

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 DollarBond

Decizie autorizare: A/2/09.01.2014  
Cod inscriere: CSC06DIR/400085

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2017 - 31.12.2018

Denumire element	31.12.2017				31.12.2018				Diferente (Lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (USD)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (USD)	Lei	
<b>I Total active</b>	<b>100.10%</b>	<b>100.00%</b>	<b>10,350,458.47</b>	<b>40,278,809.14</b>	<b>100.12%</b>	<b>100.00%</b>	<b>8,298,058.14</b>	<b>33,802,969.65</b>	<b>-6,475,839.49</b>
<b>1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:</b>	<b>83.85%</b>	<b>83.76%</b>	<b>8,669,553.30</b>	<b>33,737,566.66</b>	<b>66.88%</b>	<b>66.80%</b>	<b>5,543,466.76</b>	<b>22,581,866.21</b>	<b>-11,155,700.45</b>
1.1. valori mobiliare și instrumente ale pietei monetare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată sau un sistem alternativ de tranzacționare din România, din care:	1.19%	1.19%	123,091.21	479,009.46	1.42%	1.42%	117,626.54	479,163.47	154.01
1.1.3. obligatiuni, din care:	1.19%	1.19%	123,091.21	479,009.46	1.42%	1.42%	117,626.54	479,163.47	154.01
1.1.3.1. Obligatiuni corporative cotate	1.16%	1.16%	120,243.82	467,928.82	1.39%	1.39%	114,977.23	468,371.22	442.40
1.1.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.03%	0.03%	2,847.40	11,080.64	0.03%	0.03%	2,649.31	10,792.25	-288.39
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzacționate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzacționare dintr-un stat membru, din care:	82.66%	82.57%	8,546,462.08	33,258,557.20	65.46%	65.39%	5,425,840.22	22,102,702.74	-11,155,854.46
1.2.3. obligatiuni, din care:	82.66%	82.57%	8,546,462.08	33,258,557.20	65.46%	65.39%	5,425,840.22	22,102,702.74	-11,155,854.46
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	69.13%	69.06%	7,147,655.15	27,815,100.01	64.95%	64.87%	5,382,871.35	21,927,664.72	-5,887,435.28
1.2.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	13.53%	13.51%	1,398,806.94	5,443,457.19	0.52%	0.52%	42,968.88	175,038.01	-5,268,419.18
<b>2 valori mobiliare nou emise</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>3 alte valori mobiliare și instrumente ale pieței monetare menționate la art. 83 alin.(1) lit.a) din O.U.G. nr. 32/2012 din care:</b>	<b>1.96%</b>	<b>1.96%</b>	<b>202,929.97</b>	<b>789,701.96</b>	<b>2.43%</b>	<b>2.43%</b>	<b>201,798.88</b>	<b>822,047.91</b>	<b>32,345.95</b>
3.1. valori mobiliare	1.96%	1.96%	202,929.97	789,701.96	2.43%	2.43%	201,798.88	822,047.91	32,345.95
3.1.2. obligatiuni neadmise la tranzacționare	1.96%	1.96%	202,929.97	789,701.96	2.43%	2.43%	201,798.88	822,047.91	32,345.95
<b>4 Produe structurate admise sau tranzacționate pe o piață reglementată sau un sistem alternativ de tranzacționare din care:</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>5 Depozite bancare din care:</b>	<b>5.97%</b>	<b>5.96%</b>	<b>616,881.16</b>	<b>2,400,593.02</b>	<b>21.68%</b>	<b>21.65%</b>	<b>1,796,502.27</b>	<b>7,318,231.63</b>	<b>4,917,638.61</b>
5.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	5.97%	5.96%	616,881.16	2,400,593.02	21.68%	21.65%	1,796,502.27	7,318,231.63	4,917,638.61
<b>6 Instrumente financiare derivate tranzacționate pe o piata reglementata</b>	<b>-1.58%</b>	<b>-1.58%</b>	<b>-163,045.07</b>	<b>-634,489.91</b>	<b>1.73%</b>	<b>1.73%</b>	<b>143,780.69</b>	<b>585,705.03</b>	<b>1,220,194.93</b>
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-1.58%	-1.58%	-163,045.07	-634,489.91	1.73%	1.73%	143,780.69	585,705.03	1,220,194.93
6.4.1. Contracte forward	-1.58%	-1.58%	-163,045.07	-634,489.91	1.73%	1.73%	143,780.69	585,705.03	1,220,194.93
<b>7 Conturi curente si numerar</b>	<b>0.64%</b>	<b>0.64%</b>	<b>66,237.50</b>	<b>257,763.25</b>	<b>0.92%</b>	<b>0.92%</b>	<b>75,999.57</b>	<b>309,591.85</b>	<b>51,828.60</b>
<b>8 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzacționate pe o piata reglementata, conform art. 82 lit.g) din O.U.G. nr. 32/2012 - Contracte de tip repo pe titluri de valoare</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>9 Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.</b>	<b>9.26%</b>	<b>9.25%</b>	<b>957,901.62</b>	<b>3,727,674.15</b>	<b>6.46%</b>	<b>6.45%</b>	<b>535,526.59</b>	<b>2,181,521.12</b>	<b>-1,546,153.03</b>
<b>10 Dividende sau alte drepturi de incasat</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>983.38</b>	<b>4,005.90</b>	<b>4,005.90</b>
<b>11 Titluri suport pentru operatiuni de report</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>12 Alte active</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>II Total obligatii</b>	<b>0.10%</b>	<b>0.10%</b>	<b>10,537.86</b>	<b>41,008.08</b>	<b>0.12%</b>	<b>0.12%</b>	<b>9,753.22</b>	<b>39,730.71</b>	<b>-1,277.37</b>
1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate S.A.I.	0.08%	0.08%	8,075.42	31,425.49	0.08%	0.08%	7,042.17	28,686.98	-2,738.51
2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	1,362.89	5,303.68	0.01%	0.01%	1,188.55	4,841.67	-462.01
7. Cheltuieli cu plata comisioanelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	754.51	2,936.17	0.01%	0.01%	646.53	2,633.72	-302.45
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.00%	0.00%	224.89	875.18	0.00%	0.00%	216.03	880.00	4.82
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	120.15	467.55	0.01%	0.01%	659.94	2,688.33	2,220.78
<b>III Valoarea activului net (I - II)</b>	<b>100.00%</b>	<b>99.90%</b>	<b>10,339,920.61</b>	<b>40,237,801.05</b>	<b>100.00%</b>	<b>99.88%</b>	<b>8,288,304.92</b>	<b>33,763,238.93</b>	<b>-6,474,562.12</b>

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

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2018	Perioada corespunzatoare a anului precedent 31.12.2017	Diferente
Valoare activ net	8,288,304.92	10,339,920.61	-2,051,615.69
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	749,483.9939	938,081.5071	-188,597.5132
Valoarea unitara a activului net	11.0587	11.0224	0.0363

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA  
Director General  
Dan Marius POPOVICI

Intocmit  
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE



## FDI OTP Dollar Bond – Situatia detaliata a activelor la data de 31.12.2018

### 4. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale denumite in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulat(a)	Preț piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unei emisuni	Pondere in activul total al OPCVM
							%	usd	usd	usd	usd	usd	usd	usd	%
Romania	US77586TAC09	-	20	16-May-17	22-Aug-18	22-Feb-19	4.3750%	2.120.00	0.24	31.35	0.00	2.011.9600	40.866.28	0.000	0.492
Romania	US77586TAD81	-	1	14-May-14	22-Jul-18	22-Jan-19	4.8750%	2.128.00	0.27	43.06	0.00	2.059.5300	2.102.59	0.000	0.025
<b>TOTAL</b>													<b>42,968.88</b>		<b>0.518</b>

### VIII. Alte instrumente ale pietei monetare mentionate la art. 83 alin (1) lit.a) din O.U.G. nr.32/2012

#### 4. Obligatiuni corporative neadmise la tranzactionare

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulate(a)	Preț Bloomberg	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni al unei emisuni	Pondere in activul total al OPCVM
						%	usd	usd	usd	usd	usd	usd	%	%
ING BANK NV	USN45780CW66	200	16-Aug-16	15-Nov-18	15-Feb-19	3.4961%	1.000.00	0.10	4.56	0.00	1.004.43	201.798.88	0.000	2.432
<b>TOTAL</b>												<b>201,798.88</b>		<b>2,432</b>

### IX. Disponibil in conturi curente si numerar

#### 1. Disponibil in conturi curente si numerar in lei

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	lei	usd	%
Banca Comerciala Romana	2.491.11	4.0736	611.53	0.007
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	20.49	4.0736	5.03	0.000
Citi Bank	0.00	4.0736	0.00	0.000
ING BANK Romania	378.29	4.0736	92.88	0.001
OTP BANK ROMANIA	27.213.68	4.0736	6.680.50	0.081
<b>TOTAL</b>			<b>7,389.92</b>	<b>0.089</b>

#### 2. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	eur	lei	lei	usd	%
Banca Comerciala Romana	770.85	4.6639	4.0736	882.55	0.011
Banca Romaneasca	1.39	4.6639	4.0736	1.59	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	4.6639	4.0736	0.00	0.000
Citi Bank	0.00	4.6639	4.0736	0.00	0.000
CREDIT EUROPE BANK SA	72.24	4.6639	4.0736	82.71	0.001
ING BANK Romania	0.00	4.6639	4.0736	0.00	0.000
Libra Internet Bank	0.00	4.6639	4.0736	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.6639	4.0736	0.00	0.000
<b>TOTAL</b>				<b>966.85</b>	<b>0.012</b>

#### 2. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in USD

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	usd	%
Banca Comerciala Romana	5.320.15	0.064
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	0.000
Citi Bank	43.362.37	0.523
ING BANK Romania	18.960.28	0.228
Libra Internet Bank	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000
NUMERAR IN CASIERIE	0.00	0.000
<b>TOTAL</b>	<b>67,642.80</b>	<b>0.815</b>

### X. Depozite bancare constituite la instituti de credit din România

#### 3. Depozite bancare denumite in EUR

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Rata dobanzii	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM
			%	eur	eur	eur	lei	lei	usd	%
Banca Romaneasca	23-Jul-18	21-Jan-19	1.2000%	350,000.00	11.51	1.864.11	4.6639	4.0736	402.852.27	4.855
Banca Romaneasca	23-Jul-18	21-Jan-19	1.2000%	250,000.00	8.22	1.331.51	4.6639	4.0736	287.751.62	3.468
Banca Romaneasca	30-Oct-18	30-Oct-19	1.8500%	139,990.00	7.10	447.01	4.6639	4.0736	160.787.55	1.938
CREDIT EUROPE BANK SA	24-Dec-18	25-Jan-19	0.2000%	112,000.00	0.61	4.91	4.6639	4.0736	128.235.39	1.545
CREDIT EUROPE BANK SA	24-Dec-18	25-Jan-19	0.2000%	300,000.00	1.64	13.15	4.6639	4.0736	343.487.66	4.139
Libra Internet Bank	18-Dec-18	17-Dec-19	0.7500%	150,000.00	3.08	43.15	4.6639	4.0736	171.785.71	2.070
Libra Internet Bank	18-Dec-18	17-Dec-19	0.7500%	162,998.93	3.35	46.89	4.6639	4.0736	186.672.57	2.250
<b>TOTAL</b>									<b>1,681,572.78</b>	<b>20,265</b>

**FDI OTP Dollar Bond – Situatia detaliata a activelor la data de 31.12.2018**

**3. Depozite bancare denuminate in USD**

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Rata dobanzii		Valoarea initiala		Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoarea totala	Pondere in activul total al OPCVM	
			%	usd	usd	usd				%	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	31-Dec-18	3-Jan-19	1.5283%	14.597.77	0.62	0.62		14.598.39		0.176	
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-18	3-Jan-19	0.7000%	100.329.17	1.92	1.92		100.331.09		1.209	
<b>TOTAL</b>								<b>114.929.48</b>		<b>1.385</b>	

**XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate**

**1. Contracte forward USD/EUR**

**1.1. Contracte forward fara livrare USD/EUR**

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs valutar BNR USD/RON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM	
											USD	USD
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	140.000.00	Vanzare	23-Mar-18	25-Mar-19	1.2705	4.6639	4.0736	1.1532	0.1173	16.428.79	0.198	
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	115.000.00	Vanzare	24-Sep-18	24-Sep-19	1.2152	4.6639	4.0736	1.1714	0.9438	5.935.31	0.061	
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	55.000.00	Vanzare	3-Apr-18	3-Apr-19	1.2665	4.6639	4.0736	1.1541	0.1124	6.180.15	0.074	
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	240.000.00	Vanzare	3-Apr-18	3-Apr-19	1.2665	4.6639	4.0736	1.1541	0.1124	26.967.94	0.325	
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	100.000.00	Vanzare	3-Apr-18	3-Apr-19	1.2665	4.6639	4.0736	1.1541	0.1124	11.236.64	0.135	
Citi Bank	300.000.00	Vanzare	17-May-18	17-May-19	1.2167	4.6639	4.0736	1.1585	0.0582	17.462.16	0.210	
Citi Bank	110.000.00	Vanzare	14-Jun-18	13-Jun-19	1.2189	4.6639	4.0736	1.1612	0.0577	6.350.80	0.077	
Citi Bank	105.000.00	Vanzare	12-Jul-18	12-Jul-19	1.2036	4.6639	4.0736	1.1640	0.0396	4.153.62	0.050	
Citi Bank	125.000.00	Vanzare	29-Jan-18	29-Jan-19	1.2757	4.6639	4.0736	1.1475	0.1282	16.018.85	0.193	
Citi Bank	450.000.00	Vanzare	20-Jul-18	22-Jan-19	1.1873	4.6639	4.0736	1.1469	0.0404	18.182.54	0.219	
Citi Bank	201.000.00	Vanzare	6-Sep-18	6-Sep-19	1.1989	4.6639	4.0736	1.1696	0.0293	5.885.31	0.071	
Citi Bank	200.000.00	Vanzare	17-Sep-18	17-Sep-19	1.2026	4.6639	4.0736	1.1707	0.0319	6.376.67	0.077	
Citi Bank	240.000.00	Vanzare	27-Dec-18	27-Dec-19	1.1768	4.6639	4.0736	1.1808	-0.0040	-971.80	-0.012	
Citi Bank	300.000.00	Vanzare	20-Nov-18	21-Nov-19	1.1801	4.6639	4.0736	1.1772	0.0029	868.99	0.010	
ING BANK Romania	100.000.00	Vanzare	17-Dec-18	17-Dec-19	1.1696	4.6639	4.0736	1.1798	-0.0102	-1.018.64	-0.012	
ING BANK Romania	150.000.00	Vanzare	29-Oct-18	29-Oct-19	1.1755	4.6639	4.0736	1.1749	0.0006	90.90	0.001	
ING BANK Romania	200.000.00	Vanzare	19-Jul-18	19-Jul-19	1.1949	4.6639	4.0736	1.1647	0.0301	6.022.31	0.073	
<b>TOTAL</b>										<b>145.270.53</b>	<b>1.781</b>	

**1.2. Contracte forward fara livrare 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	
										USD	USD
Citi Bank	560.000.00	Vanzare	14-Dec-18	16-Jan-19	0.2428	4.0736	0.2455	-0.0027	-1.489.84	-0.018	
<b>TOTAL</b>									<b>-1,489.84</b>	<b>-0.018</b>	

**XIV. 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	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM	
										eur	eur
BRD EURO FOND	ROFDIN0001D9	-	365.2215	138.0521	-	4.6639	4.0736	57.725.83	0.018	0.696	
OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	26.961.9625	12.6880	-	4.6639	4.0736	391.665.68	1.032	4.720	
<b>TOTAL</b>								<b>449,391.51</b>		<b>5.416</b>	

**3. Titluri de participare denuminate in USD**

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM	
										usd	usd
FDI BRD USD FOND	ROFDIN000267	-	806.3995	106.8144	-	4.6639	4.0736	86.135.08	0.276	1.038	
<b>TOTAL</b>								<b>86,135.08</b>		<b>1.038</b>	

**XV. Dividende sau alte drepturi de primit**

**6. Cupoane si principal de incasat USD**

Emitent	Cod ISIN	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM	
			USD	%
C FLOAT 03/30/21	US172967KL43	983.38	0.012	
<b>TOTAL</b>		<b>983.38</b>	<b>0.012</b>	

**Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani**

	31-Dec-16	31-Dec-17	31-Dec-18
Activ net	8.549.243.24	10.339.920.61	8.288.304.92
VUAN	10.8511	11.0224	11.0587

**OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA**

Membru Directorat,  
Dan POPOVICI

Intocmit  
Filon ANGHEL