

**Az OTP Alapkezelő Zrt.
befektetési alapjainak
2023. I. féléves jelentése**

Tartalomjegyzék

A mögöttes tőkepiacok féléves teljesítménye	3
Az OTP befektetési alapok állandó adatai	5
Nyilvános, nyíltvégű alapok	6
OTP Tőzsdén Kereskedett BUX Indexkövető Alap.....	6
Nyilvános, zártvégű alapok	10
OTP Energiatrend Alap	11
OTP Megatrend Alap	15
OTP Megatrend II. Alap	19

A mögöttes tőkepiacok féléves teljesítménye

Hazai állampapírpiac

Jól indult az év a hazai állampapírpiacra, a hozamok január közepére minden futamidőn estek. Az Államadósság Kezelő Központ 5, 10 és 30 éves futamidőre összesen 4,25 milliárd dollár névértékű dollárkötvényt bocsátott ki. Az MNB megerősítette, hogy a 13%-os alapkamat és a 18%-os effektív kamat csökkentése a kockázati megítélés tartós, trendszerű javulásával lehetséges. Egy hó végi korrekció után a január egészében így is minden futamidőn erős hozamcsökkenés maradt. Február második felétől a hozamok a nemzetközi hatásoktól és a vártnál magasabb hazai inflációtól is húzva emelkedésbe váltottak és megközelítették az év eleji szinteket. A márciusi amerikai és európai bankpánik tovább tolta felfelé a rövidebb futamidejű papírok hozamát. Áprilisban aztán a hozamok éles fordulattal letörtek, miután a jegybank a 370-ig erősödő EURHUF árfolyam közelében megszűntette a kamatcsökkentési ciklus kezdetének gondolatát. A kisebb megingás után elfogadó piaci reakció mellett az MNB a kamatfolyosó felső korlátját 25%-ról 20,5%-ra vágta. A viszonylag eseménytelen május után júniusban a befektetési alapoknak kötelező diszkontkincstárjegy tartást előíró kormányrendelet új lökést adott a hozamcsökkenésnek, így a hosszú hozamok napok alatt a januári mélypontok közelébe, vagy azok alá csúsztak. Az MNB a várakozásoknak megfelelően 100 bázisponttal 16%-ra csökkentette az irányadó kamatát. Az éven túli lejáratú állampapírok MAX indexe az első félévben 14%-ot tudott emelkedni, míg az éven belüli lejáratok RMAX indexe 8,02%-ot növekedett.

Amerikai és európai állampapírpiacok

Az év kedvező hangulatban indult, a kötvények is jól teljesítettek. Január végére a megjelenő adatok alapján enyhült a recessziós hangulat. Februárban az USA-ban a Fed a várt 25 bázisponttal 4,75%-ra emelte az irányadó kamatot, Európában pedig az EKB 50 bázisponttal 3%-ra emelt. Márciusban a hozamemelkedést bankpiaci felfordulás fordította vissza. A kaliforniai Silvergate Bank hitelezési veszteségei miatt csődbe ment, majd a betétesek megrohanták az SVB bankot. A dominóhatás megfékezésére a betétbiztosítást az SVB és a Signature teljes betétállományára kiterjesztették, és a Fed BTFP néven fedezett likviditási kölcsönprogramot nyitott a bankok számára. Az Európára is áttérjedő hullámok a veszteségei miatt sérülékeny Credit Suisse-t érték el, ami végül a UBS-be olvadt. A kockázati felárak minden piacon megugrottak, a kockázatmentes hozamok mélyebbre zuhantak, miközben az irányadó kamatok az EKB 3,5%-ra, a Fed 5%-ra emelte. A márciusi bankpánik eseményei után az áprilisban mindössze néhány bázisponttal mozdultak el a hozamok zárószintjei, majd a május a nagy jegybankok üléseivel kezdődött. A Fed 25 bázisponttal 5% fölé emelte irányadó kamatát, az EKB pedig szintén 25 bázisponttal 3,25%-ra emelt kamat mellett hangsúlyozta az infláció letörésének célját. Júniusban az EKB újabb 25 bázisponttal 3,50%-ra emelte betéti kamatát. A Fed ugyan nem követte, de iránymutatásában jelezte, hogy még legalább két 25 bázispontos emelést tervez, így egyelőre koraiak a kamatvágási várakozások.

Hazai és közép-kelet-európai részvénytőkepiac

Az első félévben a régió részvénytőkepiacai erős teljesítményt mutattak, bár jelentős árfolyamingadozás mellett. A hazai BUX index 15,33%-kal emelkedett, míg saját devizában nézve a lengyel részvénytőkepiaci index, a WIG20 14,98%-kal, a cseh PX index pedig 6,11%-kal erősödött. A közép- európai régió indexkosara, a CETOP euróban mérve 16,11%-kal tudott növekedni az első hat hónapban. Forintban számolva a WIG20 12,34%-kal, a PX 0,03%-kal, a CETOP pedig 7,66%-kal drágult.

Globális feltörekvő részvénytőpiacok

Az év kedvezően indult a feltörekvő részvénytőpiacokon, januárban az MSCI EM index értéke dollárban számítva 7,90%-kal emelkedett. Azt követően azonban az inflációs pályával kapcsolatos aggodalmak, az emelkedő kötvénytőpiaci környezet és a kamatemelési várakozások csökkentették a kockázattővállalási hajlandóságot. A januári emelkedést így gyors korrekció követte, és a márciusi bankpánik hatását is megérezték a feltörekvő piacok. A második negyedévben kisebb mértékű visszaesést láttunk áprilisban és májusban, míg végül júniusban a kedvezővé váló globális környezet hatására ismét növekedésnek indultak az árfolyamok. Az első félév egészét tekintve az MSCI EM index dollárban mérve 4,89%-ot emelkedni tudott, de a forintban ez 4,40% visszaesést jelent.

Fejlett részvénytőpiacok

A fejlett részvénytőpiaci árfolyamok hasonló pályát jártak be, mint a feltörekvő piaci indexek. Erős évkezdést követően növekvő volatilitás mellett korrigáltak, majd a negyedév végére ismét emelkedésbe kezdtek. Ehhez hozzájárult az amerikai adósságtőplafonnal kapcsolatos politikai egyezés, így június első felében az amerikai részvénytőindexek már jelentősen nőni tudtak. A figyelem ugyanakkor fokozatosan visszafordult az inflációs pályára. A június elején publikált statisztikák visszaigazolták a munkaerőtőpiac feszességét és azt, hogy a szolgáltató szektorban tapasztalható inflációs nyomás nem fog könnyen megoldódni. Ennek nyomán a pénzpiacok fokozatosan kiárazták az idei évre korábban elképzelhetőnek gondolt kamattőcsökkentést a Fed részéről, és teret nyert a nézet, miszerint az irányadó kamatszint tartósan magas maradhat. A fejlett piacokat reprezentáló MSCI World index értéke dollárban számítva 15,09%-ot emelkedett az első félévben, ami forintban 4,89%-os növekedést jelent.

Az OTP befektetési alapok állandó adatai

1. Általános adatok

Az alapkezelő társaság	neve	OTP Alapkezelő Zrt.
	székhelye	1026 Budapest, Riadó utca 1-3.
A letétkezelő társaságok	neve	OTP Bank Nyrt.
	székhelye	1051 Budapest, Nádor u. 16.
	neve	UniCredit Bank Hungary Zrt.
	székhelye	1054 Budapest, Szabadság tér 5-6
A forgalmazó	neve	OTP Bank Nyrt.
	székhelye	1051 Budapest, Nádor u. 16.
A könyvvizsgáló	neve	Ernst & Young Könyvvizsgáló Kft.
	székhelye	1132 Budapest, Váci út 20.

2. Az OTP Alapkezelő Zrt. igazgatóságában és vezető állású személyi körében 2023. I. féléve során alábbi változások történtek:

- Kovács Antal György Úr Felügyelőbizottsági tagságáról és az elnöki tisztségéről 2023. május 24. napján lemondott
- Takács Domokos László Úr Felügyelőbizottsági tagságát az 1/2023. (05.24.) számú a Felügyelőbizottság elnöki tisztségét a 2/2023. (05.24.) számú Közgyűlési határozat szerint 2023. május 24. napjától látja el. Az MNB a kinevezéseket a 2023. napján **H-EN-III-256/2023.** számú határozatával előzetesen engedélyezte.

3. Az Alapkezelő személyi állománya

A Társaság 2023. június 30-án 63 fő munkavállalót foglalkoztatott. Az aktív állomány 60 fő, az inaktív állomány 3 fő. Az aktív állományból részmunkaidős 5 fő, inaktív állományból részmunkaidős 1 fő.

4. Az alapok hitelfelvételei

Az OTP Alapkezelő Zrt. által kezelt befektetési alapok 2023. első félévében nem vettek fel hitelt.

Nyilvános, nyíltvégű alapok

Beszámoló az I. félévről – 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)	havi változás (Ft)	egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	havi változás (Ft)
2022.12.30	2,346,660,052		1706.662	
2023.01.31	2,383,212,106	36,552,054	1765.342	58.680445
2023.02.28	2,352,305,778	-30,906,328	1742.449	-22.893577
2023.03.31	2,221,910,086	-130,395,692	1645.859	-96.589401
2023.04.28	2,353,998,128	132,088,042	1743.702	97.842994
2023.05.31	2,434,761,996	80,763,868	1837.556	93.853906
2023.06.30	2,548,762,833	114,000,837	1960.587	123.030572

A hivatalos nettó eszközérték számítás alapján a tárgyidőszak nyitó befektetési jegy állománya 1,375,000 db volt, mely a tárgyidőszak végén 1,300,000 db volt.

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

Az OTP Tőzsdén Kereskedett BUX Indexkövető Alap (BUX ETF) egy tőzsdén kereskedett alap, amelynek befektetési stratégiája, hogy minél jobban leképezze a BUX Index összetételét és kövesse teljesítményét. A beszámolási időszakban ez sikeres volt, ugyanis az alap alacsony követési hibával a BUX hozamát megközelítő teljesítményt ért el. Az alap vagyona az első félévben az év eleji 2,3 milliárdról 2,5 milliárd Ft-ra nőtt.

3. Vagyonkimutatás

BUX ETF Alap

Vagyonelem, ill. értékpapír fajta		időszak nyitó állománya		Megoszlás (%) *	időszak záró állománya		Megoszlás (%) *
		2022.12.31			2023.06.30		
adatok ezer Ft-ban							
Készpénzállomány- banki egyenlegek							
Bank	lekövetési idő						
OTP Bank Nyrt. HUF	Folyószámla		4,640	0.20%	85	0.00%	
Banki egyenlegek összesen:			4,640	0.20%	85	0.00%	
Átruházható értékpapírok							
Megnevezés	Futamidő		tőzsdei értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír	tőzsdei értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír	
Diszkontkincstárjegy / kamatozó kincstárjegy							
D230712	2023.04.12	- 2023.07.12	0	0	10,365	0	0.41%
D240124	2023.06.21	- 2024.01.24	0	0	2,609	0	0.10%
D240626	2023.06.28	- 2024.06.26	0	0	452	0	0.02%
Diszkont/kamatozó kincstárjegy összesen:			0	0	13,426	0	0.53%
Részvények							
4IG NYRT.			25,591	0	22,254	0	0.87%
AKKO INVEST			3,566	0	2,618	0	0.10%
ALTEO			15,517	0	12,274	0	0.48%
ANY BIZTONSÁGI NYOMDA NYRT			13,596	0	14,948	0	0.59%
AUTOWALLIS NYRT.			10,028	0	9,402	0	0.37%
CIG PANNÓNIA			7,483	0	7,656	0	0.30%
DELTA TECHNOLOGIES			0	0	4,645	0	0.18%
GRAPHISOFT PARK SE			14,852	0	13,633	0	0.53%
MAGYAR TELEKOM			98,428	0	87,452	0	3.43%
MASTERPLAST			14,546	0	8,566	0	0.34%
MOL RT			588,546	0	670,695	0	26.31%
OPUS			27,917	0	35,673	0	1.40%
OTP TÖRZS (100)			876,628	0	956,778	0	37.54%
PANNERGY			11,585	0	7,110	0	0.28%
RICHTER - 100			576,477	0	614,517	0	24.11%
WABERER'S INTERNATIONAL ZRT			7,530	0	4,853	0	0.19%
ZWACK RT. TÖRZS			0	0	5,393	0	0.21%
Részvény összesen:			2,292,290	0	2,478,468	0	97.24%
Átruházható értékpapírok összesen:			2,292,290	0	2,491,895	0	97.77%
Egyéb eszközök							
Követelések			52,311	2.23%	70,402	2.76%	
Aktív időbeli elhatárolások			0	0.00%	0	0.00%	
Származtatott ügyletek értékelési különbözete			0	0.00%	0	0.00%	
Egyéb eszközök összesen:			52,311	2.23%	70,402	2.76%	
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:			2,349,241	100.11%	2,562,382	100.53%	
Kötelezettségek			-2,664	-0.11%	-13,619	-0.53%	
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:			2,346,577	100.00%	2,548,763	100.00%	

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

	2022.12.31	Megjegyzés	Megoszlás (%) *	2023.06.30	Megjegyzés	Megoszlás (%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	2,292,290		97.69%	2,491,895		97.77%
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%	13,426		0.53%
d) egyéb átruházható értékpapírok:	0		0.00%	0		0.00%
e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok:	0		0.00%	13,426	DKJ	0.53%
*A Nettó Eszközérték százalékos arányában						

4. Mérleg

OTP Tőzsdén Kereskedett BUX Indexkövető Alap

Mérleg

adatok ezer Ft-ban

	A tétel megnevezése	Előző év 2022. december 31.	Tárgyév 2023. június 30.
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	2,349,241	2,539,586
09.	I. Követelések	52,311	54,640
10.	1. Követelések	49,365	54,640
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	2,946	0
14.	II. Értékpapírok	2,292,290	2,484,228
15.	1. Értékpapírok	2,289,807	2,252,733
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	2,483	231,495
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	0
18.	b) egyéb piaci megítélésből	2,483	231,495
19.	III. Pénzeszközök	4,640	718
20.	1. Pénzeszközök	4,640	718
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	0	251
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	0	251
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származtatott ügyletek értékelési különbözete	0	0
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	2,349,241	2,539,837
27.	E. Saját tőke	2,346,577	2,489,569
28.	I. Induló tőke	1,375,000	1,275,000
29.	1. Kibocsájtott befektetési jegyek névértéke	8,950,000	8,950,000
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	-7,575,000	-7,675,000
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	971,577	1,214,569
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönözete	-687,711	-773,088
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönözete	316,715	316,715
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	5,429	231,495
35.	3. Előző évek(ek) eredménye	1,259,320	1,337,144
36.	4. Üzleti év eredménye	77,824	102,303
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	2,664	50,268
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	2,664	50,268
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	2,349,241	2,539,837

5. Eredménykimutatás

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

	A tétel megnevezése	Előző év 2022.01.01-2022.12.31.	Tárgy félév 2023.01.01-2023.06.30.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei	179,680	131,286
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai	85,880	20,973
03.	III. Egyéb bevételek	0	0
04.	IV. Működési költségek	14,844	7,412
05.	V. Egyéb ráfordítások	1,132	598
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok	0	0
07.	VII. Tárgyévi eredmény	77,824	102,303

Nyilvános, zártvégű alapok

Kibocsátói nyilatkozat

Az OTP Alapkezelő Zrt. a 24/2008 (VIII.15.) PM Rendelet (a továbbiakban: Rendelet) 1. paragrafusa értelmében az általa létrehozott és kezelt nyilvános, zártvégű befektetési alapok tekintetében az alábbi nyilatkozatot teszi:

Az OTP Alapkezelő a Rendelet 2. melléklet 2.3.2. pontja alapján kijelenti, hogy az alapok féléves beszámolóját független könyvvizsgáló nem vizsgálta. A Rendelet 2. melléklet 2.4. pontja alapján kijelenti továbbá, hogy az alkalmazható számviteli előírások alapján az alapok féléves beszámolója valós és megbízható képet ad a kibocsátó eszközeiről, kötelezettségeiről, pénzügyi helyzetéről, valamint nyereségéről és veszteségéről, továbbá az alapok vezetőségi jelentése megbízható képet ad a kibocsátó helyzetéről, fejlődéséről és teljesítményéről, ismerteti a pénzügyi év hátralévő hat hónapját érintő főbb kockázatokat és bizonytalansági tényezőket.

Jelen nyilatkozatot az OTP Alapkezelő az általa kezelt nyilvános, zártvégű alapok féléves jelentéséhez kapcsolódóan adta ki.

Budapest, 2023. augusztus

Beszámoló az I. félévről – OTP Energiatrend Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2023. januártól 2026. február 20-ig

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

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	havi változás (Ft)	egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	havi változás (Ft)
2023.02.28	3,391,110,976		10013.88	
2023.03.31	3,359,673,323	-31,437,653	9921.047	-92.834752
2023.04.28	3,320,181,246	-39,492,077	9804.428	-116.619301
2023.05.31	3,290,461,458	-29,719,788	9716.666	-87.761931
2023.06.30	3,341,287,578	50,826,120	9866.754	150.088501

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023. június 30-án 338,641 db volt, amely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az Alap zártvégű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az Alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

2. Vezetőségi jelentés:

Az alap eszközeinek döntő része kamatozó eszközökbe kerül befektetésre, amelyek biztosítják a tőke és a rögzített hozam megővését. Az alap hozamát a mögöttes befektetés, azaz a Solactive European Green Deal Selection AR5% Indexre kiírt opció futamidő alatt elért teljesítménye határozza meg. Az index 43 olyan – főként európai – nagyvállalat részvényeiből összeállított kosár, amelyek az energiaátálláshoz kapcsolódó tevékenységet végeznek.

A mérleg lezárása után lényeges esemény az Alap tárgyévi gazdálkodásával kapcsolatban nem került felszínre. A beszámoló időszakában az Alap nem fizetett hozamot.

3. Vagyongkimutatás:

OTP Energiatrend Hozamvédett Zártvégű Alap

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill. értékpapír fajta	időszak nyitó állománya 2022.12.31		Megoszlás (%) *	időszak záró állománya 2023.06.30		Megoszlás (%) *
Készpénzállomány- banki egyenlegek						
Bank	lekötési idő					
OTP Bank Nyrt. HUF	Folyószámla		0	0.00%	30	0.00%
Országos Takarékpénztár és Kereskedelmi Bank Nyrt. HUF	2023.03.20	- 2026.02.20	0	0.00%	2,170,658	64.96%
Banki egyenlegek összesen:			0	0.00%	2,170,689	64.97%
Átruházható értékpapírok						
Megnevezés	Futamidő		tőzsdei értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír	tőzsdei értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír
Államkötvények						
A260422E20	2020.09.02	- 2026.04.22	0	0	429,049	0
A261021H23	2023.01.18	- 2026.10.21	0	0	532,227	0
Államkötvény összesen:			0	0	961,276	0
Átruházható értékpapírok összesen:			0	0	961,276	0
Egyéb eszközök						
Követelések			0	0.00%	39,911	1.19%
Aktív időbeli elhatárolások			0	0.00%	0	0.00%
Származtatott ügyletek értékelési különbözete			0	0.00%	175,077	5.24%
Egyéb eszközök összesen:			0	0.00%	214,989	6.43%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:			0	0.00%	3,346,954	100.17%
Kötelezettségek			0	0.00%	-5,666	-0.17%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:			0	0.00%	3,341,288	100.00%

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

	2022.12.31	Megjegyzés	Megoszlás (%) *	2023.06.30	Megjegyzés	Megoszlás (%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	0		0.00%	961,276		28.77%
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%	961,276	Államkötvény	28.77%

*A Nettó Eszközérték százalékos arányában

4. Mérleg

OTP Energiatrend Hozamvédett Zártvégű Alap

Mérleg

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Előző év (indulás) 2023. február 22.	Tárgyév 2023. június 30.
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	3,386,410	3,101,213
09.	I. Követelések	0	0
10.	1. Követelések	0	0
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	0	0
14.	II. Értékpapírok	0	961,276
15.	1. Értékpapírok	0	884,868
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	0	76,408
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	22,683
18.	b) egyéb piaci megítélésből	0	53,725
19.	III. Pénzeszközök	3,386,410	2,139,937
20.	1. Pénzeszközök	3,386,410	2,139,937
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	0	72,356
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	0	72,356
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származtatott ügyletek értékelési különbözete	0	175,077
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	3,386,410	3,348,646
27.	E. Saját tőke	3,386,410	3,343,416
28.	I. Induló tőke	3,386,410	3,386,410
29.	1. Kibocsájtott befektetési jegyek névértéke	3,386,410	3,386,410
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	0	0
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	0	-42,994
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	0	0
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	0	0
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	0	251,485
35.	3. Előző évek(ek) eredménye	0	0
36.	4. Üzleti év eredménye	0	-294,479
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	0	5,230
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	0	5,230
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	3,386,410	3,348,646

5. Eredménykimutatás

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Tárgy félév 2023.02.22-2023.06.30.	
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei		97,043
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai		372,505
03.	III. Egyéb bevételek		0
04.	IV. Működési költségek		18,429
05.	V. Egyéb ráfordítások		588
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok		0
07.	VII. Tárgyévi eredmény		-294,479

Beszámoló az I. félévről – OTP Megatrend Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2023. januártól 2028. február 18-ig

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

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	havi változás (Ft)	egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	havi változás (Ft)
2023.02.28	1,267,432,662		10013.77	
2023.03.31	1,209,606,576	-57,826,086	9556.894	-456.874005
2023.04.28	1,240,542,575	30,935,999	9801.315	244.420031
2023.05.31	1,233,108,759	-7,433,816	9742.581	-58.733307
2023.06.30	1,256,536,531	23,427,772	9927.68	185.098816

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023. június 30-án 126 569 db volt, amely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az Alap zártvégű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az Alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

2. Vezetőségi jelentés:

Az alap eszközeinek döntő része kamatozó eszközökbe kerül befektetésre, amelyek biztosítják a tőke és a rögzített hozam megóvását. Az alap hozamát az MSCI World IMI Select Food Industry & Innovation 5% Decrement Indexre kiírt opció futamidő alatt elért teljesítménye határozza meg. Az index olyan nagyvállalatok részvényeiből összeállított kosár, amelyek az élelmiszeripari technológiai átálláshoz kapcsolódó tevékenységet végeznek. A kiválasztott vállalatok mezőgazdasági, élelmiszer feldolgozó és kereskedelmi, valamint agrár- és élelmiszeripari gépgyártást végeznek.

A mérleg lezárása után lényeges esemény az Alap tárgyévi gazdálkodásával kapcsolatban nem került felszínre. A beszámoló időszakában az Alap nem fizetett hozamot.

3. Vagyonkimutatás:

OTP Megatrend Hozamvédett Zártvégű Alap

Vagyonelem, ill. értékpapír fajta		időszak nyitó állománya		Megoszlás (%) *	időszak záró állománya		Megoszlás (%) *
		2022.12.31			2023.06.30		
adatok ezer Ft-ban							
Készpénzállomány- banki egyenlegek							
Bank							
	lekövetési idő						
OTP Bank Nyrt. HUF	Folyószámla			0	0.00%	8	0.00%
Országos Takarékpénztár és Kereskedelmi Bank Nyrt. HUF	2023.03.17 - 2028.02.17			0		412,941	32.86%
Banki egyenlegek összesen:				0	0.00%	412,949	32.86%
Átruházható értékpapírok							
Megnevezés	Futamidő	tőzsdei értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír			tőzsdei értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír
Államkötvények							
A280323B22	2022.01.19 - 2028.03.23	0	0	0.00%		89,011	7.08%
A281022A11	2011.03.02 - 2028.10.22	0	0	0.00%		249,624	19.87%
Államkötvény összesen:		0	0	0.00%		338,635	26.95%
Diszkontkincstárjegy / kamatozó kincstárjegy							
D230726	2022.12.14 - 2023.07.26	0	0			496	0.04%
Diszkont/kamatozó kincstárjegy összesen:		0	0	0.00%		496	0.04%
Egyéb kötvények							
MAEXIM FLOAT 15.82 03/01/2028	2023.03.01 - 2028.03.01	0	0	0.00%		403,269	32.09%
Egyéb kötvény összesen:		0	0	0.00%		403,269	32.09%
Átruházható értékpapírok összesen:		0	0	0.00%		742,401	59.08%
Egyéb eszközök							
Követelések							
Követelések		0	0	0.00%		0	0.00%
Aktív időbeli elhatárolások		0	0	0.00%		0	0.00%
Származtatott ügyletek értékelési különbözete		0	0	0.00%		103,581	8.24%
Egyéb eszközök összesen:		0	0	0.00%		103,581	8.24%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:		0	0	0.00%		1,258,931	100.19%
Kötelezettségek							
		0	0	0.00%		-2,395	-0.19%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:		0	0	0.00%		1,256,537	100.00%

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

	2022.12.31	Megjegyzés	Megoszlás (%) *	2023.06.30	Megjegyzés	Megoszlás (%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	0		0.00%	742,401		59.08%
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%	496	DKJ	0.04%
d) egyéb átruházható értékpapírok:	0		0.00%	0		0.00%
e) hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok:	0		0.00%	742,401	Államkötvény, DKJ, Egyéb Kötv.	59.08%
*A Nettó Eszközérték százalékos arányában						

4. Mérleg

OTP Megatrend Hozamvédeett Zártvégű Alap

Mérleg

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Előző év (indulás) 2023. február 22.	Tárgyév 2023. június 30.
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	1,265,690	1,142,404
09.	I. Követelések	0	0
10.	1. Követelések	0	0
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	0	0
14.	II. Értékpapírok	0	742,401
15.	1. Értékpapírok	0	682,461
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	0	59,940
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	33,979
18.	b) egyéb piaci megítélésből	0	25,961
19.	III. Pénzeszközök	1,265,690	400,003
20.	1. Pénzeszközök	1,265,690	400,003
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	0	13,246
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	0	13,246
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származtatott ügyletek értékelési különbözete	0	104,227
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	1,265,690	1,259,877
27.	E. Saját tőke	1,265,690	1,254,647
28.	I. Induló tőke	1,265,690	1,265,690
29.	1. Kibocsájtott befektetési jegyek névértéke	1,265,690	1,265,690
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	0	0
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	0	-11,043
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	0	0
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	0	0
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	0	164,167
35.	3. Előző évek(ek) eredménye	0	0
36.	4. Üzleti év eredménye	0	-175,210
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	0	5,230
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	0	5,230
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	1,265,690	1,259,877

5. Eredménykimutatás

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

	A tétel megnevezése		Tárgy félév 2023.02.22-2023.06.30.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei		14,797
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai		179,609
03.	III. Egyéb bevételek		0
04.	IV. Működési költségek		9,917
05.	V. Egyéb ráfordítások		481
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok		0
07.	VII. Tárgyévi eredmény		-175,210

Beszámoló az I. félévről – OTP Megatrend II. Alap

1. Általános adatok:

Az alap típusa: nyilvános, zártvégű értékpapír-befektetési alap

Az alap futamideje: 2023. májustól 2025. október 31-ig

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

Dátum	nettó eszközérték (Ft)	havi változás (Ft)	egy jegyre jutó NEÉ (Ft)	havi változás (Ft)
2023.06.30	9,502,386,778		9999.986	

A forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2023. június 30-án 650,240 db volt, amely megegyezik a tárgyidőszaki nyitóállománnyal. Az Alap zártvégű jellegéből adódóan a jegyzési időszak lezárultával új befektetési jegyek nem kerültek forgalomba. Az Alap befektetési jegyei bevezetésre kerültek a Budapesti Értéktőzsde kereskedési rendszerébe.

2. Vezetőségi jelentés:

Az alap eszközeinek döntő része kamatozó eszközökbe kerül befektetésre, amelyek biztosítják a tőke és a rögzített hozam megóvását. Az alap hozamát a mögöttes befektetés, azaz a Solactive Global Artificial Intelligence ESG Net Return 11% VT 3% AR Indexre kiírt opció futamidő alatt elért teljesítménye határozza meg. Az index 26 olyan nagyvállalat részvényeiből összeállított kosár, amelyek a mesterséges intelligenciák fejlesztéséhez és alkalmazásához kínálnak hardver és szoftver megoldásokat.

A mérleg lezárása után lényeges esemény az Alap tárgyévi gazdálkodásával kapcsolatban nem került felszínre. A beszámoló időszakában az Alap nem fizetett hozamot.

3. Vagyongkimutatás:

OTP Megatrend II. Hozamvédett Zártvégű Alap

adatok ezer Ft-ban

Vagyonelem, ill. értékpapír fajta		időszak nyitó állománya 2022.12.31		Megosztás (%) *	időszak záró állománya 2023.06.30		Megosztás (%) *
Készpénzállomány- banki egyenlegek							
Bank		leköttési idő					
	OTP Bank Nyrt. HUF		Folyószámla	0	0.00%	9,502,400	100.00%
Banki egyenlegek összesen:				0	0.00%	9,502,400	100.00%
Átruházható értékpapírok							
	Megnevezés	Futamidő	tőzsdéi értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír		tőzsdéi értékpapír	tőzsdén kívüli értékpapír
Átruházható értékpapírok összesen:			0	0	0.00%	0	0
Egyéb eszközök							
Követelések			0	0.00%		0	0.00%
Aktív időbeli elhatárolások			0	0.00%		0	0.00%
Származtatott ügyletek értékelési különbözete			0	0.00%		0	0.00%
Egyéb eszközök összesen:			0	0.00%		0	0.00%
ESZKÖZÖK MINDÖSSZESEN:			0	0.00%		9,502,400	100.00%
Kötelezettségek			0	0.00%		-13	0.00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK:			0	0.00%		9,502,387	0.00%

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

	2022.12.31	Megjegyzés	Megosztás (%) *	2023.06.30	Megjegyzés	Megosztás (%) *
a) tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok:	0		0.00%	0		0.00%
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%
*A Nettó Eszközérték százalékos arányában						

4. Mérleg

Mérleg

adatok ezer Ft-ban

A tétel megnevezése		Előző év (indulás) 2023. június 29.	Tárgyév 2023. június 30.
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	9,502,400	9,502,398
09.	I. Követelések	0	0
10.	1. Követelések	0	0
11.	2. Követelések értékvesztése (-)	0	0
12.	3. Külföldi pénzürtékre szóló követelések értékelési különbözete	0	0
13.	4. Forintkövetelések értékelési különbözete	0	0
14.	II. Értékpapírok	0	0
15.	1. Értékpapírok	0	0
16.	2. Értékpapírok értékelési különbözete	0	0
17.	a) kamatokból, osztalékból	0	0
18.	b) egyéb piaci megítélésből	0	0
19.	III. Pénzeszközök	9,502,400	9,502,398
20.	1. Pénzeszközök	9,502,400	9,502,398
21.	2. Valuta, devizabetét értékelési különbözete	0	0
22.	C. Aktív időbeli elhatárolások	0	2,676
23.	1. Aktív időbeli elhatárolás	0	2,676
24.	2. Aktív időbeli elhatárolások értékvesztése (-)	0	0
25.	D. Származtatott ügyletek értékelési különbözete	0	0
26.	ESZKÖZÖK (AKTÍVÁK) ÖSSZESEN:	9,502,400	9,505,074
27.	E. Saját tőke	9,502,400	9,505,074
28.	I. Induló tőke	9,502,400	9,502,400
29.	1. Kibocsájtott befektetési jegyek névértéke	9,502,400	9,502,400
30.	2. Visszavásárolt befektetési jegyek névértéke (-)	0	0
31.	II. Tőkeváltozás (tőkenövekmény)	0	2,674
32.	1.a) Visszavásárolt befektetési jegyek bevonási értékkülönbözete	0	0
33.	1.b) Eladott befektetési jegyek értékkülönbözete	0	0
34.	2. Értékelési különbözet tartaléka	0	0
35.	3. Előző évek(ek) eredménye	0	0
36.	4. Üzleti év eredménye	0	2,674
37.	F. Céltartalékok	0	0
38.	G. Kötelezettségek	0	0
39.	I. Hosszú lejáratú kötelezettségek	0	0
40.	II. Rövid lejáratú kötelezettségek	0	0
41.	III. Külföldi pénzürtékre szóló kötelezettségek értékelési különbözete	0	0
42.	H. Passzív időbeli elhatárolások	0	0
43.	FORRÁSOK (PASSZÍVÁK) ÖSSZESEN:	9,502,400	9,505,074

5. Eredménykimutatás

Eredménykimutatás

adatok ezer Ft-ban

	A tétel megnevezése		Tárgy félév 2023.06.29-2023.06.30.
a.	b.	c.	d.
01.	I. Pénzügyi műveletek bevételei		2,677
02.	II. Pénzügyi műveletek ráfordításai		0
03.	III. Egyéb bevételek		0
04.	IV. Működési költségek		3
05.	V. Egyéb ráfordítások		0
06.	VI. Fizetett, fizetendő hozamok		0
07.	VII. Tárgyévi eredmény		2,674