

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 Euro Premium Return

Decizie autorizare: 231/29.10.2015
Cod inscriere: CSC06FDIR/400097

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2018 - 30.06.2019

Denumire element	31.12.2018				30.06.2019				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (EUR)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (EUR)	Lei	
I Total active	100.10%	100.00%	1,275,529.54	5,948,942.24	100.20%	100.00%	1,132,418.85	5,362,116.49	-586,825.75
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	44.00%	43.95%	560,643.08	2,614,783.26	75.94%	75.79%	858,305.10	4,064,160.49	1,449,377.22
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:	13.20%	13.19%	168,229.35	784,604.86	4.48%	4.47%	50,606.23	239,625.54	-544,979.32
1.1.3. obligatiuni, din care:	13.20%	13.19%	168,229.35	784,604.86	4.48%	4.47%	50,606.23	239,625.54	-544,979.32
1.1.3.1 Obligatiuni corporative cotate	3.94%	3.94%	50,212.40	234,185.61	4.48%	4.47%	50,606.23	239,625.54	5,439.92
1.1.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	9.26%	9.25%	118,016.95	550,419.25	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-550,419.25
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:	22.37%	22.35%	285,126.35	1,329,800.80	60.31%	60.19%	681,559.76	3,227,253.64	1,897,452.83
1.2.1. actiuni	6.13%	6.12%	78,122.53	364,355.69	16.87%	16.84%	190,707.87	903,020.81	538,665.12
1.2.3. obligatiuni, din care:	16.24%	16.23%	207,003.82	965,445.11	43.43%	43.35%	490,851.90	2,324,232.82	1,358,787.71
1.2.3.1 Obligatiuni corporative cotate	11.63%	11.61%	148,148.39	690,949.26	9.34%	9.32%	105,519.99	499,647.69	-191,301.57
1.2.3.2 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	4.62%	4.61%	58,855.43	274,495.85	34.09%	34.03%	385,331.91	1,824,585.13	1,550,089.28
1.3. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat terț sau negociate pe o alta piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat terț, care operează in mod regulat și este recunoscuta și deschisa publicului, aprobată de A.S.F., din care:	8.42%	8.41%	107,287.38	500,377.60	11.16%	11.14%	126,139.11	597,281.31	96,903.71
1.3.1. actiuni	8.42%	8.41%	107,287.38	500,377.60	11.16%	11.14%	126,139.11	597,281.31	96,903.71
5 Depozite bancare din care:	18.92%	18.90%	241,098.00	1,124,456.98	3.53%	3.53%	39,922.60	189,037.48	-935,419.50
5.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	18.92%	18.90%	241,098.00	1,124,456.98	3.53%	3.53%	39,922.60	189,037.48	-935,419.50
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	-0.52%	-0.52%	-6,688.80	-31,195.90	0.06%	0.06%	661.82	3,133.80	34,329.70
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.52%	-0.52%	-6,688.80	-31,195.90	0.06%	0.06%	661.82	3,133.80	34,329.70
6.4.1. Contracte forward	-0.52%	-0.52%	-6,688.80	-31,195.90	0.06%	0.06%	661.82	3,133.80	34,329.70
7 Conturi curente si numerar	14.64%	14.63%	186,598.37	870,276.15	1.70%	1.70%	19,215.46	90,987.10	-779,289.05
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	-9.32%	-9.30%	-105,296.33	-498,588.65	-498,588.65
8.2. Contracte de tip repo pe titluri de valoare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-9.32%	-9.30%	-105,296.33	-498,588.65	-498,588.65
9 Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.	23.06%	23.04%	293,878.89	1,370,621.76	18.85%	18.81%	213,062.99	1,008,874.57	-361,747.19
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	9.43%	9.41%	106,547.21	504,511.71	504,511.71
12 Alte active	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
II Total obligatii	0.10%	0.10%	1,218.24	5,681.76	0.20%	0.20%	2,235.92	10,587.33	4,905.56
1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate S.A.I.	0.04%	0.04%	548.39	2,557.63	0.14%	0.14%	1,586.58	7,512.61	4,954.97
2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.02%	0.02%	234.34	1,092.92	0.02%	0.02%	247.00	1,169.55	76.63
7. Cheltuieli cu plata comisioanelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	99.29	463.08	0.01%	0.01%	82.15	388.98	-74.10
82.8554 Cheltuielile cu auditul financiar	0.01%	0.01%	171.53	800.00	0.01%	0.01%	82.86	392.33	-407.67
9. Alte cheltuieli aprobate	0.01%	0.01%	164.70	768.13	0.02%	0.02%	237.35	1,123.86	355.73
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.90%	1,274,311.30	5,943,260.48	100.00%	99.80%	1,130,182.92	5,351,529.17	-591,731.32

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

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 30.06.2019	Perioada corespunzatoare a anului precedent 30.06.2018	Diferente
Valoarea activ net	1,130,182.92	1,567,248.63	-437,065.70
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	131,609.0043	166,841.2685	-35,232.2642
Valoarea unitara a activului net	8.5874	9.3937	-0.8063

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

FDI OTP Euro Premium Return – Situatia detaliata a investitiilor la data de 30.06.2019

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

5.2. Obligatiuni admise la tranzactionare 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 scadentei cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unei emisii	Pondere in activul total al OPCVM
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB20E	ROIBKDBC049	-	5	25-Sep-17	25-Sep-18	25-Sep-19	1.5930%	EUR 10.000.00	EUR 0.44	EUR 121.25	EUR 0.00	-	EUR 50.606.23	% 0.001	% 4.469
TOTAL														EUR 50,606.23		4.469

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

1.1. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in EUR

Emitent	Cod ISIN	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
				EUR	EUR	EUR	%	%
A&S Austria Technologie & Systemtechnik	AT0000969985	28-Jun-19	1.770	0.00	15.92	28.178.40	0.005	2.468
NOKIA OYJ	FI0009000881	28-Jun-19	8.500	0.00	4.37	37.111.00	0.003	3.277
NOVA LJUBLJANSKA BANKA D	US86980N2036	28-Jun-19	2.000	0.00	11.60	23.200.00	0.002	2.049
OMV AG	AT0000743059	28-Jun-19	700	0.00	42.85	29.995.00	0.000	2.649
ZAVAROVANICA TRIGLAV D.D.	SI0021111651	28-Jun-19	1.000	0.00	31.60	31.600.00	0.004	2.790
TOTAL						150,084.40		13.253

1.2. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR USD/RON	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				USD	USD	lei	lei	lei	%	%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	US7960502018	28-Jun-19	55	-	832.00	4.1587	4.7351	40.189.67	0.000	3.549
TOTAL								40,189.67		3.549

1.3. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in GBP

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR GBP/RON	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				GBP	GBP	lei	lei	EUR	%	%
BP PLC	GB0007980591	28-Jun-19	71	0.0000	5.4860	5.2735	4.7351	433.79	0.000	0.038
TOTAL								433.79		0.038

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 EUR

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	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unei emisii	Pondere in activul total al OPCVM
							%	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
Cable Communications Systems N.V.	XS1405770576	-	50	12-Feb-19	15-Apr-19	15-Oct-19	5.0000%	1,017.50	0.14	10.28	0.00	1036.84	EUR 52,355.89	0.005	4.623
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	24-Jul-17	20-Jun-19	20-Jun-20	2.8750%	1,017.50	0.08	0.71	0.00	1062.58	EUR 53,164.10	0.005	4.695
TOTAL													EUR 105,519.99		9.318

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

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	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unei emisii	Pondere in activul total al OPCVM
							%	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
MACEDONIA	XS1087984164	-	50	31-May-17	24-Jul-18	24-Jul-19	3.9750%	1,033.50	0.11	37.03	0.0000	1,057.1600	EUR 54,709.37	0.000	4.831
ROMANIA	XS1060842975	-	1	30-Mar-16	24-Apr-19	24-Apr-20	3.6250%	1,112.50	0.10	6.54	0.0000	1,155.0100	EUR 1,161.55	0.000	0.103
ROMANIA	XS1892141620	-	100	21-Jun-19	11-Mar-20	11-Mar-20	2.8750%	1,096.25	0.08	8.64	0.0000	1,109.9750	EUR 111,861.57	0.000	9.878
ROMANIA	XS0852474336	-	1	30-Mar-16	7-Nov-18	7-Nov-19	4.8750%	1,157.50	0.13	31.25	0.0000	1,018.1800	EUR 1,049.43	0.000	0.093
ROMANIA	XS1129788524	-	1	29-May-17	28-Oct-18	28-Oct-19	2.8750%	1,086.00	0.08	19.22	0.0000	1,123.6350	EUR 1,142.85	0.000	0.101
ROMANIA	XS1312891549	-	1	16-May-17	29-Oct-18	29-Oct-19	2.7500%	1,062.49	0.08	18.31	0.0000	1,120.1550	EUR 1,138.46	0.000	0.101
ROMANIA	XS1313004928	-	1	29-Dec-17	29-Oct-18	29-Oct-19	3.8750%	1,103.90	0.11	25.80	0.0000	1,148.4500	EUR 1,174.25	0.000	0.104
ROMANIA	XS1934867547	-	110	3-Jun-19	3-Apr-19	8-Dec-19	2.0000%	1,017.90	0.05	4.77	0.0000	1,060.7050	EUR 117,201.93	0.000	10.350
ROMANIA	XS1934867547	-	90	18-Jun-19	3-Apr-19	8-Dec-19	2.0000%	1,038.24	0.05	4.77	0.0000	1,060.7050	EUR 95,892.49	0.000	8.468
TOTAL													EUR 385,331.91		34.027

III. Valorile mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat terț

1 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				USD	USD	EUR	lei	EUR	%	%
AMAZON.COM INC	US0231351067	28-Jun-19	21	0.0000	1,893.6300	4.7351	4.1587	34,925.52	0.000	3.084
BOOKING HOLDINGS INC	US09857L1089	28-Jun-19	17	0.0379	1,874.7100	4.7351	4.1587	27,990.55	0.000	2.472
CORTEVA INC	US22052L1044	28-Jun-19	170	0.0416	29.5700	4.7351	4.1587	4,414.98	0.000	0.390
DOW INC	US2605571031	28-Jun-19	170	0.0416	49.3100	4.7351	4.1587	7,362.28	0.000	0.650
DUPONT DE NEMOURS INC	US26514N1028	28-Jun-19	170	0.0416	75.0700	4.7351	4.1587	11,206.40	0.000	0.990
Microsoft Corp	US5949181045	28-Jun-19	342	0.0000	133.9600	4.7351	4.1587	40,237.38	0.000	3.553
TOTAL								126,139.11		11.133

IX. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in lei

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	lei	eur	%
Banca Comerciala Romana	0.00	4.7351	0.00	0.000
Banca Romaneasca	0.00	4.7351	0.00	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.71	4.7351	0.15	0.000
Citi Bank	1.00	4.7351	0.21	0.000
OTP BANK ROMANIA	7,866.11	4.7351	1,661.23	0.147
TOTAL			1,661.60	0.147

FDI OTP Euro Premium Return – Situatia detaliata a investitiilor la data de 30.06.2019

2.1. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	EUR	%
Banca Comerciala Romana	5,544.15	0.490
Banca Romaneasca	52.96	0.005
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	195.27	0.017
Citi Bank	1,589.58	0.140
OTP BANK ROMANIA	9,489.87	0.838
NUMERAR IN CASERIE	0.00	0.000
TOTAL	16,871.83	1.490

2.2. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	eur	%
Banca Comerciala Romana	776.56	4.1587	4.7351	682.03	0.060
TOTAL				682.03	0.060

X. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania

1. Depozite bancare denuminate in lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Rata dobanzii	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in activul total al OPCVM
			%	lei	lei	lei	eur	%	
Banca Comerciala Romana	28-Jun-19	29-Jun-19	1.6800%	189,028.66	8.82	8.82	4.7351	39,922.60	3.525
TOTAL								39,922.60	3.525

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

1.2. Contracte forward 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
						lei	lei	eur	eur	eur	%
Citi Bank	75,000.00	Vanzare	30-Apr-19	1-Aug-19	0.884799	4.7351	4.1587	0.8760	0.0088	661.82	0.058
Total										661.82	0.058

XIII. Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conform art.82 lit.g) din O.U.G. nr. 32/2012

3. Contracte de report pe titluri emise de administratia publica centrala EUR

Serie emisiunii	Tipul de instrument	Nr. titluri detinute	Data achizitiei	Data scadența	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unui emitent	Pondere in activul total al OPCVM
					eur	eur	eur	eur	%	%
XS1934867547	REPO	100	19-Jun-19	22-Jul-19	1,053.07	0.0117	0.1053	-105,296.33	0.009	-9.298
Total								-105,296.33		-9.298

3. Titluri emise de administratia publica centrala suport pentru operatiuni de report

Emitent	Serie	Data ultimei sedințe in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unui emitent	Pondere in activul total al OPCVM
								eur	eur	eur	eur	eur	eur	eur	%
ROMANIA	XS1934867547	-	96	3-Apr-19	3-Apr-19	8-Dec-19	2.000%	990.78	0.05	4.77	-	1,060.71	102,285.32	0.000	9.032
ROMANIA	XS1934867547	-	4	3-Jun-19	3-Apr-19	8-Dec-19	2.000%	1,017.90	0.05	4.77	-	1,060.71	4,261.89	0.000	0.376
Total													106,547.21		9.409

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denuminate in lei

Denumire fond	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
			lei	lei	lei	EUR	%	%
OTP REAL ESTATE	-	362.0836	509.3096	-	4.7351	38,945.88	3.655	3.439
TOTAL						38,945.88		3.439

2.1. 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	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM
				EUR	EUR	EUR	%	%
db x-trackers II IBoxx EUR High Yield Bond U	LU1109942653	28-Jun-19	2,300.0000	-	17.1820	39,518.60	0.015	3.490
OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	7,306.9367	13.1371	-	95,991.96	0.298	8.477
TOTAL						135,510.56		11.966

2.3. Titluri de participare denuminate in GBP

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 GBP/RON	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere in activul total al OPCVM
				GBP	GBP	lei	lei	EUR	%	%
ISHARES GLBL INFRASTRUCTURE	IE00B1FZS467	28-Jun-19	1,500.0000	-	23.1100	5.2735	4.7351	38,606.55	0.005	3.409
TOTAL								38,606.55		3.409

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	30-Jun-17	30-Jun-18	30-Jun-19
Activ net	1,523,240.79	1,567,248.63	1,130,182.92
VUAN	9.7492	9.3937	8.5874

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Filon ANGHEL