

SAI: OTP Asset Management Romania

SAI SA

Decizie autorizare: PJR05SAIR/400023

CUI: 22264941

Capital social: 5.795.323 RON

Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007

Inregistrare ONRC: J40/15502/15.08.2007

Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

OTP Premium Return

Decizie autorizare: 55/26.04.2016

Cod inscriere: CSC06DIR/400099

## 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	
<b>I Total active</b>	<b>100.74%</b>	<b>100.00%</b>	<b>22.951.631,31</b>	<b>22.951.631,31</b>	<b>100.20%</b>	<b>100.00%</b>	<b>19.970.523,52</b>	<b>19.970.523,52</b>	<b>-2.981.107,79</b>
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	85.09%	84.46%	19.384.883,38	19.384.883,38	85.11%	84.94%	16.963.410,36	16.963.410,36	-2.421.473,02
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:	14.66%	14.55%	3.339.165,81	3.339.165,81	13.41%	13.39%	2.673.490,90	2.673.490,90	-665.674,92
1.1.1. actiuni	4.10%	4.07%	934.359,20	934.359,20	3.82%	3.81%	760.480,00	760.480,00	-173.879,20
1.1.3. obligatiuni, din care:	10.56%	10.48%	2.404.806,61	2.404.806,61	9.60%	9.58%	1.913.010,90	1.913.010,90	-491.795,72
1.1.3.1. Obligatiuni corporative cotate	10.56%	10.48%	2.404.806,61	2.404.806,61	9.60%	9.58%	1.913.010,90	1.913.010,90	-491.795,72
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:	64.60%	64.13%	14.717.955,78	14.717.955,78	57.32%	57.20%	11.423.906,01	11.423.906,01	-3.294.049,77
1.2.1. actiuni	11.94%	11.85%	2.719.419,58	2.719.419,58	5.38%	5.37%	1.072.151,86	1.072.151,86	-1.647.267,72
1.2.3. obligatiuni, din care:	52.28%	51.89%	11.909.908,71	11.909.908,71	51.94%	51.84%	10.351.754,15	10.351.754,15	-1.558.154,55
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	43.37%	43.05%	9.880.046,65	9.880.046,65	49.36%	49.27%	9.838.948,65	9.838.948,65	-41.098,00
1.2.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	8.91%	8.84%	2.029.862,06	2.029.862,06	2.57%	2.57%	512.805,51	512.805,51	-1.517.056,55
1.2.6. instrumente ale pietei monetare	0.39%	0.39%	88.627,49	88.627,49	0.00%	0.00%	0,00	0,00	-88.627,49
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 sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat tert, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobată de A.S.F., din care:	5.83%	5.79%	1.327.761,79	1.327.761,79	14.38%	14.35%	2.866.013,45	2.866.013,45	1.538.251,67
1.3.1. actiuni	5.83%	5.79%	1.327.761,79	1.327.761,79	14.38%	14.35%	2.866.013,45	2.866.013,45	1.538.251,67
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:	0.00%	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 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:	4.86%	4.83%	1.108.268,25	1.108.268,25	7.47%	7.46%	1.489.529,43	1.489.529,43	381.261,18
5.1. depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	4.86%	4.83%	1.108.268,25	1.108.268,25	7.47%	7.46%	1.489.529,43	1.489.529,43	381.261,18
5.1.1. OTP BANK ROMANIA	3.37%	3.35%	768.261,16	768.261,16	0.28%	0.28%	56.072,27	56.072,27	-712.188,89
5.1.2. BANCA ROMANEASCA	0.00%	0.00%	0,00	0,00	5.65%	5.84%	1.166.520,09	1.166.520,09	1.166.520,09
5.1.3. BANCA COMERCIALA ROMANA	1.49%	1.48%	340.007,08	340.007,08	1.34%	1.34%	266.937,07	266.937,07	-73.070,02
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	-0.74%	-0.73%	-167.926,40	-167.926,40	-0.69%	-0.69%	-137.042,20	-137.042,20	30.884,20
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	-0.74%	-0.73%	-167.926,40	-167.926,40	-0.69%	-0.69%	-137.042,20	-137.042,20	30.884,20
6.4.1. Contracte forward	-0.74%	-0.73%	-167.926,40	-167.926,40	-0.69%	-0.69%	-137.042,20	-137.042,20	30.884,20
7 Conturi curente si numerar	1.88%	1.87%	428.938,40	428.938,40	6.14%	6.13%	1.224.524,72	1.224.524,72	795.586,31
8 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	0.00%	0.00%	0,00	0,00	0.00%	0.00%	0,00	0,00	0,00
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	0.00%	0.00%	0,00	0,00	0.00%	0.00%	0,00	0,00	0,00
9 Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.	9.68%	9.61%	2.205.226,48	2.205.226,48	2.16%	2.15%	429.738,04	429.738,04	-1.775.488,44
10 Dividende sau alte drepturi de incasat	0.00%	0.00%	0,00	0,00	0.00%	0.00%	363,18	363,18	363,18
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	-0.03%	-0.03%	-7.758,80	-7.758,80	0.00%	0.00%	0,00	0,00	7.758,80
12.4. sume in curs de decontare	-0.03%	-0.03%	-7.758,80	-7.758,80	0.00%	0.00%	0,00	0,00	7.758,80
<b>II Total obligatii</b>	<b>0.74%</b>	<b>0.74%</b>	<b>168.815,22</b>	<b>168.815,22</b>	<b>0.20%</b>	<b>0.19%</b>	<b>38.869,45</b>	<b>38.869,45</b>	<b>-129.945,78</b>
1. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate S.A.I.	0.71%	0.70%	161.014,76	161.014,76	0.17%	0.17%	33.223,97	33.223,97	-127.790,79
2. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	3.383,40	3.383,40	0.02%	0.02%	3.540,14	3.540,14	156,74
3. Cheltuieli cu comisiunile datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	926,70	926,70	0.00%	0.00%	0,00	0,00	-926,70
7. Cheltuieli cu plata comisiunilor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	1.661,28	1.661,28	0.01%	0.01%	1.505,14	1.505,14	-156,14
8. Cheltuieli cu auditul financiar	0.00%	0.00%	1.029,33	1.029,33	0.00%	0.00%	510,41	510,41	-518,92
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	799,75	799,75	0.00%	0.00%	89,79	89,79	-709,97
<b>III Valoarea activului net (I - II)</b>	<b>100.00%</b>	<b>99.26%</b>	<b>22.782.816,09</b>	<b>22.782.816,09</b>	<b>100.00%</b>	<b>99.81%</b>	<b>19.931.654,08</b>	<b>19.931.654,08</b>	<b>-2.851.162,01</b>

\*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	19.931.654,08	17.678.575,59	-2.851.162,01
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1.720.553.9977	1.534.012.7243	-202.495.3994
Valoarea unitara a activului net	11.5844	11.5244	-0.2628

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Director General

Dan Marius POPOVICI

Intocmit

Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

OTP Premium Return – Situatia detaliata a activelor la data de 30.06.2018

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

1. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare)

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	29-Jun-18	11,200	0.0467	31.8000	356,160.00	0.011	1.783
PURCARI WINERIES PUBLIC COMPANY LIMITED	WINE	29-Jun-18	22,400	0.0467	18.0500	404,320.00	0.112	2.025
<b>TOTAL</b>						<b>760,480.00</b>		<b>3.808</b>

5. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale/obligatiuni corporativ

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	Valoare initiala	Creștere zilnică	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-17	27-Sep-18	10,000.00	0.94	257.83	0.00	-	410,313.33	0.133	2.055
UNICREDIT BANK ROMANIA	UCB24	-	100	27-Jul-17	15-Jan-18	15-Jul-18	10,000.00	0.90	148.72	0.00	-	1,014,871.78	0.182	5.082
Vrancart Adjul	VNC24	-	2,500	17-Mar-17	25-Apr-18	25-Jul-18	100.00	0.01	0.77	0.00	-	251,934.79	0.000	1.262
<b>TOTAL</b>												<b>1,677,119.91</b>		<b>8.398</b>

5.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative EUR

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	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	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB20E	-	5	25-Sep-17	25-Sep-17	25-Sep-18	10,000.00	0.44	121.69	0.00	-	4.6611	235,890.99	0.000	1.181
<b>TOTAL</b>													<b>235,890.99</b>		<b>1.181</b>

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 EUI

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	29-Jun-18	663	0.0000	55.1300	4.6611	Germania	170,368.75	0.000	0.853
RENAULT SA	FR0000131906	29-Jun-18	298	3.8100	72.8300	4.6611	Franta	101,161.44	0.000	0.507
ZAVAROVANICA TRIGLAV D.D.	SI0021111651	29-Jun-18	2,250	0.0000	30.2000	4.6611	Slovenia	316,721.75	0.010	1.586
<b>TOTAL</b>								<b>588,251.93</b>		<b>2.946</b>

2 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite 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		lei	%	%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	US7960502018	29-Jun-18	75	0.0000	841.0000	4.0033	Germania	252,508.15	0.000	1.264
<b>TOTAL</b>								<b>252,508.15</b>		<b>1.264</b>

4 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in HUI

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	HU0000153937	29-Jun-18	6,000	125.0000	2,722.0000	0.0142	Ungaria	231,391.78	0.001	1.159
<b>TOTAL</b>								<b>231,391.78</b>		<b>1.159</b>

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	Creștere zilnică	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	%	%
Banca Comerciala Roman	XS0496326223	-	2	24-Jun-14	7-Apr-18	7-Apr-19	281,837.58	38.41	4,438.19	-22,093.53	-	528,364.48	0.085	2.646
International Personal Finance PLC	XS1527191081	-	1	6-Dec-16	6-Dec-17	6-Dec-18	500,000.00	109.59	22,575.34	0.00	-	522,575.34	0.090	2.617
<b>TOTAL</b>												<b>1,050,939.82</b>		<b>5.262</b>

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	Creștere zilnică	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	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
BANK OF AMERICA CORP	XS1602857495	-	100	27-Nov-17	4-May-18	6-Aug-18	1,016.20	0.01	0.71	-	1,003.7950	4.6611	468,211.73	0.007	2.345
BNP PARIBAS	XS1626833102	-	100	27-Nov-17	7-Jun-18	7-Sep-18	1,022.47	0.01	0.27	-	994.1000	4.6611	463,487.41	0.013	2.321
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS0989152573	-	50	28-Dec-16	7-Nov-17	7-Nov-18	1,032.50	0.12	27.36	-	1,011.1300	4.6611	242,025.99	0.010	1.212
BULGARIAN ENERGY HOLDING	XS140578041	-	50	20-Jul-17	2-Aug-17	2-Aug-18	1,078.00	0.13	44.34	-	1,081.9150	4.6611	262,479.93	0.009	1.314
Cable Communications Systems N.V	XS1405770576	-	150	26-Oct-16	15-Apr-18	15-Oct-18	1,000.00	0.14	10.42	-	1,048.7550	4.6611	740,535.76	0.043	3.708
DAIMLER AG	DE000A2GSCY9	-	1	22-Nov-17	3-Apr-18	3-Jul-18	100,769.99	0.34	29.58	-	99,100.5000	4.6611	462,055.21	0.008	2.314
EMERALD CAP	XS1523215116	-	200	2-Dec-16	8-May-18	6-Aug-18	1,000.00	0.05	2.61	-	4.6611	934,651.95	5.000	4.680	
FCM BANK SPA IRELAND	XS1733030490	-	100	17-Jan-18	18-Jun-18	17-Sep-18	1,000.00	0.00	0.00	-	988.2500	4.6611	460,634.61	0.012	2.307
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	XS1729827236	-	150	1-Dec-17	1-Jun-18	3-Sep-18	1,000.00	0.01	0.31	-	983.4650	4.6611	687,817.77	0.025	3.444
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	19-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	994.27	0.08	0.79	-	1,027.4950	4.6611	239,646.42	0.025	1.200
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	19-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	1,008.75	0.08	0.79	-	1,027.4950	4.6611	239,646.42	0.009	1.200
Goldman Sachs Group Inc	XS1691349523	-	100	27-Oct-17	26-Jun-18	26-Sep-18	1,002.03	0.01	0.03	-	987.9950	4.6611	460,529.73	0.004	2.306
Goldman Sachs Group Inc	XS1691349523	-	100	23-Nov-17	26-Jun-18	26-Sep-18	1,003.21	0.01	0.03	-	987.9950	4.6611	460,529.73	0.004	2.306
HSBC HOLDING PLC	XS1681855539	-	100	27-Nov-17	5-Apr-18	5-Jul-18	1,006.00	0.00	0.41	-	994.3450	4.6611	463,865.67	0.007	2.322
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	50	30-Sep-15	7-May-18	7-Aug-18	941.25	0.07	4.01	-	915.3350	4.6611	214,257.48	0.010	1.073
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	100	24-Nov-15	7-May-18	7-Aug-18	988.00	0.07	4.01	-	915.3350	4.6611	428,514.97	0.020	2.146
RCI BANQUE SA	FR0013322146	-	1	12-Mar-18	12-Jun-18	12-Sep-18	100,000.00	0.72	12.95	-	98,080.0000	4.6611	457,221.05	0.020	2.289
Societe Generale	XS1490846810	-	100	24-Nov-16	6-Jun-18	6-Dec-18	1,000.00	0.05	1.16	-	-	4.6611	466,651.00	0.018	2.337
Turkiye Garanti Bankas	XS1084838496	-	50	24-Mar-17	8-Jul-17	8-Jul-18	1,031.00	0.09	33.01	-	1,013.5050	4.6611	243,895.62	0.010	1.221
WIND TRE SPA	XS1708450215	-	100	3-Nov-17	20-Apr-18	20-Jul-18	1,005.00	0.08	5.42	-	834.8150	4.6611	391,530.40	0.004	1.961
<b>TOTAL</b>													<b>8,788,008.82</b>		<b>44.005</b>

OTP Premium Return – Situatia detaliata a activelor la data de 30.06.2018

2.3. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale denumite in EU1

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	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
MACEDONIA	XS1087984164	-	100	30-Dec-16	24-Jul-17	24-Jul-18	eur 1.005.50	eur 0,11	eur 37,14	eur -	eur 1.063.0450	lei 4.6611	lei 512.805.51	% 0,000	% 2.568
<b>TOTAL</b>													<b>512.805.51</b>		<b>2.568</b>

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 US1

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		lei	%	%
Alphabet	US02079K1079	29-Jun-18	80	0,0039	1,115.6500	4,0033	Germania	357.302,53	0,000	1,789
Apple Inc.	US0376331005	29-Jun-18	420	0,0000	185,1100	4,0033	Germania	311.241,36	0,000	1,559
BANK OF AMERICA CORP	US0605051046	29-Jun-18	1080	0,0000	28,1900	4,0033	Germania	121.881,27	0,000	0,610
ELECTRONIC ARTS INC	US2855121099	29-Jun-18	532	0,0000	141,0200	4,0033	Germania	300.338,13	0,000	1,504
GENERAL MOTORS CO	US37045V1008	29-Jun-18	800	0,0000	39,4000	4,0033	Germania	126.184,02	0,000	0,632
JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	29-Jun-18	200	3,8843	121,3400	4,0033	Germania	97.152,08	0,000	0,486
MASTERCARD INC	US57636Q1040	29-Jun-18	465	0,0005	196,5200	4,0033	Germania	365.828,76	0,000	1,832
MICRON TECHNOLOGY INC	US5951121038	29-Jun-18	2100	0,0000	52,4400	4,0033	Germania	440.859,41	0,000	2,208
Morgan Stanley	US6174464486	29-Jun-18	610	0,0000	47,4000	4,0033	Germania	115.751,42	0,000	0,580
Pfizer, Inc.	US7170811035	29-Jun-18	700	0,1942	36,2800	4,0033	Germania	101.667,81	0,000	0,509
VISA INC	US92826C8394	29-Jun-18	685	0,0005	132,4500	4,0033	Germania	363.212,40	0,000	1,819
<b>TOTAL</b>								<b>2.701.419,19</b>		<b>13,527</b>

1.2 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite 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	29-Jun-18	185	0,0000	220,5500	4,0340	Germania	164.594,26	0,000	0,824
<b>TOTAL</b>								<b>164.594,26</b>		<b>0,824</b>

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 Romani	0,00	0,000
Banca Romaneasca	0,00	0,000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	21.241,41	0,106
Citi Bank	61,307,20	0,307
CREDIT EUROPE BANK SA	356,43	0,002
IDEA BANK	0,00	0,000
Libra Internet Bank	18,39	0,000
OTP BANK ROMANIA	0,00	0,000
PATRIA BANK	0,00	0,000
Numerar in casierie	0,00	0,000
<b>Total</b>	<b>82.923,43</b>	<b>0,415</b>

2. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romani	236.745,36	4,6611	1.103.493,80	5,526
Banca Romaneasca	0,00	4,6611	0,00	0,000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0,00	4,6611	0,00	0,000
Citi Bank	0,00	4,6611	0,00	0,000
CREDIT EUROPE BANK SA	0,00	4,6611	0,00	0,000
IDEA BANK	0,00	4,6611	0,00	0,000
Libra Internet Bank	18,91	4,6611	88,14	0,000
OTP BANK ROMANIA	4,58	4,6611	21,35	0,000
PATRIA BANK	61,24	4,6611	285,45	0,001
<b>TOTAL</b>			<b>1,103,886,73</b>	<b>5,526</b>

3. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in USC

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romani	5,070,66	4,0033	20.299,37	0,102
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0,00	4,0033	0,00	0,000
Citi Bank	0,00	4,0033	0,00	0,000
OTP BANK ROMANIA	0,04	4,0033	0,16	0,000
<b>TOTAL</b>			<b>20.299,53</b>	<b>0,102</b>

4. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in HUF

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	HUF	lei	lei	%
Banca Comerciala Romani	1.229.038,70	0,0142	17.413,02	0,087
<b>TOTAL</b>			<b>17.413,02</b>	<b>0,087</b>

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denumite 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 Romani	29-Jun-18	30-Jun-18	266.918,68	18,39	18,39	266.937,07	1,337
OTP BANK ROMANIA	29-Jun-18	2-Jul-18	56.069,66	2,61	2,61	56.072,27	0,281
<b>Total</b>						<b>323.009,34</b>	<b>1,617</b>

OTP Premium Return – Situatia detaliata a activelor la data de 30.06.2018

2. Depozite bancare denuminate in EUR

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM
			eur	eur	eur	lei	lei	%
Banca Romaneasca	31-May-18	29-May-19	250.000,00	8,90	267,12	4,6611	1,166,520,09	5,841
<b>TOTAL</b>							<b>1,166,520,09</b>	<b>5,841</b>

XII. Instrumente financiare derivate negociate in 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 in activul total al OPCVM
					lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300,000.00	Vanzare	25-May-18	28-May-19	4,7961	4,6611	4,8028	-0,0067	-2,010.00	-0,010
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	400,000.00	Vanzare	4-Jan-18	4-Jan-19	4,7744	4,6611	4,7421	0,0323	12,920.00	0,065
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	100,000.00	Vanzare	30-Jan-18	30-Jul-18	4,7168	4,6611	4,6747	0,0421	4,210.00	0,021
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300,000.00	Vanzare	25-Jul-17	25-Jul-18	4,6257	4,6611	4,6726	-0,0469	-14,070.00	-0,070
Citi Bank	50,000.00	Vanzare	22-Sep-17	24-Sep-18	4,6799	4,6611	4,6985	-0,0186	-930.00	-0,005
Citi Bank	200,000.00	Vanzare	3-Jan-18	3-Jan-19	4,7892	4,6611	4,7417	0,0475	9,500.00	0,048
Citi Bank	200,000.00	Vanzare	26-Jan-18	28-Jan-19	4,8343	4,6611	4,7521	0,0822	16,440.00	0,082
Citi Bank	100,000.00	Vanzare	12-Apr-18	12-Apr-19	4,7907	4,6611	4,7829	0,0078	780.00	0,004
Citi Bank	218,000.00	Vanzare	18-Apr-18	19-Apr-19	4,7945	4,6611	4,7859	0,0086	1,874.80	0,009
Citi Bank	150,000.00	Vanzare	20-Apr-18	22-Apr-19	4,8064	4,6611	4,7872	0,0192	2,880.00	0,014
Citi Bank	190,000.00	Vanzare	14-Jun-18	13-Jun-19	4,8471	4,6611	4,8098	0,0373	7,087.00	0,035
ING BANK Romania	265,000.00	Vanzare	21-May-18	21-May-19	4,7838	4,6611	4,7998	-0,0170	-4,505.00	-0,023
ING BANK Romania	230,000.00	Vanzare	18-Jan-18	17-Jan-19	4,7975	4,6611	4,7475	0,0500	11,500.00	0,058
ING BANK Romania	100,000.00	Vanzare	15-Jan-18	15-Jan-19	4,7780	4,6611	4,7467	0,0313	3,130.00	0,016
<b>TOTAL</b>									<b>48,806.80</b>	<b>0,244</b>

2. Contracte forward USD/RON

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR USD/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	Cumparare	14-May-18	11-Mar-19	3,8793	4,0033	4,0156	0,1363	13,630.00	0,068
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	400,000.00	Vanzare	4-Apr-18	8-Apr-19	3,7785	4,0033	4,0160	-0,2375	-95,000.00	-0,476
Citi Bank	250,000.00	Vanzare	9-Mar-18	11-Mar-19	3,7889	4,0033	4,0156	-0,2267	-56,675.00	-0,284
Citi Bank	190,000.00	Vanzare	15-Mar-18	15-Mar-19	3,7640	4,0033	4,0156	-0,2516	-47,804.00	-0,239
<b>TOTAL</b>									<b>-185,849.00</b>	<b>-0,931</b>

XIII. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

2. Titluri de participare denuminate 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	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM
				eur	eur	lei	lei	%	%
AMUNDI TOPIX HDG	LU1681037864	29-Jun-18	410.00	-	224,6700	4,6611	429,738,04	0,000	2,152
<b>TOTAL</b>							<b>429,738,04</b>		<b>2,152</b>

XV. Dividende sau alte drepturi de primit

3. Dividende de incasat denuminate in USD

Emitent	Simbol actiune	Data ex-dividend	Nr. actiuni detinute	Dividend brut	Curs valutar BNR USD/RON	Suma de incasat	Pondere in activul total al OPCVM
				USD	lei	lei	%
BANK OF AMERICA CORP	US0605051046	31-May-18	1,080	0,1200	4,0033	363,18	0,002
<b>Total</b>						<b>363,18</b>	<b>0,002</b>

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	29-Jun-16	29-Jun-17	30-Jun-18
Activ net	12,979,308,10	17,537,081,82	19,931,654,08
VUAN	10,7948	11,5267	11,5844

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,  
Dan POPOVICI

Intocmit,  
Filon ANGHEL