

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 Euro Premium Return

Decizie autorizare: 231/29.10.2015
Cod inscriere: CSC06FDIR/400097

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 (EUR)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (EUR)	Lei	
I Total active	0.00%	0.00%	0.00	0.00	100.24%	100.00%	645,700.44	2,921,471.63	2,921,471.63
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	15.51%	15.48%	99,932.50	452,144.60	452,144.60
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	15.51%	15.48%	99,932.50	452,144.60	452,144.60
1.2.3. obligatiuni, din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	15.51%	15.48%	99,932.50	452,144.60	452,144.60
1.2.3.1 Obligatiuni corporative cotate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	15.51%	15.48%	99,932.50	452,144.60	452,144.60
2 valori mobiliare nou emise	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
4 Depozite bancare din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	9.62%	9.60%	62,001.27	280,524.76	280,524.76
4.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	0.00%	0.00%	0.00	0.00	9.62%	9.60%	62,001.27	280,524.76	280,524.76
4.1.1. OTP BANK ROMANIA	0.00%	0.00%		0.00	9.62%	9.60%	62,001.27	280,524.76	280,524.76
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6 Conturi curente si numerar	0.00%	0.00%	0.00	0.00	22.07%	22.02%	142,177.36	643,281.46	643,281.46
6.1. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	22.03%	21.98%	141,918.55	642,110.47	642,110.47
6.2. OTP BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.04%	0.04%	258.81	1,170.99	1,170.99
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 - Contracte de tip repo de 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.	0.00%	0.00%	0.00	0.00	53.03%	52.90%	341,589.30	1,545,520.80	1,545,520.80
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	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
II Total obligatii	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.24%	0.24%	1,523.36	6,892.42	6,892.42
1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate S.A.I.	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.16%	0.16%	1,043.76	4,722.50	4,722.50
2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.03%	0.03%	182.08	823.84	823.84
2.1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	77.61	351.16	351.16
2.2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate custodelui	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.02%	0.02%	104.47	472.68	472.68
3. Cheltuieli cu comisioanele datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.03%	0.03%	203.07	918.79	918.79
7. Cheltuieli cu plata comisioanelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	50.24	227.29	227.29
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	44.20	200.00	200.00
III Valoarea activului net (I - II)	0.00%	0.00%	0.00	0.00	100.00%	99.76%	644,177.08	2,914,579.20	2,914,579.20

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	31.12.2015	31.12.2014	Diferente
Valoare activ net	644,177.08	0.00	644,177.08
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	65,500.8799	0.0000	65,500.8799
Valoarea unitara a activului net	9.8346	0.0000	9.8346

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

FDI OTP Euro Premium Return – Situatia detaliata a investitiilor la data de 31.12.2015

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

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 cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unei emisiuni	Pondere in activul total al OPCVM
							EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	%	%
NE PROPERTY COOPERATIEF	XS1325078308	-	100	30-Nov-15	30-Nov-15	26-Feb-16	995.97	0.10	3.29	0.07		99,932.50	0.025	15.477
TOTAL												99,932.50		15.477

IX. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in RON

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	lei	eur	%
Banca Comerciala Romana	5,051.96	4.5245	1,116.58	0.173
Libra Internet Bank	0.00	4.5245	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.5245	0.00	0.000
Numerar in casierie	0.00	4.5245	0.00	0.000
TOTAL			1,116.58	0.173

2. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	EUR	%
Banca Comerciala Romana	140,801.97	21.806
OTP BANK ROMANIA	258.81	0.040
TOTAL	141,060.78	21.846

3. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	eur	%
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.1477	4.5245	0.00	0.000
TOTAL				0.00	0.000

X. Depozite bancare

2. Depozite bancare denumite in EUR

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM
			eur	eur	eur	eur	%
OTP BANK ROMANIA	29-Dec-15	4-Jan-16	62,000.00	0.42	1.27	62,001.27	9.602
TOTAL						62,001.27	9.602

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denumite in lei

Denumire fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM
			lei	lei	lei	eur	%	%
FDI OTP AVANTIS RO	-	30,590.3946	8.4759	-	4.5245	57,306.03	1.420	8.875
TOTAL						57,306.03		8.875

2. Titluri de participare denumite in EUR

Denumire fond	Cod ISIN	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
				eur	eur	eur	%	%
iShares STOXX Europe 600	DE0002635307	30-Dec-15	1,113.00	-	36.9000	41,069.70	0.001	6.360
db x-trackers S&P 500 INVERSE DAILY UCITS	LU03222251520	30-Dec-15	2,170.00	-	19.2200	41,707.40	0.010	6.459
Lyxor ETF MSCI All Country World C-EUR	FR0011079466	30-Dec-15	212.00	-	192.0300	40,710.36	0.026	6.305
FDI OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	4,836.64	12.4039	-	59,993.23	0.172	9.291
TOTAL						183,480.69		28.416

2. Titluri de participare denumite in USD

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Curs valutar BNR USD/RON	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM
				usd	usd	lei	lei	eur	%	%
db x-trackers MSCI EMERGING MARKET SH	LU0518622286	31-Dec-15	2,348.00	-	19.8875	4.1477	4.5245	42,807.02	0.433	6.630
FDI OTP FDI DOLLAR BOND	ROFDIN0001X7	-	5,986.62	10.5676	-	4.1477	4.5245	57,995.56	1.103	8.982
TOTAL								100,802.59		15.611

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	31-Dec-13	31-Dec-14	31-Dec-15
Activ net	-	-	644,177.09
VUAN	-	-	9.8346

OTP Asset Management Romania SAI SA

Intocmit,
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

Membru Directorat,
Dan POPOVICI