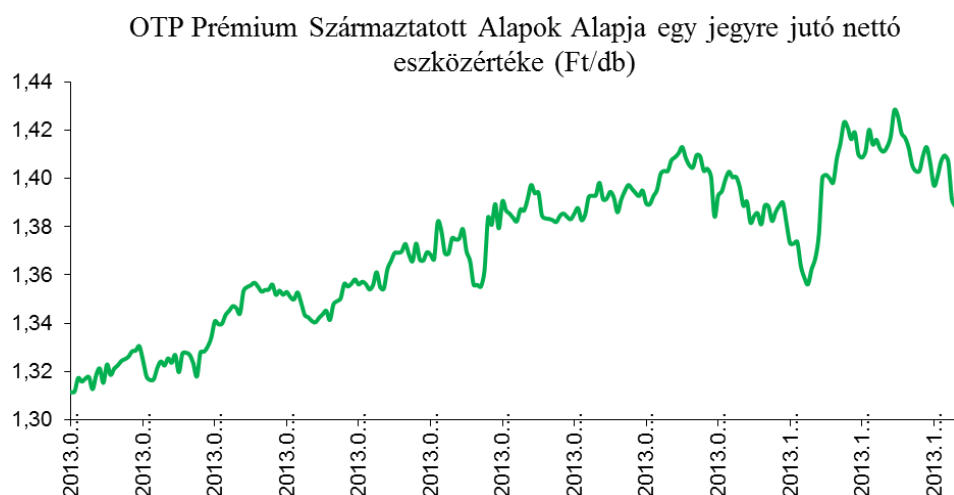
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 28 | 24 | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 28 | 24 | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 63 299 | | 611 741 | 8,39% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 53 363 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 9 936 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 179 895 | 2,47% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 431 846 | 5,92% |
| Befektetési jegyek: | | 974 526 | | 6 684 984 | 91,61% |
| OTP ABSZOLÚT HOZAM B | | 195 181 | | 0 | 0,00% |
| OTP EMDA | | 97 150 | | 715 224 | 9,80% |
| OTP FÖLD KINCSEI A | | 190 474 | | 1 494 283 | 20,48% |
| OTP GI0 EURÓ A | | 97 499 | | 730 574 | 10,01% |
| OTP SUPRA | | 197 136 | | 1 529 539 | 20,96% |
| OTP TREND A | | 0 | | 690 973 | 9,47% |
| OTP ÚJ EURÓPA A | | 197 086 | | 1 524 391 | 20,89% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 1 037 825 | 0 | 7 296 725 | 0 100,00% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | 0 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 1 037 853 | | 7 296 749 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 862 | 1,05% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | | 60 | 783 | 0,95% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 2 990 | | 80 678 | 98,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | 3 050 | | 82 323 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 1 034 803 | | 7 214 426 | |
| | | | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 791 870 382 | | 5 195 722 443 | |
| | | | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 1,30678268 | | 1,38853175 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) | |
|----------------------|--|------------------------------------|---|----------|
| 2013. január 31. | 808 787 147 | | 1,318012 | |
| 2013. február 28. | 934 616 801 | | 1,339637 | |
| 2013. március 28. | 1 186 366 139 | | 1,352974 | |
| 2013. április 30. | 1 446 083 133 | | 1,357234 | |
| 2013. május 31. | 1 776 634 042 | | 1,381971 | |
| 2013. június 28. | 2 229 002 435 | | 1,385454 | |
| 2013. július 31. | 3 160 698 084 | | 1,392841 | |
| 2013. augusztus 30. | 3 892 341 308 | | 1,403156 | |
| 2013. szeptember 30. | 4 715 761 435 | | 1,396492 | |
| 2013. október 31. | 4 871 701 520 | | 1,376516 | |
| 2013. november 29. | 4 927 545 265 | | 1,417415 | |
| 2013. december 31. | 5 195 722 443 | | 7 214 425 564 | 1,388532 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 037 825 | 100,00% | 7 296 725 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok: | 63 299 | 6,10% | 611 741 | 8,38% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 63 299 | 6,10% | 611 741 | 8,38% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 196 364 |
| b) | egyéb bevétel: | 49 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | 0 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -1 493 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -89 |
| | felügyeleti díj: | -933 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -471 |
| f) | nettó jövedelem: | 193 427 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 193 427 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 6 086 539 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -100 343 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 30 670 | 200 564 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 5 445 | 4 200 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 49 |
| 04. | IV. Működési költségek | 247 | 2 871 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 115 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 24 978 | 193 427 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Prémium Euró Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2006. december 13.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (EUR) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR) |
|------------|----------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,321,055 | 1.030976 |
| 2013.02.28 | 2,266,227 | 1.036345 |
| 2013.03.28 | 2,233,773 | 1.020864 |
| 2013.04.30 | 2,144,597 | 1.020785 |
| 2013.05.31 | 2,172,870 | 1.039393 |
| 2013.06.28 | 2,208,014 | 1.007516 |
| 2013.07.31 | 2,182,416 | 1.011668 |
| 2013.08.30 | 2,167,226 | 1.012934 |
| 2013.09.30 | 2,209,058 | 1.039590 |
| 2013.10.31 | 2,289,623 | 1.063772 |
| 2013.11.29 | 2,345,375 | 1.060597 |
| 2013.12.31 | 2,303,533 | 1.044775 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 2,289,084

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 28 415 | 62 703 |
| 2013.február | 15 826 | 83 872 |
| 2013.március | 9 718 | 11 229 |
| 2013.április | 47 312 | 139 683 |
| 2013.május | 13 636 | 36 914 |
| 2013.június | 154 012 | 32 060 |
| 2013.július | 62 772 | 96 775 |
| 2013.augusztus | 4 910 | 22 896 |
| 2013.szeptember | 0 | 19 496 |
| 2013.október | 69 233 | 32 227 |
| 2013.november | 83 480 | 19 340 |
| 2013.december | 35 517 | 40 046 |
| Összesen: | 524 831 | 597 241 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 2,204,813

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (EUR) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR) |
|----------------|------------------------------------|--|
| 2006/12/29 | 1,455,922 | 1.038556 |
| 2007/12/28 | 6,663,089 | 1.038994 |
| 2008/12/31 | 3,779,776 | 0.726603 |
| 2009/12/31 | 4,228,348 | 0.961268 |
| 2010/12/31 | 4,447,946 | 1.079039 |
| 2011/12/30 | 2,693,413 | 0.911310 |
| 2012/12/28 | 2,370,720 | 1.035663 |
| 2013/12/31 | 2,303,533 | 1.044775 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az alap befektetési politikáját alapvetően meghatározza, hogy egy alapok alapja konstrukció. Eszközei között – a szükséges likviditást biztosító rövid papírokon kívül – csak a Tájékoztatóban megjelölt 3-féle euró alapú befektetési jegyet tartja. Az alap 55%-át részvényalapok teszik ki, az alap portfóliójának 30%-át euró pénzpiaci alapok, míg 15%-át pedig abszolút hozam alapok alkotják mérsékelve ezzel az alap kockázatát.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 2,37 milliőről 2,30 millió euróra csökkent. Az OTP Prémium Euró Alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 0,88% lett.

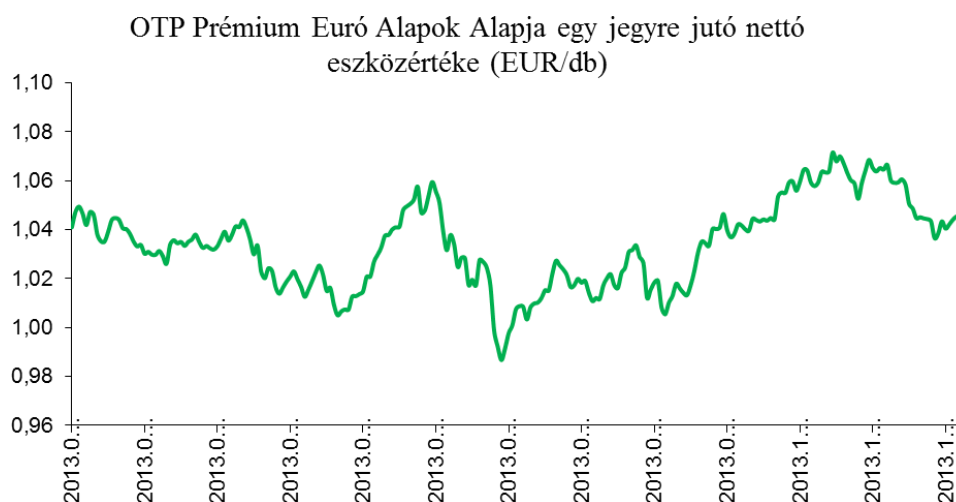
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 65 | 18 073 | 2,63% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.28 - 2013.01.02 | | 16 021 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 53 444 | 7,77% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 16 086 | 71 517 | 10,40% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Befektetési jegyek: | | 674 537 | 0 | 616 568 | 89,60% |
| OTP AFRIKA RÉSZVÉNY C | | 15 221 | | 11 601 | 1,68% |
| OTP EURÓ | | 139 429 | | 119 276 | 17,33% |
| OTP FÖLD KINCSEI B | | 0 | | 19 634 | 2,85% |
| OTP GI0 EURÓ B | | 67 984 | | 46 160 | 6,71% |
| OTP KLÍMAVÁLTOZÁS B | | 15 015 | | 14 025 | 2,04% |
| OTP KÖZÉP-EUI RÉSZVÉNY | | 201 777 | | 165 786 | 24,09% |
| OTP OMEGA B | | 28 946 | | 0 | 0,00% |
| OTP OROSZ RÉSZVÉNY C | | 36 035 | | 36 791 | 5,35% |
| OTP TÖRÖK RÉSZVÉNY C | | 20 975 | | 24 885 | 3,62% |
| OTP ÚJ EURÓPA B | | 84 866 | | 82 982 | 12,06% |
| OTP-PLANÉTA B SOROZAT | | 64 289 | | 0 | 0,00% |
| FIDELITY FAST EM Y CLASS | | 0 | | 68 469 | 9,95% |
| UBS IF - KEY SELECTION GLOBAL EQ | | 0 | | 26 959 | 3,92% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 674 537 | 0 | 616 568 | 89,60% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 293 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 1 | | 3 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 294 | | 3 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 690 917 | | 688 088 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 350 | | 350 | 73,38% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 84 | 17,61% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | 44 | | 43 | 9,01% |
| Kötelezettségek összesen: | | 394 | | 477 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 690 523 | | 687 611 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | | |
| | | 2 289 084 | | 2 216 674 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (EUR/jegy): | | | | | |
| | | 1,03559678 | | 1,04475867 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (EUR/db) | |
|----------------------|--|------------------------------------|--|----------|
| 2013. január 31. | 2 254 796 | | 1,030976 | |
| 2013. február 28. | 2 186 750 | | 1,036345 | |
| 2013. március 28. | 2 185 239 | | 1,020864 | |
| 2013. április 30. | 2 092 868 | | 1,020785 | |
| 2013. május 31. | 2 069 590 | | 1,039393 | |
| 2013. június 28. | 2 191 542 | | 1,007516 | |
| 2013. július 31. | 2 157 539 | | 1,011668 | |
| 2013. augusztus 30. | 2 139 553 | | 1,012934 | |
| 2013. szeptember 30. | 2 120 057 | | 1,039590 | |
| 2013. október 31. | 2 157 063 | | 1,063772 | |
| 2013. november 29. | 2 221 203 | | 1,060597 | |
| 2013. december 31. | 2 216 674 | | 687 610 718 | 1,044759 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 674 537 | 100,00% | 616 568 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 23 204 |
| b) | egyéb bevétel: | 3 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -4 007 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -165 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -42 |
| | felügyeleti díj: | -167 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -22 |
| f) | nettó jövedelem: | 18 804 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 18 804 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -7 658 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -14 058 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 239 614 | 96 585 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 162 346 | 73 381 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 10 | 3 |
| 04. | IV. Működési költségek | 4 674 | 4 382 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 7 | 21 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 72 597 | 18 804 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Prémium Növekedési Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2006. december 13.-tól határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 655,177,897 | 1.100800 |
| 2013.02.28 | 670,614,124 | 1.117483 |
| 2013.03.28 | 687,202,479 | 1.133349 |
| 2013.04.30 | 677,916,710 | 1.116172 |
| 2013.05.31 | 679,906,044 | 1.118493 |
| 2013.06.28 | 657,898,203 | 1.070098 |
| 2013.07.31 | 662,492,406 | 1.092408 |
| 2013.08.30 | 687,492,544 | 1.079419 |
| 2013.09.30 | 704,540,693 | 1.123970 |
| 2013.10.31 | 717,303,562 | 1.137071 |
| 2013.11.29 | 745,994,323 | 1.151508 |
| 2013.12.31 | 772,166,877 | 1.121796 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 599,274,700

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 14 256 618 | 13 972 002 |
| 2013.február | 10 729 264 | 3 131 837 |
| 2013.március | 15 480 123 | 11 708 740 |
| 2013.április | 9 011 392 | 9 579 504 |
| 2013.május | 11 339 071 | 14 465 041 |
| 2013.június | 19 774 234 | 5 957 776 |
| 2013.július | 35 442 170 | 33 827 282 |
| 2013.augusztus | 24 499 950 | 13 197 310 |
| 2013.szeptember | 17 084 286 | 21 092 802 |
| 2013.október | 17 873 066 | 9 250 011 |
| 2013.november | 17 813 160 | 5 415 874 |
| 2013.december | 55 588 198 | 3 984 109 |
| Összesen: | 248 891 532 | 145 582 288 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 688,331,042

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2006/12/29 | 346,573,213 | 1.000133 |
| 2007/12/28 | 1,528,937,078 | 1.044287 |
| 2008/12/31 | 781,714,149 | 0.677967 |
| 2009/12/31 | 1,011,687,190 | 0.940415 |
| 2010/12/31 | 952,824,873 | 1.072966 |
| 2011/12/30 | 704,937,063 | 0.952104 |
| 2012/12/28 | 648,635,733 | 1.082368 |
| 2013/12/31 | 772,166,877 | 1.121796 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az alap befektetési politikáját alapvetően meghatározza, hogy egy alapok alapja konstrukció. Eszközei között – a szükséges likviditást biztosító rövid papírokon kívül – csak a Tájékoztatóban megjelölt befektetési jegyeket tartja az alábbi megcélzott összetétellel: 5% pénzügyi alapok, 5% kötvény alapok, 15% abszolút hozam alapok, 75% részvényalapok.

Az alap vagyona 2013-ban az év eleji 0,65 milliárdról 0,77 milliárd Ft-ra nőtt. Az alap 2013. évi hozama az alapot terhelő költségek levonása után 3,64% lett.

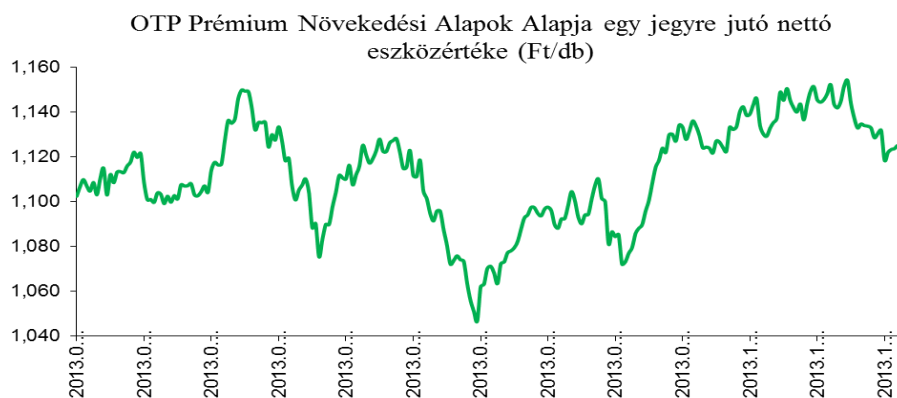
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 20 | 22 | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 20 | 22 | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 35 928 | | 125 571 | 16,00% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 17 684 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 18 244 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 63 933 | 8,15% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 61 638 | 7,85% |
| Befektetési jegyek: | | 613 871 | | 659 263 | 83,99% |
| OTP ABSZOLÚT HOZAM B | | 27 083 | | 0 | 0,00% |
| OTP AFRIKA RÉSZVÉNY B | | 28 386 | | 38 611 | 4,92% |
| OTP ÁZSIAI INGATLAN A | | 7 202 | | 7 624 | 0,97% |
| OTP BUX ETF ALAP | | 36 204 | | 38 235 | 4,87% |
| OTP EMEA | | 18 920 | | 13 723 | 1,75% |
| OTP II. ZK FELTÖREKVŐ PIACI RV | | 91 049 | | 0 | 0,00% |
| OTP KLÍMAVÁLTOZÁS A | | 25 143 | | 32 088 | 4,09% |
| OTP MAXIMA | | 16 160 | | 10 688 | 1,36% |
| OTP OMEGA A | | 22 410 | | 0 | 0,00% |
| OTP OROSZ RÉSZVÉNY B | | 111 251 | | 89 076 | 11,35% |
| OTP PALETTA | | 0 | | 30 309 | 3,86% |
| OTP QUALITY | | 65 080 | | 68 133 | 8,68% |
| OTP SUPRA | | 11 326 | | 11 595 | 1,48% |
| OTP TÖRÖK RÉSZVÉNY B | | 28 991 | | 68 294 | 8,70% |
| OTP ÚJ EURÓPA A | | 80 034 | | 91 161 | 11,61% |
| OTP ZK FEJLETT PIACI RV | | 44 632 | | 0 | 0,00% |
| ACATIS-GLOBAL | | 0 | | 82 327 | 10,49% |
| FIDELITY FAST EM Y CLASS | | 0 | | 77 399 | 9,86% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 649 799 | 0 | 784 834 | 0 |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 42 |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | | 0 |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | | 0 |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | | 42 |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 649 819 | | 784 898 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 378 | | 451 | 76,57% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 92 | 15,62% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | 40 | | 46 | 7,81% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 4 497 | | 0 | 0,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | 4 915 | | 589 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 644 904 | | 784 309 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 595 857 575 | | 699 166 819 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 1,08231216 | | 1,12177738 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 596 142 191 | | 1,100800 |
| 2013. február 28. | 603 739 618 | | 1,117483 |
| 2013. március 28. | 607 511 001 | | 1,133349 |
| 2013. április 30. | 606 942 889 | | 1,116172 |
| 2013. május 31. | 603 816 919 | | 1,118493 |
| 2013. június 28. | 617 633 377 | | 1,070098 |
| 2013. július 31. | 619 248 265 | | 1,092408 |
| 2013. augusztus 30. | 630 550 905 | | 1,079419 |
| 2013. szeptember 30. | 626 542 389 | | 1,123970 |
| 2013. október 31. | 635 165 444 | | 1,137071 |
| 2013. november 29. | 647 562 730 | | 1,151508 |
| 2013. december 31. | 699 166 819 | 784 309 522 | 1,121777 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 649 799 | 100,00% | 784 834 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 35 928 | 5,53% | 125 571 | 16,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 35 928 | 5,53% | 125 571 | 16,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 47 399 |
| b) | egyéb bevétel: | 2 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -4 827 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -179 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -85 |
| | felügyeleti díj: | -173 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | 0 |
| f) | nettó jövedelem: | 42 137 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 42 137 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 115 734 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -18 466 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

A beszámolási időszakban az Alapnak nem volt származtatott ügylete!

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| | | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 52 562 | 48 703 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 10 907 | 1 304 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 2 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 4 855 | 5 264 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 0 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 36 800 | 42 137 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Agrárpiaci Trend Fix I. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. áprilistól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,059,838,201 | 10542.997830 |
| 2013.02.28 | 2,064,977,283 | 10575.201433 |
| 2013.03.28 | 2,070,500,526 | 10641.253031 |
| 2013.04.30 | 2,078,978,920 | 10722.244732 |
| 2013.05.31 | 2,083,869,809 | 10756.012228 |
| 2013.06.28 | 2,073,899,373 | 10740.417172 |
| 2013.07.31 | 2,080,811,113 | 10811.879666 |
| 2013.08.30 | 2,088,176,992 | 10858.615914 |
| 2013.09.30 | 2,099,493,267 | 10923.879990 |
| 2013.10.31 | 2,103,063,356 | 10973.573197 |
| 2013.11.29 | 2,107,274,023 | 11022.402974 |
| 2013.12.31 | 2,090,529,113 | 11051.819986 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 195,759

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 98 | 426 |
| 2013.február | 68 | 234 |
| 2013.március | 11 | 703 |
| 2013.április | 23 | 702 |
| 2013.május | 46 | 200 |
| 2013.június | 0 | 663 |
| 2013.július | 12 | 633 |
| 2013.augusztus | 0 | 160 |
| 2013.szeptember | 22 | 125 |
| 2013.október | 0 | 545 |
| 2013.november | 27 | 494 |
| 2013.december | 37 | 2 061 |
| Összesen: | 344 | 6 946 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 189,157

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 1,915,914,873 | 9432.799997 |
| 2012/12/28 | 2,042,130,208 | 10431.858602 |
| 2013/12/31 | 2,090,529,113 | 11051.819986 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 áprilisában indult az OTP Agrárpiaci Trend Fix I. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy, a globális mezőgazdasági piacokat reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a mezőgazdasági termények, élőárak árfolyamváltozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

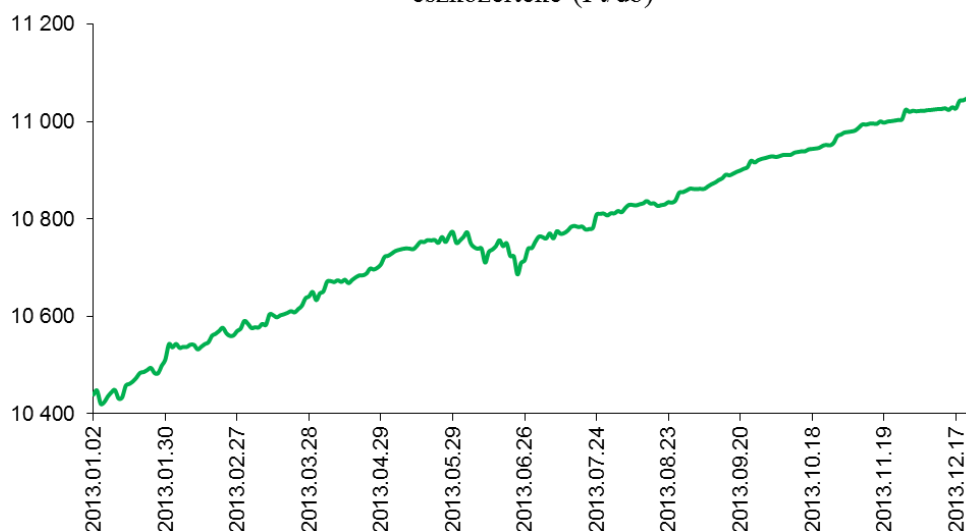
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 54 | 573 | 0,03% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 10 | 0 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.04.14 - 2014.12.01 | 1 500 000 | 1 500 000 | 71,60% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1 500 064 | 1 500 573 | 71,63% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 112 132 | | 0 | 0,00% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | 112 132 | | 0 | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 16 380 | | 46 506 | 2,22% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 12 325 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 4 055 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 70 | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 46 436 | 2,22% |
| Kötvények: | | 127 495 | | 142 754 | 6,82% |
| OTPHB FLOAT 03/15 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 127 495 | | 142 754 | 6,82% |
| Jelzáloglevelek: | | 41 786 | | 21 184 | 1,01% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - 2015.09.14 | 41 786 | | 21 184 | 1,01% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 297 793 | 0 | 210 444 | 10,05% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 8 458 | 5 225 | 0,25% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 240 969 | 378 603 | 18,07% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 249 427 | 383 828 | 18,32% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 043 284 | | 2 094 845 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 3 456 | 3 548 | 83,88% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 264 | 6,24% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | | 127 | 418 | 9,88% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 583 | 4 230 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 043 701 | | 2 090 615 | |
| | | | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 195 759 | | 189 157 | |
| | | | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 439,88 | | 11 052,27 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 195 431 | | 10 543,00 |
| 2013. február 28. | 195 265 | | 10 575,20 |
| 2013. március 28. | 194 573 | | 10 641,25 |
| 2013. április 30. | 193 894 | | 10 722,24 |
| 2013. május 31. | 193 740 | | 10 756,01 |
| 2013. június 28. | 193 077 | | 10 740,42 |
| 2013. július 31. | 192 456 | | 10 811,88 |
| 2013. augusztus 30. | 192 296 | | 10 858,62 |
| 2013. szeptember 30. | 192 193 | | 10 923,88 |
| 2013. október 31. | 191 648 | | 10 973,57 |
| 2013. november 29. | 191 181 | | 11 022,40 |
| 2013. december 31. | 189 157 | 2 090 614 597 | 11 052,27 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Agrárpiaaci Trend Fix I. Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 297 793 | 100,00% | 210 444 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 16 380 | 5,50% | 46 506 | 22,10% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 297 793 | 100,00% | 210 444 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 22 265 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -41 607 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -482 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -140 |
| | felügyeleti díj: | -520 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -419 |
| f) | nettó jövedelem: | -20 903 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -20 903 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -71 384 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 139 201 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|--|------------------|--|---------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -379 | 109 865 | -110 350 | 108 393 | -1 957 |
| | Összesen: | | | | | -1 957 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -377 | 114 497 | -111 775 | 112 942 | 1 167 |
| | | | | | | 1 167 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | 166 961 570 | 166 961 570 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | 9 978 463 | 0 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | -156 983 107 | -166 961 570 |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | | 406 800 000 | 436 074 000 |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | | -173 851 500 | -58 638 000 |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | | 232 948 500 | 377 436 000 |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | | 126 614 625 | 88 475 834 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---|------------------------|------------------------|--------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | Előző év | Tárgyév | |
| | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. I. Pénzügyi műveletek bevételei | 163 032 | 124 523 | |
| 02. II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 134 061 | 102 258 | |
| 03. III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. IV. Működési költségek | 40 418 | 43 035 | |
| 05. V. Egyéb ráfordítások | 157 | 133 | |
| 06. VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. IX. Tárgyévi eredmény | -11 604 | -20 903 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Agrárpiaci Trend Fix II. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. májustól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,641,563,666 | 10478.154342 |
| 2013.02.28 | 2,640,229,463 | 10502.523820 |
| 2013.03.28 | 2,654,953,567 | 10585.010753 |
| 2013.04.30 | 2,658,733,572 | 10644.514351 |
| 2013.05.31 | 2,658,746,871 | 10674.911654 |
| 2013.06.28 | 2,651,902,043 | 10680.233762 |
| 2013.07.31 | 2,656,487,905 | 10727.173227 |
| 2013.08.30 | 2,666,862,953 | 10771.461040 |
| 2013.09.30 | 2,678,268,936 | 10826.056469 |
| 2013.10.31 | 2,686,160,273 | 10871.357637 |
| 2013.11.29 | 2,683,494,620 | 10912.862116 |
| 2013.12.31 | 2,687,473,076 | 10942.613615 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 253,259

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 103 | 1 267 |
| 2013.február | 92 | 797 |
| 2013.március | 0 | 569 |
| 2013.április | 69 | 1 115 |
| 2013.május | 0 | 710 |
| 2013.június | 0 | 765 |
| 2013.július | 0 | 659 |
| 2013.augusztus | 218 | 273 |
| 2013.szeptember | 7 | 202 |
| 2013.október | 0 | 306 |
| 2013.november | 13 | 1 196 |
| 2013.december | 177 | 366 |
| Összesen: | 679 | 8 225 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 245,597

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2011/12/30 | 2,570,084,956 | 9566.702113 |
| 2012/12/28 | 2,639,599,142 | 10422.528487 |
| 2013/12/31 | 2,687,473,076 | 10942.613615 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 májusában indult az OTP Agrárpiaci Trend Fix II. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy, a globális mezőgazdasági piacokat reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a mezőgazdasági termények, élőárak árfolyamváltozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

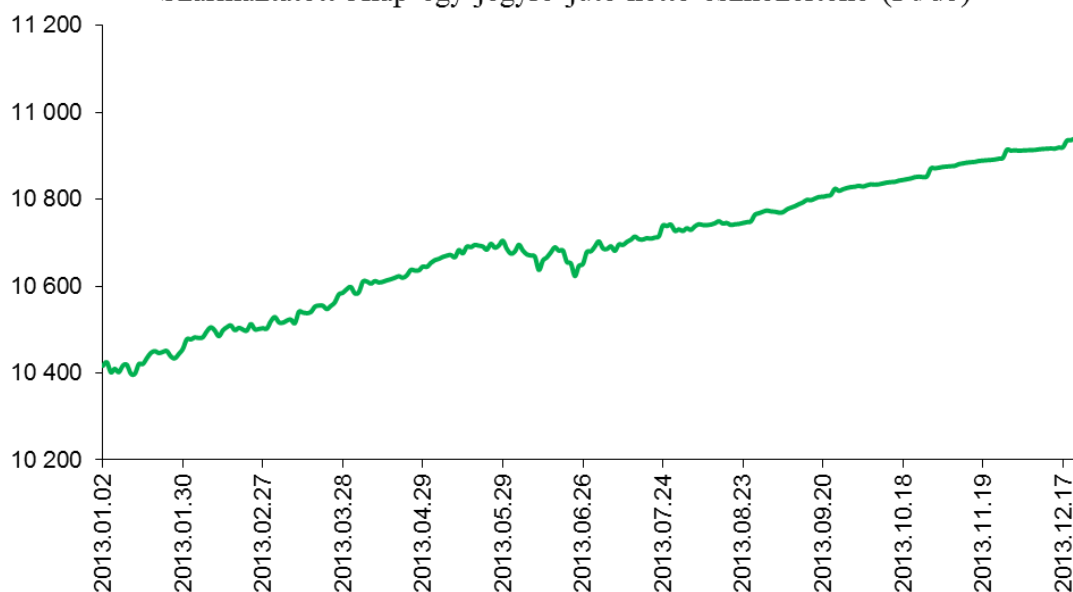
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | | | |
|--|--|--|--|---------------------------------------|--|--------------------------------------|--|------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | | |
| Bank | | | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | | 19 | | 28 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.06.01 - 2014.12.01 | | | | 200 000 | | 0 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.06.01 - 2014.12.01 | | | | 2 000 000 | | 2 000 000 | | 74,23% |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.06.01 - 2014.12.01 | | | | 0 | | 160 000 | | 5,94% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 2 200 019 | | 2 160 028 | | 80,17% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | | | Tőzsdei értékpapír | | Tőzsdei értékpapír | | |
| Államkötvények: | | | | 51 166 | | 0 | | 0,00% |
| 2015/A 2004.07.14 - 2015.02.12 | | | | 51 166 | | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | | | 48 214 | | 8 301 | | 0,31% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | | 48 214 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | | 0 | | 8 301 | | 0,31% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | | 99 380 | | 8 301 | | 0,31% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 12 406 | | 7 524 | | 0,28% |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 333 390 | | 518 432 | | 19,24% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 345 796 | | 525 956 | | 19,52% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | | 2 645 195 | | 2 694 285 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | | 4 244 | | 4 561 | | 84,65% |
| Letétkezelői díj miatt | | | | 0 | | 338 | | 6,27% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | | 164 | | 489 | | 9,08% |
| Kötelezettségek összesen: | | | | 4 408 | | 5 388 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | | 2 640 787 | | 2 688 897 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | 253 259 | | 245 713 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | | 10 427,22 | | 10 943,24 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 252 095 | | 10 478,15 |
| 2013. február 28. | 251 390 | | 10 502,52 |
| 2013. március 28. | 250 821 | | 10 585,01 |
| 2013. április 30. | 249 775 | | 10 644,51 |
| 2013. május 31. | 249 065 | | 10 674,91 |
| 2013. június 28. | 248 300 | | 10 680,23 |
| 2013. július 31. | 247 641 | | 10 727,17 |
| 2013. augusztus 30. | 247 586 | | 10 771,46 |
| 2013. szeptember 30. | 247 391 | | 10 826,06 |
| 2013. október 31. | 247 085 | | 10 871,36 |
| 2013. november 29. | 245 902 | | 10 912,86 |
| 2013. december 31. | 245 713 | 2 688 897 160 | 10 943,24 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Agrárpiaci Trend Fix II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 99 380 | 100,00% | 8 301 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 48 214 | 48,51% | 8 301 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 99 380 | 100,00% | 8 301 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|---|--------------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 2 026 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -53 084 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -615 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -73 |
| | felügyeleti díj: | -665 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -516 |
| f) | nettó jövedelem: | -52 927 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -52 927 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -80 183 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 181 220 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|---|--|---------------------------|---------------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 178 033 110 | 178 033 110 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 24 511 805 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -153 521 305 | -178 033 110 |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 563 860 000 | 604 434 600 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -254 982 200 | -86 002 400 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 308 877 800 | 518 432 200 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 181 358 222 | 129 764 554 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------------|-------------------------------|
| | | | | |
| | | | | adatok ezer Ft-ban |
| | A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 216 432 | 131 791 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 190 528 | 129 765 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 50 367 | 54 758 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 249 | 195 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | -24 712 | -52 927 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Aranygól Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. július 14.-től 2013. december 13.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 3,499,488,836 | 11171.588213 |
| 2013.02.28 | 3,511,149,011 | 11232.334093 |
| 2013.03.28 | 3,589,879,891 | 11507.426837 |
| 2013.04.30 | 3,598,552,234 | 11552.037938 |
| 2013.05.31 | 3,656,329,827 | 11756.952173 |
| 2013.06.28 | 3,666,066,965 | 11819.921863 |
| 2013.07.31 | 3,667,992,414 | 11895.741504 |
| 2013.08.30 | 3,691,098,351 | 11932.520022 |
| 2013.09.30 | 3,718,848,612 | 12013.259418 |
| 2013.10.31 | 3,721,768,631 | 12052.359556 |
| 2013.11.29 | 3,731,421,551 | 12109.068447 |
| 2013.12.31 | 2,553,652,546 | 12118.987951 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszaki nyitó befektetési jegy állománya (db) 313,885

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 92 | 839 |
| 2013.február | 165 | 770 |
| 2013.március | 25 | 806 |
| 2013.április | 280 | 500 |
| 2013.május | 98 | 697 |
| 2013.június | 12 | 845 |
| 2013.július | 1 493 | 2 291 |
| 2013.augusztus | 146 | 177 |
| 2013.szeptember | 397 | 366 |
| 2013.október | 90 | 652 |
| 2013.november | 40 | 689 |
| 2013.december | 280 | 105 523 |
| Összesen: | 3 118 | 114 155 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 210,715

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt 3 év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|------------------------|--|
| 2010/12/31 | 3,631,551,712 | 10,461.858511 |
| 2011/12/30 | 3,227,336,496 | 9865.487831 |
| 2012/12/28 | 3,375,060,293 | 10752.537691 |
| 2013/12/31 | 2,553,652,546 | 12118.987951 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2010 júliusában indult az OTP Aranygól Alap, mely tőkevédelem, illetve a lejáratkor esedékes 8%-os fix hozam mellett a 2010-es dél-afrikai labdarúgó-világbajnokságot szponzoráló vállalatok részvényeiből összeállított mögöttes részvénykosár teljesítményéből nyújt részesedési lehetőséget. Az alap futamideje 2013. december 13-án lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Aranygól Nyíltvégű Alap néven működik tovább**. Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 8%-os rögzített hozam illeti meg. Ezen felül az alap mögöttes eszközeinek teljesítménye további 13% extra hozam kifizetését is lehetővé tette, amely az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelte. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014. tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

3. Vagyonkimutatás:

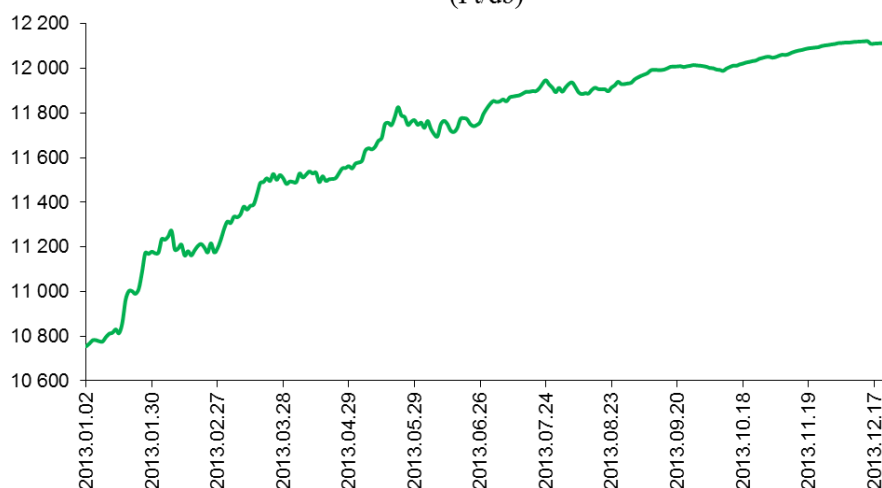
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 29 | 36 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.07.15 - 2013.12.13 | 1 950 000 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2010.07.06 - 2013.12.13 | 500 000 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.13 - 2014.01.03 | 0 | 570 000 | 21,18% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | 699 970 | 26,01% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 2 450 029 | 1 270 006 | 47,19% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 310 400 | | 257 613 | 9,57% |
| 2014/C | 2003.06.19 - 2014.02.12 | 310 400 | | 257 613 | 9,57% |
| MNB Kötvények: | | 57 501 | | 1 162 341 | 43,20% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 56 862 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 639 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 560 942 | 20,85% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 601 399 | 22,35% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 367 901 | 0 | 1 419 954 | 52,77% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 69 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 9 091 | 1 037 | 0,04% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 553 602 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 562 762 | 1 037 | 0,04% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 3 380 692 | | 2 690 997 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 4 830 | 4 629 | 1,98% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 449 | 0,19% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 208 | 547 | 0,23% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 074 | 228 530 | 97,60% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 6 112 | 234 155 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 3 374 580 | | 2 456 842 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 313 945 | | 202 908 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 748,95 | | 12 108,16 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma:

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 313 198 | | 11 171,59 |
| 2013. február 28. | 312 593 | | 11 232,33 |
| 2013. március 28. | 311 812 | | 11 507,43 |
| 2013. április 30. | 311 592 | | 11 552,04 |
| 2013. május 31. | 310 993 | | 11 756,95 |
| 2013. június 28. | 310 160 | | 11 819,92 |
| 2013. július 31. | 309 362 | | 11 895,74 |
| 2013. augusztus 30. | 309 331 | | 11 932,52 |
| 2013. szeptember 30. | 309 362 | | 12 013,26 |
| 2013. október 31. | 308 800 | | 12 052,36 |
| 2013. november 29. | 308 151 | | 12 109,07 |
| 2013. december 31. | 202 908 | 2 456 842 488 | 12 108,16 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Aranygól Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 367 901 | 100,00% | 1 419 954 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 57 501 | 15,63% | 1 162 341 | 81,86% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 367 901 | 100,00% | 1 419 954 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 1 051 775 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -65 068 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -834 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -75 |
| | felügyeleti díj: | -902 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -779 |
| f) | nettó jövedelem: | 984 117 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 984 117 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -1 341 526 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -560 329 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 274 422 890 | 0 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 119 942 270 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -154 480 620 | 0 |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 594 488 300 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -160 828 300 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 433 660 000 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 202 157 987 | 0 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 254 217 | 1 196 847 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 210 817 | 145 072 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 57 031 | 67 199 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 375 | 459 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -14 006 | 984 117 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Árupiaci Trend Fix I. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. januártól 2013. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,604,574,755 | 10711.375458 |
| 2013.02.28 | 1,607,082,793 | 10745.045920 |
| 2013.03.28 | 1,613,341,914 | 10794.111759 |
| 2013.04.30 | 1,621,511,119 | 10849.203588 |
| 2013.05.31 | 1,626,479,707 | 10892.504785 |
| 2013.06.28 | 1,628,180,325 | 10922.986214 |
| 2013.07.31 | 1,632,371,263 | 10960.587541 |
| 2013.08.30 | 1,635,347,620 | 10993.268441 |
| 2013.09.30 | 1,637,712,383 | 11019.535746 |
| 2013.10.31 | 1,632,493,086 | 11045.135289 |
| 2013.11.29 | 1,624,771,319 | 11012.188440 |
| 2013.12.31 | 1,187,186,033 | 11024.720785 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 150,212

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Viszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| 2013.január | 1 | 435 |
| 2013.február | 18 | 231 |
| 2013.március | 0 | 100 |
| 2013.április | 91 | 97 |
| 2013.május | 9 | 147 |
| 2013.június | 36 | 298 |
| 2013.július | 31 | 259 |
| 2013.augusztus | 0 | 72 |
| 2013.szeptember | 0 | 140 |
| 2013.október | 412 | 1 229 |
| 2013.november | 0 | 259 |
| 2013.december | 11 | 42 163 |
| Összesen: | 609 | 45 430 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 107,684

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 1,562,417,676 | 9850.439911 |
| 2012/12/28 | 1,596,612,216 | 10629.059037 |
| 2013/12/31 | 1,187,186,033 | 11024.720785 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 januárjában indult az OTP Árupiaci Trend Fix I. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy, a globális áru- és nyersanyag piacokat reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a mezőgazdasági termények, energiaipari nyersanyagok, ipari- és nemesfémek árfolyamváltozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége. Az alap futamideje 2013. december 2-án lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Árupiaci Nyíltvégű Alap néven működik tovább**. Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 7%-os rögzített hozam illeti meg, amely az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelte. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014 tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

3. Vagyonkimutatás

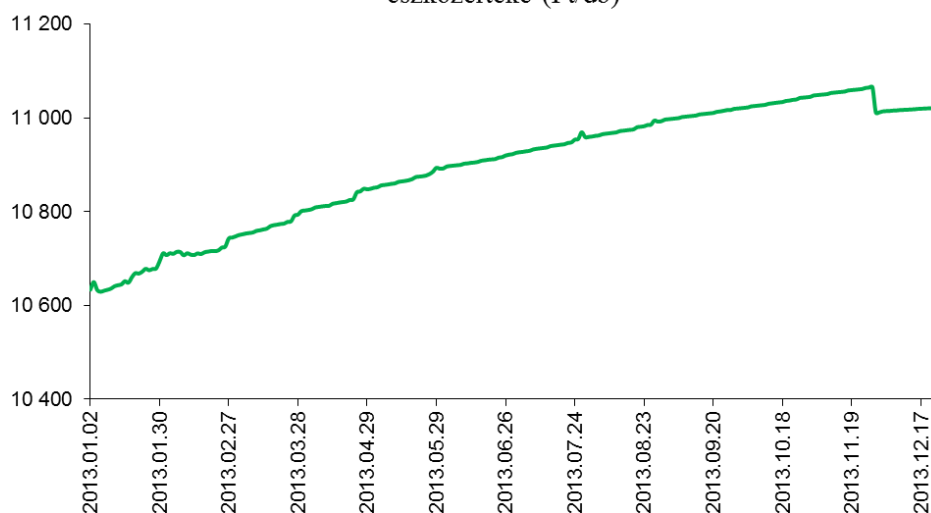
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|--|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 10 | | 25 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.02.02 - 2013.02.02 | | | 1 100 000 | | 0 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.02.02 - 2013.02.02 | | | 220 000 | | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. HUF 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | | 597 400 | | 48,63% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 320 010 | | 597 425 | | 48,63% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 36 515 | | 0 | | 0,00% |
| 2014/C 2003.06.19 - 2014.02.12 | | | 36 515 | | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | | 22 692 | | 630 539 | | 51,33% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | 22 692 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | | 282 225 | | 22,97% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | 0 | | 348 314 | | 28,36% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 59 207 | 0 | 630 539 | 0 | 51,33% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 7 603 | | 457 | 0,04% |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 214 123 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 221 726 | | 457 | | 0,04% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 1 600 943 | | 1 228 421 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 2 306 | | 2 322 | | 3,49% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 195 | | 0,29% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 100 | | 323 | | 0,49% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 062 | | 63 641 | | 95,73% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 468 | | 66 481 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 1 597 475 | | 1 161 940 | | |
| | | | | | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 150 212 | | 105 391 | | |
| | | | | | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 634,80 | | 11 025,04 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 149 778 | | 10 711,38 |
| 2013. február 28. | 149 565 | | 10 745,05 |
| 2013. március 28. | 149 465 | | 10 794,11 |
| 2013. április 30. | 149 459 | | 10 849,20 |
| 2013. május 31. | 149 321 | | 10 892,50 |
| 2013. június 28. | 149 059 | | 10 922,99 |
| 2013. július 31. | 148 831 | | 10 960,59 |
| 2013. augusztus 30. | 148 759 | | 10 993,27 |
| 2013. szeptember 30. | 148 619 | | 11 019,54 |
| 2013. október 31. | 147 802 | | 11 045,14 |
| 2013. november 29. | 147 543 | | 11 012,19 |
| 2013. december 31. | 105 391 | 1 161 939 991 | 11 025,04 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Árupiaci Trend Fix I. Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 59 207 | 100,00% | 630 539 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 22 692 | 38,33% | 630 539 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 59 207 | 100,00% | 630 539 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 307 928 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -31 739 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -366 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -74 |
| | felügyeleti díj: | -401 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -301 |
| f) | nettó jövedelem: | 275 047 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 275 047 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -493 495 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -217 087 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 117 101 373 | 0 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 11 237 823 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -105 863 550 | 0 |
| | | | |
| | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 291 362 280 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -88 476 960 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 202 885 320 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 111 042 800 | 79 913 167 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 128 494 | 387 841 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 115 941 | 79 913 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 27 312 | 32 804 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 58 | 77 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -14 817 | 275 047 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Árupiaci Trend Fix II. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. februártól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,809,632,422 | 10958.901356 |
| 2013.02.28 | 1,789,010,706 | 10860.524180 |
| 2013.03.28 | 1,816,629,945 | 11040.859776 |
| 2013.04.30 | 1,808,210,009 | 11021.302587 |
| 2013.05.31 | 1,799,461,916 | 10994.183047 |
| 2013.06.28 | 1,772,146,812 | 10851.495092 |
| 2013.07.31 | 1,785,253,468 | 10943.881296 |
| 2013.08.30 | 1,803,760,159 | 11074.505965 |
| 2013.09.30 | 1,801,306,149 | 11121.233247 |
| 2013.10.31 | 1,804,885,723 | 11144.640805 |
| 2013.11.29 | 1,795,922,095 | 11099.436321 |
| 2013.12.31 | 1,802,438,944 | 11163.031889 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 165,495

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 50 | 509 |
| 2013.február | 53 | 456 |
| 2013.március | 27 | 116 |
| 2013.április | 44 | 516 |
| 2013.május | 77 | 468 |
| 2013.június | 0 | 365 |
| 2013.július | 0 | 181 |
| 2013.augusztus | 1 | 304 |
| 2013.szeptember | 0 | 855 |
| 2013.október | 77 | 96 |
| 2013.november | 17 | 165 |
| 2013.december | 0 | 338 |
| Összesen: | 346 | 4 369 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 161,465

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|------------------------|--|
| 2011/12/30 | 1,652,046,550 | 9510.754276 |
| 2012/12/28 | 1,767,362,229 | 10679.248491 |
| 2013/12/31 | 1,802,438,944 | 11163.031889 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 februárjában indult az OTP Árupiaci Trend Fix II. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy, a globális áru- és nyersanyag piacokat reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a mezőgazdasági termények, energiaipari nyersanyagok, ipari- és nemesfémek árfolyamváltozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------|----------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 21 | | 19 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.03.01 - 2014.12.01 | | 1 240 000 | | 1 240 000 | | 68,62% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.03.01 - 2014.12.01 | | 150 000 | | 150 000 | | 8,30% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 390 021 | | 1 390 019 | | 76,92% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 60 129 | | 5 335 | | 0,30% |
| 2014/D | 2011.01.19 - 2014.08.22 | | 60 129 | | 5 335 | | 0,30% |
| MNB Kötvények: | | | 22 762 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 22 523 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 239 | | 0 | | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 82 891 | 0 | 5 335 | 0 | 0,30% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | 323 | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 8 006 | | 5 016 | | 0,28% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 291 507 | | 406 566 | | 22,50% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 299 836 | | 411 582 | | 22,78% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 1 772 748 | | 1 806 936 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 2 850 | | 3 057 | | 80,94% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 227 | | 6,01% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 110 | | 359 | | 9,50% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 681 | | 134 | | 3,55% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 4 641 | | 3 777 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 1 768 107 | | 1 803 159 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 165 488 | | 161 465 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 684,20 | | 11 167,49 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 165 029 | | 10 958,90 |
| 2013. február 28. | 164 626 | | 10 860,52 |
| 2013. március 28. | 164 537 | | 11 040,86 |
| 2013. április 30. | 164 065 | | 11 021,30 |
| 2013. május 31. | 163 674 | | 10 994,18 |
| 2013. június 28. | 163 309 | | 10 851,50 |
| 2013. július 31. | 163 128 | | 10 943,88 |
| 2013. augusztus 30. | 162 825 | | 11 074,51 |
| 2013. szeptember 30. | 161 970 | | 11 121,23 |
| 2013. október 31. | 161 951 | | 11 144,64 |
| 2013. november 29. | 161 803 | | 11 099,44 |
| 2013. december 31. | 161 465 | 1 803 158 635 | 11 167,49 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Árupiaci Trend Fix II. Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 82 891 | 100,00% | 5 335 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 22 762 | 27,46% | 0 | 0,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 82 891 | 100,00% | 5 335 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint | |
|---|---|-------------|---------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 4 153 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -35 817 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -414 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -73 |
| | felügyeleti díj: | | -448 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -348 |
| f) | nettó jövedelem: | | -32 947 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -32 947 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -44 129 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 112 128 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 142 454 700 | 139 294 200 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 47 956 002 | 24 927 226 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -94 498 698 | -114 366 974 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 408 644 710 | 438 051 550 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -165 093 080 | -56 413 150 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 243 551 630 | 381 638 400 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 116 716 755 | 84 095 772 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 135 439 | 90 453 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 123 271 | 86 300 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 32 944 | 36 999 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 44 | 101 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -20 820 | -32 947 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Árupiaci Trend Fix III. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. júliustól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,306,874,383 | 10889.804393 |
| 2013.02.28 | 2,278,834,528 | 10817.646186 |
| 2013.03.28 | 2,308,906,807 | 10962.324957 |
| 2013.04.30 | 2,300,263,868 | 10947.798641 |
| 2013.05.31 | 2,296,687,253 | 10949.328043 |
| 2013.06.28 | 2,265,676,152 | 10807.151827 |
| 2013.07.31 | 2,272,260,333 | 10872.683278 |
| 2013.08.30 | 2,285,545,830 | 10971.743491 |
| 2013.09.30 | 2,299,843,521 | 11045.204475 |
| 2013.10.31 | 2,302,152,802 | 11087.124965 |
| 2013.11.29 | 2,305,929,541 | 11108.363037 |
| 2013.12.31 | 2,307,614,968 | 11151.885060 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 212,160

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 480 | 797 |
| 2013.február | 9 | 1 188 |
| 2013.március | 13 | 50 |
| 2013.április | 45 | 555 |
| 2013.május | 0 | 356 |
| 2013.június | 0 | 110 |
| 2013.július | 0 | 658 |
| 2013.augusztus | 0 | 677 |
| 2013.szeptember | 0 | 90 |
| 2013.október | 0 | 579 |
| 2013.november | 97 | 354 |
| 2013.december | 16 | 727 |
| Összesen: | 660 | 6 141 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 206,926

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2011/12/30 | 2,073,337,501 | 9293.226869 |
| 2012/12/28 | 2,270,390,745 | 10701.313843 |
| 2013/12/31 | 2,307,614,968 | 11151.885060 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 júliusában indult az OTP Árupiaci Trend Fix III. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy, a globális áru- és nyersanyag piacokat reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a mezőgazdasági termények, energiaipari nyersanyagok, ipari- és nemesfémek árfolyamváltozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

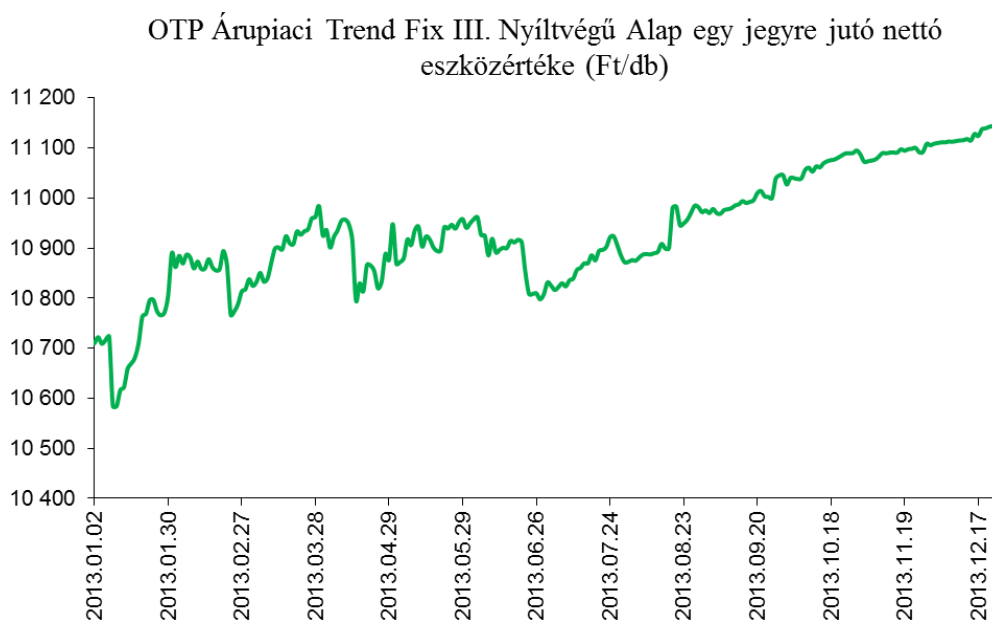
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|--|--|---------------------------------------|--|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | | |
| Bank | | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 21 | | 27 | | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 0 | | 660 | | 0,03% | |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.08.01 - 2014.12.01 | | | 1 350 000 | | 1 350 000 | | 58,33% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 350 021 | | 1 350 687 | | 58,36% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | | Futamidő | | Tőzsdei értékpapír | | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 5 372 | | 0 | | 0,00% | |
| 2015/A 2004.07.14 - 2015.02.12 | | | 5 372 | | 0 | | 0,00% | |
| MNB Kötvények: | | | 19 523 | | 10 408 | | 0,45% | |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | 19 523 | | 0 | | 0,00% | |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | 0 | | 10 408 | | 0,45% | |
| Kötvények: | | | 198 276 | | 220 159 | | 9,51% | |
| MAGYAR 5.875 05/10 2011.05.31 - 2016.05.31 | | | 45 283 | | 48 853 | | 2,11% | |
| OTPHB FLOAT 03/10 2005.03.04 - 2015.03.04 | | | 152 993 | | 171 306 | | 7,40% | |
| Jelzáloglevelek: | | | 456 512 | | 422 945 | | 18,28% | |
| FJ15NF01 2010.02.18 - 2015.09.14 | | | 456 512 | | 422 945 | | 18,28% | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 679 683 | | 0 | | 653 512 | |
| Egyéb eszközök | | | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | | 0,00% | |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 9 207 | | 4 826 | | 0,21% | |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 241 194 | | 305 155 | | 13,19% | |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 250 401 | | 309 981 | | 13,40% | |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 280 105 | | 2 314 180 | | 100,00% | |
| Kötelezettségek | | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 3 649 | | 3 917 | | 44,49% | |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 290 | | 3,29% | |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 140 | | 460 | | 5,23% | |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 53 | | 4 137 | | 46,99% | |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 842 | | 8 804 | | 100,00% | |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 276 263 | | 2 305 376 | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | | | | | |
| | | | 212 155 | | 206 674 | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 729,25 | | 11 154,65 | | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 211 838 | | 10 889,80 |
| 2013. február 28. | 210 659 | | 10 817,65 |
| 2013. március 28. | 210 622 | | 10 962,32 |
| 2013. április 30. | 210 112 | | 10 947,80 |
| 2013. május 31. | 209 756 | | 10 949,33 |
| 2013. június 28. | 209 646 | | 10 807,15 |
| 2013. július 31. | 208 988 | | 10 872,68 |
| 2013. augusztus 30. | 208 311 | | 10 971,74 |
| 2013. szeptember 30. | 208 221 | | 11 045,20 |
| 2013. október 31. | 207 642 | | 11 087,12 |
| 2013. november 29. | 207 385 | | 11 108,36 |
| 2013. december 31. | 206 674 | 2 305 375 702 | 11 154,65 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 679 683 | 100,00% | 653 512 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 19 523 | 2,87% | 10 408 | 1,59% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 679 683 | 100,00% | 653 512 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 37 157 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -45 677 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -528 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -141 |
| | felügyeleti díj: | -573 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -424 |
| f) | nettó jövedelem: | -10 186 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -10 186 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -59 768 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 99 067 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | | |
|--|---------|--|---------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------|--------------------|
| | adatok | | határidő ügylet | | határidős ügylet | | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -554 | 168 176 | -164 177 | 165 892 | 1 715 | |
| | | | | | | 1 715 | |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | | 155 374 660 | 153 754 060 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | | 67 625 933 | 863 611 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | -87 748 727 | -152 890 449 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | | | 332 876 250 | 356 829 300 |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | | | -159 308 100 | -54 252 450 |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | | | 173 568 150 | 302 576 850 |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | | | 112 806 000 | 81 129 750 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|---------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. I. | Pénzügyi műveletek bevételei | 203 031 | 139 762 |
| 02. II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | 139 355 | 102 605 |
| 03. III. | Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. IV. | Működési költségek | 41 754 | 47 234 |
| 05. V. | Egyéb ráfordítások | 100 | 109 |
| 06. VI. | Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. VII. | Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. IX. | Tárgyévi eredmény | 21 822 | -10 186 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Dupla Fix II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap
Az alap futamideje: 2010. március 3.-tól 2013. december 11.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 8,625,583,605 | 10776.793175 |
| 2013.02.28 | 8,552,804,912 | 10685.863568 |
| 2013.03.28 | 8,564,215,546 | 10700.120000 |
| 2013.04.30 | 8,694,938,763 | 10863.445421 |
| 2013.05.31 | 8,796,253,248 | 10990.027609 |
| 2013.06.28 | 8,570,085,493 | 10707.453904 |
| 2013.07.31 | 8,779,870,548 | 10969.559085 |
| 2013.08.30 | 8,672,644,045 | 10835.590428 |
| 2013.09.30 | 8,960,844,883 | 11195.668188 |
| 2013.10.31 | 9,273,178,256 | 11585.897107 |
| 2013.11.29 | 9,408,239,657 | 11754.642649 |
| 2013.12.31 | 5,610,313,382 | 11452.119916 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012. december 11.-én, az eredeti futamidő lejártakor 800,385 db volt, amely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap az eredeti futamidőt követően nyíltvégű alappá alakult. Az átalakulástól az év végéig a befektetési jegyek darabszáma 489,893 db-ra csökkent.

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.december | 52 | 327 796 |
| Összesen: | 52 | 327 796 |

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2010/12/31 | 8,091,563,496 | 10,109.589130 |
| 2011/12/30 | 7,720,143,590 | 9645.537573 |
| 2012/12/28 | 8,442,957,769 | 10548.620688 |
| 2013/12/31 | 5,610,313,382 | 11452.119916 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2010 márciusában indult OTP Dupla Fix II. Alap a tőkevédelemmel felül a futamidő alatt két alkalommal is fix, a befektetési jegyek névértékére vetített biztosított hozamot fizet. Ezenfelül az Euró-övezet 50 legnagyobb piaci kapitalizációjú vállalatát tömörítő

részvényindex futamidő alatti teljesítményéből is részesedési lehetőséget nyújt. Az alap futamideje 2013. december 11-én lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Dupla Fix II. Nyíltvégű Alap néven működik tovább.** Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 5%-os rögzített hozam, illetve a mögöttes eszközök kedvező teljesítményének köszönhetően 9,36%-os extra hozam illeti meg, amelyek az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelték. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014 tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 25 | 23 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.12.13 - 2013.12.11 | 6 450 000 | 0 | | 0,00% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 6 450 025 | 23 | | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 0 | | 1 989 650 | 33,60% |
| 2014/C | 2003.06.19 - 2014.02.12 | 0 | | 1 989 650 | 33,60% |
| MNB Kötvények: | | 183 871 | | 3 931 343 | 66,40% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 183 871 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 1 902 160 | 32,13% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 2 029 183 | 34,27% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 183 871 | 0 | 5 920 993 | 0 100,00% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 25 750 | | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 1 800 296 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 1 826 046 | | 0 | 0,00% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 8 459 942 | | 5 921 016 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 10 367 | | 9 088 | 1,73% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 1 093 | 0,21% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | 519 | | 953 | 0,18% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 0 | | 514 814 | 97,88% |
| Kötelezettségek összesen: | | 10 886 | | 525 948 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 8 449 056 | | 5 395 068 | |
| | | | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 800 385 | | 472 641 | |
| | | | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 556,24 | | 11 414,73 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 800 385 | | 10 776,79 |
| 2013. február 28. | 800 385 | | 10 685,86 |
| 2013. március 28. | 800 385 | | 10 700,12 |
| 2013. április 30. | 800 385 | | 10 863,45 |
| 2013. május 31. | 800 385 | | 10 990,03 |
| 2013. június 28. | 800 385 | | 10 707,45 |
| 2013. július 31. | 800 385 | | 10 969,56 |
| 2013. augusztus 30. | 800 385 | | 10 835,59 |
| 2013. szeptember 30. | 800 385 | | 11 195,67 |
| 2013. október 31. | 800 385 | | 11 585,90 |
| 2013. november 29. | 800 385 | | 11 754,64 |
| 2013. december 31. | 472 641 | 5 395 068 683 | 11 414,73 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Dupla Fix II. Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 183 871 | 100,00% | 5 920 993 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 183 871 | 100,00% | 3 931 343 | 66,40% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 183 871 | 100,00% | 5 920 993 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 2 588 058 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -160 647 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -2 189 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -75 |
| | felügyeleti díj: | -2 179 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -476 |
| f) | nettó jövedelem: | 2 422 492 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 2 422 492 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -3 750 569 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -1 725 911 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 496 238 700 | 0 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 370 492 356 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -125 746 344 | 0 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 1 836 960 000 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -407 156 250 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 1 429 803 750 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 513 536 459 | 364 518 166 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 528 411 | 2 953 082 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 513 836 | 365 024 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 118 773 | 165 492 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 74 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -104 198 | 2 422 492 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Dupla Fix Plusz Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. április 20.-tól 2015. december 15.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,928,400,608 | 10460.366806 |
| 2013.02.28 | 2,948,385,885 | 10561.937170 |
| 2013.03.28 | 2,960,796,003 | 10649.579178 |
| 2013.04.30 | 2,994,482,041 | 10803.540137 |
| 2013.05.31 | 2,981,594,367 | 10780.730770 |
| 2013.06.28 | 2,957,657,820 | 10701.688732 |
| 2013.07.31 | 2,978,278,853 | 10807.076023 |
| 2013.08.30 | 2,983,213,554 | 10843.120596 |
| 2013.09.30 | 3,022,390,938 | 10998.951697 |
| 2013.10.31 | 3,039,239,394 | 11071.829692 |
| 2013.11.29 | 3,047,194,988 | 11113.807988 |
| 2013.12.31 | 2,814,628,847 | 10384.398279 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 281,867

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 39 | 1 565 |
| 2013.február | 0 | 789 |
| 2013.március | 11 | 1 493 |
| 2013.április | 182 | 676 |
| 2013.május | 41 | 650 |
| 2013.június | 0 | 194 |
| 2013.július | 111 | 898 |
| 2013.augusztus | 299 | 760 |
| 2013.szeptember | 0 | 336 |
| 2013.október | 58 | 350 |
| 2013.november | 54 | 370 |
| 2013.december | 91 | 3 618 |
| Összesen: | 886 | 11 699 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 271,044

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2010/12/31 | 3,010,659,890 | 9,641.084080 |
| 2011/12/30 | 2,700,678,197 | 9043.287036 |
| 2012/12/28 | 2,930,580,916 | 10397.034474 |
| 2013/12/31 | 2,814,628,847 | 10384.398279 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2010 áprilisában indult OTP Dupla Fix Plusz Alap a tőkevédelemmel felül a futamidő alatt két alkalommal is fix, a befektetési jegyek névértékére vetített biztosított hozamot fizet. Ezenfelül a BRIC övezet 40 legnagyobb piaci kapitalizációjú vállalatát tömörítő részvényindex futamidő alatti teljesítményéből is részesedési lehetőséget nyújt.

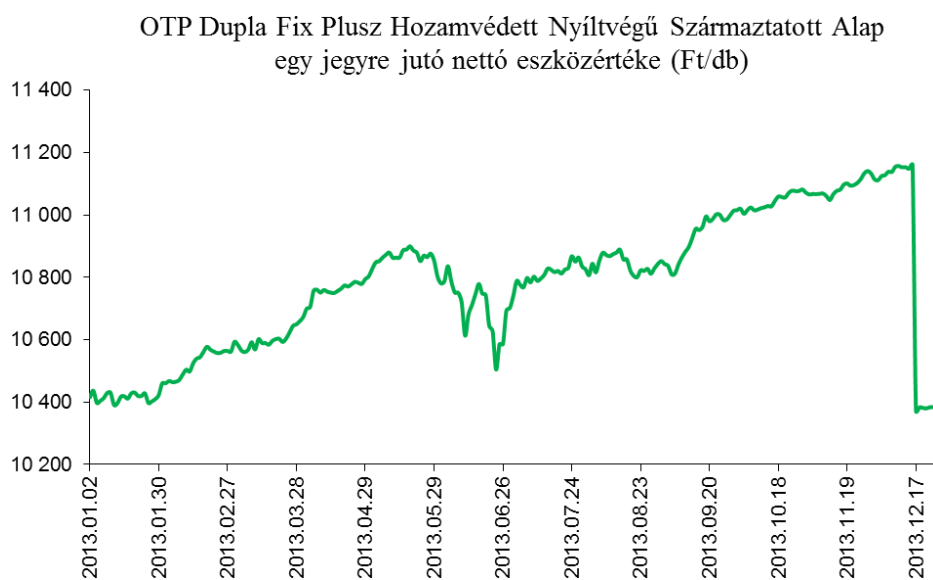
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 18 | | 29 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.04.23 - 2013.12.09 | | 200 000 | | 0 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.04.23 - 2015.12.09 | | 2 000 000 | | 2 000 000 | | 70,81% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 2 200 018 | | 2 000 029 | | 70,81% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | | |
| Államkötvények: | | 196 644 | | 149 943 | | | 5,31% |
| 2017/B | 2006.10.04 - 2017.02.24 | 196 644 | | 149 943 | | | 5,31% |
| MNB Kötvények: | | 66 668 | | 9 839 | | | 0,35% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 66 139 | | 0 | | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 529 | | 0 | | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 9 839 | | | 0,35% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 263 312 | 0 | 159 782 | 0 | | 5,66% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 9 411 | | 5 341 | | 0,19% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 463 011 | | 659 108 | | 23,34% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 472 422 | | 664 449 | | 23,53% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 935 752 | | 2 824 260 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 3 333 | | 3 736 | | 27,69% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 378 | | 2,80% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 180 | | 509 | | 3,78% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 4 159 | | 8 868 | | 65,73% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 7 672 | | 13 491 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 928 080 | | 2 810 769 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 281 467 | | 270 654 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 402,93 | | 10 385,10 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 279 941 | | 10 460,37 |
| 2013. február 28. | 279 152 | | 10 561,94 |
| 2013. március 28. | 277 670 | | 10 649,58 |
| 2013. április 30. | 277 176 | | 10 803,54 |
| 2013. május 31. | 276 567 | | 10 780,73 |
| 2013. június 28. | 276 373 | | 10 701,69 |
| 2013. július 31. | 275 586 | | 10 807,08 |
| 2013. augusztus 30. | 275 125 | | 10 843,12 |
| 2013. szeptember 30. | 274 789 | | 10 998,95 |
| 2013. október 31. | 274 497 | | 11 071,83 |
| 2013. november 29. | 274 181 | | 11 113,81 |
| 2013. december 31. | 270 654 | 2 810 769 200 | 10 385,10 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 263 312 | 100,00% | 159 782 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 66 668 | 25,32% | 9 839 | 6,16% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 263 312 | 100,00% | 159 782 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 64 586 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -44 422 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -690 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -73 |
| | felügyeleti díj: | -745 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -408 |
| f) | nettó jövedelem: | 18 248 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | -219 256 |
| | újra befektetett jövedelem: | -201 008 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -115 124 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 198 821 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 326 972 465 | 326 972 465 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 5 536 410 | 52 163 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -321 436 055 | -326 920 302 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 803 811 800 | 821 362 000 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -346 337 000 | -162 306 000 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 457 474 800 | 659 056 000 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 181 762 778 | 129 573 890 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 216 681 | 194 160 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 194 315 | 129 574 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 38 677 | 46 251 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 99 | 87 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 219 256 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -16 410 | -201 008 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Dupla Fix Plusz II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. június 03.-tól 2015. december 15.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,155,546,547 | 10700.900271 |
| 2013.02.28 | 2,167,824,174 | 10792.389822 |
| 2013.03.28 | 2,181,567,183 | 10874.126124 |
| 2013.04.30 | 2,207,715,319 | 11060.254694 |
| 2013.05.31 | 2,190,508,236 | 11039.699608 |
| 2013.06.28 | 2,174,645,453 | 10958.373830 |
| 2013.07.31 | 2,175,761,233 | 11054.686223 |
| 2013.08.30 | 2,175,014,284 | 11083.948428 |
| 2013.09.30 | 2,195,993,302 | 11238.623428 |
| 2013.10.31 | 2,205,437,264 | 11312.255150 |
| 2013.11.29 | 2,214,145,853 | 11347.378349 |
| 2013.12.31 | 2,022,473,426 | 10610.587255 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 202,001

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 31 | 575 |
| 2013.február | 45 | 570 |
| 2013.március | 0 | 291 |
| 2013.április | 335 | 1 347 |
| 2013.május | 227 | 1 414 |
| 2013.június | 300 | 275 |
| 2013.július | 146 | 1 775 |
| 2013.augusztus | 71 | 657 |
| 2013.szeptember | 52 | 888 |
| 2013.október | 0 | 435 |
| 2013.november | 227 | 63 |
| 2013.december | 351 | 5 276 |
| Összesen: | 1 785 | 13 566 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 190,609

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2010/12/31 | 2,284,734,415 | 10,453.484206 |
| 2011/12/30 | 1,946,456,334 | 9254.913245 |
| 2012/12/28 | 2,148,998,838 | 10638.555443 |
| 2013/12/31 | 2,022,473,426 | 10610.587255 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2010 júniusában indult OTP Dupla Fix Plusz II. Alap a tőkevédelemmel felül a futamidő alatt két alkalommal is fix, a befektetési jegyek névértékére vetített biztosított hozamot fizet. Ezenfelül a BRIC övezet 40 legnagyobb piaci kapitalizációjú vállalatát tömörítő részvényindex futamidő alatti teljesítményéből is részesedési lehetőséget nyújt.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 9 | | 26 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.06.06 - 2013.12.09 | | 144 000 | | 0 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.06.06 - 2015.12.09 | | 1 320 000 | | 1 320 000 | | 64,93% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 464 009 | | 1 320 026 | | 64,93% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 215 697 | | 203 866 | | 10,03% |
| 2017/B | 2006.10.04 - 2017.02.24 | | 215 697 | | 203 866 | | 10,03% |
| MNB Kötvények: | | | 110 094 | | 3 726 | | 0,18% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 110 094 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 3 726 | | 0,18% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 325 791 | 0 | 207 592 | 0 | 10,21% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 6 263 | | 3 525 | | 0,17% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 361 339 | | 501 837 | | 24,69% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 367 602 | | 505 362 | | 24,86% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 157 402 | | 2 032 980 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 2 719 | | 3 600 | | 24,31% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 274 | | 1,85% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 132 | | 439 | | 2,97% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 223 | | 10 494 | | 70,87% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 074 | | 14 807 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 154 328 | | 2 018 173 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 201 980 | | 190 199 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 666,04 | | 10 610,85 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 201 436 | | 10 700,90 |
| 2013. február 28. | 200 911 | | 10 792,39 |
| 2013. március 28. | 200 620 | | 10 874,13 |
| 2013. április 30. | 199 608 | | 11 060,25 |
| 2013. május 31. | 198 421 | | 11 039,70 |
| 2013. június 28. | 198 446 | | 10 958,37 |
| 2013. július 31. | 196 817 | | 11 054,69 |
| 2013. augusztus 30. | 196 231 | | 11 083,95 |
| 2013. szeptember 30. | 195 395 | | 11 238,62 |
| 2013. október 31. | 194 960 | | 11 312,26 |
| 2013. november 29. | 195 124 | | 11 347,38 |
| 2013. december 31. | 190 199 | 2 018 172 624 | 10 610,85 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Dupla Fix Plusz II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 325 791 | 100,00% | 207 592 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 110 094 | 33,79% | 3 726 | 1,79% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 325 791 | 100,00% | 207 592 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 49 125 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -42 968 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -502 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -74 |
| | felügyeleti díj: | -546 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -530 |
| f) | nettó jövedelem: | 4 505 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | -156 107 |
| | újra befektetett jövedelem: | -151 602 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -129 512 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 144 959 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 257 698 070 | 257 698 070 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 11 910 415 | 10 827 650 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -245 787 655 | -246 870 420 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 578 796 000 | 598 131 600 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -229 367 640 | -107 121 960 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 349 428 360 | 491 009 640 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 120 954 867 | 86 225 534 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 158 954 | 135 351 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 120 955 | 86 226 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 31 286 | 44 392 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 81 | 228 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 156 107 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 6 632 | -151 602 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Eurogól Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2012. július 11.-től 2015. december 31.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,681,388,399 | 10558.725729 |
| 2013.02.28 | 2,745,147,119 | 10809.793735 |
| 2013.03.28 | 2,761,371,433 | 10873.681563 |
| 2013.04.30 | 2,824,687,462 | 11123.006348 |
| 2013.05.31 | 2,882,738,780 | 11351.599842 |
| 2013.06.28 | 2,884,397,973 | 11358.133385 |
| 2013.07.31 | 2,934,122,570 | 11553.938059 |
| 2013.08.30 | 2,930,165,737 | 11538.356909 |
| 2013.09.30 | 2,972,183,526 | 11703.813845 |
| 2013.10.31 | 2,945,991,196 | 11600.674133 |
| 2013.11.29 | 3,103,657,635 | 12221.530360 |
| 2013.12.31 | 2,770,972,969 | 10911.490329 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012. december 31.-én 253,950 db volt, amely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2012/12/28 | 2,647,076,607 | 10423.613337 |
| 2013/12/31 | 2,770,972,969 | 10911.490329 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2012 júliusában indult OTP Eurogól Alappal befektetőink a 2012-es labdarúgó Európa-bajnokság főszponzoraiból összeállított részvénykosárra szóló származtatott részvénytőzsi befektetés futamidő alatti teljesítményéből részesedhetnek tőkevédelem és egy fix, 9%-os rögzített hozam mellett. A kontinensviadal fő szponzorai nemzetközi óriáscégek, amelyek a támogatás fejében kizárólagos hirdetési jogot kapnak a sporteseményen, illetve az Európa-bajnokság hivatalos beszállítói, szolgáltatói lehetnek. Világszerte nézők milliárdjai kísérik figyelemmel a mérkőzéseket, így a támogatók hirdetéseik révén óriási ismertséghez jutnak, illetve tovább erősíthetik piaci pozíciójukat.

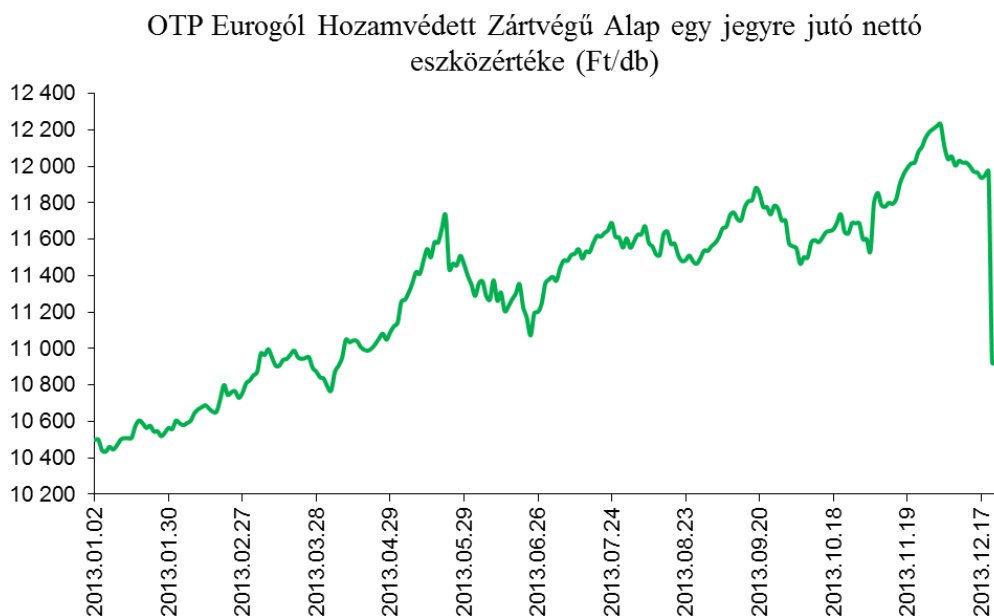
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 17 | 27 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 25 | 253 | 0,01% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 2 969 | 0,11% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 42 | 3 249 | 0,12% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 1 742 078 | | 1 447 399 | 52,15% |
| 2015/C 2012.02.15 - 2015.08.24 | | 863 710 | | 0 | 0,00% |
| 2016/C 2005.10.05 - 2016.02.12 | | 0 | | 156 084 | 5,62% |
| DK2015/02 2012.06.11 - 2015.08.24 | | 878 368 | | 910 611 | 32,81% |
| REPHUN 4.375 07/17 2007.02.01 - 2017.07.04 | | 0 | | 380 704 | 13,72% |
| MNB Kötvények: | | 12 463 | | 3 126 | 0,11% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 540 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 11 923 | | 0 | 0,00% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 3 126 | 0,11% |
| Kötvények: | | 44 958 | | 525 967 | 18,96% |
| MAGYAR 5.875 05/1 2011.05.31 - 2016.05.31 | | 0 | | 407 117 | 14,67% |
| OTPHB 5.27 09/16 2006.09.19 - 2016.09.19 | | 44 958 | | 61 748 | 2,23% |
| OTPHB FLOAT 03/1 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 0 | | 57 102 | 2,06% |
| Jelzáloglevelek: | | 657 632 | | 700 040 | 25,23% |
| FJ15ZF02 2005.05.18 - 2015.05.18 | | 657 632 | | 700 040 | 25,23% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 457 131 | 0 | 2 676 532 | 0 96,45% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 204 585 | 95 285 | 3,43% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 204 585 | 95 285 | 3,43% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 661 758 | | 2 775 066 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 3 331 | | 3 739 | 95,24% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 159 | | 187 | 4,76% |
| Kötelezettségek összesen: | | 3 490 | | 3 926 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 658 268 | | 2 771 140 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 253 950 | | 253 950 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 467,68 | | 10 912,15 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 253 950 | | 10 558,73 |
| 2013. február 28. | 253 950 | | 10 809,79 |
| 2013. március 28. | 253 950 | | 10 873,68 |
| 2013. április 30. | 253 950 | | 11 123,01 |
| 2013. május 31. | 253 950 | | 11 351,60 |
| 2013. június 28. | 253 950 | | 11 358,13 |
| 2013. július 31. | 253 950 | | 11 553,94 |
| 2013. augusztus 30. | 253 950 | | 11 538,36 |
| 2013. szeptember 30. | 253 950 | | 11 703,81 |
| 2013. október 31. | 253 950 | | 11 600,67 |
| 2013. november 29. | 253 950 | | 12 221,53 |
| 2013. december 31. | 253 950 | 2 771 140 338 | 10 912,15 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 457 131 | 100,00% | 2 676 532 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 12 463 | 0,51% | 3 126 | 0,12% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 457 131 | 100,00% | 2 676 532 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 460 555 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -43 110 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | 0 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -128 |
| | felügyeleti díj: | -719 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -8 |
| f) | nettó jövedelem: | 416 590 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | -266 300 |
| | újra befektetett jövedelem: | 150 290 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -37 418 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|---|-----------|--|---------------|-----------------------------------|--------------------|--------------|
| | adatok ezerben | határidős ügylet szerződés szerinti értéke | | határidős ügylet diszkontált piaci értéke | | eredmény | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | | | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -2 232 | 646 925 | -649 787 | 638 260 | -11 527 | | |
| | Összesen: | | | | | -11 527 | | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -4 858 | 1 474 840 | -1 439 775 | 1 454 812 | 15 037 | | |
| | Összesen: | | | | | 15 037 | | |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | | | | | Szerződés szerinti érték: | 240 744 600 | 240 744 600 |
| | | | | | | Fordulónapi piaci érték: | 216 111 450 | 80 248 200 |
| | | | | | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -24 633 150 | -160 496 400 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.07.11-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 21 053 | 651 559 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 252 235 | 191 004 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 18 530 | 43 958 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 7 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 266 300 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -249 712 | 150 290 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Európa-válogatott Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2010. november 18.-tól 2015. december 16.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 5,593,320,084 | 10594.011182 |
| 2013.02.28 | 5,600,969,184 | 10635.572843 |
| 2013.03.28 | 5,607,405,307 | 10661.317647 |
| 2013.04.30 | 5,588,879,173 | 10641.268170 |
| 2013.05.31 | 5,702,320,261 | 10881.729875 |
| 2013.06.28 | 5,576,888,953 | 10656.930493 |
| 2013.07.31 | 5,692,945,274 | 10921.696599 |
| 2013.08.30 | 5,703,748,119 | 10977.443896 |
| 2013.09.30 | 5,770,535,856 | 11143.666285 |
| 2013.10.31 | 5,862,467,292 | 11333.629685 |
| 2013.11.29 | 5,945,360,542 | 11501.309739 |
| 2013.12.31 | 4,087,844,839 | 11323.513079 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 531,274

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 7 | 3 312 |
| 2013.február | 32 | 1 375 |
| 2013.március | 0 | 668 |
| 2013.április | 41 | 791 |
| 2013.május | 18 | 1 199 |
| 2013.június | 0 | 941 |
| 2013.július | 552 | 2 387 |
| 2013.augusztus | 118 | 1 887 |
| 2013.szeptember | 44 | 1 695 |
| 2013.október | 39 | 607 |
| 2013.november | 230 | 564 |
| 2013.december | 0 | 168 340 |
| Összesen: | 1 081 | 183 766 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 361,005

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2010/12/31 | 5,687,440,632 | 9,905.965294 |
| 2011/12/30 | 5,079,981,368 | 9201.881263 |
| 2012/12/28 | 5,526,109,958 | 10401.619424 |
| 2013/12/31 | 4,087,844,839 | 11323.513079 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Európa-válogatott Alap a tőkevédelemmel felül a futamidő alatt egy alkalommal fix, a befektetési jegyek névértékére vetített biztosított hozamot fizet. Ezenfelül olyan európai nagyvállalatok futamidő alatti részvényárfolyam-teljesítményéből is részesedési lehetőséget nyújt, melyek a világ vezető exportőrei közé tartoznak. Az alap futamideje 2013. december 13-án lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Európa-válogatott Nyíltvégű Alap néven működik tovább.** Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 7%-os rögzített hozam, illetve a mögöttes eszközök kedvező teljesítményének köszönhetően 13,05%-os extra hozam illeti meg, amelyek az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelték. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014 tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 24 | 31 | 0,00% | | |
| Raiffeisen Bank HUF 2010.11.23 - 2013.12.13 | | 2 900 000 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF 2013.12.13 - 2014.01.03 | | 0 | 540 000 | 12,24% | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | 1 199 970 | 27,21% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 2 900 024 | 1 740 001 | 39,45% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 1 729 900 | | 206 319 | 4,68% |
| 2014/C 2003.06.19 - 2014.02.12 | | | 1 729 900 | | 206 319 | 4,68% |
| MNB Kötvények: | | | 53 233 | | 2 462 964 | 55,85% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | 53 233 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | | 1 126 782 | 25,55% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | 0 | | 1 336 182 | 30,30% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 1 783 133 | 0 | 2 669 283 | 60,53% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 1 078 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 10 714 | | 1 028 | 0,02% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 886 251 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 898 043 | | 1 028 | 0,02% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 5 581 200 | | 4 410 312 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 6 534 | | 7 809 | 1,68% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 710 | 0,15% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 337 | | 805 | 0,17% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 458 | | 455 417 | 98,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 7 329 | | 464 741 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 5 573 871 | | 3 945 571 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 531 274 | | 348 589 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 491,52 | | 11 318,69 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 527 969 | | 10 594,01 |
| 2013. február 28. | 526 626 | | 10 635,57 |
| 2013. március 28. | 525 958 | | 10 661,32 |
| 2013. április 30. | 525 208 | | 10 641,27 |
| 2013. május 31. | 524 027 | | 10 881,73 |
| 2013. június 28. | 523 086 | | 10 656,93 |
| 2013. július 31. | 521 251 | | 10 921,70 |
| 2013. augusztus 30. | 519 482 | | 10 977,44 |
| 2013. szeptember 30. | 517 831 | | 11 143,67 |
| 2013. október 31. | 517 263 | | 11 333,63 |
| 2013. november 29. | 516 929 | | 11 501,31 |
| 2013. december 31. | 348 589 | 3 945 571 205 | 11 318,69 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Európa-válogatott Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 783 133 | 100,00% | 2 669 283 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 53 233 | 2,99% | 2 462 964 | 92,27% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 1 783 133 | 100,00% | 2 669 283 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint | |
|---|---|-------------|------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 1 580 700 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -125 249 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -1 308 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -75 |
| | felügyeleti díj: | | -1 416 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -722 |
| f) | nettó jövedelem: | | 1 451 930 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 1 451 930 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -2 060 065 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -1 020 165 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 406 464 390 | 0 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 437 812 624 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | 31 348 234 | 0 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 638 516 200 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -190 077 600 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 448 438 600 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 238 988 194 | 171 242 584 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 372 708 | 1 751 942 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 245 922 | 171 242 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 75 164 | 128 498 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 212 | 272 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 51 410 | 1 451 930 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Fejlett Piaci Trend Fix I. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. szeptembertől 2015. márciusig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,328,700,077 | 12540.726675 |
| 2013.02.28 | 2,336,287,160 | 12577.385883 |
| 2013.03.28 | 2,412,636,210 | 13011.455960 |
| 2013.04.30 | 2,544,665,504 | 13676.732546 |
| 2013.05.31 | 2,641,941,425 | 13886.901896 |
| 2013.06.28 | 2,504,946,780 | 13361.996607 |
| 2013.07.31 | 2,659,804,062 | 13940.345924 |
| 2013.08.30 | 2,664,311,363 | 13832.458676 |
| 2013.09.30 | 2,787,592,679 | 14428.757584 |
| 2013.10.31 | 2,893,895,540 | 14773.818358 |
| 2013.11.29 | 2,938,418,787 | 14831.659854 |
| 2013.12.31 | 2,992,023,054 | 14945.394057 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 185,657

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 946 | 926 |
| 2013.február | 595 | 569 |
| 2013.március | 246 | 461 |
| 2013.április | 1 763 | 941 |
| 2013.május | 4 624 | 832 |
| 2013.június | 1 373 | 4 008 |
| 2013.július | 4 727 | 501 |
| 2013.augusztus | 1 186 | 410 |
| 2013.szeptember | 1 317 | 614 |
| 2013.október | 3 837 | 948 |
| 2013.november | 2 994 | 938 |
| 2013.december | 3 083 | 884 |
| Összesen: | 26 691 | 12 032 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 200,197

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 1,924,834,433 | 9982.131397 |
| 2012/12/28 | 2,238,774,157 | 12058.657400 |
| 2013/12/31 | 2,992,023,054 | 14945.394057 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 szeptemberében indult az OTP Fejlett Piaci Trend Fix I. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy 4 elemű, a fejlett részvénypiacokat reprezentáló indexkosár adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a fejlett részvénypiacok teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

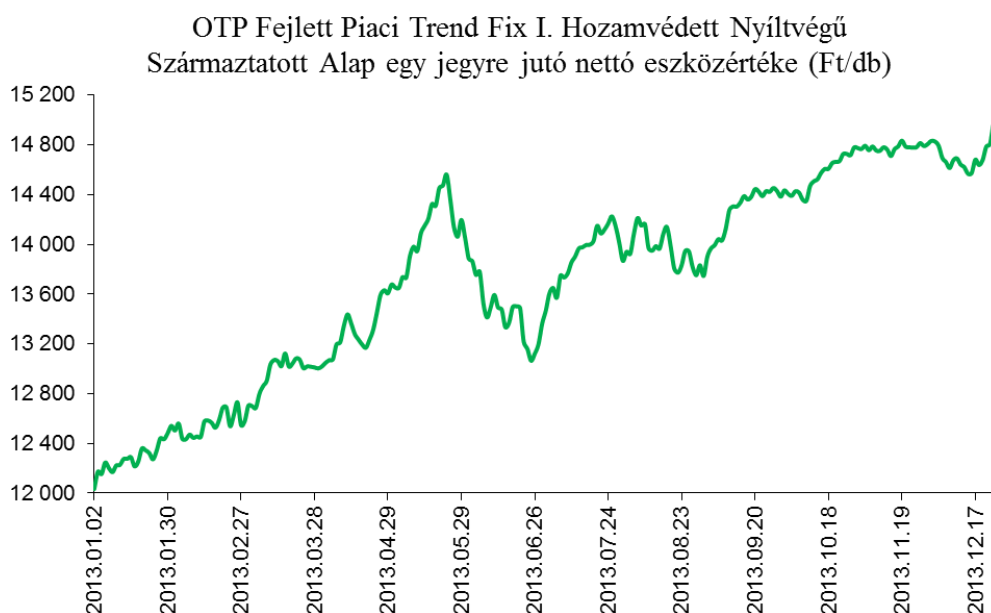
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--------------|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 23 | 25 | | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.12.30 - | 2015.03.31 | 580 000 | 580 000 | | | 19,32% |
| MKB Bank | 2011.12.30 - | 2015.03.31 | 580 000 | 580 000 | | | 19,32% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 160 023 | 1 160 025 | | | 38,64% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| MNB Kötvények: | | | 38 125 | | 222 512 | | 7,41% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | 36 238 | 0 | | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | 1 887 | 0 | | | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | 0 | 70 858 | | | 2,36% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | 151 654 | | | 5,05% |
| Kötvények: | | | 106 686 | | 118 222 | | 3,93% |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - | 2016.05.31 | 30 189 | 32 570 | | | 1,08% |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - | 2015.03.04 | 76 497 | 85 652 | | | 2,85% |
| Jelzáloglevelek: | | | 407 413 | | 423 880 | | 14,12% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - | 2015.09.14 | 407 413 | 423 880 | | | 14,12% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 552 224 | 0 | 764 614 | 0 | 25,46% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 24 066 | 137 | | 0,00% |
| Számzatatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 504 425 | 1 078 079 | | 35,90% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 528 491 | | 1 078 216 | | 35,90% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 240 738 | | 3 002 855 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | | 2 789 | 4 994 | | 56,15% |
| Letétkezelői díj miatt | | | | 0 | 365 | | 4,10% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | | 133 | 502 | | 5,64% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | | 442 | 3 034 | | 34,11% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 364 | | 8 895 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 237 374 | | 2 993 960 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 185 657 | | 200 316 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 12 051,12 | | 14 946,18 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 185 677 | | 12 540,73 |
| 2013. február 28. | 185 703 | | 12 577,39 |
| 2013. március 28. | 185 488 | | 13 011,46 |
| 2013. április 30. | 186 310 | | 13 676,73 |
| 2013. május 31. | 190 102 | | 13 886,90 |
| 2013. június 28. | 187 467 | | 13 362,00 |
| 2013. július 31. | 191 693 | | 13 940,35 |
| 2013. augusztus 30. | 192 469 | | 13 832,46 |
| 2013. szeptember 30. | 193 172 | | 14 428,76 |
| 2013. október 31. | 196 061 | | 14 773,82 |
| 2013. november 29. | 198 117 | | 14 831,66 |
| 2013. december 31. | 200 316 | 2 993 959 609 | 14 946,18 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 552 224 | 100,00% | 764 614 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 38 125 | 6,90% | 222 512 | 29,10% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 552 224 | 100,00% | 764 614 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | -4 639 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -51 820 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -647 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -85 |
| | felügyeleti díj: | -655 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -2 898 |
| f) | nettó jövedelem: | -60 744 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -60 744 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 215 679 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 601 651 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------------|--------------------------|--------------------|--------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -305 | 88 413 | -88 804 | 87 229 | -1 575 |
| | Összesen: | | | | | -1 575 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -305 | 92 595 | -90 394 | 91 338 | 944 |
| | Összesen: | | | | | 944 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | 191 088 690 | 212 432 510 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | 377 984 494 | 808 079 658 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | 186 895 804 | 595 647 148 |

9. Eredmény kimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--------------------|
| | | | | |
| | | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 170 673 | 120 303 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 87 561 | 124 942 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 31 107 | 53 528 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 109 | 2 577 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 51 896 | -60 744 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Fejlett Piaci Trend Fix II. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. novemberől 2015. márciusig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 860,706,378 | 11049.997150 |
| 2013.02.28 | 866,507,592 | 11183.484880 |
| 2013.03.28 | 884,386,365 | 11416.298101 |
| 2013.04.30 | 897,044,941 | 11605.772075 |
| 2013.05.31 | 906,303,932 | 11738.623855 |
| 2013.06.28 | 897,655,381 | 11667.559803 |
| 2013.07.31 | 916,980,033 | 11954.320114 |
| 2013.08.30 | 911,944,964 | 11894.262029 |
| 2013.09.30 | 939,842,070 | 12246.935406 |
| 2013.10.31 | 963,822,935 | 12553.046822 |
| 2013.11.29 | 992,941,296 | 12809.170722 |
| 2013.12.31 | 1,024,967,539 | 13080.906874 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 78,121

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 8 | 237 |
| 2013.február | 154 | 578 |
| 2013.március | 27 | 28 |
| 2013.április | 69 | 182 |
| 2013.május | 80 | 252 |
| 2013.június | 86 | 331 |
| 2013.július | 402 | 632 |
| 2013.augusztus | 262 | 297 |
| 2013.szeptember | 273 | 213 |
| 2013.október | 473 | 345 |
| 2013.november | 1 378 | 678 |
| 2013.december | 943 | 13 |
| Összesen: | 4 155 | 3 786 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 78,356

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 809,424,436 | 9726.204155 |
| 2012/12/28 | 839,934,370 | 10751.710424 |
| 2013/12/31 | 1,024,967,539 | 13080.906874 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 szeptemberében indult az OTP Fejlett Piaci Trend Fix II. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy 3 elemű, a fejlett részvénypiacokat reprezentáló indexkosár adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a fejlett részvénypiacok teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

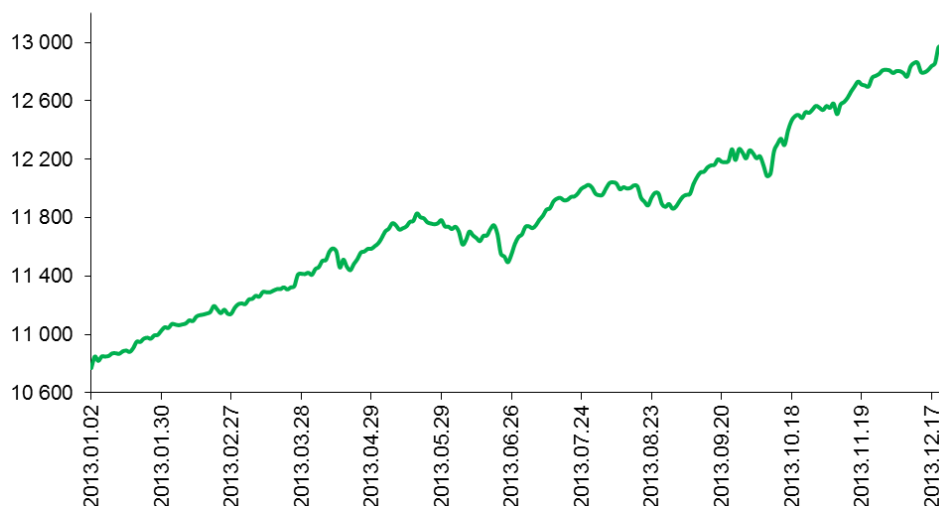
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 27 | 28 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.12.30 - 2015.03.31 | 520 000 | 520 000 | 50,55% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 520 027 | 520 028 | 50,55% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 31 397 | | 15 746 | 1,53% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | 31 397 | | 15 746 | 1,53% |
| MNB Kötvények: | | 16 522 | | 35 348 | 3,44% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 13 356 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 3 166 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 15 011 | 1,46% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 20 337 | 1,98% |
| Kötvények: | | 25 498 | | 28 550 | 2,77% |
| OTPHB FLOAT 03/15 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 25 498 | | 28 550 | 2,77% |
| Jelzáloglevelek: | | 125 358 | | 130 425 | 12,68% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - 2015.09.14 | 125 358 | | 130 425 | 12,68% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 198 775 | 0 | 210 069 | 20,42% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 10 831 | 62 | 0,01% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 109 588 | 298 532 | 29,02% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 120 419 | 298 594 | 29,03% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 839 221 | | 1 028 691 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 1 349 | | 1 711 | 90,29% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 123 | 6,49% |
| Költséggént elszámolt egyéb tétel miatt | | 52 | | 61 | 3,22% |
| Kötelezettségek összesen: | | 1 401 | | 1 895 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 837 820 | | 1 026 796 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 78 120 | | 78 489 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 724,79 | | 13 082,05 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 77 891 | | 11 050,00 |
| 2013. február 28. | 77 467 | | 11 183,48 |
| 2013. március 28. | 77 466 | | 11 416,30 |
| 2013. április 30. | 77 353 | | 11 605,77 |
| 2013. május 31. | 77 181 | | 11 738,62 |
| 2013. június 28. | 76 936 | | 11 667,56 |
| 2013. július 31. | 76 706 | | 11 954,32 |
| 2013. augusztus 30. | 76 671 | | 11 894,26 |
| 2013. szeptember 30. | 76 731 | | 12 246,94 |
| 2013. október 31. | 76 859 | | 12 553,05 |
| 2013. november 29. | 77 559 | | 12 809,17 |
| 2013. december 31. | 78 489 | 1 026 796 771 | 13 082,05 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Fejlett Piaci Trend Fix II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 198 775 | 100,00% | 210 069 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 16 522 | 8,31% | 35 348 | 16,83% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 198 775 | 100,00% | 210 069 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 5 505 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -18 270 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -219 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -78 |
| | felügyeleti díj: | | -228 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -626 |
| f) | nettó jövedelem: | | -13 916 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -13 916 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 7 328 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 195 564 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | | |
|--|------------------|-----------|----------------------------|--------------------------|------------------|--------------------|--------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | | |
| | ezzerben | | szervződés szerinti értéke | diszkontált piaci értéke | | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -72 | 20 871 | -20 964 | 20 592 | -372 | |
| | Összesen: | | | | | -372 | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -72 | 21 858 | -21 339 | 21 562 | 223 | |
| | Összesen: | | | | | 223 | |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | | 76 908 440 | 75 123 860 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | | 49 281 885 | 173 801 573 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | | -27 626 555 | 98 677 713 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | | | | | 140 589 800 | 151 482 240 |
| Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | | | | | -79 912 098 | -26 975 000 |
| A kamatswap ügylet piaci értéke: | | | | | | 60 677 702 | 124 507 240 |
| Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | | | | | 33 623 488 | 41 830 823 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 67 556 | 50 037 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 35 848 | 44 532 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 15 775 | 18 795 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 136 | 626 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 15 797 | -13 916 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix I. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. januártól 2013. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,120,332,494 | 10879.804677 |
| 2013.02.28 | 2,104,448,109 | 10815.502906 |
| 2013.03.28 | 2,102,972,091 | 10804.141339 |
| 2013.04.30 | 2,100,672,108 | 10821.624517 |
| 2013.05.31 | 2,098,993,187 | 10829.768220 |
| 2013.06.28 | 2,095,330,315 | 10843.879556 |
| 2013.07.31 | 2,101,643,096 | 10883.365074 |
| 2013.08.30 | 2,102,128,030 | 10910.113973 |
| 2013.09.30 | 2,104,437,593 | 10941.863125 |
| 2013.10.31 | 2,084,842,321 | 10965.524733 |
| 2013.11.29 | 2,086,857,471 | 10983.749420 |
| 2013.12.31 | 1,518,696,789 | 10996.284042 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 195,598

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 0 | 751 |
| 2013.február | 90 | 415 |
| 2013.március | 122 | 0 |
| 2013.április | 0 | 526 |
| 2013.május | 375 | 676 |
| 2013.június | 110 | 700 |
| 2013.július | 9 | 130 |
| 2013.augusztus | 136 | 565 |
| 2013.szeptember | 92 | 440 |
| 2013.október | 49 | 2 251 |
| 2013.november | 29 | 161 |
| 2013.december | 46 | 55 233 |
| Összesen: | 1 058 | 61 848 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 138,110

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 2,018,620,512 | 9833.258699 |
| 2012/12/28 | 2,099,874,757 | 10735.665789 |
| 2013/12/31 | 1,518,696,789 | 10996.284042 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix I. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) feltörekvő részvénypiacait reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok részvénypiacainak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége. Az alap futamideje 2013. december 02-án lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix I. Nyíltvégű Alap néven működik tovább.** Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 7%-os rögzített hozam illeti meg, amely az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelték. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014 tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

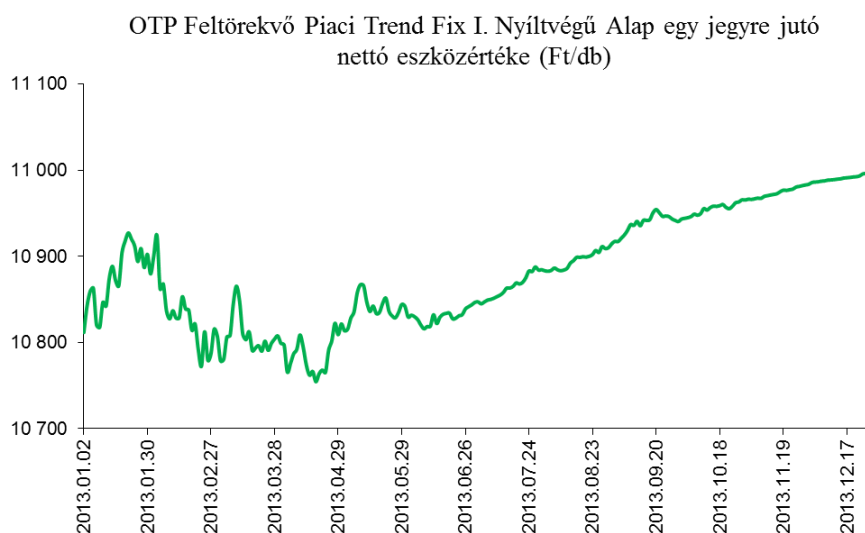
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 24 | 27 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.12.02 - 2013.12.02 | | 1 400 000 | 0 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.12.02 - 2013.12.02 | | 280 000 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | 819 100 | 52,34% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1 680 024 | 819 127 | 52,34% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 89 327 | | 0 | 0,00% |
| 2014/C 2003.06.19 - 2014.02.12 | | 89 327 | | 0 | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 24 822 | | 745 211 | 47,62% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 24 622 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 200 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 377 780 | 24,14% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 367 431 | 23,48% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 114 149 | 0 | 745 211 | 47,62% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 416 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 9 676 | | 626 | 0,04% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 302 498 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 312 590 | | 626 | 0,04% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 106 763 | | 1 564 964 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 2 303 | | 2 988 | 3,62% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 250 | 0,30% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 130 | | 416 | 0,51% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 1 072 | | 78 882 | 95,57% |
| Kötelezettségek összesen: | | 3 505 | | 82 536 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 103 258 | | 1 482 428 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 195 598 | | 134 808 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 752,96 | | 10 996,59 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) | |
|----------------------|--|------------------------------------|---|-----------|
| 2013. január 31. | 194 847 | | 10 879,80 | |
| 2013. február 28. | 194 522 | | 10 815,50 | |
| 2013. március 28. | 194 644 | | 10 804,14 | |
| 2013. április 30. | 194 118 | | 10 821,62 | |
| 2013. május 31. | 193 817 | | 10 829,77 | |
| 2013. június 28. | 193 227 | | 10 843,88 | |
| 2013. július 31. | 193 106 | | 10 883,37 | |
| 2013. augusztus 30. | 192 677 | | 10 910,11 | |
| 2013. szeptember 30. | 192 329 | | 10 941,86 | |
| 2013. október 31. | 190 127 | | 10 965,52 | |
| 2013. november 29. | 189 995 | | 10 983,75 | |
| 2013. december 31. | 134 808 | | 1 482 428 181 | 10 996,59 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| Az Alap értékpapír portfóliójának összetételével kapcsolatos további adatok (2011.évi CXCVIII. törvény 6.melléklet): | | | | |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 114 149 | 100,00% | 745 211 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 24 822 | 21,75% | 745 211 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 114 149 | 100,00% | 745 211 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint | |
|---|---|-------------|----------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 398 494 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -40 593 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -470 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -74 |
| | felügyeleti díj: | | -520 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -462 |
| f) | nettó jövedelem: | | 356 375 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 356 375 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -667 412 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -309 793 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 166 396 632 | 0 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 44 279 772 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -122 116 860 | 0 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 370 824 720 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -112 607 040 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 258 217 680 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 141 327 200 | 101 707 667 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 166 257 | 502 684 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 147 650 | 104 190 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 27 339 | 41 947 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 55 | 172 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -8 787 | 356 375 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix II. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. februártól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,991,848,208 | 10953.308558 |
| 2013.02.28 | 1,965,071,315 | 10843.567570 |
| 2013.03.28 | 1,967,885,634 | 10868.453331 |
| 2013.04.30 | 1,962,756,097 | 10886.842074 |
| 2013.05.31 | 1,947,428,794 | 10833.855124 |
| 2013.06.28 | 1,924,066,690 | 10730.751629 |
| 2013.07.31 | 1,937,675,858 | 10825.307176 |
| 2013.08.30 | 1,938,640,911 | 10841.298015 |
| 2013.09.30 | 1,961,994,748 | 10979.941395 |
| 2013.10.31 | 1,976,590,283 | 11081.156912 |
| 2013.11.29 | 1,977,584,094 | 11085.982611 |
| 2013.12.31 | 1,963,123,511 | 11053.934576 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 182,294

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 0 | 444 |
| 2013.február | 0 | 729 |
| 2013.március | 0 | 56 |
| 2013.április | 214 | 991 |
| 2013.május | 0 | 533 |
| 2013.június | 0 | 450 |
| 2013.július | 0 | 309 |
| 2013.augusztus | 46 | 222 |
| 2013.szeptember | 18 | 152 |
| 2013.október | 0 | 311 |
| 2013.november | 178 | 166 |
| 2013.december | 17 | 808 |
| Összesen: | 473 | 5 171 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 177,595

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 1,858,787,439 | 9606.285570 |
| 2012/12/28 | 1,960,708,343 | 10755.748094 |
| 2013/12/31 | 1,963,123,511 | 11053.934576 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 februárjában indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix II. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) feltörekvő részvénypiacait reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok részvénypiacainak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

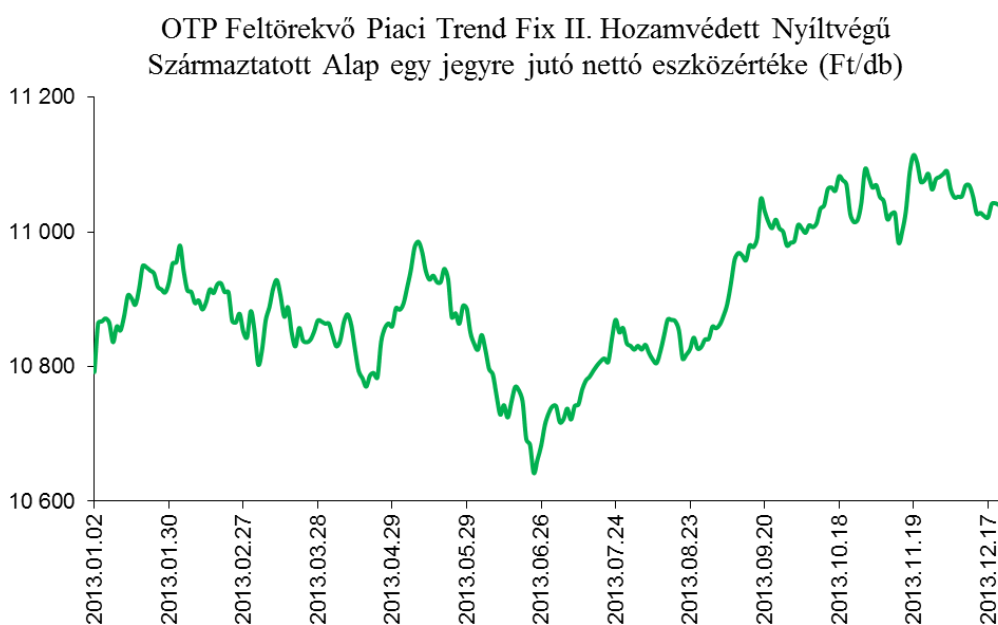
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 20 | 16 | 0,00% | | |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.12.01 - 2014.12.01 | | 160 000 | 0 | 0,00% | | |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.12.01 - 2014.12.01 | | 1 380 000 | 1 380 000 | 70,15% | | |
| Raiffeisen Bank HUF 2011.12.01 - 2014.12.01 | | 0 | 120 000 | 6,10% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1 540 020 | 1 500 016 | 76,25% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 28 272 | | 0 | 0,00% |
| 2014/D 2011.01.19 - 2014.08.22 | | | 28 272 | | 0 | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | | 33 979 | | 11 923 | 0,61% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | 33 740 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | | 239 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | | 11 923 | 0,61% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 62 251 | 0 | 11 923 | 0,61% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 8 870 | | 5 412 | 0,27% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 355 493 | | 449 840 | 22,87% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 364 363 | | 455 252 | 23,14% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 1 966 634 | | 1 967 191 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 3 303 | | 3 338 | 83,97% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 248 | 6,24% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 120 | | 389 | 9,79% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 615 | | 0 | 0,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 5 038 | | 3 975 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 1 961 596 | | 1 963 216 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 182 293 | | 177 595 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 760,68 | | 11 054,45 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 181 849 | | 10 953,31 |
| 2013. február 28. | 181 120 | | 10 843,57 |
| 2013. március 28. | 181 064 | | 10 868,45 |
| 2013. április 30. | 180 287 | | 10 886,84 |
| 2013. május 31. | 179 754 | | 10 833,86 |
| 2013. június 28. | 179 304 | | 10 730,75 |
| 2013. július 31. | 178 995 | | 10 825,31 |
| 2013. augusztus 30. | 178 819 | | 10 841,30 |
| 2013. szeptember 30. | 178 685 | | 10 979,94 |
| 2013. október 31. | 178 374 | | 11 081,16 |
| 2013. november 29. | 178 386 | | 11 085,98 |
| 2013. december 31. | 177 595 | 1 963 215 265 | 11 054,45 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 62 251 | 100,00% | 11 923 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok: | 33 979 | 54,58% | 11 923 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 62 251 | 100,00% | 11 923 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint | |
|---|---|-------------|---------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 513 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -39 203 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -451 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -74 |
| | felügyeleti díj: | | -490 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -448 |
| f) | nettó jövedelem: | | -40 153 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -40 153 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -51 028 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 92 801 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 167 958 880 | 164 390 200 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 85 659 029 | 27 017 172 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -82 299 851 | -137 373 028 |
| | | | |
| | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 452 743 060 | 485 323 300 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -182 908 880 | -62 500 900 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 269 834 180 | 422 822 400 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 129 312 089 | 93 170 856 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|-------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| | | | adatok ezer Ft-ban | |
| | A tétel megnevezése | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 151 345 | 96 405 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 137 000 | 95 892 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 38 466 | 40 484 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 66 | 182 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -24 187 | -40 153 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix III. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. áprilistól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,093,785,554 | 10867.041848 |
| 2013.02.28 | 2,071,916,618 | 10797.643486 |
| 2013.03.28 | 2,069,221,566 | 10829.708461 |
| 2013.04.30 | 2,071,252,487 | 10868.380525 |
| 2013.05.31 | 2,065,438,938 | 10856.161142 |
| 2013.06.28 | 2,047,258,850 | 10776.464535 |
| 2013.07.31 | 2,057,278,780 | 10863.518310 |
| 2013.08.30 | 2,061,189,303 | 10891.817371 |
| 2013.09.30 | 2,081,936,907 | 11003.894857 |
| 2013.10.31 | 2,094,431,463 | 11082.762092 |
| 2013.11.29 | 2,097,724,798 | 11105.477752 |
| 2013.12.31 | 2,095,356,252 | 11088.535779 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 192,861

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 20 | 497 |
| 2013.február | 0 | 498 |
| 2013.március | 0 | 912 |
| 2013.április | 45 | 443 |
| 2013.május | 55 | 376 |
| 2013.június | 0 | 280 |
| 2013.július | 0 | 600 |
| 2013.augusztus | 0 | 133 |
| 2013.szeptember | 100 | 142 |
| 2013.október | 0 | 269 |
| 2013.november | 28 | 68 |
| 2013.december | 259 | 345 |
| Összesen: | 507 | 4 563 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 188,966

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2011/12/30 | 1,918,901,364 | 9499.934967 |
| 2012/12/28 | 2,059,424,204 | 10678.282307 |
| 2013/12/31 | 2,095,356,252 | 11088.535779 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 áprilisában indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix III. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) feltörekvő részvénypiacait reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok részvénypiacainak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 23 | | 24 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | 10 | | 544 | | 0,03% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.12.01 - 2014.12.01 | | 1 500 000 | | 1 500 000 | | 71,44% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 1 500 033 | | 1 500 568 | | 71,47% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | 41 724 | | 0 | | 0,00% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | | 41 724 | | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | | 39 208 | | 8 480 | | 0,40% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 39 208 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 8 480 | | 0,40% |
| Kötvények: | | | 127 494 | | 142 754 | | 6,80% |
| OTPHB FLOAT 03/1/ | 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 127 494 | | 142 754 | | 6,80% |
| Jelzáloglevelek: | | | 52 232 | | 49 486 | | 2,36% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - 2015.09.14 | | 52 232 | | 49 486 | | 2,36% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 260 658 | 0 | 200 720 | 0 | 9,56% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | | 317 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 8 458 | | 5 225 | | 0,25% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 294 665 | | 393 151 | | 18,72% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 303 440 | | 398 376 | | 18,97% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 064 131 | | 2 099 664 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 3 296 | | 3 556 | | 59,07% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 264 | | 4,39% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 126 | | 415 | | 6,89% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 0 | | 1 785 | | 29,65% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 422 | | 6 020 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 060 709 | | 2 093 644 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 192 861 | | 188 805 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 684,94 | | 11 088,92 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 192 384 | | 10 867,04 |
| 2013. február 28. | 191 886 | | 10 797,64 |
| 2013. március 28. | 190 974 | | 10 829,71 |
| 2013. április 30. | 190 576 | | 10 868,38 |
| 2013. május 31. | 190 255 | | 10 856,16 |
| 2013. június 28. | 189 975 | | 10 776,46 |
| 2013. július 31. | 189 375 | | 10 863,52 |
| 2013. augusztus 30. | 189 242 | | 10 891,82 |
| 2013. szeptember 30. | 189 200 | | 11 003,89 |
| 2013. október 31. | 188 931 | | 11 082,76 |
| 2013. november 29. | 188 891 | | 11 105,48 |
| 2013. december 31. | 188 805 | 2 093 643 699 | 11 088,92 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix III. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 260 658 | 100,00% | 200 720 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: a fentiekből: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 39 208 | 15,04% | 8 480 | 4,22% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 260 658 | 100,00% | 200 720 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint | |
|---|---|-----------------------------------|-------------|---------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | | 9 453 |
| b) | egyéb bevétel: | | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | | -41 369 |
| d) | a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -479 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | | |
| | bizományosi díj: | | | 0 |
| | bankköltség: | | | -140 |
| | felügyeleti díj: | | | -519 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | | -429 |
| f) | nettó jövedelem: | | | -33 483 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | | -33 483 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | | -43 944 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | | 110 362 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | | |
|--|------------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|--------------------------|--------------------|--------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -379 | 109 865 | -110 350 | 108 393 | -1 957 | |
| | Összesen: | | | | | -1 957 | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -377 | 114 497 | -111 775 | 112 942 | 1 167 | |
| | Összesen: | | | | | 1 167 | |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | | 164 922 660 | 161 766 000 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | | 63 673 649 | 14 547 588 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | | -101 249 011 | -147 218 412 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | | | | | 406 800 000 | 436 074 000 |
| Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | | | | | -173 851 500 | -58 638 000 |
| A kamatswap ügylet piaci értéke: | | | | | | 232 948 500 | 377 436 000 |
| Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | | | | | 126 614 625 | 88 475 834 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| | A tétel megnevezése | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | c. | d. |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 171 071 | 114 410 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 136 438 | 104 957 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 38 197 | 42 790 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 106 | 146 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -3 670 | -33 483 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IV. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. májustól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,714,741,723 | 10769.237604 |
| 2013.02.28 | 2,671,863,823 | 10654.893936 |
| 2013.03.28 | 2,672,636,518 | 10680.591760 |
| 2013.04.30 | 2,674,805,290 | 10712.418860 |
| 2013.05.31 | 2,661,829,111 | 10700.046272 |
| 2013.06.28 | 2,638,085,889 | 10612.751337 |
| 2013.07.31 | 2,660,506,802 | 10718.816812 |
| 2013.08.30 | 2,653,315,934 | 10741.126101 |
| 2013.09.30 | 2,684,537,937 | 10896.809291 |
| 2013.10.31 | 2,701,400,997 | 10990.329445 |
| 2013.11.29 | 2,693,716,097 | 10983.462304 |
| 2013.12.31 | 2,673,516,593 | 10946.851057 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 253,516

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 0 | 1 433 |
| 2013.február | 27 | 1 436 |
| 2013.március | 0 | 544 |
| 2013.április | 0 | 438 |
| 2013.május | 36 | 961 |
| 2013.június | 46 | 236 |
| 2013.július | 7 | 375 |
| 2013.augusztus | 0 | 1 585 |
| 2013.szeptember | 5 | 269 |
| 2013.október | 18 | 586 |
| 2013.november | 27 | 567 |
| 2013.december | 0 | 1 037 |
| Összesen: | 166 | 9 467 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 244,227

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 2,563,764,373 | 9415.531079 |
| 2012/12/28 | 2,059,424,204 | 10678.282307 |
| 2013/12/31 | 2,673,516,593 | 10946.851057 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 májusában indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IV. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) feltörekvő részvénypiacait reprezentáló index adja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok részvénypiacainak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 12 | | 30 | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.06.01 - 2014.12.01 | | 230 000 | | 0 | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.06.01 - 2014.12.01 | | 2 000 000 | | 2 000 000 | 74,65% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.06.01 - 2014.12.01 | | 0 | | 115 000 | 4,29% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 2 230 012 | | 2 115 030 | 78,94% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | 17 795 | | 0 | | 0,00% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | 17 795 | | 0 | | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 35 069 | | 14 173 | | 0,53% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 35 069 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 14 173 | | 0,53% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 52 864 | 0 | 14 173 | 0 | 0,53% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 147 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 12 575 | | 7 367 | 0,28% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 403 081 | | 542 494 | 20,25% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 415 803 | | 549 861 | 20,53% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 698 679 | | 2 679 064 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 4 308 | | 4 552 | 82,60% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 339 | 6,15% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 165 | | 489 | 8,87% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 532 | | 131 | 2,38% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 5 005 | | 5 511 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 693 674 | | 2 673 553 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 253 516 | | 244 215 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 625,26 | | 10 947,54 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 252 083 | | 10 769,24 |
| 2013. február 28. | 250 674 | | 10 654,89 |
| 2013. március 28. | 250 130 | | 10 680,59 |
| 2013. április 30. | 249 692 | | 10 712,42 |
| 2013. május 31. | 248 767 | | 10 700,05 |
| 2013. június 28. | 248 577 | | 10 612,75 |
| 2013. július 31. | 248 209 | | 10 718,82 |
| 2013. augusztus 30. | 246 624 | | 10 741,13 |
| 2013. szeptember 30. | 246 360 | | 10 896,81 |
| 2013. október 31. | 245 792 | | 10 990,33 |
| 2013. november 29. | 245 252 | | 10 983,46 |
| 2013. december 31. | 244 215 | 2 673 552 691 | 10 947,54 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IV. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 52 864 | 100,00% | 14 173 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 35 069 | 66,34% | 14 173 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 52 864 | 100,00% | 14 173 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint | |
|---|---|-------------|----------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | -2 918 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -53 371 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -616 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -74 |
| | felügyeleti díj: | | -668 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -390 |
| f) | nettó jövedelem: | | -58 037 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -58 037 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -100 133 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 138 049 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 190 122 750 | 184 696 500 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 89 991 435 | 16 992 078 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -100 131 315 | -167 704 422 |
| | | | |
| | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 571 549 000 | 612 676 890 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -258 459 230 | -87 175 160 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 313 089 770 | 525 501 730 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 183 831 288 | 131 534 072 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | adatok ezer Ft-ban | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 226 131 | 133 068 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 199 765 | 135 986 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 50 390 | 55 049 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 162 | 70 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -24 186 | -58 037 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix V. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. júliustól 2014. decemberig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,405,681,461 | 11046.079459 |
| 2013.02.28 | 2,399,802,930 | 11036.722790 |
| 2013.03.28 | 2,403,622,470 | 11068.491152 |
| 2013.04.30 | 2,418,284,599 | 11145.247231 |
| 2013.05.31 | 2,440,523,902 | 11287.277723 |
| 2013.06.28 | 2,357,836,758 | 10931.092990 |
| 2013.07.31 | 2,416,662,799 | 11221.137867 |
| 2013.08.30 | 2,393,467,569 | 11198.504517 |
| 2013.09.30 | 2,462,462,122 | 11558.304609 |
| 2013.10.31 | 2,479,999,546 | 11666.303879 |
| 2013.11.29 | 2,498,986,337 | 11758.497017 |
| 2013.12.31 | 2,453,658,121 | 11561.969866 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 218,058

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 44 | 357 |
| 2013.február | 9 | 326 |
| 2013.március | 10 | 274 |
| 2013.április | 0 | 380 |
| 2013.május | 2 | 562 |
| 2013.június | 0 | 519 |
| 2013.július | 0 | 341 |
| 2013.augusztus | 10 | 1 638 |
| 2013.szeptember | 0 | 684 |
| 2013.október | 13 | 482 |
| 2013.november | 0 | 52 |
| 2013.december | 0 | 559 |
| Összesen: | 88 | 6 174 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 212,218

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2011/12/30 | 2,158,026,770 | 9368.956794 |
| 2012/12/28 | 2,355,196,222 | 10800.778793 |
| 2013/12/31 | 2,453,658,121 | 11561.969866 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2011 júliusában indult OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix V. Alap mögöttes befektetéseit egy 20 elemű részvénykosár adja, ami a BRIC országok nagyvállalatainak, illetve olyan európai vállalatoknak a részvényeiből áll, amelyek árbevételük jelentős részét a feltörekvő országokból nyerik. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok és Európa részvénytőzsdáinak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|--------------|------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | | |
| Bank | | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | | 18 | | 24 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | | | 0 | | 1 | | 0,00% |
| MKB Bank | 2011.12.01 - | 2014.12.01 | | 1 400 000 | | 1 400 000 | | 56,95% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 1 400 018 | | 1 400 025 | | 56,95% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| Államkötvények: | | | | 134 559 | | 86 035 | | 3,50% |
| 2015/A | 2004.07.14 - | 2015.02.12 | | 134 559 | | 86 035 | | 3,50% |
| MNB Kötvények: | | | | 27 760 | | 18 108 | | 0,74% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | | 26 851 | | 0 | | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | | 909 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | | 0 | | 18 108 | | 0,74% |
| Jelzáloglevelek: | | | | 484 717 | | 504 309 | | 20,51% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - | 2015.09.14 | | 484 717 | | 504 309 | | 20,51% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | | 647 036 | 0 | 608 452 | 0 | 24,75% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | | |
| Követelések | | | | 305 | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 8 018 | | 5 005 | | 0,20% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 304 528 | | 445 077 | | 18,10% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 312 851 | | 450 082 | | 18,30% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | | 2 359 905 | | 2 458 559 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | | 3 476 | | 3 648 | | 47,84% |
| Letétkezelői díj miatt | | | | 0 | | 311 | | 4,08% |
| Költségmentes egyéb tétel miatt | | | | 143 | | 475 | | 6,23% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | | 54 | | 3 191 | | 41,85% |
| Kötelezettségek összesen: | | | | 3 673 | | 7 625 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | | 2 356 232 | | 2 450 934 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 217 740 | | 11 046,08 |
| 2013. február 28. | 217 423 | | 11 036,72 |
| 2013. március 28. | 217 159 | | 11 068,49 |
| 2013. április 30. | 216 779 | | 11 145,25 |
| 2013. május 31. | 216 219 | | 11 287,28 |
| 2013. június 28. | 215 700 | | 10 931,09 |
| 2013. július 31. | 215 359 | | 11 221,14 |
| 2013. augusztus 30. | 213 731 | | 11 198,50 |
| 2013. szeptember 30. | 213 047 | | 11 558,30 |
| 2013. október 31. | 212 578 | | 11 666,30 |
| 2013. november 29. | 212 526 | | 11 758,50 |
| 2013. december 31. | 211 967 | 2 450 933 601 | 11 562,81 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix V. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 647 036 | 100,00% | 608 452 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 27 760 | 4,29% | 18 108 | 2,98% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 647 036 | 100,00% | 608 452 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 50 870 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -42 433 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -564 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -142 |
| | felügyeleti díj: | -605 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -477 |
| f) | nettó jövedelem: | 6 649 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 6 649 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -68 699 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 156 752 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 174 911 388 | 170 659 986 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 124 531 674 | 131 293 281 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -50 379 714 | -39 366 705 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 345 205 000 | 370 045 200 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -165 208 400 | -56 261 800 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 179 996 600 | 313 783 400 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 116 984 000 | 84 134 556 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | adatok ezer Ft-ban | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 186 979 | 135 717 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 123 891 | 84 847 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 39 772 | 44 065 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 138 | 156 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 23 178 | 6 649 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VI. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. szeptembertől 2015. márciusig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 3,540,752,729 | 12282.807825 |
| 2013.02.28 | 3,547,055,842 | 12323.654450 |
| 2013.03.28 | 3,568,978,741 | 12405.554346 |
| 2013.04.30 | 3,601,578,680 | 12563.325171 |
| 2013.05.31 | 3,628,326,065 | 12664.844828 |
| 2013.06.28 | 3,477,063,164 | 12161.560667 |
| 2013.07.31 | 3,595,168,277 | 12577.422841 |
| 2013.08.30 | 3,592,293,051 | 12575.547076 |
| 2013.09.30 | 3,714,856,603 | 13040.029356 |
| 2013.10.31 | 3,755,274,952 | 13202.576870 |
| 2013.11.29 | 3,772,353,943 | 13287.942792 |
| 2013.12.31 | 3,715,224,973 | 13134.176037 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 288,973

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Viszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| 2013.január | 280 | 970 |
| 2013.február | 165 | 618 |
| 2013.március | 79 | 714 |
| 2013.április | 44 | 560 |
| 2013.május | 113 | 302 |
| 2013.június | 593 | 1 173 |
| 2013.július | 328 | 391 |
| 2013.augusztus | 38 | 227 |
| 2013.szeptember | 70 | 952 |
| 2013.október | 75 | 714 |
| 2013.november | 18 | 257 |
| 2013.december | 296 | 1 159 |
| Összesen: | 2 099 | 8 037 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 282,867

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 2,992,941,017 | 9863.110045 |
| 2012/12/28 | 3,438,581,188 | 11899.316504 |
| 2013/12/31 | 3,715,224,973 | 13134.176037 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 szeptemberében indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VI. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy 20 elemű részvénykosár adja, ami a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) nagyvállalatainak, illetve olyan európai vállalatoknak a részvényeiből áll, amelyek árbevételük jelentős részét a feltörekvő országokból nyerik. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok és Európa részvénytőzsdáinak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-----------------|-------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------|----------------|---------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | | 3 522 | 26 | | 0,00% | |
| MKB Bank HUF | 2011.12.30 - | 2015.03.31 | | 910 000 | 910 000 | | 24,41% | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.12.30 - | 2015.03.31 | | 910 000 | 910 000 | | 24,41% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | | | 1 823 522 | 1 820 026 | | 48,82% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | | | |
| MNB Kötvények: | | | | 23 111 | 9 879 | | 0,27% | |
| MNB130102 | 2012.12.19 - | 2013.01.02 | | 21 643 | 0 | | 0,00% | |
| MNB130109 | 2012.12.27 - | 2013.01.09 | | 1 468 | 0 | | 0,00% | |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | | 0 | 9 879 | | 0,27% | |
| Kötvények: | | | | 236 525 | 262 986 | | 7,05% | |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - | 2016.05.31 | | 45 283 | 48 854 | | 1,31% | |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - | 2015.03.04 | | 191 242 | 214 132 | | 5,74% | |
| Jelzáloglevelek: | | | | 630 069 | 583 345 | | 15,65% | |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - | 2015.09.14 | | 630 069 | 583 345 | | 15,65% | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | | 889 705 | 0 | 856 210 | 0 | 22,97% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | 0 | | 0,00% | |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 37 759 | 214 | | 0,01% | |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 723 720 | 1 051 048 | | 28,20% | |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 761 479 | 1 051 262 | | 28,21% | |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | | 3 474 706 | 3 727 498 | | 100,00% | |
| Kötelezettségek | | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | | 5 495 | 6 291 | | 63,38% | |
| Letétkezelői díj miatt | | | | 0 | 469 | | 4,73% | |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | | 206 | 554 | | 5,58% | |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | | 1 046 | 2 612 | | 26,31% | |
| Kötelezettségek összesen: | | | | 6 747 | 9 926 | | 100,00% | |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | | 3 467 959 | 3 717 572 | | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|---------------------------------------|--|
| 2013. január 31. | 288 278 | | 12 282,81 |
| 2013. február 28. | 287 825 | | 12 323,65 |
| 2013. március 28. | 287 190 | | 12 405,55 |
| 2013. április 30. | 286 674 | | 12 563,33 |
| 2013. május 31. | 286 485 | | 12 664,84 |
| 2013. június 28. | 285 905 | | 12 161,56 |
| 2013. július 31. | 285 842 | | 12 577,42 |
| 2013. augusztus 30. | 285 653 | | 12 575,55 |
| 2013. szeptember 30. | 284 771 | | 13 040,03 |
| 2013. október 31. | 284 132 | | 13 202,58 |
| 2013. november 29. | 283 893 | | 13 287,94 |
| 2013. december 31. | 283 030 | 3 717 572 595 | 13 134,91 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VI. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 889 705 | 100,00% | 856 210 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 23 111 | 2,60% | 9 879 | 1,15% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 889 705 | 100,00% | 856 210 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|--|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 26 324 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -72 105 |
| d) a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -849 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| bizományosi díj: | | 0 |
| bankköltség: | | -75 |
| felügyeleti díj: | | -903 |
| egyéb költség és ráfordítás: | | -705 |
| f) nettó jövedelem: | | -48 313 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| újra befektetett jövedelem: | | -48 313 |
| h) a tőkeszámla változása: | | -74 345 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 372 271 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|--|------------------|--|-----------|-----------------------------|--------------------|---------------|
| | adatok | határidő ügylet | | határidős ügylet | | |
| | ezerben | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -675 | 195 669 | -196 534 | 193 048 | -3 486 |
| | Összesen: | | | | | -3 486 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -675 | 204 923 | -200 051 | 202 140 | 2 089 |
| | Összesen: | | | | | 2 089 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | Szerződés szerinti érték: | | 251 483 940 | 247 563 720 | |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | 526 354 478 | 626 820 078 | |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | 274 870 538 | 379 256 358 | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | 478 363 340 | 515 425 820 | |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | -277 510 971 | -93 287 740 | |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | 200 852 369 | 422 138 080 | |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | 116 992 128 | 145 247 628 | |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | | | |
|---------------------|-------|---------------------------------|--|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | | | |
| A tétel megnevezése | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | | | c. | d. | |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | | 275 365 | 195 995 | |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 142 123 | 169 671 | |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | | 0 | 0 | |
| 04. | IV. | Működési költségek | | 60 733 | 74 253 | |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | | 138 | 384 | |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | | 0 | 0 | |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 | 0 | |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | | 72 371 | -48 313 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VII. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. novemberől 2015. márciusig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,314,713,722 | 12019.030973 |
| 2013.02.28 | 1,309,373,666 | 11941.392303 |
| 2013.03.28 | 1,317,526,339 | 12035.721298 |
| 2013.04.30 | 1,317,647,034 | 12136.047028 |
| 2013.05.31 | 1,334,377,715 | 12298.638823 |
| 2013.06.28 | 1,275,836,339 | 11794.624613 |
| 2013.07.31 | 1,300,965,699 | 12172.664574 |
| 2013.08.30 | 1,297,175,906 | 12178.111531 |
| 2013.09.30 | 1,338,223,357 | 12670.529905 |
| 2013.10.31 | 1,342,062,093 | 12746.944892 |
| 2013.11.29 | 1,345,535,780 | 12856.747630 |
| 2013.12.31 | 1,323,711,458 | 12647.730346 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 110,366

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 106 | 1 086 |
| 2013.február | 358 | 95 |
| 2013.március | 52 | 233 |
| 2013.április | 0 | 945 |
| 2013.május | 698 | 723 |
| 2013.június | 0 | 327 |
| 2013.július | 32 | 1 327 |
| 2013.augusztus | 0 | 359 |
| 2013.szeptember | 39 | 939 |
| 2013.október | 0 | 332 |
| 2013.november | 76 | 660 |
| 2013.december | 188 | 120 |
| Összesen: | 1 549 | 7 146 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 104,660

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2011/12/30 | 1,138,027,172 | 9715.268931 |
| 2012/12/28 | 1,287,704,091 | 11667.579608 |
| 2013/12/31 | 1,323,711,458 | 12647.730346 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 novemberében indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VII. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy 20 elemű részvénykosár adja, ami a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) nagyvállalatainak, illetve olyan európai vállalatoknak a részvényeiből áll, amelyek árbevételük jelentős részét a feltörekvő országokból nyerik. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok és Európa részvénytőzsdáinak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

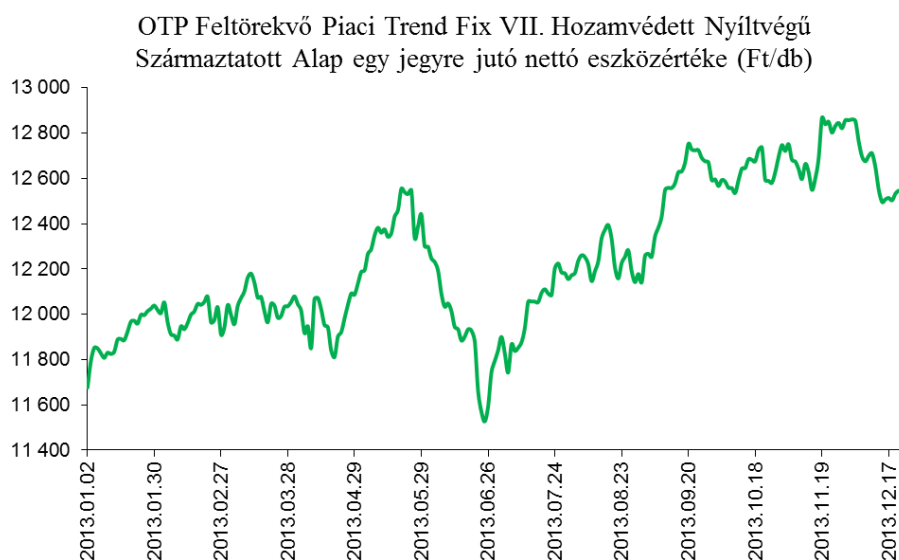
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 26 | | 23 | | 0,00% |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.12.30 - 2015.03.31 | | 730 000 | | 730 000 | | 54,98% |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 730 026 | | 730 023 | | 54,98% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | |
| MNB Kötvények: | | | 9 767 | | 33 881 | | 2,55% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 9 767 | | 0 | | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 33 881 | | 2,55% |
| Kötvények: | | | 132 185 | | 114 203 | | 8,60% |
| MAGYAR 5.875 05/1 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | | 30 189 | | 0 | | 0,00% |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 101 996 | | 114 203 | | 8,60% |
| Jelzáloglevelek: | | | 161 920 | | 100 753 | | 7,59% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - 2015.09.14 | | 161 920 | | 100 753 | | 7,59% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 303 872 | 0 | 248 837 | 0 | 18,74% |
| Egyéb eszközök | | | | | | | |
| Követelések | | | 1 528 | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 15 204 | | 87 | | 0,01% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 241 339 | | 348 882 | | 26,27% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 258 071 | | 348 969 | | 26,28% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 1 291 969 | | 1 327 829 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 2 165 | | 2 247 | | 83,97% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 168 | | 6,28% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 78 | | 261 | | 9,75% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 166 | | 0 | | 0,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 409 | | 2 676 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 1 288 560 | | 1 325 153 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 109 386 | | 12 019,03 |
| 2013. február 28. | 109 649 | | 11 941,39 |
| 2013. március 28. | 109 468 | | 12 035,72 |
| 2013. április 30. | 108 523 | | 12 136,05 |
| 2013. május 31. | 108 498 | | 12 298,64 |
| 2013. június 28. | 108 171 | | 11 794,62 |
| 2013. július 31. | 106 876 | | 12 172,66 |
| 2013. augusztus 30. | 106 517 | | 12 178,11 |
| 2013. szeptember 30. | 105 617 | | 12 670,53 |
| 2013. október 31. | 105 285 | | 12 746,94 |
| 2013. november 29. | 104 701 | | 12 856,75 |
| 2013. december 31. | 104 769 | 1 325 153 571 | 12 648,34 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 303 872 | 100,00% | 248 837 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok: | 9 767 | 3,21% | 33 881 | 13,62% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 303 872 | 100,00% | 248 837 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 19 295 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -26 339 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -304 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -74 |
| | felügyeleti díj: | | -329 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -364 |
| f) | nettó jövedelem: | | -8 115 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -8 115 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -67 977 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 112 685 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|--|------------------|--|----------------------------|--------------------------|--------------------|--------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezemben | | szervződés szerinti értéke | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -378 | 109 575 | -110 059 | 108 107 | -1 952 |
| | Összesen: | | | | | -1 952 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -378 | 114 757 | -112 029 | 113 199 | 1 170 |
| | Összesen: | | | | | 1 170 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | 102 273 550 | 97 532 925 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | 158 109 380 | 172 923 240 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | 55 835 830 | 75 390 315 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | | 197 366 450 | 212 657 760 |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | | -112 184 291 | -37 868 750 |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | | 85 182 159 | 174 789 010 |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | | 47 202 205 | 58 724 038 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 105 096 | 91 697 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 55 506 | 72 402 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 24 377 | 27 224 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 65 | 186 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 25 148 | -8 115 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VIII. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2011. decembertől 2015. márciusig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,125,430,886 | 11988.306782 |
| 2013.02.28 | 2,130,097,271 | 12014.152765 |
| 2013.03.28 | 2,125,668,663 | 12028.795875 |
| 2013.04.30 | 2,146,113,276 | 12172.730643 |
| 2013.05.31 | 2,167,453,247 | 12282.067211 |
| 2013.06.28 | 2,095,113,568 | 11874.368443 |
| 2013.07.31 | 2,149,596,350 | 12203.007329 |
| 2013.08.30 | 2,137,936,335 | 12187.112144 |
| 2013.09.30 | 2,204,357,524 | 12585.397392 |
| 2013.10.31 | 2,227,410,343 | 12708.524286 |
| 2013.11.29 | 2,254,689,739 | 12892.192369 |
| 2013.12.31 | 2,216,075,992 | 12724.733668 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 176,762

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 622 | 96 |
| 2013.február | 609 | 704 |
| 2013.március | 188 | 671 |
| 2013.április | 49 | 458 |
| 2013.május | 515 | 447 |
| 2013.június | 145 | 78 |
| 2013.július | 273 | 699 |
| 2013.augusztus | 0 | 588 |
| 2013.szeptember | 81 | 355 |
| 2013.október | 590 | 473 |
| 2013.november | 61 | 442 |
| 2013.december | 531 | 1 314 |
| Összesen: | 3 664 | 6 325 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 174,155

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2011/12/30 | 1,856,369,430 | 9795.110965 |
| 2012/12/28 | 2,061,845,214 | 11664.527523 |
| 2013/12/31 | 2,216,075,992 | 12724.733668 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2011 decemberében indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix VIII. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit egy 20 elemű részvénykosár adja, ami a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) nagyvállalatainak, illetve olyan európai vállalatoknak a részvényeiből áll, amelyek árbevételük jelentős részét a feltörekvő országokból nyerik. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok és Európa részvénypiacainak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

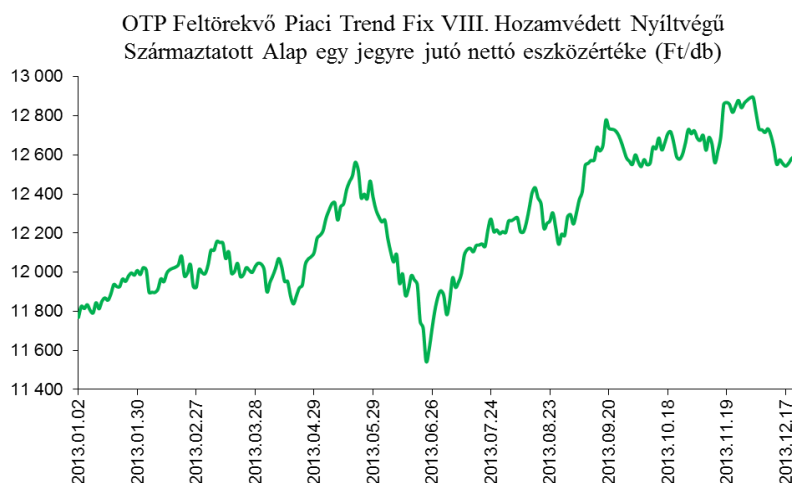
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 126 | 25 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 227 | 0,01% | | |
| MKB Bank HUF 2011.12.30 - 2015.03.31 | | 600 000 | 600 000 | 27,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.31 - 2014.01.08 | | 0 | 29 691 | 1,34% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 600 126 | 629 943 | 28,35% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 954 467 | | 961 887 | 43,29% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | | 490 970 | | 496 622 | 22,35% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | | 107 964 | | 109 739 | 4,94% |
| REPHUN 6.75 07/14 | 2009.07.28 - 2014.07.28 | | 355 533 | | 355 526 | 16,00% |
| MNB Kötvények: | | | 46 024 | | 8 904 | 0,40% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 44 476 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 1 548 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 7 516 | 0,34% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 1 388 | 0,06% |
| Kötvények: | | | 155 571 | | 183 672 | 8,26% |
| OTPHB FLOAT 03/1: | 2005.03.04 - 2015.03.04 | | 76 496 | | 85 654 | 3,85% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | | 79 075 | | 98 018 | 4,41% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 1 156 062 | 0 | 1 154 463 | 51,95% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 12 541 | | 73 | 0,00% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 298 364 | | 437 730 | 19,70% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 310 905 | | 437 803 | 19,70% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 067 093 | | 2 222 209 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 3 469 | | 3 751 | 57,84% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 280 | 4,32% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 124 | | 431 | 6,65% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 0 | | 2 023 | 31,19% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 593 | | 6 485 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 063 500 | | 2 215 724 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 177 292 | | 11 988,31 |
| 2013. február 28. | 177 197 | | 12 014,15 |
| 2013. március 28. | 176 714 | | 12 028,80 |
| 2013. április 30. | 176 305 | | 12 172,73 |
| 2013. május 31. | 176 373 | | 12 282,07 |
| 2013. június 28. | 176 440 | | 11 874,37 |
| 2013. július 31. | 176 014 | | 12 203,01 |
| 2013. augusztus 30. | 175 426 | | 12 187,11 |
| 2013. szeptember 30. | 175 152 | | 12 585,40 |
| 2013. október 31. | 175 269 | | 12 708,52 |
| 2013. november 29. | 174 888 | | 12 892,19 |
| 2013. december 31. | 174 105 | 2 215 723 421 | 12 726,36 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 1 156 062 | 100,00% | 1 154 463 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 46 024 | 3,98% | 8 904 | 0,77% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 1 156 062 | 100,00% | 1 154 463 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 58 900 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -43 200 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -506 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -134 |
| | felügyeleti díj: | | -539 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -824 |
| f) | nettó jövedelem: | | 13 697 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 13 697 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | -32 393 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 170 920 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|--|---------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -262 | 76 206 | -76 372 | 75 185 | -1 187 |
| | EUR | -1 341 | 388 729 | -390 448 | 383 522 | -6 926 |
| | Összesen: | | | | | -8 113 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -1 602 | 486 401 | -474 837 | 479 796 | 4 959 |
| | Összesen: | | | | | 4 959 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | 158 377 011 | 158 377 011 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | 238 360 050 | 291 152 387 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | 79 983 039 | 132 775 376 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | | 147 898 733 | 172 743 600 |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | | -79 782 600 | -31 125 000 |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | | 68 116 133 | 141 618 600 |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | | 41 762 167 | 48 266 334 |

9. Eredmény kimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 183 200 | 166 788 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 51 336 | 107 888 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 38 847 | 44 671 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 303 | 532 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 92 714 | 13 697 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IX. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2012. január 24.-től 2015. március 31.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,919,337,806 | 12155.145691 |
| 2013.02.28 | 2,881,263,157 | 11996.615594 |
| 2013.03.28 | 2,905,393,062 | 12097.084443 |
| 2013.04.30 | 2,835,632,078 | 11806.623051 |
| 2013.05.31 | 2,839,534,930 | 11822.873221 |
| 2013.06.28 | 2,752,364,398 | 11459.924296 |
| 2013.07.31 | 2,793,600,384 | 11631.617143 |
| 2013.08.30 | 2,792,110,891 | 11625.415392 |
| 2013.09.30 | 2,859,166,761 | 11904.613595 |
| 2013.10.31 | 2,877,936,744 | 11982.765523 |
| 2013.11.29 | 2,890,317,385 | 12034.314369 |
| 2013.12.31 | 2,860,622,508 | 11910.674839 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2012. december 31-én 240,173 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2012/12/28 | 2,823,799,169 | 11757.354778 |
| 2013/12/31 | 2,860,622,508 | 11910.674839 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2012 januárjában indult az OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IX. Alap, amelynek mögöttes befektetéseit a BRIC országok (Brazília, Oroszország, India, Kína) 40 legnagyobb vállalatának részvényeit tömörítő részvényindex alkotja. Az alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a BRIC országok részvénytőzsdáinak teljesítményének, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 14 | 28 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 66 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 200 414 | | 6,99% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 14 | 200 508 | | 6,99% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 692 532 | | 1 580 327 | 55,15% |
| 2015/A | 2004.07.14 - 2015.02.12 | 152 713 | | 153 184 | 5,35% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | 539 819 | | 548 693 | 19,15% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | 0 | | 163 064 | 5,69% |
| 2016/D | 2013.01.16 - 2016.12.22 | 0 | | 416 505 | 14,53% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | 0 | | 298 881 | 10,43% |
| MNB Kötvények: | | 206 621 | | 60 893 | 2,12% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 122 661 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 83 960 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 58 826 | 2,05% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 2 067 | 0,07% |
| Kötvények: | | 1 059 549 | | 256 958 | 8,97% |
| HUSTHO 4.4 09/14 | 2009.09.25 - 2014.09.25 | 235 659 | | 0 | 0,00% |
| MAGYAR 5.875 05/14 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | 543 403 | | 0 | 0,00% |
| OTPHB FLOAT 03/14 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 280 487 | | 256 958 | 8,97% |
| Jelzáloglevelek: | | 637 634 | | 665 541 | 23,23% |
| FJ15NF01 | 2010.02.18 - 2015.09.14 | 30 294 | | 31 519 | 1,10% |
| OJB EUR 4 12/15/14 | 2004.12.15 - 2014.12.15 | 607 340 | | 634 022 | 22,13% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 596 336 | 0 | 2 563 719 | 89,47% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 0 | | 10 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 235 344 | 101 326 | 3,54% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 235 344 | 101 336 | 3,54% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 831 694 | | 2 865 563 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 4 748 | | 4 892 | 84,58% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 362 | 6,26% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | 172 | | 530 | 9,16% |
| Kötelezettségek összesen: | | 4 920 | | 5 784 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 826 774 | | 2 859 779 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 240 173 | | 12 155,15 |
| 2013. február 28. | 240 173 | | 11 996,62 |
| 2013. március 28. | 240 173 | | 12 097,08 |
| 2013. április 30. | 240 173 | | 11 806,62 |
| 2013. május 31. | 240 173 | | 11 822,87 |
| 2013. június 28. | 240 173 | | 11 459,92 |
| 2013. július 31. | 240 173 | | 11 631,62 |
| 2013. augusztus 30. | 240 173 | | 11 625,42 |
| 2013. szeptember 30. | 240 173 | | 11 904,61 |
| 2013. október 31. | 240 173 | | 11 982,77 |
| 2013. november 29. | 240 173 | | 12 034,31 |
| 2013. december 31. | 240 173 | 2 859 779 196 | 11 907,16 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Feltörekvő Piaci Trend Fix IX. Hozamvédett Zártvégű Alap
egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 596 336 | 100,00% | 2 563 719 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 206 621 | 7,96% | 60 893 | 2,38% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 596 336 | 100,00% | 2 563 719 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 290 056 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -57 079 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -712 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -129 |
| | felügyeleti díj: | -714 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -356 |
| f) | nettó jövedelem: | 231 066 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 231 066 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -198 061 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------|--------------------|--------------------|
| | adatok ezerben | határidős ügylet | | határidős ügylet | | eredmény | |
| | | szervződés szerinti értéke | diszkontált piaci értéke | devizás értéke forintban | forint értéke | | |
| | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | | | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -4 655 | 1 349 391 | -1 355 360 | 1 331 317 | -24 043 | |
| | Összesen: | | | | | -24 043 | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -3 250 | 986 668 | -963 209 | 973 269 | 10 060 | |
| | Összesen: | | | | | 10 060 | |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | | 297 814 520 | 297 814 520 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | | 259 386 840 | 91 265 740 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | | -38 427 680 | -206 548 780 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| a. | b. | 2012.01.23-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| | | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 457 386 | 505 655 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 535 548 | 215 599 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 49 491 | 58 983 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 7 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -127 653 | 231 066 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Jövő Márkái Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap
Az alap futamideje: 2010. augusztus 19.-től 2013. december 13-ig.

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 3,545,286,793 | 10520.638348 |
| 2013.02.28 | 3,554,623,949 | 10585.917153 |
| 2013.03.28 | 3,570,502,887 | 10668.472045 |
| 2013.04.30 | 3,643,883,864 | 10900.856672 |
| 2013.05.31 | 3,667,063,020 | 10986.993864 |
| 2013.06.28 | 3,635,659,877 | 10904.013739 |
| 2013.07.31 | 3,618,944,283 | 10916.282926 |
| 2013.08.30 | 3,600,485,390 | 10874.379761 |
| 2013.09.30 | 3,619,608,785 | 10960.009160 |
| 2013.10.31 | 3,664,682,818 | 11097.297712 |
| 2013.11.29 | 3,683,187,522 | 11154.211377 |
| 2013.12.31 | 2,604,754,633 | 11148.629437 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 337,871

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 0 | 975 |
| 2013.február | 18 | 1 189 |
| 2013.március | 79 | 1 302 |
| 2013.április | 27 | 292 |
| 2013.május | 0 | 511 |
| 2013.június | 0 | 340 |
| 2013.július | 4 | 1 910 |
| 2013.augusztus | 100 | 520 |
| 2013.szeptember | 36 | 878 |
| 2013.október | 58 | 24 |
| 2013.november | 35 | 119 |
| 2013.december | 0 | 104 623 |
| Összesen: | 357 | 112 683 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 233,639

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-------------------------------|---|
| 2010/12/31 | 3,867,762,967 | 10,312.797043 |
| 2011/12/30 | 3,403,675,780 | 9537.792704 |
| 2012/12/28 | 3,517,501,961 | 10410.783882 |
| 2013/12/31 | 2,604,754,633 | 11148.629437 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Jövő Márkái Alap a tőkevédelem mellett a futamidő végén egy, a mögöttes befektetések teljesítményétől független fix hozamot biztosít befektetőinek. Emellett az alap befektetői a világ legismertebb márkáit birtokló nagyvállalatok részvényeinek futamidő alatti teljesítményéből is részesedhetnek. Az alap futamideje 2013. december 13-án lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Jövő Márkái I. Nyíltvégű Alap néven működik tovább.** Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 7%-os rögzített hozam, valamint a mögöttes eszközök kedvező teljesítményének köszönhetően további 4,31%-os többlethozam illeti meg, amely az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelte. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014 tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

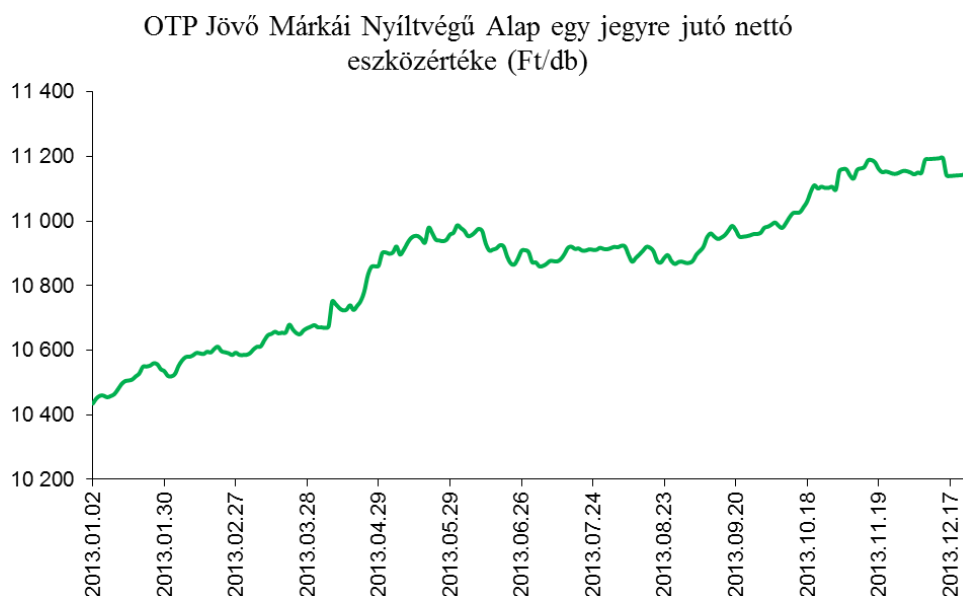
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | folyószámla | 28 | 39 | 0,00% | | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.12.13 - 2013.12.13 | 2 660 000 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.13 - 2014.01.03 | 0 | 650 000 | 23,88% | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | 699 970 | 25,72% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 2 660 028 | 1 350 009 | 49,60% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 47 310 | | 0 | 0,00% |
| 2014/C | 2003.06.19 - 2014.02.12 | | 47 310 | | 0 | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | | 45 303 | | 1 141 832 | 41,95% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | | 43 725 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | | 1 578 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 434 607 | 15,97% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 707 225 | 25,98% |
| Jelzáloglevelek: | | | 257 205 | | 228 973 | 8,41% |
| OJB2014/I | 2003.11.14 - 2014.02.12 | | 257 205 | | 228 973 | 8,41% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 349 818 | 0 | 1 370 805 | 0 |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 10 035 | | 1 175 | 0,04% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 510 178 | | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 520 213 | | 1 175 | 0,04% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 3 530 059 | | 2 721 989 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 5 070 | | 4 622 | 2,24% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 445 | 0,22% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 218 | | 544 | 0,26% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 791 | | 201 079 | 97,28% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 7 079 | | 206 690 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 3 522 980 | | 2 515 299 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 336 934 | | 10 520,64 |
| 2013. február 28. | 335 763 | | 10 585,92 |
| 2013. március 28. | 334 540 | | 10 668,47 |
| 2013. április 30. | 334 275 | | 10 900,86 |
| 2013. május 31. | 333 764 | | 10 986,99 |
| 2013. június 28. | 333 424 | | 10 904,01 |
| 2013. július 31. | 331 518 | | 10 916,28 |
| 2013. augusztus 30. | 331 098 | | 10 874,38 |
| 2013. szeptember 30. | 330 256 | | 10 960,01 |
| 2013. október 31. | 330 290 | | 11 097,30 |
| 2013. november 29. | 330 206 | | 11 154,21 |
| 2013. december 31. | 225 583 | 2 515 298 664 | 11 150,21 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 349 818 | 100,00% | 1 370 805 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 45 303 | 12,95% | 1 141 832 | 83,30% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 349 818 | 100,00% | 1 370 805 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 840 182 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -78 832 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -821 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -73 |
| | felügyeleti díj: | -898 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -527 |
| f) | nettó jövedelem: | 759 031 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 759 031 |
| h) | a tőkeszámla változása: | -1 248 310 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -518 402 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|--|--|--------------------|--------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Szerződés szerinti érték: | 308 444 640 | 0 |
| | Fordulónapi piaci érték: | 53 030 247 | 0 |
| | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | -255 414 393 | 0 |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | 632 800 700 | 0 |
| | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | -175 653 100 | 0 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 457 147 600 | 0 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 220 562 028 | 158 419 256 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 270 196 | 1 004 081 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 228 065 | 163 899 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 59 302 | 80 945 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 121 | 206 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -17 292 | 759 031 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Jövő Márkái II. Hozamvédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap
Az alap futamideje: 2010. szeptember 22.-től 2013. december 13-ig.

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,395,021,987 | 10524.377165 |
| 2013.02.28 | 2,400,475,498 | 10562.869618 |
| 2013.03.28 | 2,403,346,301 | 10623.276347 |
| 2013.04.30 | 2,438,810,659 | 10794.636605 |
| 2013.05.31 | 2,466,017,942 | 10949.373688 |
| 2013.06.28 | 2,442,807,165 | 10844.967170 |
| 2013.07.31 | 2,436,398,913 | 10840.484596 |
| 2013.08.30 | 2,427,963,975 | 10811.324340 |
| 2013.09.30 | 2,443,487,576 | 10880.884440 |
| 2013.10.31 | 2,479,372,631 | 11049.636255 |
| 2013.11.29 | 2,482,559,905 | 11102.732593 |
| 2013.12.31 | 1,682,768,044 | 11061.600137 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 228,576

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 0 | 1 007 |
| 2013.február | 0 | 313 |
| 2013.március | 0 | 1 072 |
| 2013.április | 37 | 293 |
| 2013.május | 9 | 717 |
| 2013.június | 579 | 571 |
| 2013.július | 190 | 577 |
| 2013.augusztus | 46 | 311 |
| 2013.szeptember | 4 | 13 |
| 2013.október | 0 | 182 |
| 2013.november | 306 | 1 092 |
| 2013.december | 0 | 79 716 |
| Összesen: | 1 171 | 85 864 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 152,127

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2010/12/31 | 2,524,936,932 | 10,067.611911 |
| 2011/12/30 | 2,290,169,238 | 9563.051925 |
| 2012/12/28 | 2,379,785,954 | 10411.355322 |
| 2013/12/31 | 1,682,768,044 | 11061.600137 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Jövő Márkái II. Alap a tőkevédelem mellett a futamidő végén egy, a mögöttes befektetések teljesítményétől független fix hozamot biztosít befektetőinek. Emellett az alap befektetői a világ legismertebb márkáit birtokló nagyvállalatok részvényeinek futamidő alatti teljesítményéből is részesedhetnek. Az alap futamideje 2013. december 13-án lejárt, azonban az alap nem szűnt meg, hanem határozatlan futamidejű, nyíltvégű alapként, **OTP Jövő Márkái II. Nyíltvégű Alap néven működik tovább.** Az alap átalakulása nem érinti a tájékoztatóban rögzített eredeti fizetési ígéretet, amely alapján lejáratkor azon befektetőket, akik a hozamfizetési naphoz tartozó megfeleltetési napon befektetési jeggyel rendelkeztek, fix 7%-os rögzített hozam, valamint a mögöttes eszközök kedvező teljesítményének köszönhetően további 3,42%-os többlethozam illeti meg, amely az egy jegyre jutó nettó eszközértéket növelte. Az OTP Alapkezelő tervei szerint az átalakult alapot 2014 tavaszán beolvasztja az OTP Prémium Tőkegarantált Pénzpiaci Alapba.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 16 | 31 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2010.12.13 - 2013.12.13 | 1 800 000 | 0 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.23 - 2014.01.03 | 0 | 415 000 | 23,55% | |
| OTP Bank Nyrt. HUF | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | 699 970 | 39,71% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 1 800 016 | 1 115 001 | 63,26% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 199 596 | | 0 | 0,00% |
| 2014/C | 2003.06.19 - 2014.02.12 | 199 596 | | 0 | 0,00% |
| MNB Kötvények: | | 41 426 | | 646 784 | 36,70% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 41 426 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 374 542 | 21,25% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 272 242 | 15,45% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 241 022 | 0 | 646 784 | 0 36,70% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 585 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 6 791 | 771 | 0,04% |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | 336 442 | 0 | 0,00% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 343 818 | 771 | 0,04% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 384 856 | 1 762 556 | 100,00% | |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 3 627 | 3 236 | 1,89% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 297 | 0,17% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | | 148 | 471 | 0,28% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 0 | 166 917 | 97,66% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 3 775 | 170 921 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 381 081 | 1 591 635 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|---------------------------------------|--|
| 2013. január 31. | 227 569 | | 10 524,38 |
| 2013. február 28. | 227 256 | | 10 562,87 |
| 2013. március 28. | 226 184 | | 10 623,28 |
| 2013. április 30. | 225 928 | | 10 794,64 |
| 2013. május 31. | 225 220 | | 10 949,37 |
| 2013. június 28. | 225 228 | | 10 844,97 |
| 2013. július 31. | 224 841 | | 10 840,48 |
| 2013. augusztus 30. | 224 576 | | 10 811,32 |
| 2013. szeptember 30. | 224 567 | | 10 880,88 |
| 2013. október 31. | 224 385 | | 11 049,64 |
| 2013. november 29. | 223 599 | | 11 102,73 |
| 2013. december 31. | 143 883 | 1 591 635 349 | 11 062,01 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Jövő Márkái II. Nyíltvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 241 022 | 100,00% | 646 784 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 41 426 | 17,19% | 646 784 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 241 022 | 100,00% | 646 784 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 550 373 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -50 313 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -552 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -74 |
| | felügyeleti díj: | -604 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -454 |
| f) nettó jövedelem: | | 498 376 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 498 376 |
| h) a tőkeszámla változása: | | -934 551 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | -353 271 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | Előző év | Tárgyév |
|---|--|--|--|---------------------------|---------------------------|
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | 201 110 000 | 0 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | 33 320 000 | 0 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | -167 790 000 | 0 |
| | | | | | |
| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | | Az Alap számára lejáratkor jóváírt fix lábának értéke: | | 421 984 800 | 0 |
| | | Az Alap által fizetendő változó láb értéke: | | -118 863 000 | 0 |
| | | A kamatswap ügylet piaci értéke: | | 303 121 800 | 0 |
| | | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | | 149 252 500 | 107 201 000 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | | | |
|----------------------------|-----------|---------------------------------|--|-------------------------------|-------------------------------|--------------------|
| | | | | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | | | c. | d. | |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | | 182 208 | 660 994 | |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 153 190 | 110 621 | |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | | 0 | 0 | |
| 04. | IV. | Működési költségek | | 42 751 | 51 863 | |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | | 63 | 134 | |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | | 0 | 0 | |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 | 0 | |
| 09. | IX. | Tárgyévi eredmény | | -13 796 | 498 376 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Jubileum Tőkevédett Nyíltvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2009. január 9.-től határozatlan ideig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 1,035,130,038 | 11817.227444 |
| 2013.02.28 | 1,030,118,339 | 11764.176362 |
| 2013.03.28 | 1,023,764,348 | 11887.511153 |
| 2013.04.30 | 1,061,438,958 | 12348.775033 |
| 2013.05.31 | 1,071,966,183 | 12484.029755 |
| 2013.06.28 | 1,054,445,478 | 12228.148554 |
| 2013.07.31 | 1,069,944,206 | 12533.463821 |
| 2013.08.30 | 1,032,545,652 | 12211.238005 |
| 2013.09.30 | 1,053,993,687 | 12654.200728 |
| 2013.10.31 | 1,068,420,939 | 12861.384570 |
| 2013.11.29 | 1,049,711,462 | 12929.551061 |
| 2013.12.31 | 1,048,902,444 | 12917.676868 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya (db) 87,886

Az alap befektetési jegyei darabszámának változása a tárgyidőszakban:

| | Kibocsátás mennyisége (db) | Visszaváltás mennyisége (db) |
|------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| 2013.január | 180 | 318 |
| 2013.február | 49 | 1 254 |
| 2013.március | 171 | 339 |
| 2013.április | 240 | 540 |
| 2013.május | 740 | 300 |
| 2013.június | 591 | 1 167 |
| 2013.július | 87 | 2 890 |
| 2013.augusztus | 2 150 | 408 |
| 2013.szeptember | 142 | 1 685 |
| 2013.október | 410 | 1 262 |
| 2013.november | 888 | 2 064 |
| 2013.december | 304 | 292 |
| Összesen: | 5 952 | 12 519 |

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak záró befektetési jegy állománya (db) 81,199

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-------------------------------|---|
| 2009/12/31 | 1,392,883,802 | 9656.441876 |
| 2010/12/31 | 1,341,262,406 | 10,243.727086 |
| 2011/12/30 | 1,159,141,242 | 10833.804473 |
| 2012/12/28 | 1,031,308,574 | 11734.617277 |
| 2013/12/31 | 1,048,902,444 | 12917.676868 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Alapkezelő fennállásának 15-ik évfordulója alkalmából bocsátotta ki az OTP Jubileum Alapot, mely több befektetési termék előnyét is egyesíti. Az alap különlegességét az adja, hogy a mögöttes befektetések teljesítményétől függetlenül biztosítja a befektetett tőke 3 év múlva történő visszafizetését, a folyamatos forgalmazásból adódó rugalmasságot, illetve a Magyarországon egyedülálló dinamikus hozamvédelmet nyújtja befektetőinek. Az alap mögöttes befektetéseit a BNP Millennium 3 Total Return Index alkotja, ezáltal az alap többlet hozamára a fejlett piaci kötvények és részvények, ázsiai részvények, árupiacok, és ingatlanpiacok alakulása van hatással.

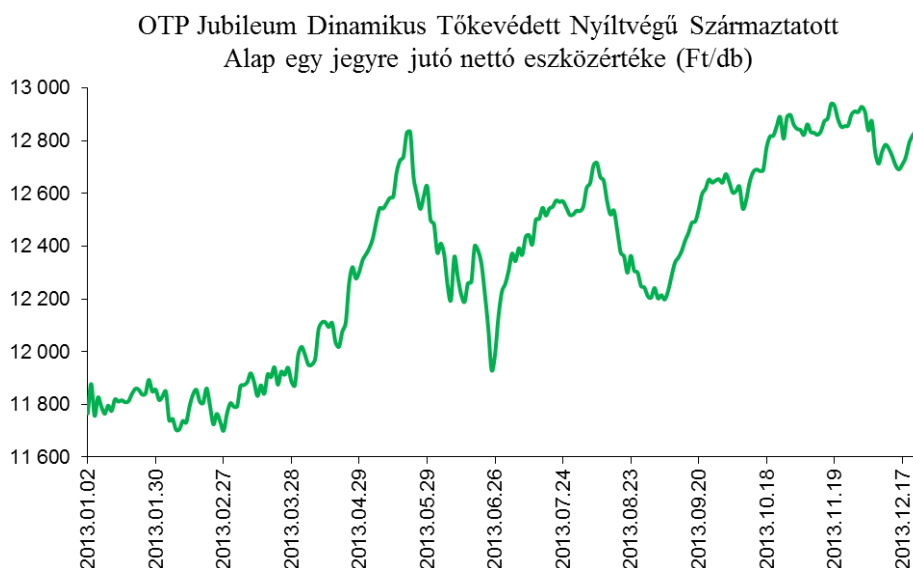
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 28 | 28 | 0,00% | |
| Raiffeisen Bank HUF | 2011.12.30 - 2014.12.31 | 886 050 | 824 050 | 78,53% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 886 078 | 824 078 | 78,53% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| MNB Kötvények: | | 2 406 | | 15 115 | 1,44% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 2 406 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 3 598 | 0,34% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 11 517 | 1,10% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 406 | 0 | 15 115 | 0 |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 17 691 | 91 | 0,01% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 111 148 | 210 049 | 20,02% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 128 839 | 210 140 | 20,03% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 1 017 323 | | 1 049 333 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 1 180 | 1 380 | 80,00% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 133 | 7,71% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 63 | 212 | 12,29% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 1 409 | 0 | 0,00% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 2 652 | 1 725 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 1 014 671 | | 1 047 608 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|---------------------------------------|--|
| 2013. január 31. | 87 628 | | 11 817,23 |
| 2013. február 28. | 86 423 | | 11 764,18 |
| 2013. március 28. | 86 255 | | 11 887,51 |
| 2013. április 30. | 85 955 | | 12 348,78 |
| 2013. május 31. | 86 395 | | 12 484,03 |
| 2013. június 28. | 85 819 | | 12 228,15 |
| 2013. július 31. | 83 016 | | 12 533,46 |
| 2013. augusztus 30. | 84 758 | | 12 211,24 |
| 2013. szeptember 30. | 83 215 | | 12 654,20 |
| 2013. október 31. | 82 363 | | 12 861,38 |
| 2013. november 29. | 81 187 | | 12 929,55 |
| 2013. december 31. | 81 199 | 1 047 607 429 | 12 901,73 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 406 | 100,00% | 15 115 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 2 406 | 100,00% | 15 115 | 100,00% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 406 | 100,00% | 15 115 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | 31 649 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -15 878 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -242 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -76 |
| | felügyeleti díj: | -262 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -678 |
| f) nettó jövedelem: | | 14 513 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 14 513 |
| h) a tőkeszámla változása: | | -80 480 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 98 904 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Kamatswap ügyletek bemutatása (adatok Ft-ban): | | Előző év | Tárgyév |
|---|--|---------------------------|---------------------------|
| | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| | Az Alap által fizetendő fix láb értéke: | 0 | 0 |
| | Az Alap számára lejáratkor jóváírt változó lábának értéke: | 111 147 594 | 210 048 878 |
| | A kamatswap ügylet piaci értéke: | 111 147 594 | 210 048 878 |
| | Az Alap által fizetett swap kamat értéke a tárgyévben: | 67 145 895 | 49 491 863 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | | adatok ezer Ft-ban | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.01.01-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 109 047 | 64 720 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 67 146 | 33 071 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 1 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 15 685 | 16 603 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 87 | 533 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | 26 130 | 14 513 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Remix20 Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013. november - 2017. május

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|--------------|-----------------------------------|---|
| 2013.11.29 | 3,510,891,944 | 9972.906560 |
| 2013.12.31 | 3,472,663,110 | 9864.315183 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 352,043 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|--------------|-----------------------------------|---|
| 2013.12.31 | 3,472,663,110 | 9864.315183 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 novemberében, az OTP Alapkezelő fennállásának 20-ik évfordulójára indult az OTP Remix20 Alap, amely tőkevédelem és biztosított fix hozam mellett nyújt részesedési lehetőséget az OTP Alapkezelő elmúlt 20 évének legsikeresebb alapjainak futamidő alatti teljesítményéből. A mögöttes alapkosár tagjai: OTP Quality, OTP Paletta, OTP Abszolút Hozam, OTP Új Európa, OTP Supra, OTP EMDA, OTP Föld Kincsei, OTP EMEA, OTP Trend Alapok.

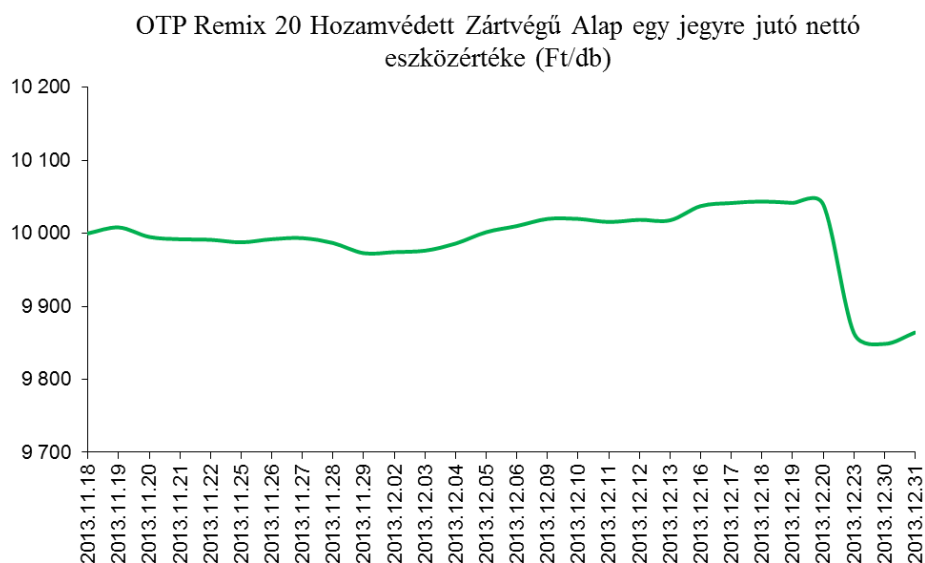
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.11.18 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 3 520 430 | 22 | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 3 520 430 | 22 | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 0 | | 1 140 433 | 30,31% |
| 2018/A | 2013.01.16 - 2018.12.20 | 0 | | 1 140 433 | 30,31% |
| MNB Kötvények: | | 0 | | 2 073 498 | 55,11% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 1 075 443 | 28,58% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 998 055 | 26,53% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 0 | 0 | 3 213 931 | 85,42% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 288 488 | 7,67% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | 259 808 | 6,91% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | 548 296 | 14,58% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 3 520 430 | | 3 762 249 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 0 | 1 935 | 0,67% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 206 | 0,07% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 0 | 181 | 0,06% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | | 0 | 288 456 | 99,20% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 0 | 290 778 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 3 520 430 | | 3 471 471 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|--------------------|--|---------------------------------------|--|
| 2013.november 18. | 352 043 | 3 520 430 000 | 10 000,00 |
| 2013. november 29. | 352 043 | | 9 972,91 |
| 2013.december 31. | 352 043 | 3 471 470 256 | 9 860,93 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.11.18 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 3 213 931 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 2 073 498 | 64,52% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 3 213 931 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|--|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | -309 253 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -6 242 |
| d) a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -207 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| bizományosi díj: | | 0 |
| bankköltség: | | -15 |
| felügyeleti díj: | | -99 |
| egyéb költség és ráfordítás: | | -82 |
| f) nettó jövedelem: | | -315 898 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| újra befektetett jövedelem: | | -315 898 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 0 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 266 939 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | Tárgyév |
|------------------------------------|--|-----------------------------------|--|---------------------------|
| | | | | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | 325 639 775 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | 259 807 734 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | -65 832 041 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|----|----|-------------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | | | Tárgyév |
| | | | | 2013.11.18-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | | 16 797 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | | 326 050 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | | 6 645 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | | 0 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | | -315 898 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Szinergia Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2012. október 9.-től 2016. március 31-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,333,093,487 | 10259.865818 |
| 2013.02.28 | 2,344,821,954 | 10311.442190 |
| 2013.03.28 | 2,357,128,707 | 10365.561596 |
| 2013.04.30 | 2,384,008,517 | 10483.766566 |
| 2013.05.31 | 2,415,337,198 | 10621.535611 |
| 2013.06.28 | 2,412,803,344 | 10610.392894 |
| 2013.07.31 | 2,412,961,614 | 10611.088892 |
| 2013.08.30 | 2,431,451,224 | 10692.397643 |
| 2013.09.30 | 2,418,368,295 | 10634.864974 |
| 2013.10.31 | 2,384,545,688 | 10486.128795 |
| 2013.11.29 | 2,443,742,274 | 10746.447995 |
| 2013.12.31 | 2,443,533,600 | 10745.530343 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 227,400 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2012/12/28 | 2,259,927,852 | 9938.117203 |
| 2013/12/31 | 2,443,533,600 | 10745.530343 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2012 októberében indult az OTP Szinergia Alap, amely esetébe az OTP Alapkezelő hat abszolút hozam alapjából összeállított kosár képezi a mögöttes befektetések alapját. Ezáltal az alap többlethozamára az OTP Abszolút Hozamú Származtatott Alapok futamidő alatti teljesítménye van hatással.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 20 | 22 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 2 | 116 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2012.12.21 - 2013.01.02 | | 13 953 | 0 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 14 252 | 0,58% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 13 975 | 14 390 | 0,58% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 720 402 | | 903 167 | 36,94% |
| DK2015/02 2012.06.11 - 2015.08.24 | | | 296 447 | | 299 966 | 12,27% |
| PEMÁK 2016/X 2013.01.17 - 2016.05.25 | | | 0 | | 149 440 | 6,11% |
| REPHUN 5 09/17 2005.05.09 - 2017.05.09 | | | 423 955 | | 453 761 | 18,56% |
| MNB Kötvények: | | | 158 495 | | 110 582 | 4,53% |
| MNB130102 2012.12.19 - 2013.01.02 | | | 136 636 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 2012.12.27 - 2013.01.09 | | | 21 859 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | | 53 708 | 2,20% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | 0 | | 56 874 | 2,33% |
| Kötvények: | | | 634 043 | | 652 860 | 26,70% |
| MAGYAR 5.875 05/10 2011.05.31 - 2016.05.31 | | | 399 100 | | 430 567 | 17,61% |
| OTPHB 5.27 09/16 2006.09.19 - 2016.09.19 | | | 234 943 | | 222 293 | 9,09% |
| Jelzáloglevelek: | | | 551 932 | | 604 978 | 24,73% |
| FJ15NF01 2010.02.18 - 2015.09.14 | | | 255 938 | | 292 346 | 11,95% |
| FJ16NF01 2012.04.13 - 2016.04.13 | | | 120 191 | | 125 712 | 5,14% |
| FJ17NF01 2011.03.24 - 2017.03.24 | | | 174 920 | | 185 948 | 7,60% |
| OJB2016/I 2006.02.17 - 2016.02.03 | | | 883 | | 972 | 0,04% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 2 064 872 | 0 | 2 271 587 | 92,90% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 7 | | 1 | 0,00% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 188 123 | | 159 407 | 6,52% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 188 130 | | 159 408 | 6,52% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 2 266 977 | | 2 445 385 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 957 | | 1 039 | 87,24% |
| Költségment elszámolt egyéb tétel miatt | | | 127 | | 152 | 12,76% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 1 084 | | 1 191 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 2 265 893 | | 2 444 194 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 227 400 | | 10 259,87 |
| 2013. február 28. | 227 400 | | 10 311,44 |
| 2013. március 28. | 227 400 | | 10 365,56 |
| 2013. április 30. | 227 400 | | 10 483,77 |
| 2013. május 31. | 227 400 | | 10 621,54 |
| 2013. június 28. | 227 400 | | 10 610,39 |
| 2013. július 31. | 227 400 | | 10 611,09 |
| 2013. augusztus 30. | 227 400 | | 10 692,40 |
| 2013. szeptember 30. | 227 400 | | 10 634,86 |
| 2013. október 31. | 227 400 | | 10 486,13 |
| 2013. november 29. | 227 400 | | 10 746,45 |
| 2013. december 31. | 227 400 | 2 444 194 408 | 10 748,44 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Szinergia Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 064 872 | 100,00% | 2 271 587 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 158 495 | 7,68% | 110 582 | 4,87% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 064 872 | 100,00% | 2 271 587 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 113 916 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -11 972 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | 0 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -133 |
| | felügyeleti díj: | | -598 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -6 |
| f) | nettó jövedelem: | | 101 207 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 101 207 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 77 094 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|-----------------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | GBP | -1 175 | 408 210 | -417 150 | 402 742 | -14 408 |
| | EUR | -533 | 151 614 | -155 219 | 149 583 | -5 636 |
| | EUR | -1 341 | 381 654 | -390 536 | 376 541 | -13 994 |
| | EUR | -283 | 80 556 | -82 443 | 79 477 | -2 965 |
| | Összesen: | | | | | -37 003 |
| 2013.12.31-én: | GBP | -1 175 | 422 078 | -418 054 | 416 346 | -1 708 |
| | EUR | -2 462 | 747 366 | -729 597 | 737 217 | 7 620 |
| | Összesen: | | | | | 5 912 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | Szerződés szerinti érték: | | 284 250 000 | 284 250 000 | |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | 225 126 000 | 153 495 000 | |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | -59 124 000 | -130 755 000 | |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | adatok ezer Ft-ban | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.10.08-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| | | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | -19 472 | 650 700 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 285 231 | 536 784 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 2 780 | 12 702 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 7 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -307 483 | 101 207 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Szinergia II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013. január - 2016. június

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 4,514,631,411 | 10032.514247 |
| 2013.02.28 | 4,500,615,474 | 10001.367720 |
| 2013.03.28 | 4,526,917,499 | 10059.816664 |
| 2013.04.30 | 4,479,971,812 | 9955.492916 |
| 2013.05.31 | 4,492,685,534 | 9983.745631 |
| 2013.06.28 | 4,485,769,750 | 9968.377222 |
| 2013.07.31 | 4,490,445,972 | 9978.768827 |
| 2013.08.30 | 4,493,042,568 | 9984.539040 |
| 2013.09.30 | 4,550,888,092 | 10113.084649 |
| 2013.10.31 | 4,505,899,752 | 10013.110560 |
| 2013.11.29 | 4,589,432,055 | 10198.737900 |
| 2013.12.31 | 4,577,543,447 | 10172.318771 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 450,000 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.12.31 | 4,577,543,447 | 10172.318771 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 januárjában indult az OTP Szinergia II. Alap, amelynek mögöttes befektetése az OTP Alapkezelő 8 legnépszerűbb, abszolút hozamú, illetve aktívan kezelt alapjából (OTP Supra, OTP EMDA, OTP Abszolút Hozam, OTP G10 Euró, OTP Új Európa, OTP Föld Kincsei, OTP Paletta, OTP EMEA Alapok) álló eszközkosár. Így a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a fenti hat alap hozamának és árfolyam ingadozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--|---------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.09 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 4 500 000 | 23 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 126 | 0,00% | | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 29 691 | 0,65% | | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 4 500 000 | 29 840 | 0,65% | | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 0 | 1 877 409 | | 40,98% |
| 2016/D 2013.01.16 - 2016.12.22 | | | 0 | 833 010 | | 18,18% |
| PEMÁK 2015/X 2012.11.21 - 2015.12.21 | | | 0 | 297 196 | | 6,49% |
| PEMÁK 2016/X 2013.01.17 - 2016.05.25 | | | 0 | 747 203 | | 16,31% |
| MNB Kötvények: | | | 0 | 183 391 | | 4,00% |
| MNB140108 2013.12.23 - 2014.01.08 | | | 0 | 76 046 | | 1,66% |
| MNB140115 2013.12.31 - 2014.01.15 | | | 0 | 107 345 | | 2,34% |
| Kötvények: | | | 0 | 1 356 216 | | 29,61% |
| BNP 4.5 11/27/2016 2013.11.27 - 2016.11.27 | | | 0 | 452 030 | | 9,87% |
| MAGYAR 5.875 05/10 2011.05.31 - 2016.05.31 | | | 0 | 781 664 | | 17,06% |
| OTPHB VAR 49-16 2006.11.07 - 2016.11.07 | | | 0 | 122 522 | | 2,68% |
| Jelzáloglevelek: | | | 0 | 957 276 | | 20,89% |
| FJ17NF02 2012.12.14 - 2017.12.14 | | | 0 | 450 025 | | 9,82% |
| FJ18NF01 2013.03.13 - 2018.03.13 | | | 0 | 507 251 | | 11,07% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 0 | 4 374 292 | 0 | 95,48% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | | 1 | 0,00% |
| Számzatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | | 177 140 | 3,87% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | | 177 141 | 3,87% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 4 500 000 | 4 581 273 | | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 0 | 1 946 | | 87,23% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 0 | 285 | | 12,77% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 0 | 2 231 | | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 4 500 000 | 4 579 042 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013.január 9. | 450 000 | 4 500 000 000 | 10 000,00 |
| 2013. január 31. | 450 000 | | 10 032,51 |
| 2013. február 28. | 450 000 | | 10 001,37 |
| 2013. március 28. | 450 000 | | 10 059,82 |
| 2013. április 30. | 450 000 | | 9 955,49 |
| 2013. május 31. | 450 000 | | 9 983,75 |
| 2013. június 28. | 450 000 | | 9 968,38 |
| 2013. július 31. | 450 000 | | 9 978,77 |
| 2013. augusztus 30. | 450 000 | | 9 984,54 |
| 2013. szeptember 30. | 450 000 | | 10 113,08 |
| 2013. október 31. | 450 000 | | 10 013,11 |
| 2013. november 29. | 450 000 | | 10 198,74 |
| 2013.december 31. | 450 000 | 4 579 042 424 | 10 175,65 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Szinergia II. Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.09 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 4 374 292 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 183 391 | 4,19% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 4 374 292 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | -255 571 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -31 468 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | 0 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -139 |
| | felügyeleti díj: | -1 101 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -2 |
| f) | nettó jövedelem: | -288 281 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -288 281 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 367 323 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|-----------|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2013.12.31-én: | EUR | -7 653 | 2 323 496 | -2 268 254 | 2 291 944 | 23 690 |
| | Összesen: | | | | | 23 690 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | |
| | | | | | | Tárgyév |
| | | | | | | 2013. december 31. |
| | | | Szerződés szerinti érték: | | | 472 500 000 |
| | | | Fordulónapi piaci érték: | | | 153 495 000 |
| | | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | -319 005 000 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|----|------------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | | Tárgyév |
| | | | 2013.01.09-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 377 049 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 632 620 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 32 708 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 2 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | -288 281 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Szinergia III. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013. március - 2016. szeptember

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.03.28 | 8,090,020,073 | 10026.696569 |
| 2013.04.30 | 7,932,948,409 | 9832.023391 |
| 2013.05.31 | 7,989,827,055 | 9902.518262 |
| 2013.06.28 | 7,984,731,424 | 9896.202784 |
| 2013.07.31 | 8,049,669,334 | 9976.686233 |
| 2013.08.30 | 8,084,953,707 | 10020.417361 |
| 2013.09.30 | 8,230,441,024 | 10200.733005 |
| 2013.10.31 | 8,230,071,706 | 10200.275276 |
| 2013.11.29 | 8,354,690,827 | 10354.727070 |
| 2013.12.31 | 8,369,017,074 | 10372.482889 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 806,848 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.12.31 | 8,369,017,074 | 10372.482889 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 márciusában indult az OTP Szinergia III. Alap, amelynek mögöttes befektetése az OTP Alapkezelő 8 legnépszerűbb, abszolút hozamú, illetve aktívan kezelt alapjából (OTP Supra, OTP EMDA, OTP Abszolút Hozam, OTP G10 Euró, OTP Új Európa, OTP Föld Kincsei, OTP Paletta, OTP EMEA, OTP Maxima Alapok) álló eszközkosár. Így a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a fenti hat alap hozamának és árfolyam ingadozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége. Az alapnak 2013-ban nem volt hozamfizetési napja.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.03.11 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 8 068 480 | 23 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 262 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 101 543 | 1,21% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 8 068 480 | 101 828 | 1,21% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 0 | | 3 496 300 | 41,71% |
| 2016/D | 2013.01.16 - 2016.12.22 | 0 | | 41 650 | 0,50% |
| 2017/B | 2006.10.04 - 2017.02.24 | 0 | | 453 036 | 5,40% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | 0 | | 2 689 932 | 32,09% |
| REPHUN 3.5 07/16 | 2006.01.18 - 2016.07.18 | 0 | | 311 682 | 3,72% |
| MNB Kötvények: | | 0 | | 84 574 | 1,01% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 73 197 | 0,87% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 11 377 | 0,14% |
| Kötvények: | | 0 | | 2 516 329 | 30,02% |
| BNP 4.5 11/27/2016 | 2013.11.27 - 2016.11.27 | 0 | | 803 611 | 9,59% |
| MAGYAR 5.875 05/16 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | 0 | | 911 941 | 10,88% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | 0 | | 555 732 | 6,63% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | 0 | | 245 045 | 2,92% |
| Jelzáloglevelek: | | 0 | | 1 608 445 | 19,19% |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - 2017.12.14 | 0 | | 675 037 | 8,05% |
| FJ18NF01 | 2013.03.13 - 2018.03.13 | 0 | | 933 408 | 11,14% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 0 | 0 | 7 705 648 | 91,93% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | | 5,00% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | | 575 244,6,86% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | | 575 249,6,86% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 8 068 480 | | 8 382 725 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 0 | | 2 842 | 55,68% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 1 046 | 20,49% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 0 | | 1 216 | 23,83% |
| Kötelezettségek összesen: | | 0 | | 5 104 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 8 068 480 | | 8 377 621 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | | |
| | | 806 848 | | 806 848 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 000,00 | | 10 383,15 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013.március 11. | 806 848 | 8 068 480 000 | 10 000,00 |
| 2013. március 28. | 806 848 | | 10 026,70 |
| 2013. április 30. | 806 848 | | 9 832,02 |
| 2013. május 31. | 806 848 | | 9 902,52 |
| 2013. június 28. | 806 848 | | 9 896,20 |
| 2013. július 31. | 806 848 | | 9 976,69 |
| 2013. augusztus 30. | 806 848 | | 10 020,42 |
| 2013. szeptember 30. | 806 848 | | 10 200,73 |
| 2013. október 31. | 806 848 | | 10 200,28 |
| 2013. november 29. | 806 848 | | 10 354,73 |
| 2013.december 31. | 806 848 | 8 377 620 732 | 10 383,15 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Szinergia III. Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.03.11 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 7 705 648 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 84 574 | 1,10% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 7 705 648 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | -528 618 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -35 644 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | -3 281 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -116 |
| | felügyeleti díj: | | -1 622 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | -698 |
| f) | nettó jövedelem: | | -569 979 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | -569 979 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 879 120 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------|---------------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2013.12.31-én: | EUR | -17 973 | 5 456 508 | -5 326 776 | 5 382 410 | 55 634 |
| | Összesen: | | | | | 55 634 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Tárgyév |
| | | | | | | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | | 839 121 920 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | | 519 610 112 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | | -319 511 808 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|----|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | | Tárgyév |
| | | | 2013.03.11-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 560 395 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 1 089 013 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 41 360 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 1 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | -569 979 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Szinergia IV. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013. május - 2016. december

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.05.31 | 7,747,761,450 | 10025.856650 |
| 2013.06.28 | 7,601,726,010 | 9836.882015 |
| 2013.07.31 | 7,590,135,318 | 9821.883281 |
| 2013.08.30 | 7,495,483,308 | 9699.400485 |
| 2013.09.30 | 7,644,990,095 | 9892.867156 |
| 2013.10.31 | 7,689,480,436 | 9950.439112 |
| 2013.11.29 | 7,694,036,154 | 9956.334360 |
| 2013.12.31 | 7,698,092,492 | 9961.583394 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 772,778 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.12.31 | 7,698,092,492 | 9961.583394 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 májusában indult az OTP Szinergia IV. Alap, amelynek mögöttes befektetése az OTP Alapkezelő 11 legnépszerűbb, abszolút hozamú, illetve aktívan kezelt alapjából (OTP Supra, OTP EMDA, OTP Abszolút Hozam, OTP G10 Euró, OTP Új Európa, OTP Paletta, OTP EMEA, OTP Maxima, OTP Orosz, OTP Török, OTP Afrika Alapok) álló eszközkosár. Így a mögöttes opciós struktúra miatt egyrészt a fenti hat alap hozamának és árfolyam ingadozásának, másrészt az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége. Az alapnak 2013-ban nem volt hozamfizetési napja.

3. Vagyonkimutatás

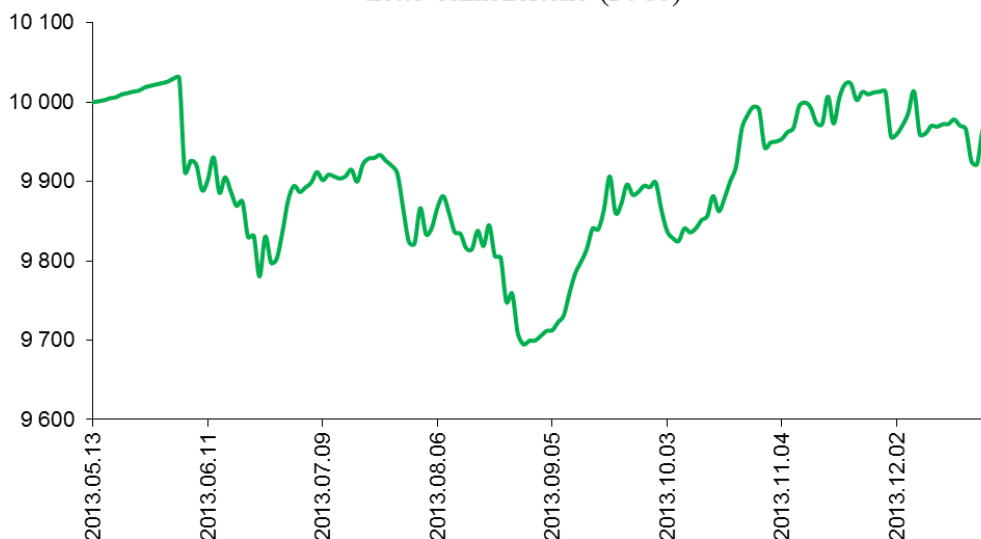
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.05.13 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 7 727 780 | 25 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 120 | 0,00% | |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.31 - 2014.01.08 | | 0 | 48 693 | 0,63% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | 7 727 780 | 48 838 | 0,63% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 0 | | 6 411 609 | 83,18% |
| 2016/D | 2013.01.16 - 2016.12.22 | 0 | | 1 874 077 | 24,31% |
| 2017/B | 2006.10.04 - 2017.02.24 | 0 | | 1 359 109 | 17,63% |
| 2018/A | 2013.01.16 - 2018.12.20 | 0 | | 518 379 | 6,73% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | 0 | | 2 660 044 | 34,51% |
| MNB Kötvények: | | 0 | | 132 214 | 1,72% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 100 991 | 1,31% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 31 223 | 0,41% |
| Kötvények: | | 0 | | 785 954 | 10,19% |
| BNP 4.5 11/27/2016 | 2013.11.27 - 2016.11.27 | 0 | | 753 385 | 9,77% |
| MAGYAR 5.875 05/10 | 2011.05.31 - 2016.05.31 | 0 | | 32 569 | 0,42% |
| Jelzáloglevelek: | | 0 | | 112 506 | 1,46% |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - 2017.12.14 | 0 | | 112 506 | 1,46% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 0 | 0 | 7 442 283 | 96,55% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | 1 | 0,00% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | 217 153 | 2,82% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | 217 154 | 2,82% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 7 727 780 | | 7 708 275 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 0 | | 3 271 | 60,37% |
| Letétkezelői díj miatt | | 0 | | 969 | 17,89% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 0 | | 1 178 | 21,74% |
| Kötelezettségek összesen: | | 0 | | 5 418 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 7 727 780 | | 7 702 857 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 772 778 | | 772 778 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 000,00 | | 9 967,75 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013.május 13. | 772 778 | 7 727 780 000 | 10 000,00 |
| 2013. május 31. | 772 778 | | 10 025,86 |
| 2013. június 28. | 772 778 | | 9 836,88 |
| 2013. július 31. | 772 778 | | 9 821,88 |
| 2013. augusztus 30. | 772 778 | | 9 699,40 |
| 2013. szeptember 30. | 772 778 | | 9 892,87 |
| 2013. október 31. | 772 778 | | 9 950,44 |
| 2013. november 29. | 772 778 | | 9 956,33 |
| 2013.december 31. | 772 778 | 7 702 857 010 | 9 967,75 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Szinergia IV. Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.05.13 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 7 442 283 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 132 214 | 1,78% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 7 442 283 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | -418 983 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -31 532 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -2 432 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -457 |
| | felügyeleti díj: | -1 211 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -697 |
| f) | nettó jövedelem: | -455 312 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -455 312 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 430 389 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------------------------------|-----------|--------------------------|---------------|---------------------------|
| | adatok | határidő ügylet | | határidős ügylet | | eredmény |
| | ezerben | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2013.12.31-én: | EUR | -8 988 | 2 728 784 | -2 663 906 | 2 691 728 | 27 822 |
| | Összesen: | | | | | 27 822 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Tárgyév |
| | | | | | | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | | 595 039 060 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | | 189 330 610 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | -405 708 450 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|----|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | | Tárgyév |
| | | | 2013.05.13-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 296 995 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 715 978 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 36 329 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 0 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | -455 312 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Szinergia Plusz Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013. július - 2017. január

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|--------------|-----------------------------------|---|
| 2013.07.31 | 4,074,209,518 | 9892.363600 |
| 2013.08.30 | 4,063,561,325 | 9866.509309 |
| 2013.09.30 | 4,071,631,195 | 9886.103316 |
| 2013.10.31 | 4,079,795,645 | 9905.926967 |
| 2013.11.29 | 4,134,790,550 | 10039.457065 |
| 2013.12.31 | 4,119,031,922 | 10001.194409 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 411,854 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2013.12.31 | 4,119,031,922 | 10001.194409 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 júliusában indult az OTP Szinergia Plusz Alap, amelynek mögöttes befektetését az OTP Supra Alap mellett két külföldi abszolút hozamú alap képezi.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|--------------|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | | Időszak nyitó állománya 2013.07.25 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | | 4 118 540 | 28 | 0,00% | |
| Banki egyenlegek összesen: | | | 4 118 540 | 28 | 0,00% | |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 0 | 1 667 595 | 40,44% | |
| 2016/D | 2013.01.16 - | 2016.12.22 | 0 | 624 759 | 15,15% | |
| 2017/B | 2006.10.04 - | 2017.02.24 | 0 | 566 295 | 13,73% | |
| DK2016/01 | 2013.03.12 - | 2016.12.22 | 0 | 476 541 | 11,56% | |
| MNB Kötvények: | | | 0 | 289 916 | 7,03% | |
| MNB140108 | 2013.12.23 - | 2014.01.08 | 0 | 163 354 | 3,96% | |
| MNB140115 | 2013.12.31 - | 2014.01.15 | 0 | 126 562 | 3,07% | |
| Kötvények: | | | 0 | 970 241 | 23,53% | |
| BNP 4.5 11/27/2016 | 2013.11.27 - | 2016.11.27 | 0 | 401 806 | 9,74% | |
| MAEXIM 5.5 02/12/1 | 2012.12.12 - | 2018.02.12 | 0 | 568 435 | 13,79% | |
| Jelzáloglevelek: | | | 0 | 1 012 556 | 24,55% | |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - | 2017.12.14 | 0 | 1 012 556 | 24,55% | |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 0 | 3 940 308 | 95,55% | |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% | |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | 0 | 0,00% | |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 0 | 183 622 | 4,45% | |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 0 | 183 622 | 4,45% | |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 4 118 540 | 4 123 958 | 100,00% | |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 0 | 3 856 | 78,28% | |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | 517 | 10,49% | |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 0 | 553 | 11,23% | |
| Kötelezettségek összesen: | | | 0 | 4 926 | 100,00% | |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 4 118 540 | 4 119 032 | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 411 854 | 411 854 | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 000,00 | 10 001,20 | | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013.május 13. | 411 854 | 4 118 540 000 | 10 000,00 |
| 2013. július 31. | 411 854 | | 9 892,36 |
| 2013. augusztus 30. | 411 854 | | 9 866,51 |
| 2013. szeptember 30. | 411 854 | | 9 886,10 |
| 2013. október 31. | 411 854 | | 9 905,93 |
| 2013. november 29. | 411 854 | | 10 039,46 |
| 2013.december 31. | 411 854 | 4 119 032 296 | 10 001,20 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Szinergia Plusz Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.07.25 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 3 940 308 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: a fentiekből: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 289 916 | 7,36% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 3 940 308 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | -262 111 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -23 778 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | -892 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -72 |
| | felügyeleti díj: | -436 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -296 |
| f) | nettó jövedelem: | -287 585 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -287 585 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 288 077 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------------|-----------------------------|--------------------------|--------------------|
| | adatok | | határidő ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2013.12.31-én: | USD | -2 542 | 559 736 | -547 258 | 552 135 | 4 877 |
| | Összesen: | | | | | 4 877 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Tárgyév |
| | | | | | | 2013. december 31. |
| | | Szerződés szerinti érték: | | | | 319 186 850 |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | | | 178 744 636 |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | -140 442 214 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|----|------------------------|
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | | Tárgyév |
| a. | b. | c. | 2013.07.25-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | | 70 311 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 332 422 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | | 25 474 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | | 0 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | -287 585 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Szinergia Plusz II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2013. szeptember - 2017. május

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|--------------|-----------------------------------|---|
| 2013.09.30 | 4,128,054,061 | 9884.855539 |
| 2013.10.31 | 4,114,327,774 | 9851.987180 |
| 2013.11.29 | 4,164,981,952 | 9973.281432 |
| 2013.12.31 | 4,135,301,013 | 9902.208769 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 417,614 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|----------------|-----------------------------------|---|
| 2013.12.31 | 4,135,301,013 | 9902.208769 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

2013 szeptemberében indult az OTP Szinergia Plusz II. Alap, amelynek mögöttes befektetését az OTP Supra Alap mellett két külföldi abszolút hozamú alap képezi.

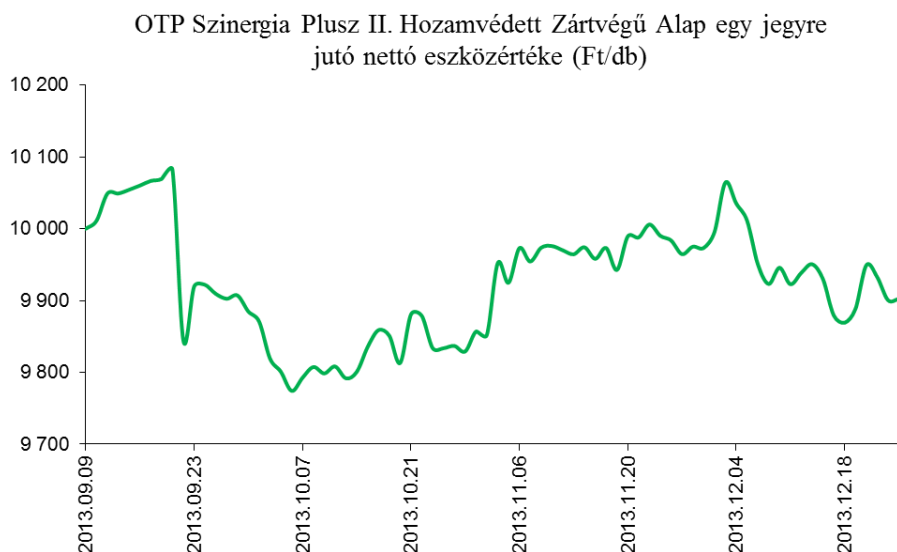
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.09.09 | | Időszak záró állománya 2013.12.31 | | Megoszlás (%) |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | | |
| Bank | | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 4 176 140 | | 21 | | 0,00% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 4 176 140 | | 21 | | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | | |
| Értékpapír neve | | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | | 0 | | 787 568 | 19,01% |
| 2018/A | 2013.01.16 - 2018.12.20 | | 0 | | 311 027 | 7,51% |
| DK2016/01 | 2013.03.12 - 2016.12.22 | | 0 | | 476 541 | 11,50% |
| MNB Kötvények: | | | 0 | | 1 458 675 | 35,22% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | | 0 | | 439 413 | 10,61% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | | 0 | | 1 019 262 | 24,61% |
| Kötvények: | | | 0 | | 668 480 | 16,14% |
| MAEXIM 5.5 02/12/1 | 2012.12.12 - 2018.02.12 | | 0 | | 668 480 | 16,14% |
| Jelzáloglevelek: | | | 0 | | 1 012 556 | 24,44% |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - 2017.12.14 | | 0 | | 1 012 556 | 24,44% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | | 0 | 0 | 3 927 279 | 94,81% |
| Egyéb eszközök | | | | | | |
| Követelések | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Számaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | | 0 | 214 963 | 5,19% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | | 0 | 214 963 | 5,19% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | | 4 176 140 | | 4 142 263 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | | |
| A lapkezelői díj miatt | | | 0 | | 5 284 | 84,14% |
| Letétkezelői díj miatt | | | 0 | | 521 | 8,30% |
| Költségmentes elszámolt egyéb tétel miatt | | | 0 | | 475 | 7,56% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 0 | | 6 280 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | | 4 176 140 | | 4 135 983 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | 417 614 | | 417 614 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | 10 000,00 | | 9 903,84 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|---------------------------------------|--|
| 2013.szeptember 9. | 417 614 | 4 176 140 000 | 10 000,00 |
| 2013. szeptember 30. | 417 614 | | 9 884,86 |
| 2013. október 31. | 417 614 | | 9 851,99 |
| 2013. november 29. | 417 614 | | 9 973,28 |
| 2013.december 31. | 417 614 | 4 135 982 459 | 9 903,84 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.09.09 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 3 927 279 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 1 458 675 | 37,14% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 0 | 0,00% | 3 927 279 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|--|-----------------------------------|-------------|
| a) befektetésekből származó jövedelem: | | -331 882 |
| b) egyéb bevétel: | | 0 |
| c) kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -21 058 |
| d) a letétkezelő díjai: | (az alapkezelési díj tartalmazza) | -641 |
| e) egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -64 |
| | felügyeleti díj: | -320 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | -216 |
| f) nettó jövedelem: | | -354 181 |
| g) felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | -354 181 |
| h) a tőkeszámla változása: | | 0 |
| i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 314 024 |
| j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|---------------------------|-----------|-----------------------------|---------------|---------------------------|
| | adatok | határidő ügylet | | határidős ügylet | | eredmény |
| | ezerben | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2013.12.31-én: | USD | -2 990 | 658 567 | -643 885 | 649 623 | 5 739 |
| | Összesen: | | | | | 5 739 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | | Tárgyév |
| | | | | | | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | | 392 557 160 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | | 209 224 614 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | | -183 332 546 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|------------------------------|---------------------------------|----|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | | | Tárgyév |
| | | | | 2013.09.09-2013.12.31. |
| a. | b. | | c. | d. |
| 01. | I. | Pénzügyi műveletek bevételei | | 60 675 |
| 02. | II. | Pénzügyi műveletek ráfordításai | | 392 557 |
| 03. | III. | Egyéb bevételek | | 0 |
| 04. | IV. | Működési költségek | | 22 299 |
| 05. | V. | Egyéb ráfordítások | | 0 |
| 06. | VI. | Rendkívüli bevételek | | 0 |
| 07. | VII. | Rendkívüli ráfordítások | | 0 |
| 08. | VIII. | Fizetett, fizetendő hozamok | | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | | | -354 181 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Trendvadász I. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap
Az alap futamideje: 2012. március 26.-tól 2015. szeptember 30-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 2,810,669,619 | 10833.977508 |
| 2013.02.28 | 2,806,443,833 | 10817.688838 |
| 2013.03.28 | 2,819,060,660 | 10866.321527 |
| 2013.04.30 | 2,846,660,243 | 10972.706589 |
| 2013.05.31 | 2,850,371,813 | 10987.013167 |
| 2013.06.28 | 2,817,168,550 | 10859.028219 |
| 2013.07.31 | 2,856,163,192 | 11009.336556 |
| 2013.08.30 | 2,850,718,727 | 10988.350378 |
| 2013.09.30 | 2,897,098,994 | 11167.127267 |
| 2013.10.31 | 2,904,899,944 | 11197.196727 |
| 2013.11.29 | 2,911,148,267 | 11221.281447 |
| 2013.12.31 | 2,920,721,635 | 11258.182850 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 259,431 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|---|
| 2012/12/28 | 2,775,552,570 | 10698.615701 |
| 2013/12/31 | 2,920,721,635 | 11258.182850 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Trendvadász I. Alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt az arany árfolyamát leíró index, az 500 legnagyobb amerikai vállalat részvényének teljesítményét leíró index, valamint egy a feltörekvő régió részvénypiacait reprezentáló részvény index futamidő alatti hozamának, valamint az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 20 | 29 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 825 | 314 | | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 300 029 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 25 237 | | 0,86% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 300 874 | 25 580 | | 0,87% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 1 592 355 | | 2 560 377 | 87,44% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | 734 153 | | 630 997 | 21,55% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | 858 202 | | 1 032 736 | 35,27% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | 0 | | 896 644 | 30,62% |
| MNB Kötvények: | | 131 553 | | 28 512 | 0,97% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 100 188 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 31 365 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 26 095 | 0,89% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 2 417 | 0,08% |
| Kötvények: | | 234 933 | | 271 347 | 9,27% |
| OTPHB FLOAT 03/1 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 165 743 | | 185 581 | 6,34% |
| OTPHB VAR 49-16 | 2006.11.07 - 2016.11.07 | 69 190 | | 85 766 | 2,93% |
| Jelzáloglevelek: | | 429 948 | | 11 206 | 0,39% |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - 2017.12.14 | 419 452 | | 0 | 0,00% |
| OJB2015/I | 2005.06.10 - 2015.06.10 | 10 496 | | 11 206 | 0,39% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 388 789 | 0 | 2 871 442 | 98,07% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 61 | | 1 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 95 504 | | 31 112 | 1,06% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 95 565 | | 31 113 | 1,06% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 785 228 | | 2 928 135 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 4 689 | | 4 951 | 96,45% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 172 | | 182 | 3,55% |
| Kötelezettségek összesen: | | 4 861 | | 5 133 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 780 367 | | 2 923 002 | |
| | | | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 259 431 | | 259 431 | |
| | | | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 717,17 | | 11 266,97 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 259 431 | | 10 833,98 |
| 2013. február 28. | 259 431 | | 10 817,69 |
| 2013. március 28. | 259 431 | | 10 866,32 |
| 2013. április 30. | 259 431 | | 10 972,71 |
| 2013. május 31. | 259 431 | | 10 987,01 |
| 2013. június 28. | 259 431 | | 10 859,03 |
| 2013. július 31. | 259 431 | | 11 009,34 |
| 2013. augusztus 30. | 259 431 | | 10 988,35 |
| 2013. szeptember 30. | 259 431 | | 11 167,13 |
| 2013. október 31. | 259 431 | | 11 197,20 |
| 2013. november 29. | 259 431 | | 11 221,28 |
| 2013. december 31. | 259 431 | 2 923 001 795 | 11 266,97 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Trendvadász I. Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 388 789 | 100,00% | 2 871 442 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 131 553 | 5,51% | 28 512 | 0,99% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 388 789 | 100,00% | 2 871 442 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 165 716 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -57 067 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | 0 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -140 |
| | felügyeleti díj: | -713 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | 0 |
| f) | nettó jövedelem: | 107 796 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 107 796 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | 34 839 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | adatok | | határidő ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -1 616 | 468 446 | -470 518 | 462 171 | -8 347 |
| | Összesen: | | | | | -8 347 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -3 806 | 1 155 445 | -1 127 973 | 1 139 754 | 11 781 |
| | Összesen: | | | | | 11 781 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | 236 860 503 | 236 860 503 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | 103 850 229 | 19 331 501 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | -133 010 274 | -217 529 002 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| adatok ezer Ft-ban | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| | | 2012.03.23-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 157 289 | 278 509 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 250 529 | 112 793 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 41 918 | 57 920 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 0 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -135 158 | 107 796 |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Trendvadász II. Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2012. május 22.-től 2015. december 31-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 3,926,981,004 | 11241.143310 |
| 2013.02.28 | 3,907,028,240 | 11184.027709 |
| 2013.03.28 | 3,925,801,989 | 11237.768332 |
| 2013.04.30 | 3,947,083,762 | 11298.688275 |
| 2013.05.31 | 3,946,393,807 | 11296.713251 |
| 2013.06.28 | 3,784,647,521 | 10833.707909 |
| 2013.07.31 | 3,877,822,012 | 11100.423690 |
| 2013.08.30 | 3,877,497,402 | 11099.494481 |
| 2013.09.30 | 3,948,022,965 | 11301.376782 |
| 2013.10.31 | 4,022,730,083 | 11515.228955 |
| 2013.11.29 | 3,991,355,301 | 11425.417361 |
| 2013.12.31 | 3,973,705,991 | 11374.895491 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 349,340 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2012/12/28 | 3,873,492,902 | 11088.031436 |
| 2013/12/31 | 3,973,705,991 | 11374.895491 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

Az OTP Trendvadász II. Alap szempontjából a mögöttes opciós struktúra miatt az arany árfolyamát leíró index, az 500 legnagyobb amerikai vállalat részvényének teljesítményét leíró index, valamint egy a feltörekvő régió részvénypiacait reprezentáló részvény index futamidő alatti hozamának, valamint az alap lejáratáig befektetett zéró-kupon kötvény hozamának van jelentősége.

3. Vagyonkimutatás

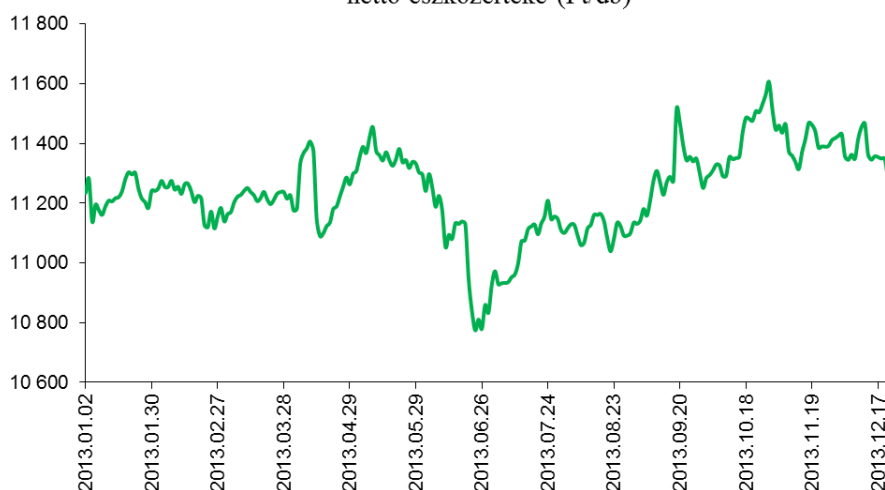
| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | Lekötési idő | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 21 | 29 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 867 | 232 | | 0,01% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 298 572 | 0 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR | 2013.12.30 - 2014.01.08 | 0 | 27 019 | | 0,68% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 299 460 | 27 280 | | 0,69% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 2 126 225 | | 3 230 506 | 81,11% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | 1 079 637 | | 801 091 | 20,11% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | 1 046 588 | | 1 413 218 | 35,48% |
| PEMÁK 2016/X | 2013.01.17 - 2016.05.25 | 0 | | 1 016 197 | 25,52% |
| MNB Kötvények: | | 11 833 | | 41 702 | 1,05% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 8 688 | | 0 | 0,00% |
| MNB130109 | 2012.12.27 - 2013.01.09 | 3 145 | | 0 | 0,00% |
| MNB140108 | 2013.12.23 - 2014.01.08 | 0 | | 35 309 | 0,89% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 6 393 | 0,16% |
| Kötvények: | | 311 007 | | 343 023 | 8,61% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | 94 267 | | 100 340 | 2,52% |
| OTPHB FLOAT 03/1: | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 216 740 | | 242 683 | 6,09% |
| Jelzáloglevelek: | | 760 369 | | 139 461 | 3,50% |
| FJ17NF01 | 2011.03.24 - 2017.03.24 | 131 191 | | 139 461 | 3,50% |
| FJ17NF02 | 2012.12.14 - 2017.12.14 | 629 178 | | 0 | 0,00% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 3 209 434 | 0 | 3 754 692 | 94,27% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | 0 | | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | 60 | | 2 | 0,00% |
| Származtatott ügyletek értékelési különbözete | | 377 930 | | 200 742 | 5,04% |
| Egyéb eszközök összesen: | | 377 990 | | 200 744 | 5,04% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 3 886 884 | | 3 982 716 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | 6 053 | | 6 242 | 96,16% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | 240 | | 249 | 3,84% |
| Kötelezettségek összesen: | | 6 293 | | 6 491 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 3 880 591 | | 3 976 225 | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | | | | |
| | | 349 340 | | 349 340 | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | | | | |
| | | 11 108,35 | | 11 382,11 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 349 340 | | 11 241,14 |
| 2013. február 28. | 349 340 | | 11 184,03 |
| 2013. március 28. | 349 340 | | 11 237,77 |
| 2013. április 30. | 349 340 | | 11 298,69 |
| 2013. május 31. | 349 340 | | 11 296,71 |
| 2013. június 28. | 349 340 | | 10 833,71 |
| 2013. július 31. | 349 340 | | 11 100,42 |
| 2013. augusztus 30. | 349 340 | | 11 099,49 |
| 2013. szeptember 30. | 349 340 | | 11 301,38 |
| 2013. október 31. | 349 340 | | 11 515,23 |
| 2013. november 29. | 349 340 | | 11 425,42 |
| 2013. december 31. | 349 340 | 3 976 225 679 | 11 382,11 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

OTP Trendvadász II. Hozamvédett Zártvégű Alap egy jegyre jutó nettó eszközértéke (Ft/db)



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|--|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 3 209 434 | 100,00% | 3 754 692 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 11 833 | 0,37% | 41 702 | 1,11% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 3 209 434 | 100,00% | 3 754 692 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | ezer forint |
|---|---|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | 232 251 |
| b) | egyéb bevétel: | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | -72 679 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | 0 |
| e) | egyéb díjak és adók: | |
| | bizományosi díj: | 0 |
| | bankköltség: | -140 |
| | felügyeleti díj: | -982 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | 0 |
| f) | nettó jövedelem: | 158 450 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | 158 450 |
| h) | a tőkeszámla változása: | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | -62 816 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|------------------|-----------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | adatok | | határidős ügylet | | határidős ügylet | |
| | ezerben | | szerződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | eredmény |
| 2012.12.31-én: | EUR | -1 837 | 532 510 | -534 865 | 525 377 | -9 488 |
| | Összesen: | | | | | -9 488 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -4 473 | 1 357 931 | -1 325 646 | 1 339 491 | 13 845 |
| | Összesen: | | | | | 13 845 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | | Előző év | Tárgyév |
| | | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. |
| Szerződés szerinti érték: | | | | | 353 532 080 | 353 532 080 |
| Fordulónapi piaci érték: | | | | | 387 418 060 | 186 896 900 |
| Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | | | | 33 885 980 | -166 635 180 |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | | |
|---------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|--|
| adatok ezer Ft-ban | | | | |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév | |
| | | 2012.05.21-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. | |
| a. | b. | c. | d. | |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 144 954 | 355 941 | |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 358 892 | 123 690 | |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 | |
| 04. | IV. Működési költségek | 43 139 | 73 801 | |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 0 | |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 | |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 | |
| 08. | VIII. Fizetett/fizetendő hozamok | 0 | 0 | |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -257 077 | 158 450 | |

Beszámoló a 2013. évről – OTP Világjátékok Hozamvédett Zártvégű Származtatott Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2012. augusztus 17.-től 2015. december 31.-ig

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján az alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke:

| Dátum | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2013.01.31 | 3,017,761,379 | 10596.221081 |
| 2013.02.28 | 3,070,582,873 | 10781.692415 |
| 2013.03.28 | 3,122,847,560 | 10965.208641 |
| 2013.04.30 | 3,182,514,490 | 11174.716253 |
| 2013.05.31 | 3,281,961,338 | 11523.902506 |
| 2013.06.28 | 3,224,428,066 | 11321.886775 |
| 2013.07.31 | 3,311,451,556 | 11627.451074 |
| 2013.08.30 | 3,257,019,531 | 11436.324706 |
| 2013.09.30 | 3,344,582,071 | 11743.781763 |
| 2013.10.31 | 3,523,540,973 | 12372.157520 |
| 2013.11.29 | 3,634,144,609 | 12760.518438 |
| 2013.12.31 | 3,679,316,755 | 12919.130729 |

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2013. december 31-én 284,796 db volt, mely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az alap zárt végű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

Az alap hivatalos napi nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az elmúlt év végén és az ezt megelőző években:

| Időpont | nettó eszközérték (Ft) | egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft) |
|------------|---------------------------|--|
| 2012/12/28 | 2,943,035,989 | 10333.838920 |
| 2013/12/31 | 3,679,316,755 | 12919.130729 |

2. A befektetési politikára ható fontosabb tényezők és az alap befektetési stratégiájának bemutatása:

A 2012 augusztusában indult OTP Világjátékok Alappal befektetőink a 2012-es Nyári Olimpiai Játékok főszponzoraiból összeállított részvénykosárra szóló származtatott részvénytársasági befektetés futamidő alatti teljesítményéből részesedhetnek tőkevédelem és egy fix, 8%-os rögzített hozam mellett. A londoni olimpia fő szponzorai nemzetközi óriáscégek, amelyek a támogatás fejében kizárólagos hirdetési jogot kapnak a sporteseményen, illetve a játékok hivatalos szállítói, szolgáltatói lehetnek. Világszerte nézők milliárdjai kísérik figyelemmel az eseményeket, így a támogatók hirdetéseik révén óriási ismertséghez jutnak, illetve tovább erősíthetik piaci pozíciójukat.

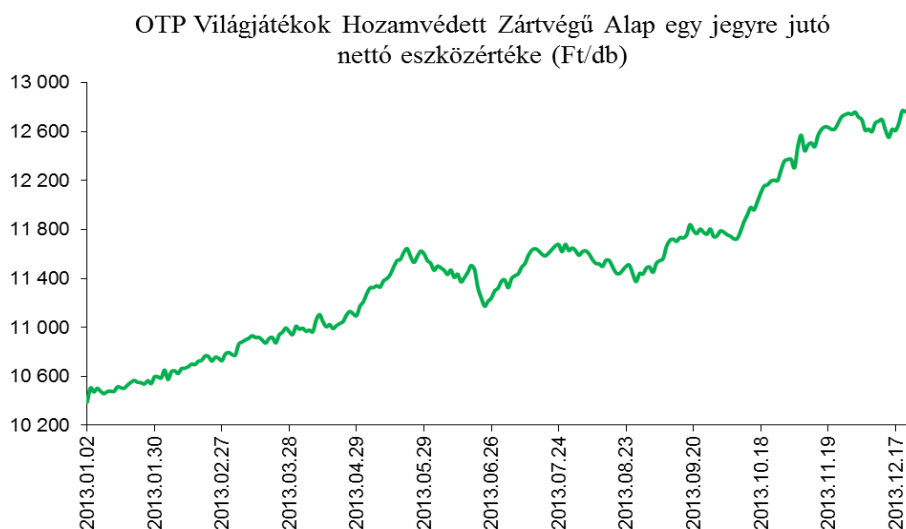
3. Vagyonkimutatás

| III. Értékpapír Alap vagyonának megoszlása piaci értéken - vagyonkimutatás | | | | adatok ezer Ft-ban | |
|--|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------------------|
| Vagyonelem, ill.értékpapír fajta | | Időszak nyitó állománya 2013.01.01 | Időszak záró állománya 2013.12.31 | Megoszlás (%) | |
| Készpénzállomány - banki egyenlegek | | | | | |
| Bank | | | | | |
| Lekötési idő | | | | | |
| OTP Bank Nyrt. HUF folyószámla | | 22 | 30 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR folyószámla | | 0 | 152 | | 0,00% |
| OTP Bank Nyrt. EUR 2013.12.30 - 2014.01.08 | | 0 | 12 470 | | 0,34% |
| Banki egyenlegek összesen: | | 22 | 12 652 | | 0,34% |
| Átruházható értékpapírok | | | | | |
| Értékpapír neve | Futamidő | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír | Tőzsdei értékpapír | Tőzsdén kívüli értékpapír |
| Államkötvények: | | 1 923 494 | | 1 961 455 | 53,23% |
| 2015/C | 2012.02.15 - 2015.08.24 | 917 691 | | 0 | 0,00% |
| 2016/C | 2005.10.05 - 2016.02.12 | 0 | | 531 284 | 14,42% |
| DK2015/02 | 2012.06.11 - 2015.08.24 | 1 005 803 | | 1 017 742 | 27,62% |
| REPHUN 4.375 07/17 | 2007.02.01 - 2017.07.04 | 0 | | 412 429 | 11,19% |
| MNB Kötvények: | | 90 601 | | 2 816 | 0,08% |
| MNB130102 | 2012.12.19 - 2013.01.02 | 90 601 | | 0 | 0,00% |
| MNB140115 | 2013.12.31 - 2014.01.15 | 0 | | 2 816 | 0,08% |
| Kötvények: | | 44 958 | | 304 094 | 8,25% |
| OTPHB 5.27 09/16 | 2006.09.19 - 2016.09.19 | 44 958 | | 246 992 | 6,70% |
| OTPHB FLOAT 03/15 | 2005.03.04 - 2015.03.04 | 0 | | 57 102 | 1,55% |
| Jelzáloglevelek: | | 745 317 | | 746 709 | 20,26% |
| FJ15ZF02 | 2005.05.18 - 2015.05.18 | 745 317 | | 746 709 | 20,26% |
| Átruházható értékpapírok összesen: | | 2 804 370 | 0 | 3 015 074 | 81,82% |
| Egyéb eszközök | | | | | |
| Követelések | | | 0 | 0 | 0,00% |
| Aktív időbeli elhatárolások | | | 0 | 1 | 0,00% |
| Szarmaztatott ügyletek értékelési különbözete | | | 169 611 | 657 191 | 17,84% |
| Egyéb eszközök összesen: | | | 169 611 | 657 192 | 17,84% |
| ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN: | | 2 974 003 | | 3 684 918 | 100,00% |
| Kötelezettségek | | | | | |
| Alapkezelői díj miatt | | | 4 222 | 5 238 | 95,95% |
| Költségként elszámolt egyéb tétel miatt | | | 181 | 221 | 4,05% |
| Kötelezettségek összesen: | | | 4 403 | 5 459 | 100,00% |
| NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK: | | 2 969 600 | | 3 679 459 | |
| | | | | | |
| A forgalomban lévő befektetési jegyek száma : | | 284 796 | | 284 796 | |
| | | | | | |
| Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték (Ft/jegy): | | 10 427,11 | | 12 919,63 | |

4. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

| | Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db) | Fordulónapi nettó eszközérték (Ft) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db) |
|----------------------|--|------------------------------------|---|
| 2013. január 31. | 284 796 | | 10 596,22 |
| 2013. február 28. | 284 796 | | 10 781,69 |
| 2013. március 28. | 284 796 | | 10 965,21 |
| 2013. április 30. | 284 796 | | 11 174,72 |
| 2013. május 31. | 284 796 | | 11 523,90 |
| 2013. június 28. | 284 796 | | 11 321,89 |
| 2013. július 31. | 284 796 | | 11 627,45 |
| 2013. augusztus 30. | 284 796 | | 11 436,32 |
| 2013. szeptember 30. | 284 796 | | 11 743,78 |
| 2013. október 31. | 284 796 | | 12 372,16 |
| 2013. november 29. | 284 796 | | 12 760,52 |
| 2013. december 31. | 284 796 | 3 679 459 081 | 12 919,63 |

5. Egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték



6. A befektetési alap összetétele

| | 2013.01.01 | Megoszl.(%) | 2013.12.31 | Megoszl.(%) |
|---|------------|-------------|------------|-------------|
| a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok: | 2 804 370 | 100,00% | 3 015 074 | 100,00% |
| b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékp.:: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| a fentiekből: | | | | |
| c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékp.: | 90 601 | 3,23% | 2 816 | 0,09% |
| d) egyéb átruházható értékpapírok: | 0 | 0,00% | 0 | 0,00% |
| e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok: | 2 804 370 | 100,00% | 3 015 074 | 100,00% |

7. A befektetési alap eszközeinek alakulása

| V. A befektetési alap eszközeinek alakulása a tárgyidőszakban | | | ezer forint |
|---|---|--|-------------|
| a) | befektetésekből származó jövedelem: | | 202 033 |
| b) | egyéb bevétel: | | 0 |
| c) | kezelési költségek (alapkezelői díj): | | -55 758 |
| d) | a letétkezelő díjai: (az alapkezelési díj tartalmazza) | | 0 |
| e) | egyéb díjak és adók: | | |
| | bizományosi díj: | | 0 |
| | bankköltség: | | -131 |
| | felügyeleti díj: | | -818 |
| | egyéb költség és ráfordítás: | | 0 |
| f) | nettó jövedelem: | | 145 326 |
| g) | felosztott jövedelem (fizetett hozam): | | 0 |
| | újra befektetett jövedelem: | | 145 326 |
| h) | a tőkeszámla változása: | | 0 |
| i) | a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése: | | 564 533 |
| j) | minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (ilyen tételek nem voltak) | | 0 |

8. Származtatott ügyletek

| Határidős deviza ügyletek bemutatása: | | | | | | |
|---|-------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------------------|---------------------------|----------------|
| | adatok ezerben | határidős ügylet | | határidős ügylet | | eredmény |
| | | szervződés szerinti értéke | | diszkontált piaci értéke | | |
| | | devizában | forintban | devizás értéke forintban | forint értéke | |
| 2012.12.31-én: | EUR | -2 534 | 734 411 | -737 659 | 724 574 | -13 085 |
| | Összesen: | | | | | -13 085 |
| 2013.12.31-én: | EUR | -4 562 | 1 385 059 | -1 352 128 | 1 366 250 | 14 122 |
| | Összesen: | | | | | 14 122 |
| Opciók bemutatása (adatok Ft-ban): | | | | Előző év | Tárgyév | |
| | | | | 2012. december 31. | 2013. december 31. | |
| | | Szerződés szerinti érték: | | 203 629 140 | 203 629 140 | |
| | | Fordulónapi piaci érték: | | 182 696 634 | 643 069 368 | |
| | | Nem realizált árfolyamkülönbözet: | | -20 932 506 | 439 440 228 | |

9. Eredménykimutatás

| Eredménykimutatás | | | |
|--------------------------|-------------------------------------|------------------------|------------------------|
| | | | |
| | | | adatok ezer Ft-ban |
| A tétel megnevezése | | Előző év | Tárgyév |
| a. | b. | 2012.08.17-2012.12.31. | 2013.01.01-2013.12.31. |
| a. | b. | c. | d. |
| 01. | I. Pénzügyi műveletek bevételei | 2 625 | 322 114 |
| 02. | II. Pénzügyi műveletek ráfordításai | 221 872 | 120 081 |
| 03. | III. Egyéb bevételek | 0 | 0 |
| 04. | IV. Működési költségek | 18 950 | 56 707 |
| 05. | V. Egyéb ráfordítások | 0 | 0 |
| 06. | VI. Rendkívüli bevételek | 0 | 0 |
| 07. | VII. Rendkívüli ráfordítások | 0 | 0 |
| 08. | VIII. Fizetett, fizetendő hozamok | 0 | 0 |
| 09. | IX. Tárgyévi eredmény | -238 197 | 145 326 |