

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: Aviz 02/13.02.2013
Cod inscriere: CSC08FIIR/400031

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2015 - 31.12.2016

Denumire element	31.12.2015				31.12.2016				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.35%	100.00%	15,039,121.90	15,039,121.90	100.65%	100.00%	12,657,404.39	12,657,404.39	-2,381,717.51
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	70.83%	70.58%	10,614,930.09	10,614,930.09	90.17%	89.58%	11,338,815.56	11,338,815.56	723,885.47
1.1. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania, din care:	32.18%	32.07%	4,822,425.81	4,822,425.81	21.01%	20.88%	2,642,512.30	2,642,512.30	-2,179,913.51
1.1.1. actiuni	20.15%	20.08%	3,019,879.44	3,019,879.44	12.15%	12.07%	1,528,121.32	1,528,121.32	-1,491,758.12
1.1.3. obligatiuni, din care:	12.03%	11.99%	1,802,546.38	1,802,546.38	8.86%	8.80%	1,114,390.98	1,114,390.98	-688,155.39
1.1.3.1 Obligatiuni corporative cotate	3.17%	3.16%	475,576.79	475,576.79	7.33%	7.29%	922,093.24	922,093.24	446,516.45
1.1.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	7.44%	7.42%	1,115,352.95	1,115,352.95	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1,115,352.95
1.1.3.3 Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	1.41%	1.41%	211,616.63	211,616.63	1.53%	1.52%	192,297.74	192,297.74	-19,318.89
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	38.65%	38.52%	5,792,504.27	5,792,504.27	59.92%	59.53%	7,535,072.18	7,535,072.18	1,742,567.91
1.2.1. actiuni	6.85%	6.82%	1,026,317.78	1,026,317.78	5.23%	5.19%	657,369.71	657,369.71	-368,948.06
1.2.3. obligatiuni, din care:	29.59%	29.49%	4,435,014.82	4,435,014.82	51.59%	51.26%	6,487,699.18	6,487,699.18	2,052,684.36
1.2.3.1 Obligatiuni corporative cotate	22.84%	22.76%	3,423,534.46	3,423,534.46	39.85%	39.59%	5,011,174.01	5,011,174.01	1,587,639.55
1.2.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	6.75%	6.73%	1,011,480.36	1,011,480.36	11.74%	11.67%	1,476,525.17	1,476,525.17	465,044.81
1.2.5. alte valori mobiliare, instrumente ale pietei monetare	2.21%	2.20%	331,171.68	331,171.68	3.10%	3.08%	390,003.29	390,003.29	58,831.61
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	9.23%	9.17%	1,161,231.07	1,161,231.07	1,161,231.07
1.3.1. actiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	9.23%	9.17%	1,161,231.07	1,161,231.07	1,161,231.07
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 pietei 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:	30.05%	29.94%	4,503,246.35	4,503,246.35	5.87%	5.83%	737,799.12	737,799.12	-3,765,447.23
4.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	30.05%	29.94%	4,503,246.35	4,503,246.35	5.87%	5.83%	737,799.12	737,799.12	-3,765,447.23
4.1.1. OTP BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	1.20%	1.19%	150,435.78	150,435.78	150,435.78
4.1.2. Credit Europe Bank SA	7.48%	7.45%	1,120,997.26	1,120,997.26	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1,120,997.26
4.1.3. BANCA COMERCIALA ROMANA	2.97%	2.96%	445,710.42	445,710.42	4.13%	4.10%	519,342.64	519,342.64	73,632.22
4.1.4. BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	1.33%	1.33%	200,004.44	200,004.44	0.54%	0.54%	68,020.70	68,020.70	-131,983.75
4.1.5. Libra Bank	10.11%	10.07%	1,514,771.73	1,514,771.73	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1,514,771.73
4.1.6. PATRIA BANK	8.15%	8.12%	1,221,762.49	1,221,762.49	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1,221,762.49
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 terț	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	-0.89%	-0.89%	-133,550.00	-133,550.00	-0.62%	-0.62%	-78,130.00	-78,130.00	55,420.00
5.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.89%	-0.89%	-133,550.00	-133,550.00	-0.62%	-0.62%	-78,130.00	-78,130.00	55,420.00
5.4.1. Contracte forward	-0.89%	-0.89%	-133,550.00	-133,550.00	-0.62%	-0.62%	-78,130.00	-78,130.00	55,420.00
6 Conturi curente si numerar	0.29%	0.29%	43,369.70	43,369.70	0.01%	0.01%	1,090.67	1,090.67	-42,279.03
6.1. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00%	0.00%	331.31	331.31	0.00%	0.00%	151.95	151.95	-179.36
6.2. BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.13%	0.13%	19,117.63	19,117.63	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-19,117.63
6.3. OTP BANK ROMANIA	0.04%	0.04%	6,594.24	6,594.24	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-6,594.24
6.4. VENETO BANCA	0.00%	0.00%	269.74	269.74	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-269.74
6.5. OTP BANK EURO	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	20.80	20.80	20.80
6.6. Credit Europe Bank SA	0.11%	0.11%	16,324.83	16,324.83	0.00%	0.00%	356.43	356.43	-15,968.40
6.7. LIBRA BANK	0.00%	0.00%	257.78	257.78	0.00%	0.00%	108.39	108.39	-149.39
6.8. Volksbank RON	0.00%	0.00%	163.16	163.16	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-163.16
6.9. VOLKSBANK EUR	0.00%	0.00%	311.01	311.01	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-311.01
6.10. OTP BANK USD	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.17	0.17	0.17
6.11. PATRIA BANK EUR	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	278.10	278.10	278.10
6.12. LIBRA EUR	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	174.83	174.83	174.83
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	-7.44%	-7.41%	-1,115,149.08	-1,115,149.08	0.00%	0.00%	0.00	0.00	1,115,149.08
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	-7.44%	-7.41%	-1,115,149.08	-1,115,149.08	0.00%	0.00%	0.00	0.00	1,115,149.08
8 Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.	9.74%	9.70%	1,459,015.61	1,459,015.61	8.10%	8.05%	1,018,806.26	1,018,806.26	-440,209.35
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	-2.22%	-2.21%	-332,740.78	-332,740.78	-2.87%	-2.85%	-360,977.22	-360,977.22	-28,236.44

10.4.	sume in curs de decontare	-2.22%	-2.21%	-332,740.78	-332,740.78	-7.20%	-7.16%	-905,667.09	-905,667.09	-572,926.31
10.5.	sume in curs de rezolvare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	4.33%	4.30%	544,689.87	544,689.87	544,689.87
II	Total obligatii	0.35%	0.35%	52,155.23	52,155.23	0.65%	0.65%	82,239.28	82,239.28	30,084.05
1.	Cheltuieli pentru plata comisiunelor datorate S.A.I.	0.31%	0.31%	46,909.17	46,909.17	0.61%	0.60%	76,090.61	76,090.61	29,181.44
1.1.	Comision de administrare	0.17%	0.17%	25,048.22	25,048.22	0.16%	0.15%	19,609.92	19,609.92	-5,438.31
1.3.	Comision de succes	0.15%	0.15%	21,860.95	21,860.95	0.45%	0.45%	56,480.70	56,480.70	34,619.75
2.	Cheltuieli pentru plata comisiunelor datorate depozitarului	0.02%	0.02%	2,346.02	2,346.02	0.01%	0.01%	1,868.97	1,868.97	-477.05
2.1.	Cheltuieli pentru plata comisiunelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	1,626.81	1,626.81	0.01%	0.01%	1,023.86	1,023.86	-602.95
2.2.	Cheltuieli pentru plata comisiunelor datorate custodelui	0.00%	0.00%	719.21	719.21	0.01%	0.01%	845.12	845.12	125.91
3.	Cheltuieli cu comisiunile datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	692.61	692.61	0.02%	0.02%	1,929.33	1,929.33	1,236.72
7.	Cheltuieli cu plata comisiunelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	1,169.42	1,169.42	0.01%	0.01%	939.56	939.56	-229.87
8.	Cheltuieli cu auditul financiar	0.01%	0.01%	1,035.00	1,035.00	0.01%	0.01%	1,032.17	1,032.17	-2.83
9.	Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	3.01	3.01	0.00%	0.00%	378.63	378.63	375.62
III	Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.65%	14,986,966.67	14,986,966.67	100.00%	99.35%	12,575,165.11	12,575,165.11	-2,411,801.56

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	La data de 31.12.2016	La data de 31.12.2015	Diferente
Valoare activ net	12,575,165.11	14,986,966.67	-2,411,801.56
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1,126,990.4241	13,988.4182	1,113,002.0059
Valoarea unitara a activului net	11.1582	1,071.3839	-1,060.2257

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	lei	%	%				
COMPET SA Ploiesti	COTE	30-Dec-16	4.756	3.3000	78.8000	374.772.80	0.055	2.961					
FONDUL PROPRIETATEA	FP	30-Dec-16	463.256	0.8500	0.7950	369.288.52	0.004	2.910					
OMV PETROM S.A.	SNP	30-Dec-16	835.000	0.1000	0.2610	217.935.00	0.001	1.722					
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	30-Dec-16	7.345	1.0000	25.0000	183.625.00	0.002	1.451					
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	30-Dec-16	750	10.0000	294.0000	220.500.00	0.006	1.742					
SIF OLTEANIA S.A.	SIF5	30-Dec-16	100.000	0.1000	1.6300	163.000.00	0.0046	1.288					
TOTAL						1.528.121.32		12.073					

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 scadentei cupon	Valoare initiala		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	%	%		
CJ HUNEDOARA	HUE26	-	6.000	13-Aug-14	15-Nov-16	15-Feb-17	27.59	0.01	0.10	0.36	-	168.282.65	1.000	1.330			
CJ HUNEDOARA	HUE26	-	1.000	13-Aug-14	15-Nov-16	15-Feb-17	23.50	0.01	0.10	0.41	-	24.015.09	0.167	0.190			
TOTAL												192.297.74	1.167	1.519			

2.2. Obligatiuni tranzactionate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala		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	%	%		
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB19	-	40	27-Sep-16	27-Sep-16	27-Sep-17	10.000.00	0.94	88.78	0.00	-	403.551.11	0.133	3.188			
UNICREDIT TIRIAC BANK S.A.	UCT18	-	45	8-Oct-15	15-Dec-16	15-Jun-17	10.590.00	1.14	27.84	-270.64	-	465.623.70	0.082	3.679			
UNICREDIT TIRIAC BANK S.A.	UCT18	-	5	25-Mar-16	15-Dec-16	15-Jun-17	10.850.00	0.69	27.84	-294.15	-	52.918.43	0.009	0.418			
TOTAL												922.093.24	0.224	7.285			

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) - denumite in EUF

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala		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-Dec-16	358	0.0000	70.7200	4.5411	Germania	114.970.48	0.001	0.908			
PORR AG	AT0000609607	30-Dec-16	1.386	0.0000	38.9200	4.5411	Austria	244.961.10	0.005	1.935			
Renault	FR0000131906	30-Dec-16	298	3.8100	84.5100	4.5411	Franta	114.362.97	0.000	0.904			
TOTAL								474.294.55		3.747			

3 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in GBI

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala		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-Dec-16	738	0.0500	46.8400	5.2961	Germania	183.075.16	0.000	1.446			
TOTAL								183.075.16		1.446			

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		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	%	%		
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	2	24-Jun-14	7-Apr-16	7-Apr-17	281.837.58	38.41	14.116.67	-13.870.58	-	564.167.33	0.085	4.457			
International Personal Finance PLC	XS1527191081	-	1	6-Dec-16	6-Dec-16	6-Dec-17	500.000.00	109.59	2.739.73	0.00	-	502.739.73	0.090	3.972			
TOTAL												1.066.907.06	0.175	8.429			

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		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 OPCVM	
							eur	eur				lei	lei	%	%				
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS0989152573	-	50	28-Dec-16	7-Nov-16	7-Nov-17	1.032.50	0.12	6.29	-	1.029.3750	4.5411	235.152.39	0.006	1.858				
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	150	26-Oct-16	26-Oct-16	15-Apr-17	1.000.00	0.14	9.03	-	1.061.2500	4.5411	729.035.76	0.021	5.760				
EMERALD CAP	XS1523215116	-	200	2-Dec-16	2-Dec-16	6-Feb-17	1.000.00	0.05	1.44	-	4.5411	909.526.68	5.000	7.186					
New Europe Property Investments PLC	XS1325078308	-	100	11-May-16	26-Feb-16	26-Feb-17	1.024.76	0.10	31.66	-	1.056.7700	4.5411	494.266.87	0.000	3.905				
ORLEN CAPITAL AB	XS1092860744	-	100	29-Apr-16	30-Jun-16	30-Jun-17	1.018.50	0.07	12.60	-	1.048.7600	4.5411	481.975.43	0.020	3.806				
OTP Bank NYRT	XS0274147296	-	50	30-Sep-15	7-Nov-16	7-Feb-17	941.25	0.07	4.03	-	935.0000	4.5411	213.211.57	0.010	1.694				
OTP Bank NYRT	XS0274147296	-	100	24-Nov-15	7-Nov-16	7-Feb-17	988.00	0.07	4.03	-	935.0000	4.5411	426.423.14	0.020	3.369				
Societe Generale	XS1490846810	-	100	24-Nov-16	6-Dec-16	6-Jun-17	1.000.00	0.05	1.24	-	-	4.5411	454.675.11	2.632	3.592				
TOTAL													3.944.266.96	0.067	31.162				

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

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala		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 OPCVM	
							eur	eur				lei	lei	%	%				
MACEDONIA	XS1087984164	-	100	30-Dec-16	24-Jul-16	24-Jul-17	1.005.50	0.11	17.42	-	1.006.1500	4.5411	464.815.49	0.000	3.672				
Republic of Croatia	XS0645940285	-	100	4-Nov-16	9-Jul-16	9-Jul-17	1.094.30	0.16	28.17	-	1.085.7800	4.5411	505.854.84	0.000	3.997				
Republic of Croatia	XS0645940285	-	100	4-Nov-16	9-Jul-16	9-Jul-17	1.094.30	0.16	28.17	-	1.085.7800	4.5411	505.854.84	0.000	3.997				
TOTAL													1.476.525.17	0.000	11.665				

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 investiti	DE000CZ93MG5	30-Dec-16	31.700	1.33	4.5411	191.457.32	1.513
Societe Generale	Certificate investiti	DE000SG3G269	30-Dec-16	1.800	24.29	4.5411	198.545.97	1.569
TOTAL							390.003.29	3.081

Sume in curs de decontare pentru valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din alt stat membru in GBP

Emitent	Tipul de valoare mobiliara	Simbol	Valoarea unitara	Numar valori mobiliare tranzactionate	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs valutar GBP/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
			GBP		lei	lei	lei	%	%
SHIRE	Actiune	JE00B2QKY057	46.4734	738.00	4.5411	5.2961	-181.642.18	0.000	-1.435
TOTAL							-181.642.18		-1.435

III.Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat membru sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat membru
1 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in USI

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-Dec-16	80	0.0010	771.82	4.3033	Germania	265.709.84	0.000	2.099
Apple Inc.	US0378331005	30-Dec-16	420	0.0000	115.82	4.3033	Germania	209.331.45	0.000	1.654
JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	30-Dec-16	200	1.0000	115.21	4.3033	Germania	99.156.64	0.000	0.783
Pfizer, Inc.	US7170811035	30-Dec-16	700	0.0500	32.48	4.3033	Germania	97.839.83	0.000	0.773
WHIRLPOOL CORP	US9633201069	30-Dec-16	393	1.0000	181.77	4.3033	Germania	307.408.86	0.001	2.429
TOTAL								979.446.61		7.738

1.2 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in CHI

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-Dec-16	185	0.0000	232.6000	4.2245	Germania	181.784.46	0.000	1.436
TOTAL								181.784.46		1.436

IX. Disponibil in conturi curente si numera
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
CREEDIT EUROPE BANK SA	356.43	0.003
Libra Internet Bank	108.39	0.001
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000
PATRIA BANK	0.00	0.000
Numerar in casierie	0.00	0.000
Total	464.82	0.004

2. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in EUI

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	4.5411	0.00	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	4.5411	0.00	0.000
Libra Internet Bank	38.50	4.5411	174.83	0.001
OTP BANK ROMANIA	4.58	4.5411	20.80	0.000
PATRIA BANK	61.24	4.5411	278.10	0.002
TOTAL			473.73	0.004

3. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in USI

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	35.31	4.3033	151.95	0.001
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	4.3033	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.04	4.3033	0.17	0.000
TOTAL			152.12	0.001

4. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in HUI

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	HUF	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.0146	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-16	31-Dec-16	56.528.03	0.00	0.00	56.528.03	0.447
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	30-Dec-16	3-Jan-17	68.020.68	0.02	0.02	68.020.70	0.537
OTP BANK ROMANIA	30-Dec-16	3-Jan-17	150.435.37	0.41	0.41	150.435.78	1.189
Total						274.984.51	2.173

2. Depozite bancare denuminate in EUR

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Curs valutar BNR	Valoare totală	Pondere în activul total
			eur	eur	eur	lei		lei
Banca Comercială Română	30-Dec-16	31-Dec-16	43.826.09	0.00	0.00	4.5411	199.018.66	1.572
TOTAL							199,018.66	1.572

3. Depozite bancare denuminate in USD

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Curs valutar BNR	Valoare totală	Pondere în activul total
			eur	eur	eur	lei		lei
Banca Comercială Română	30-Dec-16	3-Jan-17	61.300.00	0.85	0.85	4.3033	263.795.95	2.084%
TOTAL							263,795.95	2.084%

XII. Instrumente financiare derivate negociate în afara pietelor reglementate

1. Contracte forward EUR/RON

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achiziției	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totală	Pondere în activul total al OPCVM
					lei	lei				lei
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300.000.00	V	25-Nov-16	25-May-17	4.4824	4.5309	4.5689	-0.0865	-25.950.00	-0.205
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300.000.00	V	25-Jul-16	25-Jul-17	4.5385	4.5309	4.5603	-0.0218	-6.540.00	-0.052
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	400.000.00	V	4-Oct-16	4-Oct-17	4.5006	4.5309	4.5783	-0.0777	-31.080.00	-0.246
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	200.000.00	V	5-Oct-16	6-Oct-17	4.5057	4.5309	4.5785	-0.0728	-14.560.00	-0.115
TOTAL									-78,130.00	-0.617

2. Titluri de participare denuminate in USD

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piață	Curs valutar BNR	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPCVM
				usd	usd	lei		lei	%
FDI OTP DOLLAR BOND	ROFDIN0001X7	-	6.402.65	10.8495	-	4.3033	298.931.12	0.814	2.362
iShares MSCI USA Small Cap UCITS ETF (A)	IE00B3VVM098	30-Dec-16	152.00	274.0250	-	4.3033	179.240.19	0.000	1.416
TOTAL							478,171.31		3,778

3. Titluri de participare denuminate in EUR

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piață	Curs valutar BNR	Valoare totală	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-Dec-16	1.235.00	-	32.0300	4.5411	179.632.52	0.000	1.419
db x-trackers II iBoxx EUR High Yield Bond UCITS	LU1109942653	30-Dec-16	2.214.00	-	18.0400	4.5411	181.374.08	0.000	1.433
TOTAL							361,006.60		2,852

4. Titluri de participare denuminate in GBP

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piață	Curs valutar BNR	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPCVM
				gbp	gbp	lei		lei	%
iShares \$ TIPS UCITS ETF (GBP)	IE00B1FZSC47	30-Dec-16	210.00	-	161.5100	5.2961	179.628.35	0.000	1.419
TOTAL							179,628.35		1,419

Sume în curs de decontare pentru titluri de participare denuminate în EUF

Denumire fond	Valoarea unitară de piață	Nr. titluri de participare tranzacționate	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare ale unui OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPCVM
				eur	%	%
iShares Dow Jones Global Titans 50 UCITS ETF	32.38	1.235.00	4.5411	-181.595.41	0.000	-1.435
db x-trackers II iBoxx EUR High Yield Bond UCITS	18.0700	2.214.00	4.5411	-181.675.70	0.000	-1.435
iShares \$ TIPS UCITS ETF (GBP)	190.2400	210.00	4.5411	-181.418.76	0.000	-1.433
TOTAL				-544,689.87		-4,303

Sume în curs de decontare pentru titluri de participare denuminate în USC

Denumire fond	Valoarea unitară de piață	Nr. titluri de participare tranzacționate	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare ale unui OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPCVM
				eur	%	%
iShares MSCI USA Small Cap UCITS ETF USD (A)	274.1700	152.000000	4.3033	-179.335.04	0.000	-1.417
TOTAL				-179,335.04		-1,417

Evoluția activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	31-Dec-14	31-Dec-15	31-Dec-16
Activ net	12.485.756.21	14.986.966.67	12.575.165.10
VUAN	1.034.6511	1.071.3839	11.1582

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICIIntocmit,
Filon ANGHEL