

SA: OTP Asset Management Romania SAI SA

 Decizie autorizare: PJR05SAIR/400023 Cod inscriere: J4015502/15.08.2007
 CUI: 22264941 Inregistrare ONRC: J4015502/15.08.2007
 Capital social: 5.795.323 RON Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

OTP Obligatiuni

 Decizie autorizare: 375/27.02.2008
 Cod inscriere: CSC06FDIR/400048

Situația activelor și obligatiilor în perioada 31.12.2012 - 30.06.2013

Denumire element	Începutul perioadei de raportare				Sfârșitul perioadei de raportare				Diferența (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.11%	100.00%	33,787,887.62	33,787,887.62	100.11%	100.00%	53,813,635.88	53,813,635.88	20,025,748.26
1 Valori mobiliare și instrumente ale pieței monetare:	44.08%	44.03%	14,876,834.50	14,876,834.50	46.33%	46.28%	24,905,224.82	24,905,224.82	10,028,390.32
11 Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din România:	10.24%	10.23%	3,457,596.34	3,457,596.34	8.39%	8.38%	4,508,149.83	4,508,149.83	1,050,553.49
113 Obligațiuni, din care:	10.24%	10.23%	3,457,596.34	3,457,596.34	8.39%	8.38%	4,508,149.83	4,508,149.83	1,050,553.49
1131 Obligațiuni corporative cotate	3.42%	3.42%	1,154,763.00	1,154,763.00	6.97%	6.96%	3,746,714.07	3,746,714.07	2,591,951.07
1132 Obligațiuni emise de administrația publică centrală	6.22%	6.22%	2,100,150.21	2,100,150.21	1.07%	1.07%	574,786.35	574,786.35	-1,525,363.86
1133 Obligațiuni cotate emise de autoritatea administrativă publică locală	0.60%	0.60%	202,683.13	202,683.13	0.35%	0.35%	186,649.41	186,649.41	-16,033.72
12 Valori mobiliare și instrumente ale pieței monetare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată dintr-un stat membru, din care:	33.83%	33.80%	11,419,238.16	11,419,238.16	37.94%	37.90%	20,397,075.00	20,397,075.00	8,977,836.83
123 Obligațiuni	33.83%	33.80%	11,419,238.16	11,419,238.16	37.94%	37.90%	20,397,075.00	20,397,075.00	8,977,836.83
1231 Obligațiuni tranzacționate corporative	20.87%	20.85%	7,044,970.98	7,044,970.98	27.37%	27.34%	14,711,134.36	14,711,134.36	7,666,163.38
1232 Obligațiuni emise de administrația publică locală denumite în valută	0.85%	0.84%	217,841.52	217,841.52	0.40%	0.40%	216,318.73	216,318.73	-1,522.79
1233 Obligațiuni emise de administrația publică centrală	12.31%	12.30%	4,156,425.67	4,156,425.67	10.17%	10.16%	5,469,621.91	5,469,621.91	1,313,196.25
2 Disponibil în cont curent	1.46%	1.46%	493,635.55	493,635.55	0.71%	0.71%	383,403.82	383,403.82	-110,231.73
201 ALPHA BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	95.68	95.68	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-95.68
202 BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	130.83	130.83	130.83
203 BANCA ROMANEASCA	0.00%	0.00%	872.95	872.95	0.00%	0.00%	872.95	872.95	0.00
204 BRD-GROUP SOCIETATE GENERAL	0.00%	0.00%	74.25	74.25	0.03%	0.03%	15,154.03	15,154.03	15,079.78
205 CEC BANK	0.00%	0.00%	266.73	266.73	0.00%	0.00%	221.73	221.73	-45.00
207 OTP BANK ROMANIA	1.41%	1.41%	477,229.22	477,229.22	0.67%	0.67%	360,663.30	360,663.30	-116,565.92
208 PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	510.17	510.17	0.00%	0.00%	420.41	420.41	-89.76
210 Procredit Bank	0.00%	0.00%	283.93	283.93	0.00%	0.00%	62.83	62.83	-221.10
213 Banca Italo-Romana	0.00%	0.00%	74.97	74.97	0.00%	0.00%	160.54	160.54	85.57
214 Banca Comerciala Romana - EURO	0.02%	0.02%	7,470.77	7,470.77	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-7,470.77
215 CITI BANK	0.01%	0.01%	4,970.00	4,970.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-4,970.00
219 Credit Europ Bank SA	0.00%	0.00%	644.99	644.99	0.00%	0.00%	157.55	157.55	-487.44
220 Garanti Bank	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	4,481.23	4,481.23	4,481.23
221 UNICREDIT TIRIAC BANK	0.00%	0.00%	54.34	54.34	0.00%	0.00%	192.81	192.81	138.47
223 MILLENIUM BANK	0.00%	0.00%	262.79	262.79	0.00%	0.00%	338.80	338.80	76.01
227 Intesa Sanpaolo Bank	0.00%	0.00%	824.76	824.76	0.00%	0.00%	546.81	546.81	-277.95
3 Depozite bancare:	44.14%	44.09%	14,898,326.71	14,898,326.71	45.20%	45.15%	24,296,605.88	24,296,605.88	9,398,279.17
31 Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	44.14%	44.09%	14,898,326.71	14,898,326.71	45.20%	45.15%	24,296,605.88	24,296,605.88	9,398,279.17
311 OTP BANK ROMANIA	9.66%	9.65%	3,260,941.64	3,260,941.64	6.64%	6.63%	3,569,586.73	3,569,586.73	308,645.09
3120 CITY BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.25%	0.25%	133,478.58	133,478.58	133,478.58
3123 Procredit Bank	2.40%	2.39%	808,995.07	808,995.07	1.56%	1.55%	836,564.17	836,564.17	27,569.10
3125 Credit Europe Bank SA	5.73%	5.72%	1,933,829.40	1,933,829.40	4.99%	4.98%	2,681,602.08	2,681,602.08	747,772.68
3126 Garanti Bank	0.00%	0.00%	0.00	0.00	7.02%	7.01%	3,773,173.73	3,773,173.73	3,773,173.73
314 BANCA COMERCIALA ROMANA	3.88%	3.88%	1,310,825.27	1,310,825.27	5.28%	5.28%	2,840,280.76	2,840,280.76	1,529,455.49
318 Banca Italo-Romana	6.43%	6.42%	2,169,080.62	2,169,080.62	1.55%	1.55%	832,634.08	832,634.08	-1,336,446.54
320 Uncredit Tiriac BANK	9.96%	9.95%	3,362,269.99	3,362,269.99	5.10%	5.09%	2,741,459.96	2,741,459.96	-620,810.03
323 MILLENIUM BANK	6.08%	6.07%	2,052,384.72	2,052,384.72	12.81%	12.80%	6,887,625.78	6,887,625.78	4,835,241.06
5 Instrumente financiare derivate tranzacționate în afara piețelor reglementate	0.49%	0.49%	165,355.00	165,355.00	-0.30%	-0.30%	-162,588.00	-162,588.00	-327,943.00
51 Contracte Forward	0.49%	0.49%	165,355.00	165,355.00	-0.30%	-0.30%	-162,588.00	-162,588.00	-327,943.00
6 Instrumente ale pieței monetare, altele decât cele tranz pe o piață reglementată cf art 101 (1) lit g:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.15%	0.15%	79,723.41	79,723.41	79,723.41
64 Contracte reverse-repo	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.15%	0.15%	79,723.41	79,723.41	79,723.41
7 Titluri de participare la OPCVM/OPC	8.20%	8.19%	2,766,457.59	2,766,457.59	8.02%	8.01%	4,311,247.87	4,311,247.87	1,544,790.28
9 Alte active, din care:	1.74%	1.74%	587,278.26	587,278.26	0.00%	0.00%	18.07	18.07	-587,260.19
92 Suma la SSIF	0.00%	0.00%	0.22	0.22	0.00%	0.00%	0.22	0.22	0.00
93 Suma în curs de rezolvare	0.00%	0.00%	17.85	17.85	0.00%	0.00%	17.85	17.85	0.00
96 Suma în curs de decontare	1.74%	1.74%	587,260.19	587,260.19	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-587,260.19
II Total obligatii			35,951.23	35,951.23			57,146.64	57,146.64	21,763.42
10 CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligatii)	0.11%	0.11%	35,951.23	35,951.23	0.11%	0.11%	57,146.64	57,146.64	21,763.42
101 Comisia datorate soc. de admin.	0.08%	0.08%	27,232.47	27,232.47	0.08%	0.08%	40,570.16	40,570.16	13,337.69
102 Comisia datorate depozitarului	0.01%	0.01%	4,052.20	4,052.20	0.01%	0.01%	4,865.88	4,865.88	813.68
103 Taxa CNVM	0.01%	0.01%	2,793.87	2,793.87	0.01%	0.01%	4,176.59	4,176.59	1,382.73
106 Cheltuieli de audit	0.00%	0.00%	885.74	885.74	0.00%	0.00%	569.19	569.19	-316.55
107 Comision custodie	0.00%	0.00%	835.75	835.75	0.00%	0.00%	887.31	887.31	51.56
108 Rascumparari neplatite	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	6,431.91	6,431.91	6,431.91
110 Cheltuieli estimate	0.00%	0.00%	151.20	151.20	0.00%	0.00%	213.60	213.60	62.40
1111 Cota de participare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
III Valoarea activului net (II - I)			33,751,936.39	33,751,936.39			53,755,921.23	53,755,921.23	20,003,984.84

Denumire element	La data de 31.12.2012	La data de 30.06.2013	Diferența
Valoarea activ net	33,751,936.39	53,755,921.23	20,003,984.84
Numar unitati de fonduri in circulatie	2,737,107.60	4,228,616.05	1,491,508.45
Valoarea unitara a activului net	12.3312	12.7124	0.3812

 OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
 Presedinte Directorat

Dan Marius POPOVICI

Intocmit

Lavinia BERCEA

I. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania

5. Obligatiuni admise la tranzactionare

5.1. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontare	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Primaria Lugoj	LGJ14	-	1,750	-	23-Jun-08	15-Mar-13	15-Sep-13	15.76	0.002	0.03	0.00	-	27,633.26	5.0000%	0.051%
Primaria Orasului Oravita	ORV27	-	923	-	13-May-08	15-Apr-13	15-Oct-13	90.50	0.016	1.16	0.00	-	84,605.81	1.5383%	0.157%
Municipiul Timisoara	TIM26C	-	990	-	7-Jul-08	15-May-13	15-Aug-13	74.80	0.008	0.36	0.00	-	74,410.34	0.0660%	0.138%
TOTAL													186,649.41		0.347%

5.2. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale

Serie	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontare	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Banca intermediara	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
							lei	lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO0515DBN0H8	-	1	-	27-Jun-11	11-Apr-13	11-Apr-14	9,851.36	1.98	146.10	78.72	-	10,076.18	RAIFFEISEN BANK	0.0000%	0.019%
RO0914DBN049	-	1	-	27-Jun-11	5-Mar-13	5-Mar-14	10,942.43	2.05	349.59	-703.46	-	10,588.56	RAIFFEISEN BANK	0.0000%	0.020%
RO1116DBN024	-	1	-	27-Jun-11	30-Apr-13	30-Apr-14	9,505.50	1.92	98.63	204.90	-	9,809.03	BCR	0.0000%	0.018%
RO1121DBN032	-	1	-	27-Jun-11	11-Jun-13	11-Jun-14	9,002.27	1.90	29.34	201.08	-	9,232.69	RAIFFEISEN BANK	0.0000%	0.017%
RO1217DBN046	-	50	-	21-Jan-13	26-Jul-12	26-Jul-13	508,591.50	75.61	27,317.81	-829.42	-	535,079.89	CITI BANK	0.0006%	0.994%
TOTAL												574,786.35			1.068%

5.3. Obligatiuni tranzactionate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontare	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
SC GDF SUEZ Eneer Romania SA	GSER17	-	114	-	30-Oct-12	30-Oct-12	30-Oct-13	10,000.00	2.06	497.44	0.00	-	1,196,708.67	0.4560%	2.224%
SC GDF SUEZ Eneer Romania SA	GSER17	-	100	-	5-Feb-13	30-Oct-12	30-Oct-13	10,000.00	2.06	497.44	0.00	-	1,049,744.44	0.4000%	1.951%
TOTAL													2,246,453.11		4.175%

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din alt stat membru

2. Obligatiuni admise la tranzactionare

2.1. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denumite in lei

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data sadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Banca Comerciala Romana	XS0474834925	-	1	-	29-Jun-12	22-Dec-12	22-Dec-13	574,488.56	113.84	26,667.12	-9,949.13	-	591,186.55	0.0107%	1.099%
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	1	-	12-Apr-10	7-Apr-13	7-Apr-14	250,000.00	52.74	4,377.40	0.00	-	254,377.40	0.0107%	0.473%
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	3	-	17-Nov-11	7-Apr-13	7-Apr-14	248,948.61	53.08	4,377.40	202.45	-	760,885.39	0.0320%	1.413%
Banca Comerciala Romana	XS0738864734	-	1	-	14-Feb-12	31-Jan-13	31-Jan-14	250,641.03	49.11	7,450.00	-447.91	-	257,643.11	0.0107%	0.479%
CITI GROUP FUNDING Inc	XS0603236406	-	500,000	-	29-May-13	29-Nov-12	29-Nov-13	1.01	0.00	0.05	0.00	-	526,350.72	0.1266%	0.978%
KBC INTERNATIONALE FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ N.V	XS0483177632	-	8	-	4-Jul-13	12-Feb-13	12-Feb-14	260,000.00	42.04	7,976.03	-404.53	-	2,140,571.97	0.0946%	3.978%
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS0454824995	-	1	-	19-Oct-11	19-Aug-12	19-Aug-13	520,560.16	120.73	47,530.14	-18,997.46	-	549,092.83	0.0000%	1.020%
TOTAL													5,079,807.98		9.440%

2.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data sadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
MCL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XS0503453275	-	150	-	24-Jul-12	20-Apr-13	20-Apr-14	982.50	0.17	11.27	3.44	4.588	666,950.26	0.0086%	1.239%	
MCL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XS0503453275	-	100	-	5-Nov-12	20-Apr-13	20-Apr-14	1,028.75	0.14	11.27	-4.17	4.588	461,863.39	0.0057%	0.858%	
MCL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XS0503453275	-	130	-	28-Nov-12	20-Apr-13	20-Apr-14	1,031.45	0.14	11.27	-4.18	4.588	601,993.92	0.0074%	1.119%	
MCL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XS0503453275	-	100	-	5-Mar-13	20-Apr-13	20-Apr-14	1,052.00	0.13	11.27	-4.00	4.588	472,304.85	0.0057%	0.876%	
MCL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XS0503453275	-	100	-	6-Mar-13	20-Apr-13	20-Apr-14	1,050.00	0.13	11.27	-3.82	4.588	471,495.37	0.0057%	0.876%	
OTP BANK RT	XS0214084252	-	1	-	14-Jun-11	4-Jun-13	4-Jun-13	41,187.50	7.54	26.04	4,837.47	4.588	205,332.26	0.0002%	0.382%	
OTP BANK RT	XS0214084252	-	2	-	28-Jan-13	4-Jun-13	4-Sep-13	45,250.00	7.26	26.04	943.79	4.588	412,169.98	0.0004%	0.766%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	200	-	22-Jun-12	19-Sep-12	19-Sep-13	825.00	0.26	40.86	42.00	4.588	809,593.71	0.0398%	1.504%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	100	-	8-Oct-12	19-Sep-12	19-Sep-13	927.50	0.19	40.86	13.27	4.588	437,690.87	0.0199%	0.813%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	110	-	29-Oct-12	19-Sep-12	19-Sep-13	952.50	0.18	40.86	8.12	4.588	491,195.54	0.0219%	0.913%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	120	-	18-Dec-12	19-Sep-12	19-Sep-13	960.20	0.17	40.86	5.60	4.588	538,621.24	0.0239%	1.001%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	110	-	24-Dec-12	19-Sep-12	19-Sep-13	973.25	0.16	40.86	3.66	4.588	499,186.17	0.0219%	0.928%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	100	-	18-Mar-13	19-Sep-12	19-Sep-13	999.25	0.14	40.86	0.06	4.588	463,791.36	0.0199%	0.862%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	100	-	11-Apr-13	19-Sep-12	19-Sep-13	990.00	0.15	40.86	0.63	4.588	459,920.31	0.0199%	0.855%	
OTP BANK NYRT	XS0268320600	-	100	-	10-Jun-13	19-Sep-12	19-Sep-13	1,000.00	0.14	40.86	0.00	4.588	464,098.90	0.0199%	0.862%	
TOTAL													7,456,198.13		13.856%	

2.3. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denumite in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data sădenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
								USD	USD	USD	USD	USD	lei	lei	%	%
MOL Group Finance SA	XS0834436702	-	200	-	22-Apr-13	26-Mar-13	26-Sep-13	1.031.00	0.16	16.13	-0.90		3.4151	714.600.62	0.0114%	1.328%
MOL Group Finance SA	XS0834436702	-	200	-	8-May-13	26-Mar-13	26-Sep-13	1.052.50	0.15	16.13	-1.17		3.4151	729.099.14	0.0114%	1.355%
MOL Group Finance SA	XS0834436702	-	200	-	20-May-13	26-Mar-13	26-Sep-13	1.055.70	0.00	16.13	-0.96		3.4151	731.428.47	0.0114%	1.359%
TOTAL														2,175,128.23		4.042%

2.4. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data sădenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Republic of Croatia	XS0645940289	-	100	-	25-Mar-13	9-Jul-13	9-Jun-14	1,077.50	0.12	57.14	-3.85		4.4588	504,196.43	0.0027%	0.937%
Republic of Croatia	XS0645940289	-	100	-	8-May-13	9-Jul-13	9-Jun-14	1,110.00	0.10	57.14	-3.03		4.4588	519,053.68	0.0027%	0.965%
ROMANIA	XS0852474336	-	100	-	7-Nov-12	7-Nov-12	7-Nov-13	990.47	0.14	31.25	0.87		4.4588	455,955.06	0.0017%	0.847%
ROMANIA	XS0852474336	-	100	-	18-Dec-12	7-Nov-12	7-Nov-13	1,022.00	0.12	31.25	-1.69		4.4588	468,871.86	0.0017%	0.871%
ROMANIA	XS0852474336	-	100	-	6-Feb-13	7-Nov-12	7-Nov-13	1,050.00	0.11	31.25	-2.90		4.4588	480,815.95	0.0017%	0.893%
ROMANIA	XS0852474336	-	200	-	28-Feb-13	7-Nov-12	7-Nov-13	1,050.00	0.11	31.25	-2.48		4.4588	962,010.13	0.0033%	1.788%
ROMANIA	XS0852474336	-	100	-	11-Apr-13	7-Nov-12	7-Nov-13	1,058.00	0.11	31.25	-1.91		4.4588	484,825.43	0.0017%	0.901%
ROMANIA	XS0852474336	-	125	-	26-Jun-13	7-Nov-12	7-Nov-13	1,017.50	0.13	31.25	-0.02		4.4588	584,510.12	0.0021%	1.086%
TOTAL														4,460,238.65		8.288%

2.5. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale denumite in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data sădenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
ROMANIA	US775867AC09	-	147	-	22-Feb-13	22-Feb-13	22-Aug-13	1,979.26	0.25	30.70	0.69		3.4151	1,009,383.25	0.0024%	1.876%
TOTAL														1,009,383.25		1.876%

2.6. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data sădenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret Piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
								EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
CITY OF BUCHAREST	XS0222425471	-	1	-	1-Jun-11	22-Jun-12	22-Jun-13	46,875.00	7.76	39.55	1,600.46		4.4588	216,318.73	0.0100%	0.402%
TOTAL														216,318.73		0.402%

8. Obligatiuni cotate corporative

Emitent	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data cupon	Data sădenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
					lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Unicredit Triaac Bank	150	28-Jun-13	28-Jun-13	14-Dec-13	10,000.00	1.74	1.74	0.00	1,500,260.96	0.3000%	2.788%
TOTAL									1,500,260.96		2.788%

IX. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar în lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPC
	lei	%
Alpha Bank	0.00	0.000%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.000%
BANCA ITALO-ROMENA	160.54	0.000%
Banca Romaneasca	872.95	0.002%
BRD Groupe Societe Generale	15,154.03	0.028%
CEC Bank SA	221.73	0.000%
Citi Bank	0.00	0.000%
CREDIT EUROPE BANK SA	157.55	0.000%
Garanti Bank	4,481.23	0.008%
Intesa Sanpaolo Bank	546.81	0.001%
MILLENNIUM BANK	338.80	0.001%
OTP BANK ROMANIA	80,238.50	0.149%
OTP BANK ROMANIA	29,041.75	0.054%
OTP BANK ROMANIA	91,678.55	0.170%
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000%
OTP BANK ROMANIA	49,254.50	0.092%
OTP BANK ROMANIA	21,240.00	0.039%
OTP BANK ROMANIA	89,210.00	0.166%
PIRAEUS BANK	420.41	0.001%
Procredit Bank	62.83	0.000%
UniCredit Tiriac Bank	192.81	0.000%
TOTAL	383,272.99	0.712%

2. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPC
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	4.4588	0.00	0.000%
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.4588	0.00	0.000%
BRD Groupe Societe Generale	0.00	4.4588	0.00	0.000%
TOTAL			0.00	0.000%

2. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPC
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	38.31	3.4151	130.83	0.000%
OTP BANK ROMANIA	0.00	3.4151	0.00	0.000%
Citi Bank	0.00	3.4151	0.00	0.000%
TOTAL			130.83	0.000%

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denuminate în lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Dobanda zilnica	Dobanda cumulata	Valoarea totala	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	28-Jun-13	29-Jun-13	1,695,123.59	209.54	209.54	1,695,333.13	3.150%
BANCA ITALO-ROMENA	27-May-13	27-May-14	505,600.00	81.03	2,674.14	508,274.14	0.945%
BANCA ITALO-ROMENA	10-Jun-13	10-Oct-13	314,900.00	55.65	9,459.94	324,359.94	0.603%
Citi Bank	28-Jun-13	1-Jul-13	133,464.71	13.87	13.87	133,478.58	0.248%
CREDIT EUROPE BANK SA	11-Jun-13	25-Jul-13	500,000.00	71.92	1,294.52	501,294.52	0.932%
CREDIT EUROPE BANK SA	25-Jun-13	13-Aug-13	507,700.00	71.63	286.54	507,986.54	0.944%
CREDIT EUROPE BANK SA	18-Jun-13	18-Sep-13	404,400.00	59.28	652.03	405,052.03	0.753%
CREDIT EUROPE BANK SA	21-Jun-13	11-Jul-13	400,000.00	32.88	263.01	400,263.01	0.744%
CREDIT EUROPE BANK SA	21-Jun-13	20-Aug-13	466,000.00	67.67	541.33	466,541.33	0.867%
CREDIT EUROPE BANK SA	21-Jun-13	13-Aug-13	400,000.00	58.08	464.66	400,464.66	0.744%
Garanti Bank	29-Apr-13	29-Jul-13	1,015,000.00	161.29	9,838.55	1,024,838.55	1.904%
Garanti Bank	7-May-13	7-Aug-13	723,000.00	113.90	6,036.55	729,036.55	1.355%
Garanti Bank	8-May-13	8-Aug-13	1,000,000.00	156.16	8,120.55	1,008,120.55	1.873%
Garanti Bank	22-Apr-13	22-Jul-13	1,000,000.00	164.38	11,178.08	1,011,178.08	1.879%
MILLENNIUM BANK	6-Jun-13	5-Jul-13	4,008,000.00	640.17	14,723.83	4,022,723.83	7.475%
MILLENNIUM BANK	20-Jun-13	19-Jul-13	2,112,000.00	331.47	2,983.20	2,114,983.20	3.930%
MILLENNIUM BANK	28-Jun-13	29-Jul-13	750,000.00	118.75	118.75	750,118.75	1.394%
OTP BANK ROMANIA	28-Jun-13	1-Jul-13	3,261,785.76	268.09	268.09	3,262,053.85	6.062%
OTP BANK ROMANIA	8-Feb-13	8-Aug-13	300,000.00	53.42	7,532.88	307,532.88	0.571%
Procredit Bank	7-May-13	7-Nov-13	829,100.00	140.83	7,464.17	836,564.17	1.555%
UniCredit Tiriac Bank	9-May-13	9-Jan-14	2,719,500.00	430.59	21,959.96	2,741,459.96	5.094%
TOTAL						23,151,658.24	43.022%

2. Depozite bancare denuminate în EUR

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Creștere zilnica	Dobanda cumulata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totala	Pondere in activul total al OPC
			eur	eur	eur	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	28-Jun-13	29-Jun-13	256,782.48	1.33	1.33	4.4588	1,144,947.64	2.128%
TOTAL							1,144,947.64	2.128%

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

1.1. Contracte forward denumite in EUR

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totala	Pondere in activul total al OPC
	EUR				lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD Groupe Societe Generale	150.000,00	V	20-Jun-13	20-Sep-13	4.5780	4.4588	4.5020	0.0760	11.400,00	0.021%
BRD Groupe Societe Generale	300.000,00	V	10-Jun-13	12-Dec-13	4.6126	4.4588	4.5442	0.0684	20.520,00	0.038%
BRD Groupe Societe Generale	100.000,00	V	9-Apr-13	11-Jul-13	4.4499	4.4588	4.4662	-0.0163	-1.630,00	-0.003%
BRD Groupe Societe Generale	200.000,00	V	10-Apr-13	12-Jul-13	4.4295	4.4588	4.4667	-0.0372	-7.440,00	-0.014%
Citi Bank	200.000,00	V	18-Apr-13	22-Oct-13	4.4470	4.4588	4.5182	-0.0712	-14.240,00	-0.026%
Citi Bank	100.000,00	V	18-Apr-13	22-Oct-13	4.4527	4.4588	4.5182	-0.0655	-6.550,00	-0.012%
Citi Bank	100.000,00	V	14-May-13	18-Nov-13	4.3915	4.4588	4.5320	-0.1405	-14.050,00	-0.026%
Citi Bank	100.000,00	V	8-May-13	12-Nov-13	4.3710	4.4588	4.5289	-0.1579	-15.790,00	-0.029%
Citi Bank	100.000,00	V	8-May-13	12-Nov-13	4.3727	4.4588	4.5289	-0.1562	-15.620,00	-0.029%
Citi Bank	100.000,00	V	7-May-13	12-Nov-13	4.3787	4.4588	4.5289	-0.1502	-15.020,00	-0.028%
Citi Bank	100.000,00	V	17-Jun-13	17-Sep-12	4.4961	4.4588	4.5005	-0.0044	-440,00	-0.001%
Citi Bank	100.000,00	V	21-Jun-13	26-Sep-12	4.5647	4.4588	4.5049	0.0598	5.980,00	0.011%
Citi Bank	100.000,00	V	27-Jun-13	1-Oct-12	4.4933	4.4588	4.5075	-0.0142	-1.420,00	-0.003%
OTP BANK ROMANIA	800.000,00	V	26-Jun-13	30-Sep-13	4.4605	4.4588	4.5070	-0.0465	-37.200,00	-0.069%
OTP BANK ROMANIA	100.000,00	V	17-Jun-13	19-Sep-13	4.4960	4.4588	4.5015	-0.0055	-550,00	-0.001%
OTP BANK ROMANIA	200.000,00	V	3-Jun-13	5-Sep-13	4.4509	4.4588	4.4945	-0.0436	-8.720,00	-0.016%
OTP BANK ROMANIA	100.000,00	V	16-Apr-13	18-Jul-13	4.4167	4.4588	4.4698	-0.0531	-5.310,00	-0.010%
OTP BANK ROMANIA	300.000,00	V	11-Apr-13	15-Jul-13	4.4318	4.4588	4.4683	-0.0365	-10.950,00	-0.020%
TOTAL									-117.030,00	-0.217%

1.2. Contracte forward denumite in USD

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR USD/RON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totala	Pondere in activul total al OPC
	EUR				lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD Groupe Societe Generale	220.000,00	V	8-May-13	12-Nov-13	3.3255	3.4151	3.4679	-0.1424	-31.328,00	-0.058%
BRD Groupe Societe Generale	100.000,00	V	22-Apr-13	24-Jul-13	3.3613	3.4151	3.4256	-0.0643	-6.430,00	-0.012%
OTP BANK ROMANIA	600.000,00	V	26-Jun-13	30-Sep-13	3.4385	3.4151	3.4515	-0.0130	-7.800,00	-0.014%
TOTAL									-45.558,00	-0.085%

XIII. Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conf. art. 101(1), lit.g din legea nr 297/2004

1. Contracte de report pe titluri emise de administratia publica centrala

Serie emisiunii	Tipul de instrument	Nr. titluri detinute	Data achizitiei	Data scadentei	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Valoare totala	Banca intermediara	Pondere in total obligatiuni ale unui emittent	Pondere in activul total al OPC
					lei	lei	lei	lei		%	%
RO1015DBN010	Repo	200	6-Jun-13	5-Jul-13	-1.955.205,31	-252,55	-5.808,59	-1.961.013,90	Citi Bank Romania	0.0023%	-3.644%
RO1113DBN047	Repo	90	6-Jun-13	5-Jul-13	-933.350,26	-120,56	-2.772,82	-936.123,08	Citi Bank Romania	0.0010%	-1.740%
RO1215DBN073	Repo	100	6-Jun-13	5-Jul-13	-995.873,90	-128,63	-2.958,58	-998.832,48	Citi Bank Romania	0.0011%	-1.856%
TOTAL								-3.895.969,46			-7.240%

Serie	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontare	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret piata	Valoare totala	Banca intermediara	Pondere in total obligatiuni emittent	Pondere in activul total al OPC
							lei	lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO1015DBN010	-	55	-	31-Mar-11	30-Apr-13	30-Apr-14	525.429,34	106,89	5.424,66	13.529,52	-	544.383,52	PIRAEUS BANK	0.0006%	1.012%
RO1015DBN010	-	20	-	28-Jun-11	30-Apr-13	30-Apr-14	191.945,60	38,62	1.972,60	4.205,29	-	198.123,49	PIRAEUS BANK	0.0002%	0.368%
RO1015DBN010	-	25	-	11-Apr-12	30-Apr-13	30-Apr-14	251.341,75	39,89	2.465,75	-534,77	-	253.272,73	RAIFFEISEN BANK	0.0003%	0.471%
RO1015DBN010	-	100	-	2-Jul-12	30-Apr-13	30-Apr-14	994.950,57	169,28	9.863,01	1.771,22	-	1.006.584,80	RAIFFEISEN BANK	0.0011%	1.871%
RO1113DBN047	-	90	-	17-Jan-13	19-Oct-12	19-Oct-13	899.424,43	150,04	37.430,14	341,16	-	937.195,73	BCR	0.0010%	1.742%
RO1215DBN073	-	100	-	16-Jan-13	26-Oct-12	26-Oct-13	996.470,96	162,39	39.090,41	571,35	-	1.036.132,62	BCR	0.0011%	1.925%
TOTAL												3.975.692,89			7.388%

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denuminate in lei

Denumire fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	lei	%	%
FDI CERTINVEST TEZAUR	-	1.053.486693	79.8700	-	84.141.98	0.7527%	0.156%
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	-	84.380.823155	25.4900	-	2.150.867.18	8.8747%	3.997%
FDI OTP COMODISRO	-	47.193.722800	15.3764	-	725.669.56	0.4078%	1.348%
TOTAL					2.960.678.72		5.502%

2. Titluri de participare denuminate in EUR

Denumire fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Curs valutar BNR EUR/RON	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%	%
FDI OTP EUROBOND	-	26.465.9098	11.4449	4.4586	-	1.350.569.14	1.3241%	2.510%
TOTAL						1.350.569.14		2.510%

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	4.320.599.41	21.077.186.38	53.755.921.23
VUAN	11.13	11.8159	12.7124

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General

Dan Marius POPOVICI

Intocmit

Lavinia Bercea