

SAI: OTP Asset Management Romania
 SAI SA

 Decizie autorizare: PJ/RO5SAIR/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 Global Mix

 Decizie autorizare: 230/29.10.2015
 Cod inscriere: CSC06FDR/400098

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 (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.21%	100.00%	26.969.777.11	26.969.777.11	100.21%	100.00%	20.037.465.50	20.037.465.50	-6.932.311.61
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	54.92%	54.81%	14.781.467.36	14.781.467.36	88.31%	88.12%	17.657.452.45	17.657.452.45	2.875.965.09
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:	15.80%	15.76%	4.251.265.70	4.251.265.70	25.70%	25.64%	5.138.233.46	5.138.233.46	886.967.76
1.1.1. actiuni	1.97%	1.97%	531.200.00	531.200.00	17.12%	17.08%	3.422.634.00	3.422.634.00	2.891.434.00
1.1.3. obligatiuni, din care:	13.82%	13.79%	3.720.065.70	3.720.065.70	8.58%	8.56%	1.715.599.46	1.715.599.46	-2.004.466.24
1.1.3.1. Obligatiuni corporative colate	11.77%	11.75%	3.168.570.15	3.168.570.15	5.87%	5.86%	1.174.681.90	1.174.681.90	-1.993.888.25
1.1.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.12%	0.12%	31.994.26	31.994.26	0.11%	0.11%	21.479.29	21.479.29	-10.514.97
1.1.3.3. Obligatiuni colate emise de autoritati ale administratiei publice locale	1.93%	1.93%	519.501.30	519.501.30	2.60%	2.59%	519.438.28	519.438.28	-63.02
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:	30.81%	30.75%	8.293.394.11	8.293.394.11	40.99%	40.90%	8.196.148.84	8.196.148.84	-97.245.27
1.2.1. actiuni	7.33%	7.31%	1.971.769.12	1.971.769.12	16.40%	16.37%	3.279.917.40	3.279.917.40	1.308.148.28
1.2.3. obligatiuni, din care:	23.49%	23.44%	6.321.624.99	6.321.624.99	24.59%	24.54%	4.916.231.43	4.916.231.43	-1.405.393.56
1.2.3.1. Obligatiuni corporative colate	23.49%	23.44%	6.321.624.99	6.321.624.99	9.17%	9.15%	1.834.295.60	1.834.295.60	-4.487.329.39
1.2.3.2. Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.00%	0.00%	0.00	0.00	15.41%	15.38%	3.081.935.84	3.081.935.84	3.081.935.84
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, aprobata de A.S.F., din care:	8.31%	8.29%	2.236.807.55	2.236.807.55	21.62%	21.57%	4.323.070.15	4.323.070.15	2.086.262.60
1.3.1. actiuni	8.31%	8.29%	2.236.807.55	2.236.807.55	21.62%	21.57%	4.323.070.15	4.323.070.15	2.086.262.60
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:	18.30%	18.26%	4.925.888.54	4.925.888.54	4.59%	4.58%	918.158.32	918.158.32	-4.007.730.23
5.1. depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	18.30%	18.26%	4.925.888.54	4.925.888.54	4.59%	4.58%	918.158.32	918.158.32	-4.007.730.23
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	-0.11%	-0.11%	-29.963.00	-29.963.00	0.51%	0.51%	102.767.00	102.767.00	132.730.00
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	-0.11%	-0.11%	-29.963.00	-29.963.00	0.51%	0.51%	102.767.00	102.767.00	132.730.00
6.4.1. Contracte forward	-0.11%	-0.11%	-29.963.00	-29.963.00	0.51%	0.51%	102.767.00	102.767.00	132.730.00
7 Conturi curente si numerar	18.94%	18.90%	5.096.593.17	5.096.593.17	1.49%	1.49%	298.726.14	298.726.14	-4.797.867.03
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.	8.16%	8.14%	2.195.791.03	2.195.791.03	5.30%	5.29%	1.060.361.60	1.060.361.60	-1.135.429.43
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 obligati	0.21%	0.21%	55.964.24	55.964.24	0.21%	0.21%	41.559.45	41.559.45	-14.404.89
1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate S.A.I.	0.17%	0.17%	46.216.90	46.216.90	0.17%	0.17%	33.868.61	33.868.61	-12.348.29
2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.02%	0.02%	4.664.48	4.664.48	0.02%	0.01%	3.001.77	3.001.77	-1.662.71
3. Cheltuieli cu comisioanele datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	490.37	490.37	0.00%	0.00%	406.30	406.30	-84.07
7. Cheltuieli cu plata comisioanelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	2.097.18	2.097.18	0.01%	0.01%	1.559.89	1.559.89	-537.30
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.00%	0.00%	800.00	800.00	0.00%	0.00%	800.00	800.00	0.00
9. Alte cheltuieli aprobate	0.01%	0.01%	1.695.31	1.695.31	0.01%	0.01%	1.922.88	1.922.88	227.57
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.79%	26.913.812.86	26.913.812.86	100.00%	99.79%	19.995.906.06	19.995.906.06	-6.917.906.80

*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	19.995.906.06	26.913.812.86	-6.917.906.80
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1,694,359,3668	2,518,540,7391	-824,181,3723
Valoarea unitara a activului net	11.8015	10.6863	1.1152

 OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
 Director General
 Dan Marius POPOVICI

 Intocmit
 Filon-Daniel ANGHEL

FDI OTP Global Mix – Situația detaliată a investițiilor la data de 31.12.2019

I. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată sau pe un sistem alternativ de tranzacționare din România

1. Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare)

Emitent	Simbol acțiune	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
					lei	lei	lei	%	%
BANCA TRANSILVANIA S.A.	TLV	ROTLVAACNOR1	30-Dec-19	300.000	1.0000	2.5950	778.500,00	0,006	3,885
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	BRD	ROBRDBACNOR2	30-Dec-19	18.850	1.0000	15.8400	298.584,00	0,003	1,490
FONDUL PROPRIETATEA	FP	ROFPPTAACNOR5	30-Dec-19	350.000	0,5200	1,2100	423.500,00	0,002	2,114
OMV PETROM S.A.	SNP	ROSNPPACNOR9	30-Dec-19	1.400.000	0,1000	0,4470	625.800,00	0,002	3,123
PURCĂRI WINERIES PUBLIC COMPANY LIM	WINE	CY0107600716	30-Dec-19	37.500	0,0467	22,2000	832.500,00	0,188	4,155
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	ROSGNACNOR3	30-Dec-19	12.500	1,0000	37,1000	463.750,00	0,003	2,314
TOTAL							3.422.634,00		17,081

5. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale/obligațiuni corporative

5.1. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale

Emitent	Simbol obligațiune	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret piață	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emisiune	Pondere în activul total al OPCVM
								%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
PRIMĂRIA MUNICIPIULUI BUCUREȘTI	PMB28	ROPMBUDBL053	-	50	23-Apr-18	23-Apr-19	23-Apr-20	5,6000%	10.002,00	1,53	387,10	-0,34	-	519.438,28	0,023	2,592
TOTAL														519.438,28		2,592

5.2. Obligațiuni tranzacționate corporative denumite în RON

Emitent	Simbol obligațiune	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret piață	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emisiune	Pondere în activul total al OPCVM
								%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB21	ROXR6Y7LQ1H7	-	27	15-Oct-18	15-Oct-19	15-Jan-20	4,4600%	10.000,00	1,24	94,16	0,00	-	272.542,20	0,009	1,360
Vrancart Adj. ad	VNC24	ROVRJUDBC011	-	2.000	17-Mar-17	25-Oct-19	25-Jan-20	5,0400%	100,00	0,01	0,94	0,00	-	201.877,92	0,523	1,008
Vrancart Adj. ad	VNC24	ROVRJUDBC011	-	2.615	6-Jun-17	25-Oct-19	25-Jan-20	5,0400%	100,00	0,01	0,94	0,00	-	263.955,39	0,684	1,317
Vrancart Adj. ad	VNC24	ROVRJUDBC011	-	1.945	7-Aug-17	25-Oct-19	25-Jan-20	5,0400%	100,00	0,01	0,94	0,00	-	196.326,27	0,508	0,980
TOTAL														934.701,78		4,665

5.3. Obligațiuni tranzacționate corporative denumite în EUR

Emitent	Simbol obligațiune	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Curs valutar BNR EUR/RON	Pret piață	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emisiune	Pondere în activul total al OPCVM
								%	eur	eur	eur	eur	lei	eur	lei	%	%
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	4,7793	-	239.980,12	0,008	1,198
TOTAL															239.980,12		1,198

6. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale

Seria emisiunii	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Număr obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată (a)	Pret piață	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emisiune	Pondere în activul total al OPCVM
							%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
RO1320DBN022	RO1320DBN022	-	1	28-Jan-16	29-Apr-19	29-Apr-20	5,7500%	11.455,46	1,57	388,05	-	10,067,20	10.455,25	0,000	0,052
RO1323DBN018	RO1323DBN018	-	1	28-Jan-16	26-Apr-19	26-Apr-20	5,8500%	11.687,64	1,60	399,59	-	10,624,45	11.024,04	0,000	0,055
TOTAL													21.479,29		0,107

II. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată sau pe un sistem alternativ de tranzacționare din alt stat membru

1.1 Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) - denumite în EUI

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
				EUR	EUR	lei	lei	%	%
NOKIA OYJ	FI0009000681	30-Dec-19	30.000	0,0000	3,2960	4,7793	472.577,18	0,001	2,358
NOVA LJUBLJANSKA BANKA D	US66980N2036	31-Dec-19	8.000	0,0000	12,0600	4,7793	461.106,86	0,003	2,301
VINCI	FR0000125486	31-Dec-19	580	2,5000	99,0000	4,7793	274.427,41	0,000	1,370
WUESTENROT & WUERTEMBERGISCHE A	DE0008051004	31-Dec-19	3.250	0,0000	19,3600	4,7793	300.713,56	0,000	1,501
ZAVAROVALNICA TRIGLAV D.D.	SI0021111651	30-Dec-19	3.900	0,0000	33,3000	4,7793	620.687,69	0,017	3,098
TOTAL							2.129.612,70		10,628

1.2 Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) - denumite în USI

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
				usd	usd	lei	lei	%	%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	US7960502018	31-Dec-19	170	0,0000	970,0000	4,2608	702.605,92	0,000	3,506
TOTAL							702.605,92		3,506

1.3 Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) - denumite în GB

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR GBP/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
				gbp	gbp	lei	lei	%	%
BP PLC	GB0007980591	31-Dec-19	5	0,0000	4,7160	5,6088	132,26	0,000	0,001
TOTAL							132,26		0,001

1.6 Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) - denumite în SEK

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR SEK/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
				SEK	SEK	lei	lei	%	%
ERICSSON LM-B SHS	SE0000108656	31-Dec-19	12.000	23.8965	81.5600	0.4574	447.666.53	0.001	2.234
TOTAL							447.666.53		2.234

3. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale, obligațiuni corporative

3.1. Obligațiuni admise la tranzacționare corporative denumite în RON

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoare inițială	Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emitent	Pondere în activul total al OPCVM
							%	RON	RON	RON	RON	RON	lei	%	%
Black Sea Trade and Development Bank	XS1917958651		2	11-Dec-18	11-Dec-19	11-Dec-20	4.9000%	500.000,00	66.94	1.405.74	0.00	-	1.002.811.48	0.000	5.005
Black Sea Trade and Development Bank	XS1953911499		1	25-Feb-19	25-Feb-19	25-Feb-20	4.9000%	501.365,00	65.88	20.808.22	-386.09	-	521.787.13	0.000	2.604
LEASEPLAN CORPORATION NV	XS1551746768	-	3	20-Jan-17	19-Jan-19	19-Jan-20	3.4000%	100.000,00	9.32	3.232.33	0.00	-	309.696.99	0.000	1.546
TOTAL													1.834.295.60		9.154

4. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în EU1

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Rata cuponului	Valoare inițială	Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emitent	Pondere în activul total al OPCVM
							%	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
ROMANIA	XS1934867547	-	133	3-Apr-19	8-Dec-19	8-Dec-20	2.0000%	990.78	0.05	1.31	-	1.073.44	4.7793	683.162.44	0.000	3.409
ROMANIA	XS1934867547	-	297	3-Jun-19	8-Dec-19	8-Dec-20	2.0000%	1.017.90	0.05	1.31	-	1.073.44	4.7793	1.525.558.24	0.000	7.614
ROMANIA	XS1934867547	-	170	15-Oct-19	8-Dec-19	8-Dec-20	2.0000%	1.082.31	0.05	1.31	-	1.073.44	4.7793	873.215.15	0.000	4.358
TOTAL														3.081.935.84		15.381

III. Valorile mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată dintr-un stat terț

1.1 Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) în US1

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
				USD	USD	lei	lei	%	%
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	US01609W1027	31-Dec-19	490	0.0000	212.10	4.2608	442.820.68	0.000	2.210
Alphabet	US02079K1079	31-Dec-19	93	0.0043	1.337.02	4.2608	529.800.06	0.000	2.644
AMAZON.COM INC	US0231351067	31-Dec-19	70	0.0000	1.847.84	4.2608	551.129.37	0.000	2.750
BOOKING HOLDINGS INC	US09857L1069	31-Dec-19	43	0.0382	2.053.73	4.2608	376.272.91	0.000	1.878
CISCO SYSTEMS INC	US17275R1023	31-Dec-19	1.500	0.0043	47.96	4.2608	308.521.95	0.000	1.530
MASTERCARD INC	US57636Q1040	31-Dec-19	413	0.0005	298.59	4.2608	525.431.93	0.000	2.622
Microsoft Corp	US949181045	31-Dec-19	1.200	0.0000	157.70	4.2608	806.313.79	0.000	4.024
VISA INC	US92826C8394	31-Dec-19	550	0.0004	187.90	4.2608	440.332.38	0.000	2.198
TOTAL							3.978.623.07		19.856

1.2 Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) - denumite în CH

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR CHF/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPCVM
				CHF	CHF	lei	lei	%	%
Nestlé	CH0038963350	30-Dec-19	342	0.4780	104.7800	4.4033	157.791.20	0.000	0.787
Roche Genussscheine	CH0012032048	30-Dec-19	135	0.0000	314.0000	4.4033	186.655.89	0.000	0.932
TOTAL							344.447.09		1.719

IX. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar în RON

Denumire banca	Valoare curentă	Pondere în activul total al OPCVM
	lei	%
Banca Comercială Română	1.842.99	0.009
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	58.55	0.000
Citi Bank	7.560.99	0.038
CREDIT EUROPE BANK SA	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	40.823.93	0.204
NUMERAR ÎN CASIERIE	0.00	0.000
TOTAL	50.286.46	0.251

2.1. Disponibil în conturi curente și numerar denumite în EUR

Denumire banca	Valoare curentă	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al OPCVM
	EUR	lei	lei	%
Banca Comercială Română	248.30	4.7793	1.186.70	0.006
Banca Românească	104.56	4.7793	499.72	0.002
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	0.00	4.7793	0.00	0.000
Citi Bank	0.00	4.7793	0.00	0.000
CREDIT EUROPE BANK SA	0.00	4.7793	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	51.248.70	4.7793	244.932.91	1.222
TOTAL			246.619.34	1.231

2.2. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in USD

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	427.23	4.2608	1.820.34	0.009
TOTAL			1.820.34	0.009

2.3. 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 Romana	0.00	0.0145	0.00	0.000
TOTAL			0.00	0.000

2.4. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in NOK

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR NOK/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
	NOK	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.4848	0.00	0.000
TOTAL			0.00	0.000

X. Depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania

2. Depozite bancare denumite in EUR

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
			%	eur	eur		lei	lei	%
Banca Romaneasca	8-Jul-19	7-Jul-20	1.2000%	191.000.00	6.28	1111.46	4.7793	918.158.32	4.582
TOTAL								918.158.32	4.582

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

1.1 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.	100.000.00	Vanzare	12-Apr-19	14-Apr-20	4.9657	4.7799	4.8267	0.1390	13.900.00	0.069
Citi Bank	150.000.00	Vanzare	22-Apr-19	22-Apr-20	4.9684	4.7799	4.8303	0.1381	20.715.00	0.103
Citi Bank	155.000.00	Vanzare	21-May-19	22-May-20	4.9702	4.7799	4.8438	0.1264	19.592.00	0.098
Citi Bank	95.000.00	Vanzare	26-Sep-19	26-Jun-20	4.8724	4.7799	4.8594	0.0130	1.235.00	0.006
Citi Bank	500.000.00	Vanzare	7-Oct-19	7-Oct-20	4.9172	4.7799	4.9057	0.0115	5.750.00	0.029
Citi Bank	100.000.00	Vanzare	8-Oct-19	9-Oct-20	4.9194	4.7799	4.9066	0.0128	1.280.00	0.006
ING BANK Romania	150.000.00	Vanzare	29-Oct-19	26-Oct-20	4.9217	4.7799	4.9143	0.0074	1.110.00	0.006
ING BANK Romania	250.000.00	Vanzare	15-Jan-19	15-Jan-20	4.8587	4.7799	4.7856	0.0731	18.275.00	0.091
TOTAL									81.857.00	0.409

1.2 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	%
Citi Bank	400.000.00	Vanzare	1-Nov-19	3-Nov-20	4.3165	4.2900	4.3016	0.0149	5.960.00	0.030
ING BANK Romania	500.000.00	Vanzare	11-Sep-19	8-Sep-20	4.3243	4.2900	4.2944	0.0299	14.950.00	0.075
TOTAL									20.910.00	0.104

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denumite 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	Pondere in activul total al OPCVM
				lei	lei	lei	%	%
FDI OTP Real Estate & Constructor	ROTOW22GGA16	-	1.014.368	529.9207	-	537.534.65	4.427	2.683
TOTAL						537.534.65		2.683

2. Titluri de participare denumite 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	%	%
FDI OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	8.244.7049	13.2684	-	4.7793	522.826.95	0.298	2.609
TOTAL							522.826.95		2.609

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 an

	31-Dec-17	31-Dec-18	31-Dec-19
Activ net	32.148.862.42	26.913.812.86	19.995.906.06
VUAN	11.6726	10.6863	11.8015

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membri Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Filon ANGHEL