

**SAI: OTP Asset Management Romania
SAI SA**

 Decizie autorizare: PJR05SAIR/400023 Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007
 CUI: 22264941 Inregistrare ONRC: J40/15502/15.08.2007
 Capital social: 5.795.323 RON Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

OTP AvantisRO

 Decizie autorizare: 376/27.02.2008
 Cod inscriere: CSC06FDIR/400050

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2014 - 31.12.2015

Denumire element	31.12.2014				31.12.2015				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.45%	100.00%	15,067,937.19	15,067,937.19	100.31%	100.00%	18,362,955.34	18,362,955.34	3,295,018.14
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	85.70%	85.32%	12,856,151.22	12,856,151.22	88.47%	88.20%	16,196,035.17	16,196,035.17	3,339,883.95
1.1. valori mobiliare și instrumente ale pieței monetare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din România, din care:	78.54%	78.19%	11,781,481.15	11,781,481.15	77.31%	77.08%	14,153,315.49	14,153,315.49	2,371,834.34
1.1.1. actiuni	77.19%	76.84%	11,578,835.49	11,578,835.49	77.31%	77.08%	14,153,315.49	14,153,315.49	2,574,480.00
1.1.3. obligatiuni, din care:	1.35%	1.34%	202,645.66	202,645.66	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-202,645.66
1.1.3.3. Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	1.35%	1.34%	202,645.66	202,645.66	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-202,645.66
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	7.16%	7.13%	1,074,670.07	1,074,670.07	11.16%	11.12%	2,042,719.68	2,042,719.68	968,049.61
1.2.1. actiuni	4.02%	4.01%	603,492.35	603,492.35	11.16%	11.12%	2,042,719.68	2,042,719.68	1,439,227.33
1.2.3. obligatiuni, din care:	3.14%	3.13%	471,177.71	471,177.71	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-471,177.71
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	3.14%	3.13%	471,177.71	471,177.71	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-471,177.71
1.3. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat terț sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat terț, care operează în mod regulat și este recunoscută și deschisă publicului, aprobată de A.S.F., din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
2 valori mobiliare nou emise	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
2.1. actiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
2.2. obligatiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
3 alte valori mobiliare și instrumente ale pieței monetare menționate la art. 83 alin.(1) lit.a) din O.U.G. nr. 32/2012 din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
3.1. valori mobiliare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
3.2. instrumente ale pietei monetare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4 Depozite bancare din care:	6.42%	6.39%	962,708.08	962,708.08	2.37%	2.36%	434,006.76	434,006.76	-528,701.32
4.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	6.42%	6.39%	962,708.08	962,708.08	2.37%	2.36%	434,006.76	434,006.76	-528,701.32
4.1.1. OTP BANK ROMANIA	2.75%	2.74%	412,695.86	412,695.86	0.87%	0.87%	159,005.23	159,005.23	-253,690.63
4.1.2. BANCA COMERCIALA ROMANA	3.67%	3.65%	550,012.22	550,012.22	1.50%	1.50%	275,001.53	275,001.53	-275,010.69
4.2. depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4.3. depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat tert	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	1,340.00	1,340.00	1,340.00
5.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	1,340.00	1,340.00	1,340.00
5.4.1. Contracte forward	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	1,340.00	1,340.00	1,340.00
6 Conturi curente si numerar	0.31%	0.31%	46,151.06	46,151.06	0.04%	0.04%	7,336.74	7,336.74	-38,814.32
6.1. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.29%	0.29%	43,057.85	43,057.85	0.00%	0.00%	157.04	157.04	-42,900.81
6.2. BANCA ROMANEASCA	0.00%	0.00%	123.33	123.33	0.00%	0.00%	123.33	123.33	0.00
6.3. BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.00%	0.00%	253.61	253.61	0.00%	0.00%	126.70	126.70	-126.91
6.4. OTP BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	86.77	86.77	0.03%	0.03%	6,252.43	6,252.43	6,165.66
6.5. Procredit Bank	0.00%	0.00%	99.18	99.18	0.00%	0.00%	99.18	99.18	0.00
6.6. Banca Comerciala Romana - EURO	0.02%	0.02%	2,360.32	2,360.32	0.00%	0.00%	408.43	408.43	-1,951.89
6.7. LIBRA BANK	0.00%	0.00%	170.00	170.00	0.00%	0.00%	169.63	169.63	-0.37
7 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conform art. 82 lit.g) din O.U.G. nr. 32/2012	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
7.1. Titluri emise de administratia publica centrala	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
7.2. Contracte de tip repo pe titluri de valoare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00

8	Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.	7.84%	7.80%	1,175,519.49	1,175,519.49	9.35%	9.32%	1,712,034.67	1,712,034.67	536,515.18
9	Dividende sau alte drepturi de incasat	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
10	Alte active	0.18%	0.18%	27,407.35	27,407.35	0.07%	0.07%	12,202.00	12,202.00	-15,205.35
10.4.	sume in curs de decontare	0.18%	0.18%	27,407.35	27,407.35	0.07%	0.07%	12,202.00	12,202.00	-15,205.35
II Total obligatii		0.45%	0.45%	67,296.19	67,296.20	0.31%	0.30%	55,908.80	55,908.80	-11,387.40
1.	Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate S.A.I.	0.41%	0.41%	61,912.29	61,912.29	0.26%	0.26%	47,625.90	47,625.90	-14,286.39
1.1.	Comision de administrare	0.41%	0.41%	61,839.79	61,839.79	0.25%	0.25%	45,381.24	45,381.24	-16,458.55
1.2.	Comision de subscriere	0.00%	0.00%	72.50	72.50	0.01%	0.01%	2,244.66	2,244.66	2,172.16
2.	Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.02%	0.02%	3,185.46	3,185.46	0.02%	0.02%	3,851.24	3,851.24	665.78
2.1.	Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	1,916.06	1,916.06	0.01%	0.01%	2,248.57	2,248.57	332.51
2.2.	Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate custodelui	0.01%	0.01%	1,269.40	1,269.40	0.01%	0.01%	1,602.67	1,602.67	333.27
3.	Cheltuieli cu comisioanele datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	49.33	49.33	0.00%	0.00%	788.05	788.05	738.72
7.	Cheltuieli cu plata comisioanelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	1,250.30	1,250.30	0.01%	0.01%	1,428.52	1,428.52	178.22
8.	Cheltuielile cu auditul financiar	0.01%	0.01%	896.42	896.42	0.01%	0.01%	2,182.00	2,182.00	1,285.58
9.	Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	2.40	2.40	0.00%	0.00%	33.08	33.08	30.68
III Valoarea activului net (I - II)		100.00%	99.55%	15,000,641.00	15,000,641.00	100.00%	99.70%	18,307,046.54	18,307,046.54	3,306,405.54

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	La data de 31.12.2015	La data de 31.12.2014	Diferente
Valoare activ net	18,307,046.54	15,000,641.00	3,306,405.54
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	2,154,049.3248	1,875,101.8113	278,947.5135
Valoarea unitara a activului net	8.4989	7.9999	0.4990

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

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

1. Actiuni tranzactionate

Emitent	Simbol actiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				lei	lei	lei	%	%
ALBALACT SA	ALBZ	30-Dec-15	1,905,860	0.1000	0.3400	647,992.40	0.292	3.529
ANTIBIOTICE S.A.	ATB	30-Dec-15	996,794	0.1000	0.5320	530,294.41	0.148	2.888
BANCA TRANSILVANIA S.A.	TLV	30-Dec-15	349,000	1.0000	2.4300	848,070.00	0.012	4.618
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	BRD	30-Dec-15	65,742	1.0000	12.1000	795,478.20	0.009	4.332
BURSA DE VALORI BUCURESTI SA	BVB	30-Dec-15	7,609	10.0000	27.0000	205,443.00	0.099	1.119
C.N.T.E.E. TRANSELECTRICA	TEL	30-Dec-15	30,578	10.0000	29.1500	891,348.70	0.042	4.854
COMPA S. A.	CMP	30-Dec-15	321,700	0.1000	0.6840	220,042.80	0.147	1.198
CONPET SA Ploiesti	COTE	30-Dec-15	12,263	3.3000	77.0000	944,251.00	0.142	5.142
ELECTRICA SA	EL	30-Dec-15	73,800	10.0000	12.2000	900,360.00	0.021	4.903
FONDUL PROPRIETATEA	FP	30-Dec-15	2,025,147	0.9000	0.8100	1,640,369.07	0.018	8.933
OMV PETROM S.A.	SNP	30-Dec-15	2,000,000	0.1000	0.2900	580,000.00	0.004	3.159
S.N. NUCLEARELECTRICA S.A.	SNN	30-Dec-15	89,501	10.0000	6.4200	574,596.42	0.030	3.129
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	30-Dec-15	47,720	1.0000	27.2000	1,297,984.00	0.012	7.068
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	30-Dec-15	3,642	10.0000	277.0000	1,008,834.00	0.031	5.494
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	30-Dec-15	542,396	0.1000	1.6880	915,564.45	0.099	4.986
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	30-Dec-15	619,000	0.1000	0.7860	486,534.00	0.060	2.650
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	30-Dec-15	485,704	0.1000	1.6900	820,839.76	0.084	4.470
SIF TRANSILVANIA S.A.	SIF3	30-Dec-15	3,090,725	0.1000	0.2735	845,313.29	0.141	4.603
TOTAL						14,153,315.49		77.075

2. Actiuni netranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare

Emitent	Simbol actiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				lei	lei	lei	%	%
VULCAN SA BUCURESTI	VULC	22-May-13	60,000	2.5000	-	0.00	0.202	0.000
TOTAL						0.00		0.000

8. Sume in curs de decontare pentru valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania

Emitent	Tipul de valoare mobiliara	Simbol	Valoare unitara	Numar valori mobiliare tranzactionate	Valoare totala	Pondere în capitalul social ale emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
					lei	%	%
ELECTRICA SA	Actiune	EL	12.2020	1,000	12,202.00	0.000	0.066
TOTAL					12,202.00		0.066

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

1. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare - denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR EUR/RON	Piata de achizitie	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				EUR	EUR	lei		lei	%	%
Erste Bank	AT0000652011	31-Dec-15	11,800	-	28.91	4.5245	Austria	1,543,478.88	0.003	8.405
TOTAL								1,543,478.88		8.405

2. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare - denuminate in HUF

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR HUF/RON	Piata de achizitie	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				HUF	HUF	lei		lei	%	%
OTP BANK PLC	HU0000061726	30-Dec-15	5,800	-	6,000.00	0.0143	Ungaria	499,240.80	0.002	2.719
TOTAL								499,240.80		2.719

IX. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in RON

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	%
Banca Comerciala Romana	157.04	0.001
Banca Romaneasca	123.33	0.001
BRD Groupe Societe Generale	126.70	0.001
Libra Internet Bank	169.63	0.001
OTP BANK ROMANIA	6,252.43	0.034
Procredit Bank	99.18	0.001
Numerar in casierie	0.00	0.000
TOTAL	6,928.31	0.038

2. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	90.27	4.5245	408.43	0.002
BRD Groupe Societe Generale	0.00	4.5245	0.00	0.000
TOTAL			408.43	0.002

3. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	4.1477	0.00	0.000
BRD Groupe Societe Generale	0.00	4.1477	0.00	0.000
TOTAL			0.00	0.000

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denuminate in lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM
			lei	lei	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	30-Dec-15	5-Jan-16	275,000.00	0.76	1.53	275,001.53	1.498
OTP BANK ROMANIA	29-Dec-15	4-Jan-16	159,000.00	1.74	5.23	159,005.23	0.866
TOTAL						434,006.76	2.363

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

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 OPCVM
					lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	100,000.00	V	8-Jan-15	8-Jan-16	4.5385	4.5245	4.5251	0.01	1,340.00	0.007
TOTAL									1,340.00	0.007

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 OPCVM
			lei	lei	lei	%	%
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	-	38,647.721247	28.3000	-	1,093,730.51	6.263	5.956
OTP GLOBAL MIX	-	15,022.232900	10.0023	-	150,256.88	6.953	0.818
FII OTP Premium Return	-	412.4689	1,071.1003	-	441,795.56	2.949	2.406
FII OMNIHEDGE	-	4.66	5,633.4155	-	26,251.72	7.986	0.143
TOTAL					1,712,034.67		9.323

Evolutia activului net si a VUAN în ultimii 3 ani

	31-Dec-13	31-Dec-14	31-Dec-15
Activ net	17,219,372.86	15,000,641.00	18,307,046.53
VUAN	7.8266	7.9999	8.4989

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICIIntocmit,
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE