

FDI OTP Obligțiuni – Situația detaliată a activelor la data de 31.12.2012

1. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania

5. Obligțiuni admise la tranzacționare

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

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret plată	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
Primăria Lupeni	LG14	-	1.750	-	23-Jun-08	15-Dec-12	15-Mar-13	22,00	0,00	0,00	0,00	-	38.625,61	0,0000%	0,101%
Primăria Comunei Crăciun	CR27	-	902	-	13-Mar-08	15-Oct-12	15-Apr-13	93,00	0,02	1,40	0,00	-	96.867,06	1,5380%	0,225%
Municipal Timisoara	TIM26C	-	990	-	7-Jul-08	15-Nov-12	15-Feb-13	77,60	0,01	0,57	0,00	-	77.390,45	0,0660%	0,202%
TOTAL													202.683,12		0,529%

5.2. Obligțiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale

Serie	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret plată	Valoare totală	Banca intermediara	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
RO0915DBN008	-	1	-	27-Jun-11	11-Apr-12	11-Apr-13	8.851,36	1,98	490,07	59,50	-	10.400,93	RAFFEISEN BANK	0,0000%	0,020%
RO0915DBN009	-	1	-	27-Jun-11	11-Apr-12	11-Apr-13	18.942,43	2,05	910,14	-537,08	-	11.320,89	RAFFEISEN BANK	0,0000%	0,030%
RO1115DBN024	-	1	-	27-Jun-11	30-Apr-12	30-Apr-13	9.905,50	1,92	408,38	154,06	-	10.064,75	BCR	0,0000%	0,026%
RO1115DBN032	-	1	-	27-Jun-11	11-Jun-12	11-Jun-13	9.002,27	1,90	332,55	151,08	-	9.486,80	RAFFEISEN BANK	0,0000%	0,026%
RO1015DBN010	-	55	-	31-Mar-11	30-Apr-12	30-Apr-13	525.429,34	106,89	22.241,10	10.579,72	-	558.250,15	BRD Groupe Societate Generale	0,001%	1,456%
RO1015DBN010	-	20	-	28-Jun-11	30-Apr-12	30-Apr-13	191.945,60	38,62	8.087,67	3.176,95	-	203.210,22	RBS Romania	0,000%	0,530%
RO1015DBN010	-	25	-	11-Apr-12	30-Apr-12	30-Apr-13	251.341,75	39,89	10.109,59	-319,18	-	261.132,16	BCR	0,000%	0,681%
RO1015DBN010	-	100	-	2-Jul-12	30-Apr-12	30-Apr-13	994.950,57	169,28	40.438,38	895,39	-	1.036.284,92	BCR	0,001%	2,703%
TOTAL												2.186.196,21			3,475%

5.3. Obligțiuni tranzactionate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret plată	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
SC GDF SUEZ Energy Romania SA	GSE17	-	114	-	30-Oct-12	30-Oct-12	30-Oct-13	10.000,00	2,06	129,50	0,00	-	1.154.763,00	0,4560%	3,313%
TOTAL													1.154.763,00		3,313%

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din alt stat membru

2. Obligțiuni admise la tranzacționare

2.1. Obligțiuni admise la tranzacționare corporative

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret plată	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
Banca Comerciala Romana	XSO474834925	-	1	-	20-Jun-12	22-Dec-12	22-Dec-13	574.468,66	113,45	1.410,96	-5.069,97	-	570.809,55	0,0107%	1,489%
Banca Comerciala Romana	XSO496326223	-	1	-	12-Apr-10	7-Apr-12	7-Apr-13	250.000,00	62,74	14.186,99	0,00	-	264.186,99	0,0107%	0,688%
Banca Comerciala Romana	XSO496326223	-	3	-	17-Nov-11	7-Apr-12	7-Apr-13	245.948,61	53,08	14.186,99	141,03	-	260.276,63	0,0320%	2,061%
Banca Comerciala Romana	XSO736864734	-	1	-	14-Feb-12	31-Jan-12	31-Jan-13	250.641,03	48,97	16.754,10	-287,88	-	267.107,24	0,0107%	0,697%
Boerische Hypo- und Vrentbank AG	XSO454624095	-	1	-	18-Oct-11	19-Aug-12	19-Aug-13	520.560,16	120,73	20.434,93	-13.512,71	-	527.482,38	0,0000%	1,376%
TOTAL													2.416.416,93		6,312%

2.2. Obligțiuni admise la tranzacționare corporative denumite în valută

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret plată	Curs valutar BNR EURRON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XSO505453275	-	150	-	24-Jul-12	20-Apr-12	20-Apr-13	982,50	0,17	41,21	1,63	-	4.4287	681.133,92	0,0200%	1,777%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XSO505453275	-	100	-	5-Nov-12	20-Apr-12	20-Apr-13	1.028,75	0,14	41,21	-1,01	-	4.4287	473.485,11	0,0135%	1,235%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XSO505453275	-	130	-	28-Nov-12	20-Apr-12	20-Apr-13	1.031,45	0,14	41,21	-0,67	-	4.4287	617.177,09	0,0173%	1,810%
QTP BANK RT	XSO214084262	-	1	-	14-Jun-11	4-Dec-12	4-Mar-13	41.187,50	7,51	28,82	3.676,74	-	4.4287	198.817,87	0,0002%	0,519%
QTP BANK HB	XSO208320800	-	200	-	22-Jun-12	19-Sep-12	19-Sep-13	825,00	0,26	15,02	21,79	-	4.4287	763.336,22	0,0395%	1,991%
QTP BANK HB	XSO208320800	-	100	-	8-Oct-12	19-Sep-12	19-Sep-13	927,50	0,19	15,02	4,27	-	4.4287	419.304,66	0,0199%	1,094%
QTP BANK HB	XSO208320800	-	110	-	29-Oct-12	19-Sep-12	19-Sep-13	952,50	0,18	15,02	2,14	-	4.4287	472.374,34	0,0219%	1,232%
QTP BANK HB	XSO208320800	-	120	-	13-Dec-12	19-Sep-12	19-Sep-13	960,20	0,17	15,02	0,41	-	4.4287	518.488,62	0,0239%	1,353%
QTP BANK HB	XSO208320800	-	110	-	19-Dec-12	19-Sep-12	19-Sep-13	973,25	0,16	15,02	0,16	-	4.4287	491.517,02	0,0219%	1,296%
TOTAL														4.625.954,93		12,067%

Suma în curs de decontare pentru obligatiuni admise la tranzacționare corporative

Emitent	Numar Instrumente tranzactionate	Valoarea unitara	Curs valutar BNR EURRON	Valoarea Actualizata	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPC
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	120,00	1.105,0274	4.4287	587.260,10	0,0230%	1,530%
TOTAL				587.260,10		1,532%

2.3. Obligțiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în valută

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret plată	Curs valutar BNR EURRON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
Republica de Crotia	XSO645940288	-	100	-	28-Jun-12	8-Jul-12	9-Jul-13	1.085,50	0,12	28,33	-1,17	-	4.4287	462.762,38	0,0067%	1,286%
ROMANIA	XSO371163600	-	116	-	13-Sep-12	18-Jun-12	18-Jun-13	1.076,60	0,14	35,08	-4,00	-	4.4287	564.156,66	0,0026%	1,473%
ROMANIA	XSO371163600	-	100	-	21-Jun-12	18-Jun-12	18-Jun-13	1.087,50	0,14	35,08	-4,58	-	4.4287	496.272,18	0,0019%	1,250%
ROMANIA	XSO371163600	-	100	-	26-Oct-12	18-Jun-12	18-Jun-13	1.111,75	0,12	35,08	-3,63	-	4.4287	506.288,71	0,0019%	1,321%
ROMANIA	XSO371163600	-	100	-	18-Jun-12	18-Jun-12	18-Jun-13	1.088,75	0,13	35,08	-3,18	-	4.4287	505.182,00	0,0019%	1,318%
ROMANIA	XSO367424095	-	150	-	21-Jun-12	17-Jun-12	17-Jun-13	1.025,50	0,13	28,48	-2,73	-	4.4287	695.025,02	0,0029%	1,813%
ROMANIA	XSO352474336	-	100	-	7-Nov-12	7-Nov-12	7-Nov-13	990,47	0,14	7,35	0,21	-	4.4287	441.993,54	0,0019%	1,153%
ROMANIA	XSO352474336	-	100	-	13-Dec-12	7-Nov-12	6-Nov-13	1.022,00	0,12	7,35	-0,12	-	4.4287	455.812,18	0,0019%	1,169%
TOTAL														4.156.458,81		10,843%

2.4. Obligțiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale denumite în valută

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achiziției	Data decontare	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret Plată	Curs valutar BNR EURRON	Valoare totală	Pondere în total obligatiuni emise	Pondere în activul total al OPC
CITY OF BUCHAREST	XSO222425471	-	1	-	1-Jun-11	22-Jun-12	22-Jun-13	46.875,00	7,76	1.090,58	1.223,01	-	4.4287	217.841,52	0,0040%	0,568%
TOTAL														4.4287		0,568%

IX. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar în lei

Denumire banca	Valoare curenta lei	Pondere in activul total al OPC %
Alpha Bank	95.68	0.000%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.000%
BANCA ITALO-ROMENA	74.97	0.000%
Banca Romanesca	872.95	0.000%
BRD Groupe Societe Generale	74.25	0.000%
CSC Bank SA	266.73	0.001%
C8 Bank	4.970.00	0.013%
CREDIT EUROPE BANK SA	644.99	0.002%
Infima Sarabada Bank	262.76	0.002%
MILLENNIUM BANK	262.79	0.001%
OTP BANK ROMANIA	34.648.50	0.090%
OTP BANK ROMANIA	11.566.25	0.030%
OTP BANK ROMANIA	11.294.75	0.029%
OTP BANK ROMANIA	330.149.72	0.861%
OTP BANK ROMANIA	89.568.00	0.240%
PROXIS BANK	510.17	0.001%
Procredit Bank	263.63	0.001%
UniCredit Tyre Bank	54.34	0.000%
TOTAL	486.164.76	1.286%

2. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate în valuta

Denumire banca	Valoare curenta EUR	Curs valutar BNR EUR/RON lei	Valoare actualizata lei	Pondere in activul total al OPC %
Banca Comerciala Romana	1.686.50	4.4287	7.470.77	0.019%
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.4287	0.00	0.000%
BRD Groupe Societe Generale	0.00	4.4287	0.00	0.000%
TOTAL			7.470.77	0.019%

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denuminate în lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala lei	Dobanda zilnica lei	Dobanda cumulata lei	Valoare totala lei	Pondere in activul total al OPC %
Banca Comerciala Romana	31-Dec-12	1-Jan-13	1.310.628.68	196.59	196.59	1.310.825.27	3.400%
BANCA ITALO-ROMENA	13-Nov-12	13-Feb-13	400.000.00	76.71	3.758.90	403.758.90	1.063%
BANCA ITALO-ROMENA	26-Nov-12	27-Mar-13	499.300.00	89.82	3.223.40	492.523.40	1.280%
BANCA ITALO-ROMENA	10-Apr-12	10-Jan-13	300.160.00	53.45	14.218.54	314.378.54	0.820%
BANCA ITALO-ROMENA	23-Jul-12	23-Jul-13	725.400.00	126.20	20.444.36	745.844.36	1.946%
BANCA ITALO-ROMENA	6-Aug-12	6-Aug-13	207.300.00	36.06	5.260.42	212.560.42	0.555%
CREDIT EUROPE BANK SA	3-Dec-12	3-Jan-13	703.800.00	120.51	3.494.90	707.294.90	1.845%
CREDIT EUROPE BANK SA	5-Dec-12	7-Jan-13	505.700.00	86.59	2.338.00	508.038.00	1.325%
CREDIT EUROPE BANK SA	10-Dec-12	10-Jan-13	715.800.00	122.57	2.698.51	718.498.51	1.871%
MILLENNIUM BANK	12-Dec-12	12-Jan-13	2.045.000.00	369.24	7.384.72	2.052.384.72	5.354%
OTP BANK ROMANIA	26-Nov-12	3-Jan-13	200.000.00	33.70	1.213.15	201.213.15	0.525%
OTP BANK ROMANIA	12-Dec-12	15-Jan-13	200.000.00	33.70	873.97	200.873.97	0.524%
OTP BANK ROMANIA	6-Dec-12	10-Jan-13	200.000.00	33.70	876.16	200.876.16	0.524%
OTP BANK ROMANIA	3-Dec-12	8-Jan-13	200.000.00	33.70	877.26	200.877.26	0.524%
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-12	3-Jan-13	1.455.438.85	189.50	199.50	1.455.638.35	3.797%
OTP BANK ROMANIA	28-Dec-12	31-Jan-13	200.000.00	35.62	142.47	200.142.47	0.522%
OTP BANK ROMANIA	21-Dec-12	23-Jan-13	200.000.00	35.62	391.78	200.391.78	0.523%
OTP BANK ROMANIA	21-Dec-12	21-Jan-13	400.000.00	71.23	783.56	400.783.56	1.046%
OTP BANK ROMANIA	24-Dec-12	26-Jan-13	200.000.00	35.62	294.93	200.294.93	0.523%
Procredit Bank	5-Nov-12	7-Mar-13	800.000.00	157.81	8.995.07	808.995.07	2.111%
UniCredit Tyre Bank	13-Dec-12	14-Jan-13	700.000.00	126.39	2.407.39	702.407.39	1.822%
UniCredit Tyre Bank	6-Mar-12	4-Jan-13	1.000.000.00	194.44	58.527.78	1.058.527.78	2.761%
UniCredit Tyre Bank	6-Mar-12	4-Jan-13	1.512.800.00	294.16	88.540.82	1.601.340.82	4.176%
TOTAL						14.698.328.71	38.687%

XII. Instrumente financiare derivate negociate în afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

Contraparte	Cantitate EUR	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare lei	Curs valutar BNR EUR/RON lei	Curs forward lei	Profit / pierdere lei	Valoare totala lei	Pondere in activul total al OPC %
BRD Groupe Societe Generale	100.000.00	V	4-Dec-12	6-Mar-13	4.5880	4.4287	4.4738	0.1142	11.420.00	0.030%
BRD Groupe Societe Generale	100.000.00	V	5-Oct-12	9-Jan-13	4.5965	4.4287	4.4353	0.1612	16.120.00	0.042%
BRD Groupe Societe Generale	150.000.00	V	10-Dec-12	20-Mar-13	4.5165	4.4287	4.4334	0.0331	4.965.00	0.013%
C8 Bank	100.000.00	V	11-Feb-13	11-Feb-13	4.5620	4.4287	4.4580	0.1040	10.400.00	0.027%
C8 Bank	100.000.00	V	12-Oct-12	16-Jan-13	4.6195	4.4287	4.4403	0.1792	17.920.00	0.047%
C8 Bank	100.000.00	V	2-Nov-12	6-Feb-13	4.5195	4.4287	4.4545	0.1250	12.500.00	0.033%
C8 Bank	100.000.00	V	15-Nov-12	15-Feb-13	4.5865	4.4287	4.4607	0.1258	12.580.00	0.033%
C8 Bank	100.000.00	V	11-Dec-12	13-Mar-13	4.5928	4.4287	4.4786	0.1142	11.420.00	0.030%
OTP BANK ROMANIA	100.000.00	V	11-Dec-12	19-Mar-13	4.5179	4.4287	4.4827	0.0350	3.520.00	0.009%
OTP BANK ROMANIA	100.000.00	V	18-Oct-12	18-Jan-13	4.6273	4.4287	4.4417	0.1856	18.560.00	0.048%
OTP BANK ROMANIA	300.000.00	V	10-Oct-12	14-Jan-13	4.6198	4.4287	4.4389	0.1809	54.270.00	0.142%
OTP BANK ROMANIA	800.000.00	V	27-Dec-12	28-Mar-13	4.4784	4.4287	4.4688	-0.0704	165.355.00	0.431%
TOTAL									165.355.00	0.431%

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AQPC

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 plata	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare ale OPCVM/AQPC	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	lei	%	%
FDI CERTINVEST TEZAUZ	-	1.053.486693	77.2500	-	81.381.85	1.2903%	0.212%
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	-	84.380.823155	24.6600	-	2.080.831.10	9.6693%	5.428%
OTP ComodoriFO	-	40.863.714100	14.9330	-	604.244.64	0.3757%	1.576%
TOTAL					2.766.457.59		7.21%

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	An T-2	An T-1	An T
Activ net	9.502.061.73	14.500.223.47	33.751.936.39
VUAN	10.1400	11.4600	12.3312

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Membru Directorat

Dan Marius Popovici

Intocmit

Lavinia Bercea