

SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA

OTP Obligatiuni

 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

 Decizie autorizare: 375/27.02.2008
 Cod inscriere: CSC06DIR/400048

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 (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%	160,618,523.86	160,618,523.86	-31,905,132.47
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	69.66%	69.59%	133,982,593.09	133,982,593.09	53.52%	53.47%	85,880,455.48	85,880,455.48	-48,102,137.61
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	13.18%	13.16%	21,141,672.40	21,141,672.40	-9,003,964.80
1.1.3. obligatiuni, din care:	15.67%	15.66%	30,145,637.19	30,145,637.19	13.18%	13.16%	21,141,672.40	21,141,672.40	-9,003,964.80
1.1.3.1 Obligatiuni corporative cotate	8.51%	8.50%	16,373,407.82	16,373,407.82	9.28%	9.27%	14,892,841.57	14,892,841.57	-1,480,566.25
1.1.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	2.71%	2.71%	5,211,211.24	5,211,211.24	0.69%	0.69%	1,111,630.74	1,111,630.74	-4,099,580.50
1.1.3.3 Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	4.45%	4.45%	8,561,018.14	8,561,018.14	3.20%	3.20%	5,137,200.09	5,137,200.09	-3,423,818.05
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:	53.99%	53.93%	103,836,955.89	103,836,955.89	40.34%	40.31%	64,738,783.08	64,738,783.08	-39,098,172.81
1.2.3. obligatiuni, din care:	53.99%	53.93%	103,836,955.89	103,836,955.89	40.34%	40.31%	64,738,783.08	64,738,783.08	-39,098,172.81
1.2.3.1 Obligatiuni corporative cotate	44.34%	44.30%	85,284,181.01	85,284,181.01	38.97%	38.93%	62,532,076.30	62,532,076.30	-22,752,104.71
1.2.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	9.65%	9.64%	18,552,774.88	18,552,774.88	1.38%	1.37%	2,206,706.78	2,206,706.78	-16,346,068.10
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
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
5 Depozite bancare din care:	20.14%	20.12%	38,732,873.27	38,732,873.27	31.94%	31.91%	51,250,676.66	51,250,676.66	12,517,803.39
5.1. depozite bancare constituite la institutiile de credit din Romania	20.14%	20.12%	38,732,873.27	38,732,873.27	31.94%	31.91%	51,250,676.66	51,250,676.66	12,517,803.39
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	-0.32%	-0.32%	-614,492.39	-614,492.39	1.45%	1.44%	2,319,294.51	2,319,294.51	2,933,786.90
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.32%	-0.32%	-614,492.39	-614,492.39	1.45%	1.44%	2,319,294.51	2,319,294.51	2,933,786.90
6.4.1. Contracte forward	-0.32%	-0.32%	-614,492.39	-614,492.39	1.40%	1.40%	2,253,521.59	2,253,521.59	2,868,013.98
6.4.3. Marja contracte forward	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.04%	0.04%	65,772.92	65,772.92	65,772.92
7 Conturi curente si numerar	0.43%	0.43%	818,676.22	818,676.22	4.29%	4.29%	6,890,792.05	6,890,792.05	6,072,115.83
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	-2.43%	-2.43%	-4,669,161.10	-4,669,161.10	0.00%	0.00%	0.00	0.00	4,669,161.10
8.2. 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./O.P.C.V.M.	9.68%	9.67%	18,624,876.82	18,624,876.82	8.90%	8.89%	14,277,332.30	14,277,332.30	-4,347,544.52
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	2.43%	2.43%	4,677,199.99	4,677,199.99	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-4,677,199.99
12 Alte active	0.00%	0.00%	-27.13	-27.13	0.00%	0.00%	-27.15	-27.15	-0.02
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%	-27.37	-27.37	-0.02
II Total obligatii	0.10%	0.10%	191,358.70	191,358.70	0.10%	0.10%	155,441.11	155,441.11	-35,917.59
1. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate S.A.I.	0.08%	0.08%	149,280.60	149,280.60	0.07%	0.07%	114,636.62	114,636.62	-34,643.98
2. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	23,697.07	23,697.07	0.01%	0.01%	20,754.95	20,754.95	-2,942.11
7. Cheltuieli cu plata comisiunilor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	13,822.83	13,822.83	0.01%	0.01%	12,515.08	12,515.08	-1,307.75
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.00%	0.00%	3,947.25	3,947.25	0.00%	0.00%	3,969.00	3,969.00	21.75
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	610.94	610.94	0.00%	0.00%	3,565.45	3,565.45	2,954.51
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.90%	192,332,297.62	192,332,297.62	100.00%	99.90%	160,463,082.74	160,463,082.74	-31,869,214.88

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

Situatia valorii unitare a activului net - Clasa R

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2018	Perioada corespunzatoare a anului precedent 31.12.2017	Diferente
Valoare activ net	128,792,334.26	192,332,297.62	-63,539,963.36
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	8,462,624.0408	12,865,599.7242	-4,402,975.6834
Valoarea unitara a activului net	15.2190	14.9493	0.2697
Coefficient de impartire pentru clasa de unitati de fond	0.80263226	1.00000000	-0.19736774

Situatia valorii unitare a activului net - Clasa I

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2018	Perioada corespunzatoare a anului precedent 31.12.2017	Diferente
Valoare activ net	31,670,748.48	0.00	31,670,748.48
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	2,074,440.0139	0.0000	2,074,440.0139
Valoarea unitara a activului net	15.2671	0.0000	15.2671
Coefficient de impartire pentru clasa de unitati de fond	0.19736774	0.00000000	0.19736774

 OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
 Director General
 Dan Marius POPOVICI

 Intocmit
 Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

FDI OTP Obligatiuni – Situatia detaliata a activelor la data de 31.12.2018

I. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau pe un sistem alternativ de tranzactionare din Romania

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

5.1. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadenta cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret plata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emise	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
								%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PMB20	ROPMBUDBL020	-	100	4-May-15	4-May-18	4-May-19	3.5800%	10.000.00	0.78	237.36	-134.15	10.232.6500	1.033.585.75	0.045	0.644
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PMB22	ROPMBUDBL038	-	50	4-May-15	4-May-18	4-May-19	4.4300%	10.000.00	1.21	293.72	0.00	-	514.685.75	0.023	0.320
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PMB25	ROPMBUDBL046	-	85	4-May-15	4-May-18	4-May-19	5.1000%	10.000.00	1.40	338.14	0.00	-	878.741.64	0.038	0.547
PRIMARIA MUNICIPIULUI BUCURESTI	PMB28	ROPMBUDBL053	-	250	23-Apr-18	23-Apr-18	23-Apr-19	5.6000%	10.002.00	1.53	388.16	-0.14	-	2.597.506.48	0.450	1.617
Primăria Orașului Oravița	ORV27	ROORVTDDBL014	-	923	1-Mar-09	15-Oct-18	15-Apr-19	4.5000%	62.50	0.01	0.61	0.00	-	58.249.95	1.538	0.036
Primaria Teus	TEU20	ROTEU5DBL015	-	600	29-Sep-15	25-Nov-18	25-May-19	4.6500%	17.60	0.01	0.10	0.12	-	10.690.24	4.000	0.007
Municipiul Timisoara	TIM26C	ROTIMYDBL060	-	990	1-Mar-09	15-Nov-18	15-Feb-19	3.1700%	44.00	0.00	0.18	0.00	-	43.740.28	0.061	0.027
TOTAL														5.137.200.09		3.198

5.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative RON

Emitent	Simbol obligatiune	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadenta cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret plata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emise	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
								%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB19	ROIIBKDBC023	-	25	27-Sep-16	27-Sep-18	27-Sep-19	3.4000%	10.000.00	0.94	88.78	0.00	-	252.219.44	0.008	0.157
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB19	ROIIBKDBC023	-	164	27-Sep-16	27-Sep-18	27-Sep-19	3.4000%	10.000.00	0.94	88.78	0.00	-	1.654.559.56	0.053	1.030
RAIFFEISEN BANK S.A	RBR019	RORFZBDBC036	-	178	14-May-14	15-May-18	15-May-19	5.3500%	10.000.00	1.47	338.59	0.00	-	1.840.265.85	0.356	1.148
UNICREDIT BANK ROMANIA	UCB24	ROUCTBDBC048	-	1.000	27-Jul-17	15-Jul-18	15-Jan-19	4.5100%	10.000.00	1.24	210.05	0.00	-	10.210.054.79	1.639	6.357
TOTAL														13.957.102.64		8.590

5.2. Obligatiuni tranzactionate corporative denumite in EUR

Emitent	Simbol obligatiune	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadenta cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Curs valutar BNR EUR/RON	Pret plata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emise	Pondere in activul total al OPCVM
								%	eur	eur	eur	eur	lei	eur	lei	%	%
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB21E	ROAB22JS4SS1	-	20	15-Oct-18	15-Oct-18	15-Oct-19	1.5026%	10.000.00	0.42	31.72	0.00	4.6639	-	935.738.92	0.030	0.583
TOTAL															935.738.92		0.583

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

Serie	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadenta cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret plata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emise	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
							%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
RO112IDBN032	RO112IDBN032	-	1	9-Mar-15	11-Jun-18	11-Jun-19	5.9500%	11.904.01	1.63	332.55	0.00	10.459.7000	10.792.25	0.000	0.007
RO1323DBN018	RO1323DBN018	-	100	11-Dec-18	26-Apr-18	26-Apr-19	5.8500%	10.670.62	1.60	400.68	0.00	10.607.7000	1.100.838.49	0.001	0.685
TOTAL													1.111.630.74		0.692

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau pe un sistem alternativ de tranzactionare din alt stat membru

3. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale, obligatiuni corporative

3.1. 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	Rata cuponului	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret plata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emise	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
							%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
AKBANK TAS	XS1242426739	-	2	5-Jun-15	6-Jun-18	6-Jun-19	4.0300%	500.000.00	55.21	11.537.95	-	-	1.023.075.89	0.007	0.637
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	2	27-Mar-14	7-Apr-18	7-Apr-19	7.7000%	267.226.54	45.65	14.116.67	-13.813.89	-	535.458.62	0.169	0.333
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	3	24-Jun-14	7-Apr-18	7-Apr-19	7.7000%	281.837.58	38.41	14.116.67	-24.879.69	-	813.223.65	0.254	0.506
Black Sea Trade and Development Bank	XS1917556551	-	5	11-Dec-18	11-Dec-18	11-Dec-19	4.9000%	500.000.00	67.12	1.409.59	0.00	-	2.507.047.95	0.007	1.561
BNP PARIBAS	XS1463358025	-	2	9-Aug-16	9-Aug-18	9-Aug-19	2.9000%	500.000.00	39.73	5.760.27	-	-	1.011.620.55	0.000	0.630
ERSTE GROUP BANK AG	AT000A1FR32	-	1	17-May-16	31-Jul-18	31-Jul-19	3.4000%	506.767.71	42.17	7.172.60	-4.225.41	-	509.714.90	0.001	0.317
FCE Bank plc	XS1412585165	-	4	17-May-16	17-May-18	17-May-19	2.5200%	500.000.00	34.52	7.905.21	-	-	2.031.620.82	0.000	1.265
ING BANK NV	XS1246246467	-	1.000	19-Jun-15	18-Sep-18	18-Sep-19	3.9500%	1.000.00	0.11	11.30	-	-	1.011.301.39	0.002	0.630
International Personal Finance PLC	XS1627191081	-	11	6-Dec-16	6-Dec-18	6-Dec-19	8.0000%	500.000.00	109.59	2.849.32	-	-	502.849.32	0.018	0.313
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1361691576	-	4	12-Feb-16	12-Feb-18	12-Feb-19	2.7000%	500.000.00	36.99	11.946.58	-	-	2.047.786.30	0.005	1.275
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1551746768	-	20	20-Jan-17	19-Jan-18	19-Jan-19	3.4000%	100.000.00	9.32	3.232.33	-	-	2.064.646.58	0.026	1.285
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1553923639	-	10	20-Jan-17	20-Jan-18	20-Jan-19	2.4000%	100.000.00	6.58	2.275.07	-	-	1.022.750.68	0.013	0.637
NIBC Bank N.V.	XS1441636138	-	10	11-Jul-16	11-Jul-18	11-Jul-19	3.3300%	100.000.00	9.12	1.587.45	-	-	1.015.874.52	0.003	0.632
NIBC Bank N.V.	XS1481206768	-	9	26-Aug-16	26-Aug-18	26-Aug-19	2.7000%	100.000.00	7.40	946.85	-	-	998.521.64	0.003	0.566
UNICREDIT GROUP	XS1233785630	-	5	15-May-16	26-Mar-18	26-Mar-19	4.0500%	550.000.00	61.88	5.878.13	-	-	2.779.390.63	0.003	1.730
UNICREDIT GROUP	XS1233785630	-	6	31-May-17	26-Sep-18	26-Mar-19	4.0500%	570.790.00	37.36	5.878.13	-14.219.58	-	3.374.691.30	0.003	2.101
TOTAL													23.159.474.73		14.419

FDI OTP Obligatiuni – Situația detaliată a activelor la data de 31.12.2018

3.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoarea inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret plată	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emisiune	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
							%	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	100	25-Jan-17	15-Oct-18	15-Apr-19	5.0000%	1.072.70	0.14	10.56	-	1.042.6750	4.6639	491.216.20	0.029	0.306
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	100	5-May-17	15-Oct-18	15-Apr-19	5.0000%	1.072.00	0.14	10.56	-	1.042.6750	4.6639	491.216.20	0.029	0.306
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	200	6-Jul-17	15-Oct-18	15-Apr-19	5.0000%	1.057.50	0.14	10.56	-	1.042.6750	4.6639	982.432.40	0.057	0.612
Croatian Bank for Reconstruction and Develo	XS0961637542	-	150	19-May-16	8-May-18	8-May-19	6.0000%	1.116.25	0.06	39.12	-73.34	1.123.9750	4.6639	762.380.42	0.100	0.475
DANMLER AG	DE0004203019	-	3	22-Nov-17	3-Oct-18	3-Jan-19	0.1330%	100.770.00	0.37	33.25	-	97.280.5000	4.6639	1.361.584.80	0.001	0.848
EMERALD CAP	XS1523215116	-	1.700	2-Dec-16	5-Nov-18	5-Feb-19	1.7820%	1.000.00	0.06	2.82	-	-	4.6639	7.951.000.63	0.877	4.950
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	XS1729872736	-	500	1-Dec-17	3-Dec-18	1-Mar-19	0.3840%	1.000.00	0.01	0.31	-	844.5750	4.6639	1.970.228.02	0.001	1.227
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	159	19-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	2.8750%	994.27	0.08	15.36	-	1.000.3950	4.6639	753.243.07	0.015	0.469
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	1411	19-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	2.8750%	1.008.75	0.08	15.36	-	1.000.3950	4.6639	667.970.27	0.013	0.416
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	150	27-Jun-17	20-Jun-18	20-Jun-19	2.8750%	1.008.50	0.08	15.36	-	1.000.3950	4.6639	710.606.67	0.014	0.442
Goldman Sachs Group Inc	XS1173867323	-	250	28-Nov-16	26-Oct-18	28-Jan-19	0.6830%	1.018.70	0.02	1.27	-	995.5750	4.6639	1.162.297.68	0.007	0.724
Goldman Sachs Group Inc	XS1691349523	-	200	27-Oct-17	27-Dec-18	26-Mar-19	0.3100%	1.002.03	0.01	0.04	-	954.7800	4.6639	890.639.85	0.005	0.555
J.P. Morgan Structured Products B.V.	XS0867176423	-	15	11-Jul-13	7-Nov-18	7-Feb-19	4.1320%	52.642.81	4.59	315.64	-2288.15	-	4.6639	4.368.277.09	0.000	2.720
New Europe Property Investments PLC	XS1325078308	-	100	6-May-16	26-Feb-18	26-Feb-19	3.7500%	1.028.00	0.10	31.75	-	941.8600	4.6639	454.080.37	0.011	0.283
New Europe Property Investments PLC	XS1325078308	-	140	11-Jul-16	26-Feb-18	26-Feb-19	3.7500%	1.045.50	0.10	31.75	-	941.8600	4.6639	435.712.52	0.016	0.396
New Europe Property Investments PLC	XS1325078308	-	100	5-Oct-16	26-Feb-18	26-Feb-19	3.7500%	1.060.00	0.10	31.75	-	941.8600	4.6639	454.080.37	0.011	0.283
New Europe Property Investments PLC	XS1325078308	-	150	3-Dec-18	26-Feb-18	26-Feb-19	3.7500%	940.00	0.10	31.75	-	941.8600	4.6639	681.120.56	0.017	0.424
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	200	21-Aug-17	7-Nov-18	7-Feb-19	2.6830%	980.00	0.07	4.10	-	920.0350	4.6639	862.013.74	0.001	0.537
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	100	19-Dec-17	7-Nov-18	7-Feb-19	2.6830%	974.00	0.07	4.10	-	920.0350	4.6639	431.006.87	0.000	0.268
PIRELLI & C SPA	XS1796261397	-	500	26-Mar-18	27-Dec-18	26-Mar-19	0.3900%	1.000.00	0.01	0.05	-	-	4.6639	2.332.076.31	0.062	1.452
RCI BANQUE SA	FR0013322146	-	4	12-Mar-18	12-Dec-18	12-Mar-19	0.2660%	100.000.00	0.74	14.78	-	91.692.0000	4.6639	1.710.844.96	0.010	1.065
Societe Generale	XS1490846810	-	1.800	24-Nov-16	6-Dec-18	6-Jun-19	1.7630%	1.000.00	0.05	1.27	-	4.6639	4.6639	8.405.709.19	0.014	5.233
WIND TRE SPA	XS1708450215	-	200	3-Nov-17	22-Oct-18	22-Jan-19	2.7500%	1.005.00	0.08	5.42	-	898.1800	4.6639	842.863.38	0.003	0.525
TOTAL														39.372.601.58		24.513

4. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoarea inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret plată	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni al unei emisuni	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
							%	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
Macedonia	XS1087984164	-	100	30-Dec-16	24-Jul-18	24-Jul-19	3.9750%	1.005.50	0.11	17.53	0.00	1.052.14	4.6639	498.885.05	0.006	0.311
Republica Montenegro	XS1205717702	-	100	18-Mar-15	18-Mar-18	18-Mar-19	3.8750%	994.44	0.11	30.68	0.00	1.025.70	4.6639	492.685.77	0.008	0.307
ROMANIA	XS1312891549	-	100	15-May-17	29-Oct-18	29-Oct-19	2.7500%	1.061.00	0.08	4.82	0.00	1.077.28	4.6639	757.022.27	0.001	0.471
ROMANIA	XS1313004928	-	100	26-Feb-18	29-Oct-18	29-Oct-19	3.8750%	1.081.34	0.11	6.79	0.00	975.46	4.6639	458.113.69	0.000	0.285
TOTAL														2.206.706.78		1.374

IX. Disponibil în conturi curente și numari

1. Disponibil în conturi curente și numari în lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
	lei	%
Banca Comerciala Romana	274.36	0.000
Banca Romaneasca	0.00	0.000
BANCA TRANSILVANIA S.A.	258.97	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A	47.353.39	0.029
Citi Bank	0.00	0.000
CREDIT EUROPE BANK SA	1.335.13	0.001
IDEA BANK	0.00	0.000
ING BANK Romania	199.905.59	0.124
Libra Internet Bank	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000
PATRIA BANK	1.035.88	0.001
UniCredit Bank Romania	184.23	0.000
Numerar în Casierie	0.00	0.000
TOTAL	260.345.55	0.156

2. Disponibil în conturi curente și numari denumite EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	1.423.358.66	4.6639	6.638.402.45	4.133
Banca Romaneasca	14.67	4.6639	68.42	0.000
BANCA TRANSILVANIA S.A.	73.75	4.6639	343.96	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A	0.00	4.6639	0.00	0.000
Citi Bank	6.90	4.6639	32.18	0.000
CREDIT EUROPE BANK SA	278.00	4.6639	1.296.56	0.001
IDEA BANK	0.00	4.6639	0.00	0.000
ING BANK Romania	0.00	4.6639	0.00	0.000
Libra Internet Bank	5.52	4.6639	25.74	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.6639	0.00	0.000
PATRIA BANK	59.43	4.6639	277.18	0.000
TOTAL			6.640.446.50	4.134

3. Disponibil în conturi curente și numari denumite USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	4.0736	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.0736	0.00	0.000
TOTAL			0.00	0.000

X. Depozite bancare constituite la instituții de credit din România

1. Depozite bancare denumite în lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadenței	Rata dobanzilor	Valoarea inițială	Cresterea zilnică	Dobanda cumulată	Valoarea totală	Pondere în activul total al O.P.C.V.M.
			%	lei	lei	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	28-Dec-18	7-Jan-19	2.0000%	2.000.000.00	111.11	444.44	2.000.444.44	1.245
Citi Bank	31-Dec-18	3-Jan-19	0.6300%	385.565.15	6.75	6.75	385.571.90	0.240
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-18	3-Jan-19	1.7000%	3.999.684.28	186.29	186.29	3.999.870.57	2.490
TOTAL							6.385.866.91	3.976

Emitent	Descriere	Valoare curenta	Valoare actualizată	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
		lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIETÉ GENERALE S.A.	Marja contracte forward	20.033.96	20.033.96	0.012
TOTAL			20.033.96	0.012

Emitent	Descriere	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizată	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
		EUR	lei	lei	%
Citi Bank	Marja contracte forward	9.807.02	4.6639	45.738.96	0.028
TOTAL				45.738.96	0.028

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denuminate in lei

Denumire fond	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al O.P.C.V.M.
				lei			%	%
FDI BRD SIMFONIA	ROFDIN000010	-	54.030.6311	41.1661	-	2.224.230.36	0.194	1.385
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	ROFDIN0000X9	-	89.778.3629	30.6600	-	2.752.604.61	24.390	1.714
TOTAL						4.976.834.97		3.099

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 O.P.C.V.M.
				EUR		EUR		lei	%
FDI OTP EUROBOOND	ROFDIN0001J6	-	157.167.87	12.6880	-	4.6639	9.300.497.33	6.015	5.790
TOTAL							9.300.497.33		5.790

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	31-Dec-16	31-Dec-17	31-Dec-18
Activ net - Clasa R	206.772.991.59	192.332.297.62	128.792.334.26
VUAN - Clasa R	14.6750	14.9493	15.2190
Activ net - Clasa I	-	-	31.670.748.48
VUAN - Clasa I	-	-	15.2671
Coefficient - Clasa R	1.000000	1.000000	0.802632
Coefficient - Clasa I	0.000000	0.000000	0.197368

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

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit
Filon ANGHEL