

**OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott
Nyíltvégű Alap**

*Éves jelentés
és független könyvvizsgálói jelentés*

2016. december 31.

FÜGGETLEN KÖNYVVIZSGÁLÓI JELENTÉS

Az OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap befektetőinek

Vélemény

Elvégeztük az OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap (az „Alap”) 2016. évi éves jelentésének I - XIV. pontjaiban található számviteli információinak (a „számviteli információk”) könyvvizsgálatát.

Véleményünk szerint az Alap mellékelt 2016. december 31-ével végződő üzleti évre vonatkozó éves jelentésében közölt számviteli információk minden lényeges szempontból a Magyarországon hatályos, a számvitelről szóló 2000. évi C. törvénnyel (a „számviteli törvény”), valamint a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvénnyel összhangban kerültek összeállításra. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban szereplő eszközök és kötelezettségek leltárral alátámasztottak. Az éves jelentésben közölt számviteli információkban bemutatott kezelési költségek az Alap letétkezelője által adott értékelés alapján kerültek elszámolásra.

A vélemény alapja

Könyvvizsgálatunkat a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal összhangban és a könyvvizsgálatra vonatkozó – Magyarországon hatályos – törvények és egyéb jogszabályok alapján hajtottuk végre. Ezen standardok értelmében fennálló felelősségünk bővebb leírását jelentésünk „A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége” szakasza tartalmazza.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk általunk végzett könyvvizsgálatára vonatkozó, Magyarországon hatályos etikai követelményeknek megfelelően, függetlenek vagyunk az Alaptól és annak kezelőjétől, az OTP Alapkezelő Zrt.-től, és ugyanezen etikai követelményekkel összhangban eleget tettünk egyéb etikai felelősségeinknek is.

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

Kulcsfontosságú könyvvizsgálati kérdések

Megállapítottuk, hogy nincsenek a jelentésünkben kommunikálandó kulcsfontosságú könyvvizsgálati kérdések.

Egyéb kérdések

Az előző évi éves jelentést másik könyvvizsgáló auditálta. A 2016. április 29-én kiadott könyvvizsgáló jelentése korlátozás nélküli könyvvizsgálói véleményt tartalmazott.

Egyéb információk

Az egyéb információk az éves jelentésben foglalt nem számviteli információkból állnak, de nem tartalmazzák az éves jelentésben található számviteli információkat és az azokra vonatkozó könyvvizsgálói jelentésünket. Az OTP Alapkezelő Zrt. ügyvezetése (a „vezetés”) felelős az egyéb információk elkészítéséért. A jelentésünk „Vélemény” szakaszában az éves jelentésben közölt számviteli információkra adott véleményünk nem vonatkozik az egyéb információkra, és az egyéb információkra vonatkozóan nem bocsátunk ki semmilyen formájú bizonyosságot nyújtó következtetést.

Az éves jelentésben közölt számviteli információk általunk végzett könyvvizsgálatával kapcsolatban a mi felelősségünk az egyéb információk átolvasása és ennek során annak mérlegelése, hogy az éves jelentésben foglalt egyéb információk lényegesen ellentmondanak-e az éves jelentésben közölt számviteli információknak vagy a könyvvizsgálat során szerzett ismereteinknek, vagy egyébként úgy tűnik-e, hogy azok lényeges hibás állítást tartalmaznak. Ha az elvégzett munkánk alapján arra a következtetésre jutunk, hogy az egyéb információk lényeges hibás állítást tartalmaznak, kötelességünk ezt a tényt jelteni. Ebben a tekintetben nincs jelteni valónk.

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

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

Az éves jelentésben közölt számviteli információk elkészítése során a vezetés felelős azért, hogy felmérje az Alapnak a vállalkozás folytatására való képességét és az adott helyzetnek megfelelően közzétegye a vállalkozás folytatásával kapcsolatos információkat, valamint a vezetés felel a vállalkozás folytatásának elvén alapuló számvitel éves jelentésben való alkalmazásáért, azt az esetet kivéve, ha a vezetésnek szándékában áll megszüntetni az Alapot vagy beszüntetni az üzletszerű tevékenységet, vagy amikor ezen kívül nem áll előtte más reális lehetőség.

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

A könyvvizsgáló éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálatáért való felelőssége

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

Egy, a Magyar Nemzeti Könyvvizsgálati Standardokkal összhangban elvégzésre kerülő könyvvizsgálatnak a részeként szakmai megítélést alkalmazunk, és szakmai szkepticizmust tartunk fenn a könyvvizsgálat egésze során. Emellett:

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

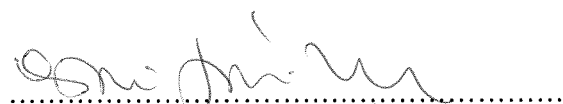
Kommunikáljuk az irányítással megbízott személyek felé – egyéb kérdések mellett – a könyvvizsgálat tervezett hatókörét és ütemezését, a könyvvizsgálat jelentős megállapításait, beleértve a belső kontrollnak a könyvvizsgálatunk során általunk azonosított jelentős hiányosságait is.

Nyilatkozunk az irányítással megbízott személyeknek arról, hogy megfelelünk a függetlenségre vonatkozó releváns etikai követelményeknek, és kommunikáljuk feljük mindazon kapcsolatokat és egyéb kérdéseket, amelyekről ésszerűen feltételezhető, hogy befolyásolják a függetlenségünket, valamint adott esetben a kapcsolódó biztosítékokat.

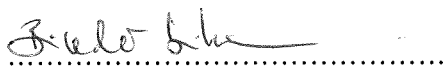
Az irányítással megbízott személyek felé kommunikált kérdések közül meghatározzuk azokat a kérdéseket, amelyek az éves jelentésben közölt számviteli információk könyvvizsgálata során a legjelentősebb kérdések, és ennél fogva a kulcsfontosságú könyvvizsgálati kérdések voltak. Könyvvizsgálói jelentésünkben ismertetjük ezeket a kérdéseket, kivéve, ha jogszabály vagy szabályozás kizárja az adott kérdés nyilvános közzétételét, vagy ha - rendkívül ritka körülmények között - azt állapítjuk meg, hogy egy adott kérdést a könyvvizsgálói jelentésben nem lehet kommunikálnunk, mert ésszerű várakozások alapján annak hátrányos következményei súlyosabbak lennének, mint a kommunikáció közérdekű hasznai.

A jelen független könyvvizsgálói jelentést eredményező könyvvizsgálat megbízásért felelős partnerének a jelentés aláírói minősülnek.

Budapest, 2017. április 27.



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



Binder Szilvia
Kamarai tag könyvvizsgáló
Tagszám: 003801



OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

Éves jelentés a 2016. december 31-én zárult üzleti évről

Pénzügyi év: 2016. január 1-től
2016. december 31-ig

Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Székhelye:	1134 BUDAPEST, Váci út 33.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Székhelye:	1051 BUDAPEST, Nádor u.16.

OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

Mérleg

		adatok ezer Ft-ban	
A tétel megnevezése		Előző év 2015. december 31.	Tárgyév 2016. december 31.
a.	b.	c.	d.
01.	A) Befektetett eszközök	0	0
02.	I. Értékpapírok	0	0
03.	1. Értékpapírok	0	0
04.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	0	0
05.	a) kamatokból, osztalékból	0	0
06.	b) egyéb piaci megítélésből	0	0
07.	II. Hosszú lejáratú bankbetétek	0	0
08.	B. Forgóeszközök	3.377.036	3.369.091
09.	I. Követelések	667.609	640.450
10.	1. Követelések	667.609	640.450
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	0	0
14.	II. Értékpapírok	2.533.394	2.436.991
15.	1. Értékpapírok	2.339.716	2.124.346
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	193.678	312.645
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	3.691
18.	b) egyéb piaci megítélésből	193.678	308.954
19.	III. Pénzeszközök	176.033	291.650
20.	1. Pénzeszközök	176.033	291.650
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	801	413
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	801	413
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származtatott ügyletek értékelési különbözete	0	0
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	3.377.837	3.369.504
27.	E. Saját tőke	2.682.796	2.674.912
28.	I. Induló tőke	3.120.668	2.731.760
29.	1. Kibocsátott befektetési jegyek névértéke	12.723.118	13.641.240
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-9.602.450	-10.909.480
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	-437.872	-56.848
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	2.427.043	2.630.872
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	-2.954.625	-3.089.648
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	193.678	312.645
35.	3. Előző év(ek) eredménye	-421.229	-103.968
36.	4. Üzleti év eredménye	317.261	193.251
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	695.041	694.592
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	695.041	694.592
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	3.377.837	3.369.504

Eredménykimutatás

		adatok ezer Ft-ban	
A tétel megnevezése		Előző év 2015.01.01-2015.12.31.	Tárgyév 2016.01.01-2016.12.31.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei	1.822.711	702.472
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	1.439.680	452.397
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	64.382	55.592
05.	V. Egyéb ráfordítások	1.388	1.232
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	317.261	193.251

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.

Kelt: BUDAPEST, 2017. március 31.

.....
az Alapkezelő vezetője

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

Tájékoztató adatok:

Az Alap neve: OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

Az Alap felügyeleti nyilvántartásba vételének száma (lajstromszám) és dátuma: 1111-257, 2008. január 8.

Az Alap típusa: nyilvános

Az Alap fajtája: nyíltvégű értékpapír-befektetési alap

Az Alap futamideje: 2008. január 8-tól határozatlan ideig.

Az Alap üzleti éve: megegyezik a naptári évvel.

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

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

Alapkezelő neve: OTP Alapkezelő Zrt. székhelye: Budapest, 1134 Váci út 33.

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

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

Az Alap képviselőjére jogosult személy Köves Benedek Balázs, lakóhelye 1126 Budapest, Márvány utca 27. fszt. 6. A könyvviteli szolgáltatás körébe tartozó feladatok irányításáért, vezetéséért felelős személy Szabó Andrea, lakóhelye 2151 Fót, Németh Kálmán utca 72. mérlegképes igazolvány száma: MK 191836.

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

Az Alap 2016. üzleti évére vonatkozó 27% ÁFÁ-val növelt bruttó könyvvizsgálati díj 745 eFt. Ezt részben az Alapkezelő által számlázott alapkezelői díj tartalmazta, de a szerződéses konstrukció változása miatt 709 eFt már az Alapot közvetlenül terhelte.

Az Alap tőzsdei bevezetésének dátuma: 2014. december 23.

Az Alappal kapcsolatos további információkat ld. az Alapkezelő honlapján:

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

A számviteli politika fő vonásai és az alkalmazott számviteli alapelvek

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

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

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

Értékpapírok értékelése és elszámolása

- A Kormányrendelet előírásainak megfelelően az értékpapírok nettó beszerzési értéken kerülnek nyilvántartásba vételre. Az értékpapírok eladása során az értékesítésre jutó könyv szerinti érték FIFO módszerrel kerül meghatározásra.
- Az értékpapírok a KBFTV., a Kormányrendelet, valamint az Alap kibocsátási tájékoztatója által előírt rendszerességgel piaci értéken kerülnek értékelésre.
- A Kormányrendelet előírásainak megfelelően az értékpapírok után tárgyévben járó időarányos kamatok és osztalékok az értékpapírok értékkülönbözeteként kerülnek elszámolásra.

Származékos ügyletek értékelése és elszámolása

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

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

Külföldi pénzürtékre szóló követelések és kötelezettségek

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

Immateriális javak és tárgyi eszközök

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

A mérleg egyes tételeinek magyarázata:

Eszközök:

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

Források:

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

Az eredménykimutatás egyes tételeinek magyarázata:

A pénzügyi műveletek eredménye 250.075 eFt, amely 702.472 eFt bevétel és 452.397 eFt ráfordítás különbsége. 55.592 eFt működési költség és 1.232 eFt egyéb ráfordítás után a nyereség 193.251 eFt.

A működési költségeket a likviditási jelentés II. táblázata részletezi, amelyben a "pénzügyileg realizált oszlop" tartalmazza az 2016. évi költségek azon részét, amelyet a futamidő végéig kifizetett. Az Alappal kapcsolatos azon költségeket, amelyek a fent említett táblázatban nem szerepelnek (pl.: forgalmazási díj, reklám költségek,...) az Alap tájékoztatójának megfelelően az Alapkezelő viseli.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

I. Vagyongkimutatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2016.01.01		Időszak záró állománya 2016.12.31		Megoszlás (%)
Készpénzállomány - banki egyenlegek					
Bank	Lekötési idő				
OTP Bank Nyrt. HUF	foliószám	13	5.101	0,15%	
OTP Bank Nyrt. EUR	foliószám	125.736	13.687	0,41%	
OTP Bank Nyrt. USD	foliószám	0	36.998	1,10%	
OTP Bank Nyrt. GBP	foliószám	124	0	0,00%	
OTP Bank Nyrt. SEK	foliószám	0	119.514	3,55%	
OTP Bank Nyrt. DKK	foliószám	0	116.350	3,45%	
OTP Bank Nyrt. USD	2015.12.30 - 2016.01.06	50.160	0	0,00%	
Banki egyenlegek összesen:		176.033	291.650	8,66%	
Átruházható értékpapírok					
Értékpapír neve	Futamidő	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír	Tőzsdei értékpapír	Tőzsdén kívüli értékpapír
Államkötvények:		0		71.581	2,13%
2017/B	2006.10.04 - 2017.02.24	0		71.581	2,13%
Diszkont kincstárjegyek:		53.841		8.868	0,26%
D160413	2015.04.15 - 2016.04.13	53.841		0	0,00%
D170524	2016.05.25 - 2017.05.24	0		8.868	0,26%
Belföldi részvények:		31.199		30.829	0,92%
MASTERPLAST		31.199		30.829	0,92%
Külföldi részvények:		2.448.354		2.325.713	69,01%
ACUITY BRANDS INC		140.730		0	0,00%
ADOBE SYSTEMS INC		70.277		0	0,00%
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC		68.616		62.711	1,86%
AEROVIRONMENT		70.533		0	0,00%
ALPHABET INC-CL A		138.260		0	0,00%
AMAZON.COM INC		139.485		0	0,00%
AMERICAN WATER WORKS CO INC		70.389		0	0,00%
AQUA AMERICA		140.253		0	0,00%
COHERENT		0		63.751	1,89%
COSAN LTD		0		62.948	1,87%
EUROFINS SCIENTIFIC		83.646		76.838	2,28%
FIRST SOLAR		141.861		0	0,00%
GAMESA		84.006		0	0,00%
HD SUPPLY HOLDINGS INC		0		127.095	3,77%
INTERSIL CORP		0		63.790	1,89%
ITRON		0		62.943	1,87%
JA SOLAR HOLDINGS CO LTD		70.676		0	0,00%
KAPSCH		105.863		99.724	2,96%
KINGSPAN GROUP		85.078		0	0,00%
MASTEC		0		127.165	3,77%
MCDERMOTT INTL INC		0		63.440	1,88%
MUELLER WATER PRODUCTS INC		0		127.356	3,78%
NORDEX SE		168.177		0	0,00%
NVIDIA CORP		0		122.259	3,63%
ORMAT TECH		71.083		0	0,00%
OSRAM LICHT AG		0		77.327	2,30%
OWENS CORNING		70.771		0	0,00%
PACIFIC ETHANOL INC		0		128.399	3,81%
PERKINELMER INC		70.325		0	0,00%
POOL CORP		139.850		63.126	1,87%
REX AMERICAN RESOURCES CORP		0		63.514	1,88%
ROCKWOOL		0		76.616	2,27%
ROPER INDUSTRIES INC		140.351		0	0,00%
SIEMENS AG		0		154.027	4,57%
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG		162.917		0	0,00%
TORO CO		0		126.526	3,76%
US SILICA HOLDINGS INC		0		127.511	3,78%
VEECO INSTRUMENTS INC		0		64.208	1,91%

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

I. Vagyongkimutatás - folytatás

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill.értékpapír fajta	Időszak nyitó állománya 2016.01.01	Időszak záró állománya 2016.12.31	Megoszlás (%)
VERBUND AG	0	152.919	4,54%
VESTAS	145.147	91.104	2,70%
WACKER CHEMIE AG	0	76.861	2,28%
WASTE CONNECTIONS	70.060	0	0,00%
XYLEM	0	63.555	1,89%
Átruházható értékpapírok összesen:	2.533.394	2.436.991	72,32%
Egyéb eszközök			
Követelések	667.609	640.450	19,01%
Aktív időbeli elhatárolások	801	413	0,01%
Származtatott ügyletek értékelési különbözete	0	0	0,00%
Egyéb eszközök összesen:	668.410	640.863	19,02%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:	3.377.837	3.369.504	100,00%
Kötelezettségek			
1. Hitelállomány:	0	0	0,00%
2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:			
Alapkezelői díj	4.521	4.477	0,64%
Letétkezelői díj	266	249	0,04%
Költségként elszámolt egyéb tétel	869	916	0,13%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség	689.385	688.950	99,19%
3. Céltartalékok:	0	0	0,00%
4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:	0	0	0,00%
Kötelezettségek összesen:	695.041	694.592	100,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:	2.682.796	2.674.912	

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma :	3.120.667.569	2.731.760.619
--	----------------------	----------------------

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

	2015.12.31	2016.12.31
Jelen dokumentum alapján:	0,859686	0,979190
A hivatalosan közzétett nettó eszközérték alapján:	0,859712	0,978512 *

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

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

Éves jelentés - OTP Klimaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

IV. Az Alap értékpapír portfóliójának összetétele

Megnevezés	2016.01.01	Megoszl.(%)	2016.12.31	Megoszl.(%)
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	2.533.394	75,00%	2.436.991	72,32%
b) más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
<i>a fentiekből:</i>				
c) a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok:	53.841	1,59%	8.868	0,26%
d) egyéb átruházható értékpapírok:	0	0,00%	0	0,00%
e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok:	53.841	1,59%	80.449	2,39%

*A megoszlási viszonyszámok az Alap összes eszközértékéhez viszonyított arányokat mutatja (előző évi auditált jelentésben az arányszám az értékpapír portfólió összértéke alapján lett számszerűsítve).

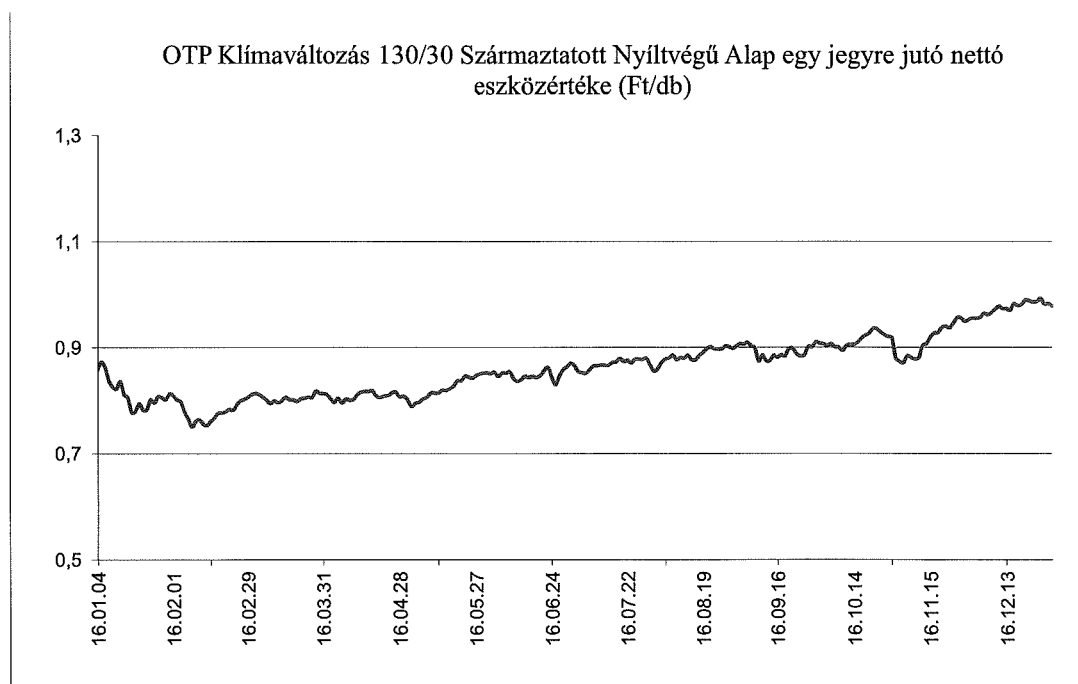
A portfólió összetételében a tárgyidőszakban bekövetkezett változások leírása

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

V. Az Alap eszközeinek alakulása

Megnevezés	2015. december 31. el zárult üzleti év	2016. december 31. el zárult üzleti év
a) befektetésekből származó jövedelem:	383.031	250.075
b) egyéb bevétel:	0	0
c) kezelési költségek (alapkezelői díj):	-55.117	-49.000
d) a letétkezelő díjai:	-1.102	-977
e) egyéb díjak és adók:		
bizományosi díj:	-6.163	-3.787
bankköltség:	-393	-275
felügyeleti díj:	-689	-611
egyéb költség és ráfordítás:	-2.306	-2.174
f) nettó jövedelem:	317.261	193.251
g) felosztott jövedelem (fizetett hozam):	0	0
újra befektetett jövedelem:	317.261	193.251
h) a tőkeszámla változása:	-797.690	-320.102
i) a befektetések értéknövekedése, illetve értékcsökkenése:	-301.399	118.967
j) minden olyan egyéb változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire: (*)	0	0

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



Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

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

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma és nettó eszközértéke:

	Elért hozamok éves bontásban	Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	Fordulónapi nettó eszközérték (Ft)	Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft/db)
2012. december 31.		1.652.665.151	816.184.913	0,493860
2013. december 31.	38,59%	2.205.503.729	1.509.484.584	0,684417
2014. december 31.	23,29%	4.106.001.895	3.464.623.585	0,843795
2015. december 31.	1,88%	3.120.667.569	2.682.795.047	0,859686
2016. január 29.		3.130.833.089		0,813095
2016. február 29.		3.107.435.385		0,806009
2016. március 31.		3.081.597.473		0,813379
2016. április 29.		3.067.586.711		0,809084
2016. május 31.		2.962.761.926		0,851827
2016. június 30.		2.789.310.409		0,863408
2016. július 29.		2.614.917.455		0,880604
2016. augusztus 31.		2.596.747.576		0,898672
2016. szeptember 30.		2.656.000.395		0,910925
2016. október 28.		2.615.124.484		0,918806
2016. november 30.		2.694.012.294		0,955509
2016. december 31.	13,90%	2.731.760.619	2.674.911.986	0,979190

Az OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap 2016. évi hozama az Alapot terhelő költségek levonása után 13,9 % lett.

Az Alapra kibocsátott befektetési jegyek darabszámának havi változása:

'A' sorozat (névérték 1 Ft.)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2016. január	87.745.999	77.774.535
2016. február	50.958.712	74.116.640
2016. március	54.045.482	70.690.372
2016. április	48.587.402	60.895.602
2016. május	14.402.329	117.104.436
2016. június	20.210.957	123.356.036
2016. július	15.298.622	186.226.000
2016. augusztus	56.036.352	68.152.903
2016. szeptember	83.743.084	50.507.739
2016. október	61.891.631	127.018.446
2016. november	128.700.076	83.128.430
2016. december	125.161.089	83.780.564
Összesen:	746.781.735	1.122.751.703

'B' sorozat (névérték 1 EUR)	Kibocsátás mennyisége (db)	Visszaváltás mennyisége (db)
2016.január	50.760	49.996
2016.február	4.704	5.648
2016.március	8.575	44.768
2016.április	24.755	31.458
2016.május	21.217	29.574
2016.június	5.332	282.129
2016.július	3.203	16.847
2016.augusztus	21.143	44.975
2016.szeptember	130.788	28.357
2016.október	107.372	11.896
2016.november	199.622	68.456
2016.december	97.098	111.398
Összesen:	674.569	725.502

Az Alap nem fizetett hozamot a beszámolási időszakban.

A nettó eszközérték napi alakulását bemutató grafikon a 7. oldalon található.

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

VII. A származtatott ügyletek és a kapcsolódó kötelezettségvállalások bemutatása

A származtatott ügyletek és kapcsolódó kötelezettségvállalások a XIII. pontban az értékpapírok értékkülönbségének részletezésével együtt kerülnek bemutatásra.

VIII. Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, valamint a befektetési politika alakulására ható fontosabb tényezők bemutatása

Az Alapkezelő működésére vonatkozó belső szabályzatok a KBFTV., valamint egyéb vonatkozó jogszabályok előírásai szerint kerültek kialakításra, illetve módosításra. Az Alapkezelő működésében ugyanakkor tárgyidőszak folyamán jelentős változás nem történt.

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

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

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

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

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

Az Alapkezelő által 2016. évben kifizetett összes:

eFt.

Megnevezés	Összeg
Rögzített javadalmazás	366.809
Változó javadalmazás	292.317
Összesen	659.126

Az Alap kockázati profiljára lényeges hatást gyakorlók körében 2016. évben kifizetett összes:

eFt.

Megnevezés	Ügyvezetők	Egyéb munkavállalók	Összesen
Kedvezményezettak száma	5	5	10
Nyereségrészesedés	0	0	0
Teljes javadalmazás *	168.098	95.097	263.195

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

X. Kockázatkezelésre vonatkozó információk

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

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

b) likviditáskezeléssel kapcsolatos megállapodások bemutatása

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

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

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

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

c) az Alap aktuális kockázati profilja és az Alapkezelő által e kockázatok kezelése érdekében alkalmazott kockázatkezelési rendszerek

Az Alap kockázati profiljára vonatkozó információkat az Alap Tájékoztatójának "Az Alap kockázati profilja" c., a Kezelési Szabályzatának "A kockázati tényezők bemutatása" c. fejezetei, valamint a Kiemelt Befektetői Információjának "Hozam és kockázat profit" c., illetve "Jelentős kockázati tényezők" pontjai tartalmazzák.

A Társaság likviditási politikája a Bizottság 2012. december 19-i, a 2011/61/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek a mentességek, az általános működési feltételek, a letétkezelők, a tőkeáttétel, az átláthatóság és a felügyelet tekintetében történő kiegészítéséről szóló 231/2013/EU felhatalmazáson alapuló rendelete („ABAK-rendelet”) 46-48. cikkének megfelelően lett kialakítva.

A Társaság likviditási politikája az ÁÉKBV-alapkezelőre vonatkozó szervezeti, összeférhetetlenségi, üzletviteli és kockázatkezelési követelményekről szóló 79/2014. (III. 14.) Korm. rendelet („79/2014. Korm. rendelet”) 24. paragrafusának megfelelően lett kialakítva.

XI. Tőkeáttétel mértékében bekövetkezett változások

	2015.12.31	2016.12.31	Változás 2016/2015
Tőkeáttétel	2.669.664.893	2.666.631.295	99,8864%

XII. Egyéb információk

a) Az Alap illikviddé vált eszközeinek bemutatása

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

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

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

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

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

adatok ezer Ft-ban

Értékpapír megnevezése	futamideje	Beszerzési ár	Értékkülönbség		Piaci érték
			kamatból, osztalékból	egyéb piaci megítélésből	
Államkötvények:		64.648	3.691	3.242	71.581
2017/B	2006.10.04 - 2017.02.24	64.648	3.691	3.242	71.581
Diszkont kincstárjegyek:		8.864	0	4	8.868
D170524	2016.05.25 - 2017.05.24	8.864	0	4	8.868
Belföldi részvények:		30.595	0	234	30.829
MASTERPLAST		30.595	0	234	30.829
Külföldi részvények:		2.020.239	0	305.474	2.325.713
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC		42.198	0	20.513	62.711
COHERENT		42.456	0	21.295	63.751
COSAN LTD		55.453	0	7.495	62.948
EUROFINS SCIENTIFIC		78.326	0	-1.488	76.838
HD SUPPLY HOLDINGS INC		127.143	0	-48	127.095
INTERSIL CORP		56.431	0	7.359	63.790
ITRON		65.511	0	-2.568	62.943
KAPSCH		96.462	0	3.262	99.724
MASTEC		104.587	0	22.578	127.165
MCDERMOTT INTL INC		63.687	0	-247	63.440
MUELLER WATER PRODUCTS INC		105.744	0	21.612	127.356
NVIDIA CORP		52.599	0	69.660	122.259
OSRAM LICHT AG		76.536	0	791	77.327
PACIFIC ETHANOL INC		97.615	0	30.784	128.399
POOL CORP		63.136	0	-10	63.126
REX AMERICAN RESOURCES CORP		58.905	0	4.609	63.514
ROCKWOOL		76.883	0	-267	76.616
SIEMENS AG		140.036	0	13.991	154.027
TORO CO		111.111	0	15.415	126.526
US SILICA HOLDINGS INC		68.715	0	58.796	127.511
VEECO INSTRUMENTS INC		63.960	0	248	64.208
VERBUND AG		147.062	0	5.857	152.919
VESTAS		87.614	0	3.490	91.104
WACKER CHEMIE AG		76.858	0	3	76.861
XYLEM		61.211	0	2.344	63.555
MINDÖSSZESEN:		2.124.346	3.691	308.954	2.436.991

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

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

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

XV. A mérleghez és eredménykimutatáshoz kapcsolódó kiegészítő megjegyzések

Saját tőke mozgástábla

adatok eFt-ban

Megnevezés	Nyitó egyenleg	Növekedés	Csökkenés	Záró egyenleg
Induló tőke változása:	3.120.668	918.122	-1.307.030	2.731.760
Tőkenövekmény változásának levezetése:				
Jegyforgalmazás értékkülönbözet:	-527.582	203.829	-135.023	-458.776
Értékelési különbözet:	193.678	312.645	-193.678	312.645
Eredménytartalék:	-103.968	193.251	0	89.283
Tőkenövekmény összesen:	-437.872	709.725	-328.701	-56.848
Saját tőke összesen:	2.682.796	1.627.847	-1.635.731	2.674.912

Likviditási jelentés

I. Hitelállomány összetétele

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

II. Költségek összetétele

adatok Ft-ban

Költségelem megnevezése	2015. évi költség	2015. évben pénzügyileg realizált	2016. évi költség	2016. évben pénzügyileg realizált
Alapkezelési díj	55.117.138	50.595.576	49.000.154	44.523.560
Letétkezelői díj	1.101.827	836.162	977.092	727.757
Bizományosi díj	6.162.567	6.162.567	3.787.308	3.787.308
Tanácsadó testület díja				
Bankköltség	392.767	392.767	274.968	274.968
Felügyeleti díj	689.000	524.000	611.000	403.857
Könyvvizsgálat díja	703.580	0	708.827	0
Tőkevisszafiz. garancia díja				
Tőzsdei díjak				
Tőke- és hozamfiz. jutalék				
Alapítási költségek				
jegyzési jutalék, szerv.díj				
reklám, hirdetés				
felügyeleti díj				
bef. jegy nyomtatása				
Egyéb (forgalmazás)	215.135	215.135	232.433	232.433
Összesen:	64.382.014	58.726.207	55.591.782	49.949.883

Éves jelentés - OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap

Cash flow kimutatás		adatok ezer Ft-ban	
		2015.01.01- 2015.12.31.	2016.01.01- 2016.12.31.
I. Működési cash flow		-529.034	-337.483
1. Tárgyévi eredmény (kapott hozamok nélkül)		296.993	169.192
3. Elszámolt értékvesztés és visszairás		0	0
4. Elszámolt értékelési különbözet		-301.399	118.967
5. Céltartalékképzés és felhasználás különbözete		0	0
7. Értékpapír befektetések értékesítésének eredménye		-834.247	-533.773
8. Befektetett eszközök állományváltozása		0	0
9.1. Követelések változása		-667.609	27.159
9.2. Értékpapírok értékelési különbözetének változása		301.399	-118.967
10. Rövid lejáratú kötelezettségek állományváltozása		675.321	-449
11. Hosszú lejáratú kötelezettségek állományváltozása		0	0
12. Aktív időbeli elhatárolások állományváltozása		508	388
13. Passzív időbeli elhatárolások állományváltozása		0	0
Származtatott ügyletek állományváltozása		0	0
II. Befektetési tevékenységből származó pénzeszköz-változás		1.219.557	773.202
17. Értékpapírok beszerzése -		-12.396.750	-9.676.764
18. Értékpapírok eladása, beváltása +		13.596.039	10.425.907
19. Kapott hozamok +		20.268	24.059
III. Pénzügyi műveletekből származó pénzeszköz-változás		-797.690	-320.102
20. Befektetési jegy kibocsátás +		883.756	783.099
22. Befektetési jegy visszavásárlása -		-1.681.446	-1.103.201
23. Befektetési jegyek után fizetett hozamok -		0	0
IV. Pénzeszközök változása		-107.167	115.617
Pénzeszközök nyitó értéke		283.200	176.033
Pénzeszközök záró értéke		176.033	291.650

Megjegyzések:

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

Portfólió jelentés értékpapíralapra

Alapadatok:

Alap neve:	OTP Klímaváltozás 130/30 Származtatott Nyíltvégű Alap
Alap lajstromszáma:	1111-257
Alapkezelő neve:	OTP Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő neve:	OTP Bank Nyrt.
Nettó Eszközérték számítás típusa:	T

	Ft
Tárgynap (T):	2016.12.31
Saját tőke:	2.674.911.986
Egy jegyre jutó NEÉ:	0,97919
Darabszám:	2.731.760.619

A tárgynapi nettó eszközérték meghatározása:

I. KÖTELEZETTSÉGEK

	Futamidő	Összeg	%
I/1. Hitelállomány:		0	0,00
I/2. Egyéb kötelezettségek és elhatárolt költségek:		694.592	100,00
Alapkezelői díj		4.477	0,64
Letétkezelői díj		249	0,04
Bizományosi díj		0	0,00
Forgalmi ktg.		0	0,00
Közzétételi ktg.		0	0,00
Reklám ktg.		0	0,00
Költségként elszámolt egyéb tétel		916	0,13
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		688.950	99,19
I/3. Céltartalékok:		0	0,00
I/4. Egyéb passzív időbeli elhatárolás:		0	0,00
Kötelezettségek összesen:		694.592	100,00

II. ESZKÖZÖK

			Összeg	%
II/1. Folyószámla, készpénz (összes):			291.650	8,66
II/2. Egyéb követelés:			640.450	19,01
II/3. Lekötött bankbetétek (összes):	Bank	Futamidő	0	0,00
II/3.1. 3 hónapnál rövidebb lekötésű bankbetétek:			0	0,00
II/4. Értékpapírok (összes):	Devizanem	Névérték devizában	2.436.991	72,32
II/4.1. Állampapírok (összes):			80.449	2,39
II/4.1.1. Magyar államkötvények (összes):			71.581	2,13
2017/B államkötvény	HUF	63.970	71.581	2,13
II/4.1.2. Kincstárjegyek (összes):			8.868	0,26
D170524 diszkont kincstárjegy	HUF	8.870	8.868	0,26
II/4.3. Részvények (összes):			2.356.542	69,93
II/4.3.1. Tőzsdére bevezetett (összes):			30.829	0,92
MASTERPLAST részvény	HUF	6.154	30.829	0,92
II/4.3.2. Külföldi részvények (összes):			2.325.713	69,01
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC részvény	USD	4	62.711	1,86
COHERENT részvény	USD	16	63.751	1,89
COSAN LTD részvény	USD	285	62.948	1,87
EUROFINS SCIENTIFIC részvény	EUR	61	76.838	2,28
HD SUPPLY HOLDINGS INC részvény	USD	102	127.095	3,77
INTERSIL CORP részvény	USD	97	63.790	1,89
ITRON részvény	USD	3.410	62.943	1,87
KAPSCH részvény	EUR	8.595	99.724	2,96

Portfólió jelentés értékpapíralapra

MASTEC részvény	USD	1.132	127.165	3,77
MCDERMOTT INTL INC részvény	USD	29.230	63.440	1,88
MUELLER WATER PRODUCTS INC részvény	USD	326	127.356	3,78
NVIDIA CORP részvény	USD	4	122.259	3,63
OSRAM LICHT AG részvény	EUR	4.990	77.327	2,30
PACIFIC ETHANOL INC részvény	USD	46	128.399	3,81
POOL CORP részvény	USD	2	63.126	1,87
REX AMERICAN RESOURCES CORP részvény	USD	22	63.514	1,88
ROCKWOOL részvény	DKK	14.700	76.616	2,27
SIEMENS AG részvény	EUR	4.240	154.027	4,57
TORO CO részvény	USD	7.700	126.526	3,76
US SILICA HOLDINGS INC részvény	USD	77	127.511	3,78
VEECO INSTRUMENTS INC részvény	USD	75	64.208	1,91
VERBUND AG részvény	EUR	32.400	152.919	4,54
VESTAS részvény	DKK	4.745	91.104	2,70
WACKER CHEMIE AG részvény	EUR	2.500	76.861	2,28
XYLEM részvény	USD	4.370	63.555	1,89
II/5. Aktív időbeli elhatárolások (összes):			413	0,01
Eszközök összesen:			3.369.504	100,00

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

OTP ALAPKEZELŐ ZRT.

2.

Kelt:

BUDAPEST, 2017. március 31.

.....
az Alapkezelő vezetője