

SAI: OTP Asset Management Romania
SAI SADecizie autorizare: PJR05SAIR/400023 Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007
CUI: 22264941 Inregistrare CNRC: J40/15502/15.08.2007
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

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2017 - 30.06.2018

Denumire element	31.12.2017				30.06.2018				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.10%	100.00%	192,523,656.32	192,523,656.32	100.10%	100.00%	176,739,290.53	176,739,290.53	-15,784,365.79
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	72.09%	72.02%	138,659,793.08	138,659,793.08	58.44%	58.38%	103,163,493.55	103,163,493.55	-35,476,299.53
1.1. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare din Romania, din care:	15.67%	15.66%	30,145,637.19	30,145,637.19	12.92%	12.91%	22,809,435.81	22,809,435.81	-7,336,201.38
1.1.1. obligatiuni, din care:	8.51%	8.50%	16,373,407.82	16,373,407.82	8.74%	8.73%	15,438,100.94	15,438,100.94	-935,306.88
1.1.3.1 Obligatiuni corporative cotate	2.71%	2.71%	5,211,211.24	5,211,211.24	1.12%	1.12%	1,985,765.17	1,985,765.17	-3,225,446.06
1.1.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	4.45%	4.45%	8,561,018.14	8,561,018.14	3.05%	3.05%	5,385,569.70	5,385,569.70	-3,175,448.44
1.1.3.3 Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale									
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat membru, din care:	56.42%	56.36%	108,514,155.89	108,514,155.89	45.52%	45.48%	80,374,057.74	80,374,057.74	-28,140,098.14
1.2.3. obligatiuni, din care:	56.42%	56.36%	108,514,155.89	108,514,155.89	45.52%	45.48%	80,374,057.74	80,374,057.74	-28,140,098.14
1.2.3.1 Obligatiuni corporative cotate	44.34%	44.30%	85,284,181.01	85,284,181.01	43.38%	43.34%	76,596,497.51	76,596,497.51	-8,687,683.51
1.2.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	12.08%	12.07%	23,229,974.88	23,229,974.88	2.14%	2.14%	3,777,560.24	3,777,560.24	-19,452,414.64
1.3. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat tert, care opereaza pe o alta piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat tert, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobat 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
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:	0.50%	0.50%	971,117.54	971,117.54	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-971,117.54
3.1. valori mobiliare	0.50%	0.50%	971,117.54	971,117.54	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-971,117.54
3.1.2. obligatiuni neadmise la tranzactionare	0.50%	0.50%	971,117.54	971,117.54	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-971,117.54
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 Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4.1. Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare din Romania	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4.2. Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat membru	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4.3. Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat tert	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
5 Depozite bancare din care:	20.14%	20.12%	38,732,873.27	38,732,873.27	29.35%	29.32%	51,827,673.38	51,827,673.38	13,094,800.11
5.1. depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	20.14%	20.12%	38,732,873.27	38,732,873.27	29.35%	29.32%	51,827,673.38	51,827,673.38	13,094,800.11
5.1.1. OTP BANK ROMANIA	1.80%	1.80%	3,456,590.43	3,456,590.43	0.28%	0.28%	502,133.79	502,133.79	-2,954,456.64
5.1.2. CITI BANK	0.06%	0.06%	112,484.47	112,484.47	0.03%	0.03%	51,676.29	51,676.29	-60,808.18
5.1.3. Credit Europe Bank SA	12.30%	12.28%	23,648,939.31	23,648,939.31	14.25%	14.24%	25,164,662.63	25,164,662.63	1,515,723.33
5.1.4. BANCA ROMANIASCA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	6.87%	6.86%	12,125,219.53	12,125,219.53	12,125,219.53
5.1.5. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.04%	0.04%	72,001.50	72,001.50	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-72,001.50
5.1.6. BRD-GROUP SOCIETI GENERAL	0.11%	0.11%	218,648.43	218,648.43	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-218,648.43
5.1.7. Libra Bank	5.84%	5.83%	11,224,209.13	11,224,209.13	7.58%	7.57%	13,375,721.31	13,375,721.31	2,151,512.18
5.1.8. IDEA BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.34%	0.34%	608,259.83	608,259.83	608,259.83
5.2. 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
5.3. 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
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	-0.32%	-0.32%	-614,492.39	-614,492.39	0.56%	0.56%	984,159.01	984,159.01	1,598,651.39
6.1. instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6.2. instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6.3. instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat tert	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.32%	-0.32%	-614,492.39	-614,492.39	0.56%	0.56%	984,159.01	984,159.01	1,598,651.39
6.4.1. Contracte forward	-0.32%	-0.32%	-614,492.39	-614,492.39	0.56%	0.56%	984,159.01	984,159.01	1,598,651.39
6.4.2. Conturi curente si numerar	0.43%	0.43%	818,676.22	818,676.22	2.95%	2.94%	5,203,405.62	5,203,405.62	4,384,729.40
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 pe titluri de valoare	-2.43%	-2.43%	-4,669,161.10	-4,669,161.10	0.00%	0.00%	0.00	0.00	4,669,161.10
8.1. Titluri emise de administratia publica centrala	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
8.2. Contracte de tip repo pe titluri de valoare	-2.43%	-2.43%	-4,669,161.10	-4,669,161.10	0.00%	0.00%	0.00	0.00	4,669,161.10
9 Titluri de participare ale A.O.P./C.I.O.P./C.V.M.	9.68%	9.67%	18,624,876.82	18,624,876.82	8.80%	8.79%	15,540,586.10	15,540,586.10	-3,084,290.72
10 Dividende sau alte drepturi de incasat	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
11 Titluri suport pentru operatiuni de report	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
12 Alte active	0.00%	0.00%	-27.13	-27.13	0.00%	0.00%	-27.13	-27.13	-0.01
12.3. sume la S.S.I.F.	0.00%	0.00%	0.22	0.22	0.00%	0.00%	0.22	0.22	0.00
12.5. sume in curs de rezolvare	0.00%	0.00%	-27.35	-27.35	0.00%	0.00%	-27.35	-27.35	-0.01
Total obligatiuni	0.10%	0.10%	191,358.70	191,358.70	0.10%	0.10%	183,431.82	183,431.82	-7,926.88
1. Cheltuieli pentru plata comisionelor datorate S.A.I.	0.08%	0.08%	149,280.60	149,280.60	0.08%	0.08%	144,995.47	144,995.47	-4,285.13
2. Cheltuieli pentru plata comisionelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	23,697.07	23,697.07	0.01%	0.01%	22,841.48	22,841.48	-855.59
7. Cheltuieli cu plata comisionelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	13,822.83	13,822.83	0.01%	0.01%	13,320.13	13,320.13	-502.71
8. Cheltuieli cu auditul financiar	0.00%	0.00%	3,947.25	3,947.25	0.00%	0.00%	1,957.32	1,957.32	-1,989.94
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	610.94	610.94	0.00%	0.00%	317.43	317.43	-293.52
Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.90%	192,332,297.62	192,332,297.62	100.00%	99.90%	176,335,858.71	176,335,858.71	-15,776,438.91

*Datele prezentate sunt aferente ultimei valori certificate de Depozitarul fondului pentru data respectiva.

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 30.06.2018	Perioada corespunzatoare a anului precedent 30.06.2017	Diferente
Valoarea activ net	176,335,858.71	204,602,609.53	-15,776,438.91
Numar unitati de fondsiactiuni in circulatie	11,739,064.8545	13,806,182.4472	-1,126,534.6697
Valoarea unitara a activului net	15.0400	14.8196	0.0907

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICIIntocmit
Filon-Daniel ANGHIEL-GRIGORE

FDI OTP Obligatiuni – Situatia detaliata a activelor la data de 30.06.2018

1. 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 administratiilor publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoarea initiala	Cresterre zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret plata	Valoarea totala	Pondere in total obligatiuni emisiune	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
CJ HUNEDOARA	HUE26	-	15,000	6-Aug-14	15-May-18	16-Aug-18	lei 23,40	lei	0,01	0,21	0,36	lei 359,433,72	% 2,500	% 0,203
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PRMB20	-	100	4-May-15	4-May-19	4-May-19	10,000,00	0,78	55,81	-86,89	10,32 8500	1,092,050,07	0,051	0,577
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PRMB22	-	50	4-May-15	4-May-19	4-May-19	10,000,00	1,21	69,18	0,00	-	503,409,04	0,023	0,285
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PRMB25	-	85	4-May-15	4-May-18	4-May-19	10,000,00	1,40	79,64	0,00	-	856,769,73	0,038	0,485
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PRMB28	-	250	23-Apr-18	23-Apr-18	23-Apr-18	10,002,00	1,53	104,33	-0,04	-	2,526,572,89	0,450	1,430
Primaria Orașului Oravita	ORV27	-	100	1-Mar-09	15-Apr-19	15-Oct-19	65,450	0,01	4,47	0,00	-	60,994,13	0,001	0,024
Primaria Teus	TEU20	-	600	29-Sep-15	25-May-18	25-Nov-18	21,12	0,01	0,09	0,11	-	12,792,55	0,007	0,007
Municipiul Timisoara	TIM26C	-	890	1-Mar-09	15-May-18	15-Aug-18	46,80	0,00	0,15	0,00	-	46,480,01	0,006	0,026
TOTAL												5,385,969,71		3,047

5.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative RON

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoarea initiala	Cresterre zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret plata	Valoarea totala	Pondere in total obligatiuni emisiune	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
C.N.T.E.E. TRANSELECTRICA	TEL18	-	70	3-Oct-17	19-Dec-17	19-Dec-18	lei 10,458,00	lei	0,61	322,55	-285,88	lei 735,328,60	% 0,007	% 0,416
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IBI18	-	80	14-Oct-15	14-Oct-17	14-Oct-18	10,000,00	1,14	291,58	0,00	-	823,324,44	0,076	0,466
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IBI19	-	25	27-Sep-17	27-Sep-17	27-Sep-18	10,000,00	0,94	257,83	0,00	-	256,445,83	0,024	0,145
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IBI19	-	194	27-Sep-17	27-Sep-17	27-Sep-18	10,000,00	0,94	257,83	0,00	-	1,882,284,67	0,155	0,952
RAIFFEISEN BANK S.A.	RBR019	-	178	14-May-14	15-May-18	15-May-19	10,000,00	1,47	67,42	0,00	-	1,392,001,56	0,246	1,014
UNICREDIT BANK ROMANIA	UCB24	-	1,000	27-Jul-17	15-Jan-18	15-Jul-18	10,000,00	0,90	148,72	0,00	-	10,148,717,81	1,639	5,742
TOTAL												15,438,100,94		8,735

6. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiilor publice centrale

Serie	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoarea initiala	Cresterre zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret plata	Valoarea totala	Banca intermediara	Pondere in total obligatiuni emisiune	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
RO1121DBN032	-	1	9-Mar-15	11-Jun-18	11-Jun-19	lei 11,904,01	1,63	30,97	0,00	10,394,400	lei 10,425,37	BRD GSG	% 0,000	% 0,006
RO1318DBN034	-	1	8-May-15	28-Nov-17	28-Nov-18	lei 11,175,57	1,53	328,33	0,00	10,093,800	lei 10,422,13	ING BANK	% 0,000	% 0,006
RO1620DBN017	-	400	3-Oct-16	26-Feb-18	26-Feb-19	lei 5,079,33	0,31	38,22	0,00	4,874,0750	lei 1,964,917,67	Raiffeisen Bank	% 0,002	% 1,112
TOTAL											1,965,766,17			1,124

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 cupon	Data scadentei cupon	Valoarea initiala	Cresterre zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret plata	Valoarea totala	Pondere in total obligatiuni emisiune	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
AKBANK TAS	XS1244248739	-	2	5-Jun-15	6-Jun-18	6-Jun-19	lei 500,000,00	lei	55,21	lei 1,324,93	lei -	lei 1,002,649,96	% 0,006	% 0,567
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	2	27-Mar-14	7-Apr-18	7-Apr-19	267,228,54	45,65	4,438,19	-12,167,27	lei -	lei 1,518,994,93	0,134	0,294
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	3	24-Jun-14	7-Apr-18	7-Apr-19	281,837,58	38,41	4,438,19	-22,093,53	lei -	lei 792,546,72	0,201	0,448
BWP PARIBAS	XS1460358028	-	2	9-Aug-15	9-Aug-17	9-Aug-18	500,000,00	39,73	16,910,96	-	lei -	lei 1,025,921,92	0,959	0,580
ERSTE GROUP BANK AG	AT000041FRS2	-	1	17-May-16	31-Jul-18	31-Jul-18	506,767,71	45,17	15,816,16	-3,410,29	lei -	lei 518,913,58	0,000	0,294
FCE Bank plc	XS1412588165	-	4	17-May-16	17-May-18	17-May-19	500,000,00	34,52	1,518,96	-	lei -	lei 2,006,075,62	0,000	1,135
ING BANK NV	XS1248246487	-	1,000	19-Jun-15	18-Sep-17	18-Sep-18	1,000,00	0,11	30,94	-	lei -	lei 1,030,941,67	0,000	0,583
International Personal Finance PLC	XS1322223498	-	1	2-Dec-15	2-Dec-18	2-Dec-18	500,000,00	65,89	20,136,89	-	lei -	lei 520,136,99	0,016	0,294
International Personal Finance PLC	XS1527191081	-	1	6-Dec-16	6-Dec-18	6-Dec-18	500,000,00	109,59	22,575,34	-	lei -	lei 522,575,34	0,016	0,296
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1361891576	-	4	12-Feb-16	12-Feb-18	12-Feb-19	500,000,00	36,99	5,104,11	-	lei -	lei 2,020,416,44	0,006	1,143
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1551746768	-	20	20-Jan-17	19-Jan-18	19-Jan-19	100,000,00	0,32	1,509,04	-	lei -	lei 2,020,180,82	0,001	1,149
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1553923639	-	10	20-Jan-17	20-Jan-18	20-Jan-19	100,000,00	6,58	1,058,63	-	lei -	lei 1,010,588,30	0,015	0,572
NIBC Bank N.V.	XS1441636138	-	10	11-Jul-17	11-Jul-17	11-Jul-18	100,000,00	9,12	3,229,64	-	lei -	lei 1,032,296,44	0,015	0,584
NIBC Bank N.V.	XS1481206768	-	9	26-Aug-16	26-Aug-17	26-Aug-18	100,000,00	7,40	2,276,36	-	lei -	lei 920,505,21	0,478	0,521
UNICREDIT GROUP	XS1233789630	-	5	15-May-15	26-Sep-18	26-Sep-18	61,88	15,815,23	-	lei -	lei 2,781,621,43	0,003	1,572	
UNICREDIT GROUP	XS1233789630	-	6	31-May-17	26-Mar-18	26-Sep-18	870,790,00	37,36	8,816,25	-968,02	lei -	lei 3,401,533,37	0,003	1,925
Yapi ve Kredi Bankasi A.S	XS0994330438	-	2	26-Nov-13	26-Nov-17	26-Nov-18	500,000,00	88,36	19,084,93	-	lei -	lei 1,038,169,86	0,005	0,587
TOTAL												22,171,458,35		12,545

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	Valoarea initiala	Cresterre zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret plata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totala	Pondere in total obligatiuni emisiune	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
BANK OF AMERICA CORP	XS1802267495	-	250	27-Oct-17	4-May-18	6-Aug-18	EUR 1,013,88	0,01	0,71	-	EUR 1,003,7950	4,6611	lei 1,170,529,32	0,012	0,662
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS0989152573	-	100	9-Sep-16	7-Nov-17	7-Nov-18	1,040,00	0,12	27,36	-	EUR 1,011,1300	4,6611	lei 484,051,96	0,005	0,274
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS0989152573	-	200	22-Sep-16	7-Nov-17	7-Nov-18	1,038,45	0,12	27,36	-	EUR 1,011,1300	4,6611	lei 898,103,96	0,010	0,548
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS0989152573	-	200	28-Sep-16	7-Nov-17	7-Nov-18	1,038,00	0,12	27,36	-	EUR 1,011,1300	4,6611	lei 968,103,96	0,010	0,548
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS1405878041	-	100	22-Sep-16	2-Aug-17	2-Aug-18	1,098,75	0,13	44,34	-	EUR 1,081,9150	4,6611	lei 524,959,87	0,005	0,297
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	100	25-Jun-17	15-Apr-18	15-Oct-18	1,022,70	0,14	10,42	-	EUR 1,048,7550	4,6611	lei 493,690,51	0,005	0,279
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	100	5-May-17	15-Apr-18	15-Oct-18	1,022,00	0,14	10,42	-	EUR 1,048,7550	4,6611	lei 493,690,51	0,005	0,279
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	200	6-Jul-17	15-Apr-18	15-Oct-18	1,057,50	0,14	10,42	-	EUR 1,048,7550	4,6611	lei 987,381,01	0,010	0,559
Croatian Bank for Reconstruction and Development	XS0961837542	-	150	19-May-16	8-May-19	8-May-19	1,116,25	0,08	8,71	-64,34	EUR 1,123,9750	4,6611	lei 753,945,96	0,002	0,427
DAMLER AG	DE0002035C99	-	4	22-Nov-17	3-Apr-18	3-Jul-18	100,770,00	0,34	29,58	0,00	EUR 99,100,00	4,6611	lei 1,848,220,82	0,001	1,046
EMERALD CAP	XS1523215116	-	1,700	2-Dec-16	8-May-18	6-Aug-18	1,000,00	0,05	2,61	-	EUR 1,002,7500	4,6611	lei 794,541,52	0,011	4,495
FCE Bank NV	XS1580260278	-	100	31-Mar-17	29-Mar-18	28-Aug-18	1,000,00	0,08	3,03	-	EUR 1,002,7500	4,6611	lei 467,444,16	0,001	0,264
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	XS1723827238	-	500	13-Dec-17	1-Jun-18	3-Sep-18	1,000,00	0,01	0,31	-	EUR 983,4650	4,6611	lei 2,292,725,89	0,001	1,297
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	159	19-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	994,27	0,08	0,79	-	EUR 1,027,4950	4,6611	lei 782,075,81	0,006	0,431
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	141	19-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	1,008,75	0,08	0,79	-	EUR 1,027,4950	4,6611	lei 675,802,90	0,006	0,382
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	150	27-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	1,008,50	0,08	0,79	-	EUR 1,027,4950	4,6611	lei 718,939,25	0,006	0,407
Goldman Sachs Group Inc	XS1173867323	-	250	28-Nov-16	26-Apr-18	1,018,70	0,02	1,21	-	EUR 1,015,4800	4,6611	lei 1,184,727,32	0,002	0,670	
Goldman Sachs Group Inc	XS1458408306	-	500	28-Nov-16	27-Apr-18	27-Jul-18	1,017,80	0,02	1,19	-	EUR 1,015,7800	4,6611	lei 2,370,110,31	0,003	1,341
Goldman Sachs Group Inc	XS1691349523	-	200	27-Oct-17	26-Sep-18	26-Sep-18	1,002,03	0,01	0,08	-	EUR 987,9950	4,6611	lei 621,059,46	0,001	0,521
J.P. Morgan Structured Products B.V.	XS0851764233	-	15	11-Jul-13	7-May-18	4-Aug-18	52,642,81	4,83	309,15	-2076,49	EUR -	EUR 4,506,258,53	0,000	2,437	
MOL HUNGARIAN OIL & GAS	XS1401114811	-	300	10-May-17	28-Apr-18	28-Apr-19	1,051,75	0,07	4,53	-	EUR 1,059,5750	4,6611	lei 1,487,971,09	0,003	0,842
NE PROPERTY COOPERATIEF	XS172898431														

FDI OTP Obligațiuni – Situația detaliată a activelor la data de 30.06.2018

XII. Instrumente financiare derivate negociate în afara piețelor reglementate

1. Contracte forward

1.1. Contracte forward denominate în EUR

Contraparte	Canțitate	Tip contract	Data achiziției	Data scadenței	Preț de exercitare	Curs valutar BNR EURRON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totală	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
	EUR				lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	100.000,00	Vanzare	21-Jul-17	23-Jul-18	4.6392	4.6611	4.6718	-0.0226	-3.290,00	-0.002
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	100.000,00	Vanzare	31-Aug-17	5-Sep-18	4.6666	4.6611	4.6905	-0.0239	-2.390,00	-0.001
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	210.000,00	Vanzare	3-Jul-17	3-Jul-18	4.6170	4.6611	4.6830	-0.0460	-9.660,00	-0.005
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	300.000,00	Vanzare	10-Jan-19	10-Jan-19	4.7994	4.6611	4.7446	0.0548	16.440,00	0.009
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	200.000,00	Vanzare	2-Feb-18	6-Feb-19	4.8166	4.6611	4.7558	0.0608	12.160,00	0.007
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	400.000,00	Vanzare	27-Mar-18	27-Mar-19	4.7902	4.6611	4.7760	0.0142	5.680,00	0.003
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	150.000,00	Vanzare	3-Apr-18	3-Apr-19	4.7965	4.6611	4.7390	0.0175	2.620,00	0.001
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	600.000,00	Vanzare	22-Feb-19	22-Feb-19	4.8138	4.6611	4.7624	0.0524	30.040,00	0.018
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	100.000,00	Vanzare	14-May-18	14-May-19	4.7832	4.6611	4.7967	-0.0135	-1.360,00	-0.001
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	400.000,00	Vanzare	19-Apr-18	23-Apr-19	4.8006	4.6611	4.7876	0.0130	5.200,00	0.003
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	170.000,00	Vanzare	19-May-18	20-Feb-19	4.7608	4.6611	4.7508	0.0100	4.080,00	0.002
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	300.000,00	Vanzare	26-Jun-18	28-Dec-18	4.7592	4.6611	4.7392	0.0200	6.000,00	0.003
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A	200.000,00	Vanzare	5-Jun-18	5-Jun-19	4.8266	4.6611	4.8083	0.0203	4.060,00	0.002
Citi Bank	100.000,00	Vanzare	11-Jun-18	13-Dec-18	4.7451	4.6611	4.7238	0.0213	2.320,00	0.001
Citi Bank	725.000,00	Vanzare	12-Jun-18	12-Jun-19	4.8349	4.6611	4.8093	0.0256	18.580,00	0.011
Citi Bank	200.000,00	Vanzare	19-Jun-18	21-Dec-18	4.7573	4.6611	4.7362	0.0211	4.220,00	0.002
Citi Bank	500.000,00	Vanzare	20-Jun-18	20-Dec-18	4.7565	4.6611	4.7558	0.0027	11.350,00	0.006
Citi Bank	400.000,00	Vanzare	24-May-18	27-May-19	4.7856	4.6611	4.8024	-0.0122	-5.160,00	-0.003
Citi Bank	180.000,00	Vanzare	18-May-18	20-May-19	4.7925	4.6611	4.7993	-0.0068	-1.224,00	-0.001
Citi Bank	200.000,00	Vanzare	18-May-18	22-Feb-19	4.7516	4.6611	4.7624	-0.0108	-2.160,00	-0.001
Citi Bank	200.000,00	Vanzare	31-May-18	3-Jun-19	4.8192	4.6611	4.8054	0.0138	2.760,00	0.001
Citi Bank	512.877,69	Vanzare	20-Apr-18	22-Apr-19	4.8064	4.6611	4.7872	0.0192	9.847,25	0.006
Citi Bank	500.000,00	Vanzare	30-Apr-18	30-Apr-19	4.8114	4.6611	4.7907	0.0207	10.360,00	0.006
Citi Bank	1.000.000,00	Vanzare	7-May-18	7-May-19	4.8087	4.6611	4.7937	0.0150	15.000,00	0.008
Citi Bank	150.000,00	Vanzare	8-May-18	10-May-19	4.8046	4.6611	4.7950	0.0096	1.536,00	0.001
Citi Bank	300.000,00	Vanzare	9-May-18	13-May-19	4.8029	4.6611	4.7963	0.0066	1.980,00	0.001
Citi Bank	340.000,00	Vanzare	15-Mar-18	17-Oct-18	4.7281	4.6611	4.7083	0.0198	6.732,00	0.004
Citi Bank	610.000,00	Vanzare	8-Apr-18	8-Apr-19	4.7973	4.6611	4.7912	0.0161	8.211,90	0.005
Citi Bank	410.000,00	Vanzare	17-Apr-18	19-Apr-19	4.7893	4.6611	4.7859	0.0034	1.394,00	0.001
Citi Bank	100.000,00	Vanzare	19-Apr-18	23-Apr-19	4.8004	4.6611	4.7876	0.0128	1.280,00	0.001
Citi Bank	300.000,00	Vanzare	5-Mar-18	3-Aug-19	4.7091	4.6611	4.6764	0.0327	9.010,00	0.006
Citi Bank	300.000,00	Vanzare	21-Feb-18	25-Feb-19	4.8227	4.6611	4.7637	0.0590	17.700,00	0.010
Citi Bank	150.000,00	Vanzare	16-Feb-18	18-Feb-19	4.8180	4.6611	4.7608	0.0572	6.560,00	0.005
Citi Bank	150.000,00	Vanzare	15-Jan-18	15-Jan-19	4.7780	4.6611	4.7467	0.0313	4.695,00	0.003
Citi Bank	500.000,00	Vanzare	16-Jan-18	16-Jan-19	4.8147	4.6611	4.7471	0.0676	33.800,00	0.019
Citi Bank	1.100.000,00	Vanzare	27-Dec-17	28-Dec-18	4.8136	4.6611	4.7392	0.0744	81.840,00	0.046
Citi Bank	800.000,00	Vanzare	5-Dec-17	5-Dec-18	4.8034	4.6611	4.7293	0.0741	59.280,00	0.034
Citi Bank	500.000,00	Vanzare	29-Jan-18	29-Jan-19	4.8166	4.6611	4.7626	0.0661	33.050,00	0.019
Citi Bank	450.000,00	Vanzare	5-Feb-18	5-Feb-19	4.7992	4.6611	4.7554	0.0438	19.710,00	0.011
Citi Bank	100.000,00	Vanzare	5-Feb-18	7-Feb-19	4.7992	4.6611	4.7562	0.0430	4.300,00	0.002
Citi Bank	100.000,00	Vanzare	7-Feb-18	11-Feb-19	4.8218	4.6611	4.8218	0.0000	6.300,00	0.004
Citi Bank	120.000,00	Vanzare	12-Feb-18	12-Feb-19	4.8154	4.6611	4.7583	0.0571	6.652,00	0.004
Citi Bank	100.000,00	Vanzare	29-Jun-17	3-Jul-18	4.6085	4.6611	4.6630	-0.0545	-5.450,00	-0.003
ING BANK Romania	650.000,00	Vanzare	19-Sep-17	19-Sep-18	4.6825	4.6611	4.6964	-0.0139	-9.035,00	-0.005
ING BANK Romania	500.000,00	Vanzare	12-Feb-18	12-Feb-19	4.8164	4.6611	4.7983	0.0271	28.650,00	0.016
ING BANK Romania	175.000,00	Vanzare	14-Feb-18	15-Feb-19	4.8193	4.6611	4.7596	0.0597	10.447,50	0.006
ING BANK Romania	427.200,00	Vanzare	30-Jan-18	30-Jan-19	4.8119	4.6611	4.7529	0.0590	25.204,80	0.014
ING BANK Romania	477.750,00	Vanzare	31-Jan-18	31-Jul-18	4.7272	4.6611	4.7571	0.0521	29.890,78	0.016
ING BANK Romania	250.000,00	Vanzare	3-Jan-18	3-Jul-18	4.6611	4.6611	4.6630	0.0482	12.060,00	0.007
ING BANK Romania	250.000,00	Vanzare	10-Jan-18	10-Jan-19	4.8004	4.6611	4.7446	0.0558	13.960,00	0.008
ING BANK Romania	490.000,00	Vanzare	16-Jan-18	16-Jan-19	4.8164	4.6611	4.7471	0.0693	33.467,00	0.019
ING BANK Romania	250.000,00	Vanzare	18-Jan-18	18-Jan-19	4.8039	4.6611	4.7479	0.0560	14.000,00	0.008
ING BANK Romania	983.100,00	Vanzare	25-Jan-18	25-Jan-19	4.8315	4.6611	4.7509	0.0806	79.237,86	0.045
ING BANK Romania	770.000,00	Vanzare	25-Jan-18	25-Jan-19	4.8315	4.6611	4.7509	0.0806	62.062,00	0.035
ING BANK Romania	1.000.000,00	Vanzare	20-Feb-18	20-Feb-19	4.8223	4.6611	4.7616	0.0607	60.700,00	0.034
ING BANK Romania	300.000,00	Vanzare	5-Mar-18	5-Oct-18	4.7365	4.6611	4.7031	0.0334	10.020,00	0.006
ING BANK Romania	850.000,00	Vanzare	6-Nov-18	6-Nov-18	4.7501	4.6611	4.7169	0.0332	28.220,00	0.016
ING BANK Romania	510.000,00	Vanzare	21-Feb-19	21-Feb-19	4.8226	4.6611	4.8226	0.0000	13.087,80	0.008
ING BANK Romania	250.000,00	Vanzare	4-Apr-18	8-Apr-19	4.7963	4.6611	4.7812	0.0151	3.775,00	0.002
ING BANK Romania	416.750,00	Vanzare	23-Feb-18	25-Feb-19	4.8167	4.6611	4.7637	0.0530	22.987,75	0.012
ING BANK Romania	307.802,59	Vanzare	27-Feb-18	27-Feb-19	4.8124	4.6611	4.7645	0.0479	14.737,74	0.008
ING BANK Romania	591.173,84	Vanzare	8-Mar-18	12-Mar-19	4.8062	4.6611	4.7698	0.0364	21.518,73	0.012
ING BANK Romania	300.000,00	Vanzare	20-Apr-18	22-Apr-19	4.8071	4.6611	4.7872	0.0199	5.970,00	0.003
ING BANK Romania	477.750,00	Vanzare	30-May-18	31-May-19	4.8089	4.6611	4.8048	0.0049	2.804,00	0.001
ING BANK Romania	350.000,00	Vanzare	23-May-18	24-May-19	4.7947	4.6611	4.8011	-0.0064	-2.240,00	-0.001
ING BANK Romania	535.000,00	Vanzare	6-Jun-18	6-Jun-19	4.8273	4.6611	4.8067	0.0206	11.021,00	0.006
ING BANK Romania	250.000,00	Vanzare	27-Jun-18	24-Dec-18	4.7462	4.6611	4.7375	0.0117	2.865,00	0.002
ING BANK Romania	500.000,00	Vanzare	29-Jun-18	1-Apr-19	4.8058	4.6611	4.7781	0.0277	13.850,00	0.008
OTP BANK ROMANIA	500.000,00	Vanzare	13-Sep-17	17-Sep-18	4.6611	4.6611	4.6955	-0.0175	-8.760,00	-0.005
ING BANK Romania	500.000,00	Vanzare	29-Jun-17	29-Jun-18	4.6093	4.6611	4.6611	-0.0518	-26.900,00	-0.015
TOTAL	500.000,00	Vanzare	29-Jun-17	29-Jun-18	4.6093	4.6611	4.6611	-0.0518	26.900,00	-0.015

Emitent	Descriere	Valoare curenta	Valoare actualizată	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
		lei	lei	%
BRD - GRUPE SOCIETI GENERALE S.A.	Marja contracte forward	20.042,10	20.042,10	0,011
TOTAL		20.042,10	20.042,10	0,011

Emitent	Descriere	Valoare curenta	Curs valutar BNR EURRON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
		EUR	lei	lei	%
Citi Bank	Marja contracte forward	9.825,47	4.6611	45.797,50	0,026
TOTAL		9.825,47		45.797,50	0,026

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denominate în lei

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unitati de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Preț plată	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
				lei	lei	lei	%	%
FDI BRD SIMFONIA	ROFDIN00010	-	54.030.6311	40.3110	-	2.178.028,77	0,181	1,232
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	ROFDIN00009	-	102.603.7320	30.1600	-	3.094.528,56	23,159	1,751
FDI OTP ComedieRO	ROFDIN001C1	-	53.000.0000	17.4871	-	926.818,30	0,937	0,524
TOTAL						6.199.375,63		3,506

2. Titluri de participare denominate în EUR

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unitati de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Preț plată	Curs valutar BNR EURRON	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
				EUR	EUR	lei	lei	%	%
FDI OTP EUROBOOND	ROFDIN001J6	-	157.167,87	-	EUR	12.7512	9.341.212,47	4,934	5,285
TOTAL							9.341.212,47		5,285

Evoluția activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	29-Jun-16	29-Jun-17	30-Jun-18
Activ net	156.654.312,071	204.496.716,861	176.556.658,771
VUAN	14,4564	14,8235	15,0400

OTP ASSET MANAGEMENT S.A.I. S.A.

Membri Directorat,
Dan POPOVICI

Incompt
Florian ANGHEL