

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 Premium Return

Decizie autorizare: 55/26.04.2016
Cod inscriere: CSC06FDIR/400099

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2016 - 30.06.2017

Denumire element	31.12.2016				30.06.2017				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.65%	100.00%	12,657,404.39	12,657,404.39	100.56%	100.00%	17,776,979.50	17,776,979.50	5,119,575.11
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	90.17%	89.58%	11,338,815.56	11,338,815.56	77.13%	76.70%	13,634,786.70	13,634,786.70	2,295,971.14
1.1. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania, din care:	21.01%	20.88%	2,642,512.30	2,642,512.30	12.47%	12.40%	2,204,555.86	2,204,555.86	-437,956.45
1.1.1. actiuni	12.15%	12.07%	1,528,121.32	1,528,121.32	4.79%	4.77%	847,480.64	847,480.64	-680,640.68
1.1.3. obligatiuni, din care:	8.86%	8.80%	1,114,390.98	1,114,390.98	7.68%	7.63%	1,357,075.22	1,357,075.22	242,684.23
1.1.3.1. Obligatiuni corporative cotate	7.33%	7.29%	922,093.24	922,093.24	6.64%	6.61%	1,174,332.02	1,174,332.02	252,238.78
1.1.3.3. Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	1.53%	1.52%	192,297.74	192,297.74	1.03%	1.03%	182,743.20	182,743.20	-9,554.55
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	59.92%	59.53%	7,535,072.18	7,535,072.18	57.76%	57.44%	10,210,385.16	10,210,385.16	2,675,312.97
1.2.1. actiuni	5.23%	5.19%	657,369.71	657,369.71	3.93%	3.91%	695,597.60	695,597.60	38,227.89
1.2.3. obligatiuni, din care:	51.59%	51.26%	6,487,699.18	6,487,699.18	52.02%	51.74%	9,196,984.53	9,196,984.53	2,709,285.36
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	39.85%	39.59%	5,011,174.01	5,011,174.01	32.52%	32.34%	5,748,844.41	5,748,844.41	737,670.40
1.2.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	11.74%	11.67%	1,476,525.17	1,476,525.17	19.50%	19.40%	3,448,140.12	3,448,140.12	1,971,614.96
1.2.5. alte valori mobiliare, instrumente ale pietei monetare	3.10%	3.08%	390,003.29	390,003.29	1.80%	1.79%	317,803.02	317,803.02	-72,200.27
1.3. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat tert sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat tert, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobat de A.S.F., din care:	9.23%	9.17%	1,161,231.07	1,161,231.07	6.90%	6.86%	1,219,845.69	1,219,845.69	58,614.61
1.3.1. actiuni	9.23%	9.17%	1,161,231.07	1,161,231.07	6.90%	6.86%	1,219,845.69	1,219,845.69	58,614.61
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 si instrumente ale pietei monetare mentionate 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:	5.87%	5.83%	737,799.12	737,799.12	19.04%	18.93%	3,365,295.40	3,365,295.40	2,627,496.28
4.1. depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	5.87%	5.83%	737,799.12	737,799.12	19.04%	18.93%	3,365,295.40	3,365,295.40	2,627,496.28
4.1.1. OTP BANK ROMANIA	1.20%	1.19%	150,435.78	150,435.78	9.27%	9.22%	1,639,017.07	1,639,017.07	1,488,581.28
4.1.2. BANCA COMERCIALA ROMANA	4.13%	4.10%	519,342.64	519,342.64	9.40%	9.35%	1,661,754.97	1,661,754.97	1,142,412.33
4.1.3. BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.54%	0.54%	68,020.70	68,020.70	0.36%	0.36%	64,523.37	64,523.37	-3,497.33
4.2. depozite bancare constituite la instituti 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 instituti 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	-0.62%	-0.62%	-78,130.00	-78,130.00	-0.29%	-0.28%	-50,510.10	-50,510.10	27,619.90
5.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.62%	-0.62%	-78,130.00	-78,130.00	-0.29%	-0.28%	-50,510.10	-50,510.10	27,619.90
5.4.1. Contracte forward	-0.62%	-0.62%	-78,130.00	-78,130.00	-0.29%	-0.28%	-50,510.10	-50,510.10	27,619.90
6 Conturi curente si numerar	0.01%	0.01%	1,090.67	1,090.67	1.21%	1.21%	214,771.40	214,771.40	213,680.73
6.1. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00%	0.00%	151.95	151.95	0.01%	0.01%	1,694.55	1,694.55	1,542.60
6.2. Banca Comerciala Romana - EURO	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.16%	0.15%	205,300.29	205,300.29	205,300.29
6.3. OTP BANK EURO	0.00%	0.00%	20.86	20.86	0.00%	0.00%	20.86	20.86	0.00
6.4. Credit Europe Bank SA	0.00%	0.00%	356.43	356.43	0.00%	0.00%	356.43	356.43	0.00
6.5. LIBRA BANK	0.00%	0.00%	108.39	108.39	0.00%	0.00%	78.39	78.39	-30.00
6.6. OTP BANK USD	0.00%	0.00%	0.17	0.17	0.00%	0.00%	0.16	0.16	-0.01
6.7. PATRIA BANK EUR	0.00%	0.00%	278.10	278.10	0.00%	0.00%	278.88	278.88	0.78
6.8. LIBRA EUR	0.00%	0.00%	174.83	174.83	0.00%	0.00%	145.22	145.22	-29.61
6.9. Banca Comerciala Romana - HUF	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.04%	0.04%	6,896.62	6,896.62	6,896.62
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.	8.10%	8.05%	1,018,806.26	1,018,806.26	2.92%	2.91%	516,916.50	516,916.50	-501,889.76
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	-2.87%	-2.85%	-360,977.22	-360,977.22	0.54%	0.54%	95,719.60	95,719.60	456,696.82
10.4. sume in curs de decontare	-7.20%	-7.16%	-905,667.09	-905,667.09	0.54%	0.54%	95,719.60	95,719.60	1,001,386.69
10.5. sume in curs de rezolvare	4.33%	4.30%	544,689.87	544,689.87	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-544,689.87
II Total obligatii	0.65%	0.65%	82,239.28	82,239.28	0.56%	0.55%	98,403.91	98,403.91	16,164.63
1.1. Cheltuieli pentru plata comisionelor datorate S.A.I.	0.61%	0.60%	76,090.61	76,090.61	0.52%	0.51%	91,419.55	91,419.55	15,328.93
1.1.1. Comision de administrare	0.16%	0.15%	19,609.92	19,609.92	0.16%	0.16%	29,090.70	29,090.70	9,480.78
1.1.3. Comision de succes	0.45%	0.45%	56,480.70	56,480.70	0.35%	0.35%	62,328.85	62,328.85	5,848.15
2. Cheltuieli pentru plata comisionelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	1,868.97	1,868.97	0.02%	0.02%	2,848.29	2,848.29	979.32
2.1. Cheltuieli pentru plata comisionelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	1,023.86	1,023.86	0.01%	0.01%	1,802.27	1,802.27	778.41
2.2. Cheltuieli pentru plata comisionelor datorate custodelui	0.01%	0.01%	845.12	845.12	0.01%	0.01%	1,046.03	1,046.03	200.91
3. Cheltuieli cu comisionele datorate intermediarilor	0.02%	0.02%	1,929.33	1,929.33	0.01%	0.01%	1,646.40	1,646.40	-282.93
7. Cheltuieli cu plata comisionelor/taxelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	939.56	939.56	0.01%	0.01%	1,367.89	1,367.89	428.34
8. Cheltuieli cu auditul financiar	0.01%	0.01%	1,032.17	1,032.17	0.00%	0.00%	513.25	513.25	-518.93
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	378.63	378.63	0.00%	0.00%	608.53	608.53	229.90
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.35%	12,575,165.11	12,575,165.11	100.00%	99.45%	17,678,575.59	17,678,575.59	5,103,410.48

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	La data de 30.06.2017	La data de 31.12.2016	Diferente
Valoarea activului net	17,678,575.59	12,575,165.11	5,103,410.48
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1,534,012.7243	1,126,990.4241	407,022.3002
Valoarea unitara a activului net	11.5244	11.1582	0.3662

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	%	%
DIGI COMMUNICATIONS N.V.	DIGI	30-Jun-17	8,000	0.0455	39.0000	312.000,00	0.008	1.755
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	30-Jun-17	15,345	1.0000	30.7500	471.858,75	0.004	2.654
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	30-Jun-17	35,904	0.1000	1.7720	63.621,89	0.006	0.358
TOTAL						847.480,64		4.767

Sume in curs de decontare pentru actiuni tranzactionate pe o piata reglementata din Romania

Denumire Emitent	Tip valoare mobiliara	Numar instrumente financiare tranzactionate	Valoarea unitara a instrumentului financiar	Valoare actualizată	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	%	%
DIGI COMMUNICATIONS N.V.	Actiune	-2.467,00	-38.8000	95.719,60	0.006	0.538
TOTAL				95.719,60		0,538

2. Obligatiuni admise la tranzactionare

2.1. 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 cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
CJ HUNEDOARA	HUE26	-	1,000	13-Aug-14	15-May-17	15-Aug-17	22.31	0.01	0.10	0.42	-	22.828,74	0.167	0.128
CJ HUNEDOARA	HUE26	-	6,000	13-Aug-14	15-May-17	15-Aug-17	26.19	0.01	0.10	0.36	-	159.914,45	1.000	0.900
TOTAL												182.743,20		1,028

2.2. Obligatiuni tranzactionate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB19	-	40	27-Sep-16	27-Sep-16	27-Sep-17	10.000,00	0.94	258.78	0.00	-	410.351,11	0.133	2.308
UNICREDIT TIRIAC BANK S.A.	UCT18	-	45	8-Oct-15	15-Jun-17	15-Dec-17	10.590,00	1.14	27.84	-380,10	-	460.698,01	0.082	2.592
UNICREDIT TIRIAC BANK S.A.	UCT18	-	5	25-Mar-16	15-Jun-17	15-Dec-17	10.850,00	0.69	27.84	-484,67	-	51.965,84	0.009	0.292
Vrancart Adjud	VNC24	-	2,500	17-Mar-17	25-Apr-17	25-Jul-17	100,00	0.01	0.53	0.00	-	251,317,05	0.000	1.414
TOTAL												1.174.332,02		6,606

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

1 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate 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	%	%
DAIMLER AG	DE0007100000	30-Jun-17	663	0.0000	63.3700	4.5539	Germania	191.328,97	0.000	1.076
Renault	FR0000131906	30-Jun-17	298	3.8100	79.2500	4.5539	Franta	107.547,18	0.000	0.605
TOTAL								298.876,15		1,681

3 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in GBP

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR GBP/RON	Piata de achizitie	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				GBP	GBP	lei		lei	%	%
SHIRE	JE00B2QKY057	30-Jun-17	738	0.0500	42.3800	5.1852	Germania	162.174,60	0.000	0.912
TOTAL								162.174,60		0,912

4 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - 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	%	%
MOL HUNGARIAN OIL & GAS	HU0000068952	30-Jun-17	750	0.0000	21.225,0000	0.0147	Ungaria	234.546,86	0.001	1.319
TOTAL								234.546,86		1,319

2. Obligatiuni admise la tranzactionare

2.1. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denumite in RON

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 cumulat(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	2	24-Jun-14	7-Apr-17	7-Apr-18	281,837.58	38.41	4,491.67	-16,611.57	-	539,435.36	0.085	3.034
International Personal Finance PLC	XS1527191081	-	1	6-Dec-16	6-Dec-16	6-Dec-17	500,000.00	109.59	22,684.93	0.00	-	522,684.93	0.090	2.940
TOTAL												1,062,120.29		5.975

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 cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulat(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS0989152573	-	50	28-Dec-16	7-Nov-16	7-Nov-17	1,032.50	0.12	27.48	-	1,043.4150	4.5539	243,837.31	0.006	1.372
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	150	26-Oct-16	15-Apr-17	15-Oct-17	1,000.00	0.14	10.56	-	1,054.3800	4.5539	727,441.50	0.021	4.092
EMERALD CAP	XS1523215116	-	200	2-Dec-16	5-May-17	7-Aug-17	1,000.00	0.05	2.80	-	-	4.5539	913,333.90	5.000	5.138
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	19-Jun-17	19-Jun-17	20-Jun-18	994.27	0.08	0.95	0.04	-	4.5539	228,614.10	5.000	1.275
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	19-Jun-17	19-Jun-17	20-Jun-18	1,008.75	0.07	0.95	(0.06)	-	4.5539	229,889.46	5.000	1.293
New Europe Property Investments PLC	XS1325078308	-	100	11-May-16	26-Feb-17	26-Feb-18	1,024.76	0.10	12.84	-	1,086.9350	4.5539	500,827.66	0.000	2.817
ORLEN CAPITAL AB	XS11082660744	-	100	29-Apr-16	30-Jun-17	30-Jun-18	1,018.50	0.07	4.08	-	1,069.2000	4.5539	486,934.18	0.020	2.730
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	50	30-Sep-15	7-May-17	7-Aug-17	941.25	0.07	4.08	-	959.6300	4.5539	219,432.11	0.010	1.234
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	100	24-Nov-15	7-May-17	7-Aug-17	988.00	0.07	4.08	-	959.6300	4.5539	438,864.21	0.020	2.469
Societe Generale	XS1490846810	-	100	24-Nov-16	6-Jun-17	6-Dec-17	1,000.00	0.05	1.22	-	4.5539	4.5539	455,945.01	2.632	2.565
Turkiye Garanti Bankasi	XS1084838496	-	50	24-Mar-17	8-Jul-16	8-Jul-17	1,031.00	0.09	33.10	-	1,036.7700	4.5539	243,604.67	0.010	1.370
TOTAL													4,686,724.12		26.364

2.3. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale 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 cumulat(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
MACEDONIA	XS1087984164	-	100	30-Dec-16	24-Jul-16	24-Jul-17	1,005.50	0.11	37.25	-	1,046.5550	4.5539	493,551.78	0.000	2.776
ROMANIA	XS1060842975	-	100	23-May-17	24-Apr-17	24-Apr-18	1,133.90	0.10	6.75	-	1,139.6650	4.5539	522,067.49	0.000	2.937
ROMANIA	XS112978524	-	100	23-May-17	28-Oct-16	28-Oct-17	1,084.23	0.08	19.38	-	1,086.9050	4.5539	503,789.63	0.000	2.834
ROMANIA	XS1312891549	-	100	16-May-17	29-Oct-16	29-Oct-17	1,062.50	0.08	18.46	-	1,064.8150	4.5539	493,312.10	0.000	2.776
ROMANIA	XS1313004928	-	50	4-Apr-17	29-Oct-16	29-Oct-17	1,058.60	0.11	26.01	-	1,048.5900	4.5539	244,681.11	0.000	1.375
ROMANIA	XS1313004928	-	150	19-Apr-17	29-Oct-16	29-Oct-17	1,043.41	0.11	26.01	-	1,048.5900	4.5539	734,043.33	0.000	4.129
ROMANIA	XS1599193403	-	100	19-Apr-17	19-Apr-17	19-Apr-18	996.83	0.07	4.75	-	998.1150	4.5539	456,694.69	0.000	2.569
TOTAL													3,448,140.12		19.397

3. Alte valori mobiliare admise la tranzactionare pe o piata reglementata (Certificate de investitii)

Emitent	Tip valoare mobiliara	Simbol	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Numar valori mobiliare	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM
					eur	lei	lei	%
Commerzbank AG	Certificate investitii	DE000CZ93MG5	30-Jun-17	31,700	0.95	4.5539	137,140.70	0.771
Societe Generale	Certificate investitii	DE000SG3G269	30-Jun-17	1,800	22.04	4.5539	180,662.32	1.016
TOTAL							317,803.02	1.788

III.Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat nemembru sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat nemembru,

1 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR USD/RON	Piata de achizitie	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				USD	USD	lei		USD	%	%
Alphabet	US02079K1079	30-Jun-17	80	0.0010	908.73	3.9915	Germania	290,175.66	0.000	1.632
Apple Inc.	US0378331005	30-Jun-17	420	0.0000	144.02	3.9915	Germania	241,439.45	0.000	1.358
JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	30-Jun-17	200	1.0000	132.29	3.9915	Germania	105,607.11	0.000	0.594
Pfizer Inc.	US7170811035	30-Jun-17	700	0.0500	33.59	3.9915	Germania	93,852.14	0.000	0.528
WHIRLPOOL CORP	US9633201069	30-Jun-17	393	1.0000	191.62	3.9915	Germania	300,586.53	0.001	1.691
TOTAL								1,031,660.89		5.803

1.2 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in CHF

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR CHF/RON	Piata de achizitie	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				CHF	CHF	lei		lei	%	%
Roche Genussscheine	CH0012032048	30-Jun-17	185	0.0000	244.2000	4.1655	Germania	188,184.79	0.000	1.059
TOTAL								188,184.79		1.059

IX. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	0.000
Citi Bank	0.00	0.000
CREDIT EUROPE BANK SA	356.43	0.002
Libra Internet Bank	78.39	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000
PATRIA BANK	0.00	0.000
Total	434.82	0.002

2. Disponibilii în conturi curente și numerar denumite în EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere în activul total al OPCVM
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	45,082.30	4.5539	205,300.29	1.155
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	4.5539	0.00	0.000
Citi Bank	0.00	4.5539	0.00	0.000
Libra Internet Bank	31.89	4.5539	145.22	0.001
OTP BANK ROMANIA	4.58	4.5539	20.86	0.000
PATRIA BANK	61.24	4.5539	278.88	0.002
TOTAL			205,745.25	1.157

3. Disponibilii în conturi curente și numerar denumite în USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere în activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	424.54	3.9915	1,694.55	0.010
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	3.9915	0.00	0.000
Citi Bank	0.00	3.9915	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.04	3.9915	0.16	0.000
TOTAL			1,694.71	0.010

4. Disponibilii în conturi curente și numerar denumite în HUF

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare actualizata	Pondere în activul total al OPCVM
	HUF	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	468,075.20	0.0147	6,896.62	0.039
TOTAL			6,896.62	0.039

X. Depozite bancare
1. Depozite bancare denumite în lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala	Pondere în activul total al OPCVM
			lei	lei	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	30-Jun-17	1-Jul-17	1,661,754.97	0.00	0.00	1,661,754.97	9.348
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	30-Jun-17	3-Jul-17	64,523.35	0.02	0.02	64,523.37	0.363
OTP BANK ROMANIA	30-Jun-17	3-Jul-17	1,639,014.82	2.25	2.25	1,639,017.07	9.220
Total						3,365,295.40	18.931

XII. Instrumente financiare derivate negociate în afara pietelor reglementate
1. Contracte forward EUR/RON

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totala	Pondere în activul total al OPCVM
					lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300,000.00	Vanzare	25-May-17	28-May-18	4.6101	4.5539	4.6004	0.0097	2,910.00	0.016
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	400,000.00	Vanzare	4-Oct-16	4-Oct-17	4.5006	4.5539	4.5659	-0.0653	-26,120.00	-0.147
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	200,000.00	Vanzare	5-Oct-16	6-Oct-17	4.5057	4.5539	4.5662	-0.0605	-12,100.00	-0.068
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300,000.00	Vanzare	25-Jul-16	25-Jul-17	4.4824	4.5539	4.5665	-0.0741	-22,230.00	-0.125
Citi Bank	190,000.00	Vanzare	14-Jun-17	14-Jun-18	4.6234	4.5539	4.6029	0.0205	3,895.00	0.022
Citi Bank	218,000.00	Vanzare	18-Apr-17	18-Apr-18	4.5809	4.5539	4.5946	-0.0137	-2,986.60	-0.017
ING BANK Romania	265,000.00	Vanzare	19-May-17	21-May-18	4.6225	4.5539	4.5994	0.0231	6,121.50	0.034
TOTAL									-50,510.10	-0.284

XIII. Titluri de participare la OPCVM / AOPC
2. Titluri de participare denumite în EUR

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedinte în care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPCVM
				eur	eur	lei	lei	%	%
iShares Dow Jones Global Titans 50 UCITS ETF	DE0006289382	30-Jun-17	1,235.00	-	31.6100	4.5539	177,776.74	0.021	1.000
db x-trackers II iBoxx EUR High Yield Bond UCITS E	LU1109942653	30-Jun-17	2,214.00	-	17.8600	4.5539	180,070.50	0.014	1.013
TOTAL							357,847.24		2.013

3. Titluri de participare denumite în USD

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedinte în care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPCVM
				usd	usd	lei	lei	%	%
ISHARES V PUBLIC LIMITED COMPANY ISHRS G	IE00B6R52036	30-Jun-17	4,320.00	-	9.23	3.9915	159,069.26	0.010	0.895
TOTAL							159,069.26		0.895

Evolutia activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	30-Jun-15	30-Jun-16	30-Jun-17
Activ net	9,245,071.46	12,971,067.88	17,678,575.57
VUAN	1,079,2935	10,7879	11,5244

OTP Asset Management Romania SAI SA

 Membru Directorat,
Dan POPOVICI

 Intocmit,
Filon ANGHEL