

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: 23129.10.2015
Cod inscriere: CSC06FDIR/400097

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2018 - 31.12.2019

Denumire element	31.12.2018				31.12.2019				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	100.66%	100.00%	1,212,782.47	5,796,251.26	-152,690.98
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	44.00%	43.95%	560,643.08	2,614,783.26	78.24%	77.73%	942,683.21	4,505,365.85	1,890,582.58
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	7.49%	7.44%	90,184.78	431,020.12	-353,684.74
1.1.1. actiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	3.32%	3.30%	39,972.38	191,040.00	191,040.00
1.1.3. obligatiuni, din care:	13.20%	13.19%	168,229.35	784,604.86	4.17%	4.14%	50,212.40	239,980.12	-544,624.74
1.1.3.1. Obligatiuni corporative cotate	3.94%	3.94%	50,212.40	234,185.61	4.17%	4.14%	50,212.40	239,980.12	5,794.51
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	54.15%	53.79%	652,410.52	3,118,065.62	1,788,264.81
1.2.1. actiuni	6.13%	6.12%	78,122.53	364,355.69	18.70%	18.58%	225,357.72	1,077,052.14	712,696.45
1.2.3. obligatiuni, din care:	16.24%	16.23%	207,003.82	965,445.11	35.44%	35.21%	427,052.81	2,041,013.47	1,075,568.36
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	11.63%	11.61%	148,148.39	690,949.26	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-690,949.26
1.2.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	4.62%	4.61%	58,855.43	274,495.85	35.44%	35.21%	427,052.81	2,041,013.47	1,766,517.62
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:	8.42%	8.41%	107,287.38	500,377.60	16.61%	16.50%	200,087.90	956,280.10	455,902.50
1.3.1. actiuni	8.42%	8.41%	107,287.38	500,377.60	16.61%	16.50%	200,087.90	956,280.10	455,902.50
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:	18.92%	18.90%	241,098.00	1,124,456.98	1.84%	1.83%	22,183.41	106,021.17	-1,018,435.81
5.1. depozite bancare constituite la institutiile de credit din Romania	18.92%	18.90%	241,098.00	1,124,456.98	1.84%	1.83%	22,183.41	106,021.17	-1,018,435.81
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	-0.52%	-0.52%	-6,688.80	-31,195.90	0.03%	0.03%	359.11	1,716.27	32,912.17
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.52%	-0.52%	-6,688.80	-31,195.90	0.03%	0.03%	359.11	1,716.27	32,912.17
6.4.1. Contracte forward	-0.52%	-0.52%	-6,688.80	-31,195.90	0.03%	0.03%	359.11	1,716.27	32,912.17
7 Conturi curente si numerar	14.64%	14.63%	186,598.37	870,276.15	2.51%	2.50%	30,285.54	144,743.67	-725,532.47
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
8.2. 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.	23.06%	23.04%	293,878.89	1,370,621.76	18.03%	17.92%	217,271.21	1,038,404.30	-332,217.46
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%	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	0.66%	0.66%	7,944.45	37,968.90	32,287.14
1. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate S.A.I.	0.04%	0.04%	548.39	2,557.63	0.60%	0.59%	7,212.60	34,471.17	31,913.53
2. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate depozitarului	0.02%	0.02%	234.34	1,092.92	0.02%	0.02%	190.58	910.82	-182.10
7. Cheltuieli cu plata comisiunilor tarifulor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	99.29	463.08	0.01%	0.01%	93.98	449.17	-13.91
8 Cheltuielile cu auditul financiar	0.01%	0.01%	171.53	800.00	0.01%	0.01%	167.39	800.00	0.00
9. Alte cheltuieli aprobate	0.01%	0.01%	164.70	768.13	0.02%	0.02%	279.90	1,337.75	569.62
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.90%	1,274,311.30	5,943,260.48	100.00%	99.34%	1,204,838.02	5,758,282.36	-184,978.12

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

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2019	Perioada corespunzatoare a anului precedent 31.12.2018	Diferente
Valoarea activ net	1,204,838.02	1,274,311.30	-69,473.28
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	136,507,6259	149,885,5141	-13,377,8882
Valoarea unitara a activului net	8.8262	8.5019	0.3243

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL

FDI OTP Euro Premium Return – Situatia detaliata a investitiilor la data de 31.12.2019

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

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

Emitent	Simbol actiune	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
					lei	lei	lei	eur	%	%
FONDUL PROPRIETATEA	FP	ROFPTAACNOR5	30-Dec-19	84.000	0.5200	1.2100	4.7793	21.266.71	0.001	1.754
OMV PETROM S.A.	SNP	ROSNNPACNOR9	30-Dec-19	200.000	0.1000	0.4470	4.7793	18.705.67	0.000	1.542
TOTAL								39.972.38		3.296

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 emisuni	Pondere in activul total al OPCVM
									EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB20E	ROIIBKDBC049	-	5	25-Sep-17	25-Sep-19	25-Sep-20	1.5930%	10.000.00	0.44	42.48	0.00	-	50.212.40	0.001	4.140
TOTAL														50.212.40		4.140

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	%	%
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik	AT00009693985	31-Dec-19	1.770	0.00	20.06	35.506.20	0.005	2.928
NOKIA OYJ	FI0009000881	30-Dec-19	8.500	0.00	3.30	28.016.00	0.003	2.310
NOVA LIUBLJANSKA BANKA D	US66980N2036	31-Dec-19	2.000	0.00	12.06	24.120.00	0.002	1.989
WAREHOUSES DE PALUW SCA	BE0974349814	31-Dec-19	170	0.00	162.20	27.574.00	0.001	2.274
ZAVAROVALNICA TRIGLAV D.D.	SI0021111651	30-Dec-19	1.000	0.00	33.30	33.300.00	0.004	2.746
TOTAL						148.516.20		12.246

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	31-Dec-19	55	-	970.00	4.2608	4.7793	47.562.13	0.000	3.922
TOTAL								47.562.13		3.922

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	31-Dec-19	72	0.0000	4.7160	5.6088	4.7793	398.48	0.000	0.033
TOTAL								398.48		0.033

1.4. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denumite in SEK

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR SEK/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	%	%
ERICSSON LM-B SHS	SE0000108656	31-Dec-19	3.700	23.8965	81.5600	0.4574	4.7793	28.880.91	-	2.381
TOTAL								28.880.91		2.381

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 emisuni	Pondere in activul total al OPCVM
								EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
ROMANIA	XS1060842975	-	1	30-Mar-16	24-Apr-19	24-Apr-20	3.6250%	1.112.50	0.10	24.96	0.0000	1.148.7150	1.173.67	0.000	0.097
REPUBLIC OF INDONESIA	XS2069959398	-	100	30-Oct-19	30-Oct-19	30-Oct-20	1.4000%	998.68	0.04	2.41	0.0000	997.8900	100.029.98	0.000	8.248
ROMANIA	XS1129788524	-	1	29-May-17	28-Oct-19	28-Oct-20	2.8750%	1.086.00	0.08	5.11	0.0000	1.120.1550	1.125.26	0.000	0.093
ROMANIA	XS1312891549	-	1	16-May-17	29-Oct-19	29-Oct-20	2.7500%	1.062.49	0.08	4.81	0.0000	1.122.1050	1.126.91	0.000	0.093
ROMANIA	XS1313004928	-	1	29-Dec-17	29-Oct-19	29-Oct-20	3.8750%	1.103.90	0.11	6.78	0.0000	1.164.7550	1.171.53	0.000	0.097
ROMANIA	XS1934867547	-	96	3-Apr-19	8-Dec-19	8-Dec-20	2.0000%	990.78	0.05	1.31	0.0000	1.073.4400	103.176.14	0.000	8.507
ROMANIA	XS1934867547	-	114	3-Jun-19	8-Dec-19	8-Dec-20	2.0000%	1.017.90	0.05	1.31	0.0000	1.073.4400	122.521.67	0.000	10.103
ROMANIA	XS1934867547	-	90	18-Jun-19	8-Dec-19	8-Dec-20	2.0000%	1.038.24	0.05	1.31	0.0000	1.073.4400	96.727.63	0.000	7.976
TOTAL													427.052.81		35.213

III. Valori 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	31-Dec-19	21	0.0000	1.847.8400	4.7793	4.2608	34.594.78	0.000	2.853
BOOKING HOLDINGS INC	US09857L1089	31-Dec-19	17	0.0382	2.053.7300	4.7793	4.2608	31.125.70	0.000	2.566
CISCO SYSTEMS INC	US17275R1023	31-Dec-19	450	0.0043	47.9600	4.7793	4.2608	19.240.60	0.000	1.586
CORTEVA INC	US22052L1044	31-Dec-19	170	0.0426	29.5600	4.7793	4.2608	4.480.02	0.000	0.369
DOW INC	US2605571031	31-Dec-19	170	0.0426	54.7300	4.7793	4.2608	8.294.71	0.000	0.684
DUPONT DE NEMOURS INC	US26614N1028	31-Dec-19	170	0.0426	64.2000	4.7793	4.2608	9.729.95	0.000	0.802
Microsoft Corp	US5949181045	31-Dec-19	342	0.0000	157.7000	4.7793	4.2608	48.062.24	0.000	3.965
PROCTER & GAMBLE CO	US7427181091	31-Dec-19	400	0.0000	124.9000	4.7793	4.2608	44.536.91	0.000	3.673
TOTAL								200.087.90		16.498

FDI OTP Euro Premium Return – Situatia detaliata a investitiilor la data de 31.12.2019

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	eur	lei	eur	lei	eur	%	%
Banca Comerciala Romana	904.16		4.7793		189.18			0.016
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	385.96		4.7793		80.76			0.007
Citi Bank	1.00		4.7793		0.21			0.000
OTP BANK ROMANIA	4.781.05		4.7793		1,000.37			0.082
TOTAL					1,270.51			0.105

2.1. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in EUR

Denumire banca	Valoare curenta		Pondere in activul total al OPCVM	
	EUR	lei	eur	%
Banca Comerciala Romana	25,217.89		2.079	
Banca Romaneasca	24.00		0.002	
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	195.27		0.016	
Citi Bank	1,662.88		0.137	
OTP BANK ROMANIA	0.00		0.000	
NUMERAR IN CASERIE	0.00		0.000	
TOTAL	27,100.04		2.235	

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	lei	eur	lei	eur	%	%
Banca Comerciala Romana	2,148.02		4.2608		4.7793		1,914.98		0.158	
TOTAL							1,914.98		0.158	

X. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania

2. Depozite bancare denuminate in EUR

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Rata dobanzii	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala		Pondere in activul total al OPCVM	
							eur	lei	eur	%
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-19	3-Jan-20	0.0000%	22,183.41	0.00	0.00	22,183.41		1.829	
TOTAL							22,183.41		1.829	

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	eur	lei	eur			eur	lei	eur	%
Citi Bank	75,000.00	Vanzare	1-Nov-19	3-Feb-20	0.891226	4.7793	4.2608	0.8897	0.0016		0.0016	117.68		0.010	
ING BANK Romania	90,000.00	Vanzare	1-Nov-19	3-Feb-20	0.892339	4.7793	4.2608	0.8897	0.0027		0.0027	241.42		0.020	
Total												359.11		0.030	

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	eur					
FDI OTP REAL ESTATE & CONSTRUCTION	-	362.0836	529.9207	-	-	4.7793	40,147.22	2.313	3.310
TOTAL							40,147.22		3.310

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	GBP				
FDI OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	7.306.9367	13.2684	-	-	96.951.36	0.264	7.994
X EUSTOXX600 FOOD & BEV SWAP	LU0292105359	31-Dec-19	200.0000	-	148.0400	-	29.608.00	0.036	2.441
TOTAL							126,559.36		10.435

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	EUR						
ISHARES GLBL INFRASTRUCTURE	IE0081FZS467	31-Dec-19	1,850.0000	-	23.2900	-	5.6088	4.7793	50,564.64	0.009	4.169
TOTAL									50,564.64		4.169

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	31-Dec-17	31-Dec-18	31-Dec-19
Activ net	1,759,411.88	1,274,311.30	1,204,838.02
VUAN	10.0129	8.5019	8.8262

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Filon ANGHEL