

# OTP CETOP ETF Alap

## Az alap bemutatása (A sorozat)

|                   |                                |
|-------------------|--------------------------------|
| Az alap neve:     | OTP CETOP ETF Alap             |
| Fajtája,típusa:   | nyilvános, nyíltvégű, részvény |
| Alapkezelő neve:  | OTP Alapkezelő Zrt.            |
| Az alap indulása: | 2024.04.08.                    |
| Referenciaindex:  | 100% CETOP NTR                 |
| ISIN:             | HU0000734454                   |

## Az alap kezelői

|                                                                                   |                                                                                     |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |
| Kovács-Kvotidián Máté,<br>CFA<br>Portfólió menedzser                              | Csáti Olivér<br>Portfólió menedzser                                                 |

## Befektetési politika

Az alap összetétele a Budapesti Értéktőzsde CETOP NTR indexének összetételét képezi le, azaz a térség hét országának 25 legnagyobb forgalmú részvényéből válogat. Az indexben, és így az alapban is magyar, cseh, szlovák, lengyel, horvát, román és a szlovén tőzsdén jegyzett blue chip-ek kaphatnak helyet. A követett CETOP NTR index az egyes vállalatok és országok súlyainak meghatározásán keresztül biztosítja a széles körű és arányos lefedettséget a befektetés célpiacai között.

## Havi aktualitások

### Makrokörnyezet:

Az alap benchmark indexe 2,3%-os euróban kifejezett emelkedéssel zárta a novembert. A cseh piac leginkább a pénzügyi szektornak köszönhetően remekelt. A magyar piac volt a régió második legjobb szereplője, amelyet a legnagyobb magyar bank húzott. Előbbi piac 4,4%-ot, utóbbi pedig 2,0%-ot emelkedett saját devizájában. A többi ország papírjai is emelkedni tudtak, azonban ennél kisebb mértékben. Különösen rosszul szerepeltek az iparhoz, illetve a nem alapvető fogyasztási cikkekhez kapcsolt cégek részvényei. Szektorokat tekintve a pénzügy és a nyersanyag remekelt (+5,3%, illetve +4,0%). A legnagyobb esést az ipar és a diszkracionális fogyasztói szektor szenvedte el (-6,1%, illetve -4,8%). Az EKB továbbra is 2,00%-on, az MNB pedig 6,50%-on tartja a kamatszintet. A lengyel jegybank a várakozásoknak megfelelően a november eleji ülésen 4,50%-ról 4,25%-ra vágott, a decemberi ülésen pedig már 4,00% lehet az irányadó kamatszint. A forint továbbra is erős az euróval és a dollárral szemben is.

### Változások az alapban:

November folyamán az OMV Petrom, a Moneta Bank, valamint a Banca Transilvania is fizetett osztalékot. A hónap legjobb egyedi szereplői közt az alábbiakat említhetjük: KGHM (+9,2%), VIG (+8,4%) és Moneta Bank (+8,3%). Legrosszabbul a Dino Polska szerepelt (-7,4%). Az alap 99,80%-os részvénysúllyal zárta a hónapot.

## Vagyon és árfolyam

|                   | Deviza | Összeg     |
|-------------------|--------|------------|
| Nettó eszközérték | EUR    | 86 402 333 |
| Árfolyam*         | EUR    | 15,709515  |

\*Egy jegyre jutó nettó eszközérték.

## Az alap kockázati besorolása:



Ajánlott befektetési időtáv: 5 év

## Visszatekintő teljesítmény (hó utolsó munkanapjára)

| Évesített hozamok* | 1 év   | 3 év | 5 év | 10 év | Indulástól |
|--------------------|--------|------|------|-------|------------|
| Alap               | 51,32% | n.a  | n.a  | n.a   | 30,76%     |
| Benchmark          | 52,04% | n.a  | n.a  | n.a   | 31,50%     |
| Különbség          | -0,72% | n.a  | n.a  | n.a   | -0,74%     |

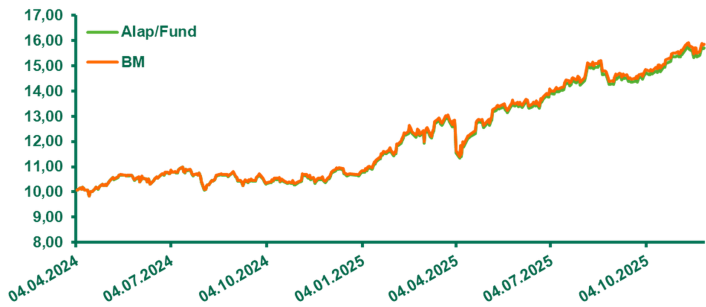
\*Nettó eszközértéken alapuló nettó hozamok, az 1 évnél hosszabb időtávokon évesített hozamok (a kamatos kamatszámítás módszerével tört kitevővel, 365 napos éves bázison számolt adatok).

## Az alapra vonatkozó releváns kockázati mutatók

| Kockázati mutatók    | 1 év    | 3 év | 5 év | 10 év | Indulástól |
|----------------------|---------|------|------|-------|------------|
| Szórás               | 17,33%  | n.a  | n.a  | n.a   | 15,73%     |
| Követési hiba        | 0,49%   | n.a  | n.a  | n.a   | 0,48%      |
| Információs hányados | -1,45   | n.a  | n.a  | n.a   | -1,55      |
| Béta                 | 1,0014  | n.a  | n.a  | n.a   | 0,9997     |
| Alfa                 | -0,79%  | n.a  | n.a  | n.a   | -0,73%     |
| Max. visszaesés      | -12,56% | n.a  | n.a  | n.a   | -12,56%    |

# OTP CETOP ETF Alap

## Az alap árfolyamának alakulása



A grafikon az alap indulásától a tárgyító utolsó munkanapjáig terjedő időszakot mutatja.

## Nettó összesített kockázati kitettség\*

|         |
|---------|
| 100,06% |
|---------|

\*Kockázattávallási mutató, amely figyelembe veszi a tőkeáttétel (pl. származtatott ügyletek) által hordozott kockázatot is. A 100-nál magasabb érték tőkeáttétel alkalmazására utal, azaz az alap árfolyama a piact meghaladó mértékben is változhat.

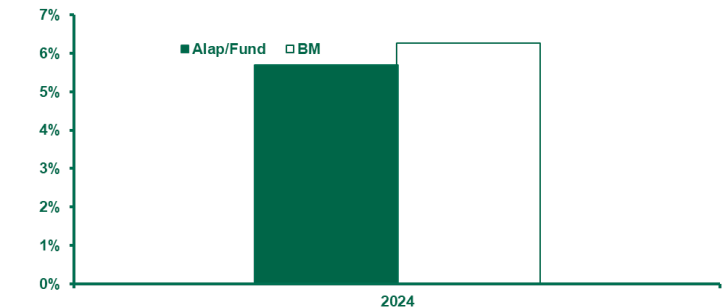
## Deviza összetétel

| Deviza         | Arány  |
|----------------|--------|
| lengyel zlotyi | 40,51% |
| euró           | 19,71% |
| forint         | 17,75% |
| cseh korona    | 11,19% |
| új román lej   | 10,84% |

## Ország összetétel

| Ország        | Arány  |
|---------------|--------|
| Lengyelország | 40,51% |
| Magyarország  | 17,75% |
| Ausztria      | 12,71% |
| Csehország    | 11,17% |
| Románia       | 10,71% |
| Szlovénia     | 5,92%  |
| Horvátország  | 1,09%  |
| készpénz      | 0,15%  |

## Az elmúlt naptári évek teljesítménye



## 10%-ot meghaladó eszközök

OTP TÖRZS (100)  
ERSTE BANK STAMM

## Eszköz összetétel

| Eszköz                  | Arány |
|-------------------------|-------|
| Betétek                 | 0,0%  |
| Diszkont kincstárjegyek | 0,0%  |
| Államkötvények          | 0,0%  |
| Jelzáloglevelek         | 0,0%  |
| Egyéb kötvények         | 0,0%  |
| Részvények              | 99,9% |
| Befektetési jegyek      | 0,0%  |
| Egyéb                   | 0,1%  |

## Iparági összetétel

| Iparág                           | Arány  |
|----------------------------------|--------|
| pénzügy                          | 55,06% |
| energia                          | 15,26% |
| közmű                            | 8,24%  |
| egészségügy                      | 6,45%  |
| nyersanyag                       | 4,53%  |
| diszkracionális fogyasztási cikk | 4,53%  |
| alapvető fogyasztási cikk        | 3,66%  |
| kommunikáció                     | 2,11%  |
| készpénz                         | 0,15%  |

## OTP CETOP ETF Alap

### TOP 10 Instrumentum

| Instrument            | Weight |
|-----------------------|--------|
| ERSTE BANK STAMM      | 11,24% |
| OTP BANK PLC          | 10,76% |
| PKO BANK              | 8,15%  |
| PKN                   | 7,93%  |
| CEZ                   | 6,44%  |
| PZU SA - 0.1          | 6,25%  |
| PEKAO                 | 5,45%  |
| KGHM                  | 4,53%  |
| ALLEGRO.EU SA         | 4,53%  |
| BANCA TRANSILVANIA SA | 3,93%  |

### Forgalmazás

|                   |                |
|-------------------|----------------|
| Vezető Forgalmazó | OTP Bank Nyrt. |
|-------------------|----------------|

### Jogi nyilatkozat

A dokumentum marketingközlemény. Az alapok múltbeli teljesítménye nem nyújt garanciát a jövőbeli hozamok nagyságára. A visszatekintő hozamok, kockázati mutatók, a nettó eszközérték, az árfolyam és a portfólió összetétel számítása a hónap utolsó munkanapjára történik. A múltbeli hozam adatok forrása: Bloomberg (benchmark), illetve OTP Bank Nyrt. (alapok). Jelen kiadvány nem minősül ajánlattételnek, vagy befektetési tanácsadásnak. Az alap befektetési politikájáról és a befektetés lehetséges kockázatairól részletesen tájékozódjon az alap forgalmazási helyein található kiemelt információkat tartalmazó dokumentumból, hivatalos tájékoztatójából és kezelési szabályzatából. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők. Honlapunk: [otpalap.hu](http://otpalap.hu)