

SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA
Decizia autorizare: P.ROSSAR/400022 Cod inregistrare: J40/15502/15.08.2007
CUI: 22264841 Inregistrare OMRC: J40/15502/15.08.2007
Capital social: 5.795.323 RON Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

OTP Obligatiuni
Decizia autorizare: 375/27.02.2008
Cod inregistrare: CSC/06FD/4000408

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2013 - 30.06.2014

Denumire element	31.12.2013				30.06.2014			
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei
Total active	100.00%	100.00%	73.596.369.76	73.596.369.76	100.00%	100.00%	89.476.193.02	89.476.193.02
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	50.42%	50.37%	37.048.681.52	37.048.681.52	57.17%	56.28%	58.285.711.77	58.285.711.77
11 Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	15.77%	15.76%	11.589.365.34	11.589.365.34	21.77%	21.40%	18.145.692.50	18.145.692.50
113 Obligatii, din care:	15.77%	15.76%	11.589.365.34	11.589.365.34	21.77%	21.40%	18.145.692.50	18.145.692.50
1131 Obligatii corporative cotate	5.69%	5.69%	4.184.020.30	4.184.020.30	12.71%	12.49%	11.178.906.96	11.178.906.96
1132 Obligatii emise de administratia publica centrala	9.85%	9.84%	7.234.638.76	7.234.638.76	8.88%	8.73%	7.811.698.49	7.811.698.49
1133 Obligatii cotate emise de autoritati de administratie publice locale	0.23%	0.23%	170.706.28	170.706.28	0.18%	0.17%	155.087.04	155.087.04
12 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	30.53%	30.50%	22.434.753.77	22.434.753.77	35.40%	34.80%	31.140.019.28	31.140.019.28
123 Obligatii	30.53%	30.50%	22.434.753.77	22.434.753.77	35.40%	34.80%	31.140.019.28	31.140.019.28
1231 Obligatii tranzactionate corporative	26.90%	26.88%	19.768.943.02	19.768.943.02	31.25%	30.72%	27.484.247.22	27.484.247.22
1232 Obligatii emise de administratia publica locala denumite in valuta	0.30%	0.30%	224.047.74	224.047.74	0.25%	0.24%	216.279.90	216.279.90
1233 Obligatii emise de administratia publica centrala	3.32%	3.32%	2.441.763.01	2.441.763.01	3.91%	3.84%	3.439.492.16	3.439.492.16
14 Valori mobiliare nou emise, din care:	4.12%	4.11%	3.024.542.41	3.024.542.41	0.00%	0.00%	0.00	0.00
141 Obligatii corporative	4.12%	4.11%	3.024.542.41	3.024.542.41	0.00%	0.00%	0.00	0.00
2 Disponibil in cont curent	1.87%	1.87%	1.375.388.24	1.375.388.24	0.65%	0.65%	43.258.36	43.258.36
201 ALPHA BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	102.32	102.32	0.00%	0.00%	52.85	52.85
202 BANCA COMERCIALA ROMANIA	0.88%	0.88%	646.686.10	646.686.10	0.02%	0.02%	14.411.10	14.411.10
203 BANCA ROMANEASCA	0.00%	0.00%	872.95	872.95	0.00%	0.00%	107.86	107.86
204 BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.59	0.59
205 CEC BANK	0.00%	0.00%	158.73	158.73	0.00%	0.00%	104.73	104.73
207 OTP BANK ROMANIA	0.98%	0.98%	724.335.81	724.335.81	0.01%	0.01%	11.030.00	11.030.00
208 PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	320.60	320.60	0.00%	0.00%	621.79	621.79
210 Procredit Bank	0.00%	0.00%	76.18	76.18	0.00%	0.00%	0.55	0.55
213 VENETO BANCA	0.00%	0.00%	52.09	52.09	0.00%	0.00%	304.14	304.14
214 Banca Comerciala Romana - EURO	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	11.159.52	11.159.52
219 Credit Europ Bank SA	0.00%	0.00%	312.54	312.54	0.00%	0.00%	284.38	284.38
220 Garanti Bank	0.00%	0.00%	863.60	863.60	0.00%	0.00%	1.834.14	1.834.14
221 UNICREDIT TIRAC BANK	0.00%	0.00%	22.82	22.82	0.00%	0.00%	310.55	310.55
223 MILLENNIUM BANK	0.00%	0.00%	1.323.58	1.323.58	0.00%	0.00%	2.948.01	2.948.01
227 Intesa Sanpaolo Bank	0.00%	0.00%	190.86	190.86	0.00%	0.00%	0.00	0.00
232 LIBRA BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	88.05	88.05
3 Depozite bancare:	37.51%	37.47%	27.563.896.76	27.563.896.76	36.27%	35.65%	31.899.794.27	31.899.794.27
31 Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	37.51%	37.47%	27.563.896.76	27.563.896.76	36.27%	35.65%	31.899.794.27	31.899.794.27
311 OTP BANK ROMANIA	4.24%	4.24%	3.115.596.12	3.115.596.12	0.40%	0.40%	355.478.14	355.478.14
312 ALPHA BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	3.05%	3.00%	2.684.675.98	2.684.675.98
3130 CITY BANK	0.19%	0.19%	141.247.24	141.247.24	0.35%	0.34%	303.502.57	303.502.57
3120 Procredit Bank	1.17%	1.17%	860.818.68	860.818.68	1.00%	0.98%	879.625.20	879.625.20
3125 Credit Europe Bank SA	9.12%	9.11%	6.699.142.35	6.699.142.35	4.79%	4.70%	4.208.172.99	4.208.172.99
3126 Garanti Bank	0.00%	0.00%	0.00	0.00	10.17%	10.00%	8.949.337.03	8.949.337.03
313 BANCA ROMANEASCA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	3.05%	3.00%	2.685.977.96	2.685.977.96
314 BANCA COMERCIALA ROMANIA	4.51%	4.50%	3.310.480.64	3.310.480.64	0.57%	0.56%	501.203.34	501.203.34
315 PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	7.28%	7.16%	6.404.722.22	6.404.722.22
316 BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.26%	0.26%	194.513.70	194.513.70	0.12%	0.12%	105.963.31	105.963.31
318 VENETO BANCA	2.58%	2.58%	1.899.377.81	1.899.377.81	0.39%	0.38%	341.186.16	341.186.16
320 Unicredit Triac BANK	10.05%	10.04%	7.383.007.57	7.383.007.57	0.00%	0.00%	0.00	0.00
323 MILLENNIUM BANK	5.39%	5.38%	3.959.712.64	3.959.712.64	0.00%	0.00%	0.00	0.00
327 Libra Bank	0.00%	0.00%	0.00	0.00	5.09%	5.01%	4.478.929.38	4.478.929.38
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate in afara pietelor reglementate	-0.02%	-0.02%	-15.305.00	-15.305.00	0.41%	0.40%	357.344.00	357.344.00
51 Contracte Forward	-0.02%	-0.02%	-15.305.00	-15.305.00	0.41%	0.40%	357.344.00	357.344.00
6 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranz pe o piata reglementata cf art 101 (1) lit g:	0.80%	0.80%	0.00	0.00	-2.99%	-2.94%	-2.634.282.56	-2.634.282.56
64 Contracte reverse-repo <1an	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-2.99%	-2.94%	-2.634.282.56	-2.634.282.56
7 Titluri de participare la OPCVM/ADPC	7.38%	7.37%	5.421.947.30	5.421.947.30	9.54%	9.38%	8.394.054.63	8.394.054.63
8 Alte active, din care:	2.94%	2.94%	2.161.890.89	2.161.890.89	1.29%	1.27%	1.132.312.55	1.132.312.55
82 Sume la SSF	0.00%	0.00%	0.22	0.22	0.00%	0.00%	0.22	0.22
83 Sume in curs de recuperare	0.00%	0.00%	17.85	17.85	0.00%	0.00%	-4.00	-4.00
86 Sume in curs de decontare	2.94%	2.94%	2.161.782.82	2.161.782.82	1.29%	1.27%	1.132.316.33	1.132.316.33
Total obligatii	77.81%	77.81%	77.811.24	77.811.24	1.73%	1.70%	1.521.723.89	1.521.723.89
10 CHELTUIELILE FONDULUI (polid obligatii)	0.19%	0.19%	77.811.24	77.811.24	1.73%	1.70%	1.521.723.89	1.521.723.89
101 Comisionare datorate soc. de admn.	0.08%	0.08%	59.451.85	59.451.85	0.09%	0.08%	75.473.41	75.473.41
102 Comisionare datorate depozitarului	0.01%	0.01%	8.838.63	8.838.63	0.01%	0.01%	11.203.33	11.203.33
103 Taxa CNVM	0.01%	0.01%	6.062.83	6.062.83	0.01%	0.01%	7.377.59	7.377.59
106 Cheltuieli de audit	0.00%	0.00%	896.94	896.94	0.00%	0.00%	573.71	573.71
107 Comision custodie	0.00%	0.00%	1.496.99	1.496.99	0.00%	0.00%	2.151.64	2.151.64
108 Rascumparari nepalate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	1.62%	1.59%	1.424.758.61	1.424.758.61
110 Cheltuieli estimate	0.00%	0.00%	264.00	264.00	0.00%	0.00%	184.80	184.80
9 Valoarea activului net (9 - 8)			73.479.298.46	73.479.298.46			87.956.469.92	87.956.469.92

Denumire element	La data de 31.12.2013	La data de 30.06.2014	Diferenta
Valoarea activ net	73.479.298.46	87.956.469.92	14.477.171.46
Numar unitati de fond/investitii in circulatie	6.617.834.1873	6.581.836.07	544.177.43
Valoarea unitatii de activului net	13.0801	13.4043	0.3242

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Prezidentul Directorat

Dan Marius POPOVICI

Intocmit

Nadia Corina Chiriac

OTP Obligațiuni - Situația detaliată a activelor la data de 30/06/2014

1. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din România

5. Obligațiuni admise la tranzacționare

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

Emitent	Simbol obligațiune	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
Primăria Lugoj	LUGO1	-	1.700	23-Jun-08	23-Jun-08	15-Jun-14	14-Sep-14	161	2,39	0,00	0,0000	101	161,13	0,0000%	0,001%
Primăria Craiova	CRAIO7	-	923	13-May-08	13-May-08	15-Apr-14	14-Oct-14	86,50	0,01	0,7829	0,00	101	86,581	1,5300%	0,000%
Primăria Timișoara	TIMOS1	-	890	7-Jul-08	7-Jul-08	15-May-14	14-Aug-14	89,20	0,01	0,2718	0,00	101	89,778	0,5300%	0,007%
Total													350,487		0,530%

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

Serie	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Valoare totală	Banka intermediară	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
							lei	lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO051028N018	1	-	27-Jun-11	11-Apr-13	11-Apr-13	9,991	1,96	160,79	118,14	10,19	101,19	160,79	RAIFFEISEN BANK	0,0000%	0,0171%
RO0711028N018	100	-	10-Sep-14	11-Jun-15	11-Jun-15	1,000	0,04	36,9663	465,10	0,00	1,000	1,000	RAIFFEISEN BANK	0,0000%	1,294%
RO111608N014	1	-	30-Apr-14	30-Apr-14	9,995	1,99	101,80	107,49	9,914	0,00	101,80	107,49	BCR	0,0000%	0,011%
RO111028N011	1	-	24-Sep-14	11-Jun-15	11-Jun-15	15,371	3,90	1,49	120,80	13,96	10,387	10,387	RAIFFEISEN BANK	0,0000%	0,012%
RO111028N012	200	-	25-Jun-14	11-Jun-15	11-Jun-15	2,026	0,10	5,505	268,87	0,00	2,026	2,026	RAIFFEISEN BANK	0,0000%	2,466%
RO120708N011	100	-	26-Jun-14	26-Jul-13	26-Jul-13	1,000	0,00	189,86	34,007	49,00	1,144	1,144	CTI BANK	0,0000%	1,029%
RO121028N018	100	-	19-May-14	26-Apr-14	26-Apr-14	1,014	0,07	1,017	10,378	240,51	1,000	1,000	CTI BANK	0,0000%	1,210%
Total												3,986			0,04%

Sume în curs de decontare și obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale

Emitent	Număr instrumente Reședințe tranzacționare	Valoarea unitară a instrumentelor financiare	Valoare	Pondere în capitalul social al entității	Pondere în activul total al OPC
RO171028N014	100	11,323	1,132	0,0000%	-1,285%
Total			1,132		-1,285%

5.3 Obligațiuni valutare corporative

Emitent	Simbol obligațiune	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
SC GDF SUEZ Energy Romania SA	GSR017	-	114	-	30-Oct-12	30-Oct-13	30-Oct-14	10,000	0,00	201,95	0,00	1,007	1,007	0,04%	1,338%
SC GDF SUEZ Energy Romania SA	GSR017	-	100	-	9-Feb-13	30-Oct-13	30-Oct-14	10,000	0,00	201,95	0,00	1,000	1,000	0,04%	1,176%
Unicredit Trade Bank	UCT18	-	180	-	28-Jun-13	30-Jun-14	10,000	0,00	1,74	26,10	0,00	1,803	1,803	0,0007%	1,681%
Unicredit Trade Bank	UCT18	-	90	-	31-Oct-13	30-Jun-14	10,000	0,00	26,10	21,19	0,00	103,848	0,0000%	0,000%	
C.N.T.E. TRANS-ELECTRICA	TSE18	-	300	-	23-Sep-13	23-Sep-14	10,000	0,00	1,07	117,83	0,00	3,115	3,115	0,01%	1,480%
RAIFFEISEN BANK S.A.	RBR019	-	178	-	14-May-14	14-May-14	10,000	0,00	1,47	25,38	0,00	1,792	1,792	0,003%	2,003%
Commerzbank AG	CBR11	-	220	-	3-Jun-14	3-Jun-14	10,000	0,00	41,96	0,00	2,000	2,000	0,000%	1,198%	
Total												11,178			12,493%

6. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată dintr-un stat membru

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

2.1 Obligațiuni admise la tranzacționare corporative - denumite în lei

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Banka Comercială Română	RO041048N018	1	27-Jun-12	27-Jun-12	22-Sep-13	27-Oct-14	27-Oct-14	514	103,44	26,945	-10,592	101	501,146	0,001%	0,001%
Banka Comercială Română	RO080030N013	1	12-Apr-10	7-Sep-15	8-Sep-15	200	0,00	50,74	4,492	0,00	0,00	50,74	2,205	0,003%	2,465%
Banka Comercială Română	RO080030N013	3	18-Sep-11	7-Apr-14	8-Apr-15	248	0,00	248	4,492	0,00	0,00	248	70,128	0,001%	0,001%
Banka Comercială Română	RO080030N013	2	24-Sep-14	24-Sep-14	7-Apr-15	247	0,00	44,42	4,492	0,00	0,00	44,42	161,977	0,001%	0,001%
Banka Comercială Română	RO080030N013	100	18-Sep-14	25-Jul-13	8-Sep-15	281	0,00	4,492	4,492	0,00	0,00	4,492	498,648	0,000%	0,000%
ENERGY GROUP BANK AG	AT0000130N14	2	25-Mar-14	25-Mar-14	24-May-14	23-May-15	200	0,00	71,23	2,706	0,00	1,003	1,003	0,000%	1,124%
REUNION FINANCIERE ET BANCAIRE SA	FR0000117N04	8	30-May-13	30-May-13	12-Feb-14	11-Feb-15	200	0,00	42,04	8,061	4,343	2,000	2,000	0,000%	2,340%
First Western Bank S.A.	RO090030N018	2	7-Sep-13	7-Sep-13	28-Sep-15	28-Sep-14	200	0,00	39,38	10,175	0,00	1,000	1,000	0,000%	1,198%
Total													2,193		2,593%

2.2 Obligațiuni admise la tranzacționare corporative denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Curs valutar EUR/EURON	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
								EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
CTI GROUP INC	US1040848N28	2	-	18-Apr-14	26-Sep-14	26-Sep-14	26-Sep-14	200,000	16,31	2,009	-	-	4,387	2,219,206.48	0.000%	2.480%
CTI GROUP INC	US1040848N28	100	-	28-Apr-14	30-Sep-14	30-Oct-14	30-Oct-14	1,000.00	0.12	7.71	-	4,387	4,387	2,203,271.51	0.003%	2.465%
J.P. Morgan Structured Products B.V.	XS0801776N23	16	-	11-Jul-13	7-Aug-14	7-Aug-14	7-Aug-14	52.00	842.81	0.00	406.15	4,387	3,988	3,988	0.000%	4.012%
WOL HUNGARIAN OIL & GAS	XS0901403N75	100	-	1-Mar-13	25-Apr-14	19-Apr-15	19-Apr-15	1,000.00	0.13	11.89	-16.90	4,387	458	458	0.000%	0.513%
WOL HUNGARIAN OIL & GAS	XS0901403N75	100	-	25-Jul-13	25-Apr-14	19-Apr-15	19-Apr-15	1,000.00	0.12	11.89	-13.34	4,387	491	491	0.000%	0.510%
WOL HUNGARIAN OIL & GAS	XS0901403N75	200	-	19-Sep-13	25-Apr-14	19-Apr-15	19-Apr-15	1,000.00	0.11	11.89	-9.78	4,387	513	513	0.000%	1.044%
CTP BANK NYLT	XS0214984N52	1	-	9-Jun-11	4-Jun-14	3-Sep-14	41	187,65	7,88	32,21	7,217	4,387	212	212	0.000%	0.237%
CTP BANK NYLT	XS0214984N52	2	-	25-Jun-13	4-Jun-14	3-Sep-14	42	200,00	1,40	32,21	3,322	4,387	420	420	0.000%	4.455%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	19-Jun-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	825.00	0.26	41.15	83.44	4,387	416	416	0.000%	0.460%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	3-Oct-12	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	927.00	0.19	41.15	31.73	4,387	438	438	0.000%	0.480%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	110	-	26-Jul-12	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	992.00	0.19	41.15	29.28	4,387	496	496	0.000%	0.540%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	120	-	13-Sep-12	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	960.00	0.17	41.15	19.26	4,387	530	530	0.000%	0.580%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	110	-	19-Sep-12	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	973.00	0.16	41.15	16.88	4,387	484	484	0.000%	0.520%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	13-Mar-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	999.00	0.14	41.15	0.26	4,387	494	494	0.000%	0.519%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	8-Apr-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	990.00	0.15	41.15	3.88	4,387	493	493	0.000%	0.520%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	8-Jun-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	1,000.00	0.14	41.15	0.00	4,387	499	499	0.000%	0.530%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	12-Jul-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	990.00	0.15	41.15	0.01	4,387	493	493	0.000%	0.520%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	15-Aug-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	990.00	0.15	41.15	7.69	4,387	493	493	0.000%	0.520%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	4-Oct-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	1,010.00	0.13	41.15	-3.59	4,387	491	491	0.000%	0.510%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	9-Oct-13	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	1,010.00	0.14	41.15	-2.43	4,387	490	490	0.000%	0.514%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	9-Feb-14	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	1,000.00	0.11	41.15	-4.80	4,387	486	486	0.000%	0.520%
CTP BANK PLC	XS0408300N00	100	-	3-Mar-14	19-Sep-13	19-Sep-14	19-Sep-14	1,000.00	0.12	41.15	-2.52	4,387	484	484	0.000%	0.519%
RAIFFEISEN BANK INTL	XS1016608N72	2	-	13-Feb-14	21-Feb-14	20-Feb-15	20-Feb-15	99,912.00	12.35	1,602.74	2.85	4,387	880	880	0.000%	0.950%
Total													17,984,015.48		20.81%	

2.3 Obligațiuni admise la tranzacționare corporative denumite în USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Curs valutar EUR/EURON	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
								USD	USD	USD	USD	USD	lei	lei	%	%
WOL Group Finance SA	XS0801403N72	200	-	3-May-13	26-Mar-14	25-Sep-14	25-Sep-14	1,000	0,15	16,47	-0,429	101	881	881	0,000%	0,761%
WOL Group Finance SA	XS0801403N72	200	-	15-May-13	26-Mar-14	25-Sep-14	25-Sep-14	1,000	0,15	16,47	-0,715	101	882	882	0,000%	0,763%
WOL Group Finance SA	XS0801403N72	200	-	27-Mar-14	26-Mar-14	25-Sep-14	25-Sep-14	1,000	0,14	16,47	-2,426	101	880	880	0,000%	0,760%
BPV Gas Capital S.A.	XS0404800N14	100	-	30-May-14	23-Apr-14	22-Oct-14	22-Oct-14	121	0,14	17,44	-3,193	101	879	879	0,000%	0,440%
TOTAL														3,445		2,76%

2.4 Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei scadențe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni destinate	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Crestere cizică	Debitanda cumulată	Discount/primă cumulată(s)	Preț plată	Curs valutar EUR/EURON	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emise	Pondere în activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Ministerul Finanțelor Publice	ES1003042N75		350	15-Apr-14	15-Apr-14	24-Apr-14	23-Apr-15	993,74	0,10	6,75	0,12		4,3870	1.036.386,15	1,2268%	1,717%
ROMANIA	XS0814743036		25	3-Oct-13	3-Oct-13	7-Nov-13	6-Sep-14	1042,00	0,11	37,82	-2,40		4,3870	117.254,48	0,0033%	0,191%
ROMANIA	XS0817318941		34	21-Oct-13	21-Oct-13	18-Sep-15		1037,69	0,12	35,24	-0,75		58,1547	0,0045%	0,177%	
Total														1.012.236,87		2,009%

3.5. Obligatfuri admisa la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale denumite in USD

Emitent	Cod IBR	Data ultimei pedine in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni delimitate	Data achizitiei	Data decurtarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoarea initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(s)	Preț plată	Curs valutar BNR USD/EUR	Valoarea totala	Pondere in total obligatiuni emisa	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Ministerul Finantelor Publice	165719871A203		140	20-Feb-13	20-Feb-13	20-Feb-14	21-Aug-14	1979.28	0.25	31.18	3.61		3.2138	851.622.28	0.02%	1.000%
Ministerul Finantelor Publice	165719871A204		50	11-Apr-14	11-Apr-14	22-Jan-15	23-Sep-15	2152.00	0.32	54.14	-1.07		3.2138	354.414.28	0.18%	0.000%
Republica Moldova	164645504A201		50	16-Mar-14	16-Mar-14	25-Mar-14	25-Sep-14	1973.25	0.30	28.63	0.72		3.2138	121.188.01	0.00%	0.360%
TOTAL														1,407,248.58		1.360%

3.6. Obligatfuri admisa la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale denumite in EUR

Emitent	Cod IBR	Data ultimei scedente in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni delimitate	Data achizitiei	Data decurtarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoarea initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(s)	Preț plată	Curs valutar BNR EUR/EUR	Valoarea totala	Pondere in total obligatiuni emisa	Pondere in activul total al OPC
								EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	lei	lei	%	%
CTT OF BUCHAREST	165224204A1		1	27-May-11	27-May-11	22-Jun-15	21-Jun-15	40871.00	7.75	60.36	2.374.33		4.1870	216,279.30	0.000%	0.242%
Total														216,279.30		0.242%

IX. Disponibiliti in contul curente si numerar

1. Disponibiliti in contul curente si numerar in lei

Denominare banca	Valoarea curenta	Pondere in activul total al OPC
	lei	%
Alpha Bank	53.85	0.000%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.000%
Banca Romaneasca	107.98	0.000%
BANCA VENETO BANCA	304.14	0.000%
BPC Grupa Societate Generale	0.58	0.000%
Cit Bank SA	104.73	0.000%
Cit Bank	0.00	0.000%
CREDIT EUROPE BANK SA	284.36	0.000%
Comert Bank	824.14	0.000%
Immob-Solgarbank Bank	0.00	0.000%
Libra Internal Bank	88.95	0.000%
MILLENIUM BANK	2.9402	0.000%
CTP BANK ROMANIA	11,030.00	0.000%
PROELUS BANK	621.78	0.001%
Procredit Bank	0.00	0.000%
Procredit Trade Bank	310.63	0.000%
Total	17,687.74	0.000%

2. Disponibiliti in contul curente si numerar denumite in EUR

Denominare banca	Valoarea curenta	Curs valutar BNR EUR/EUR	Valoarea actualizata lei	Pondere in activul total al OPC
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	2,643.77	4.3870	11,188.52	0.072%
CTP BANK ROMANIA	0.00	4.3870	0.00	0.000%
BPC Grupa Societate Generale	0.00	4.3870	0.00	0.000%
Cit Bank	0.00	4.3870	0.00	0.000%
Total			11,188.52	0.072%

3. Disponibiliti in contul curente si numerar denumite in USD

Denominare banca	Valoarea curenta	Curs valutar BNR USD/EUR	Valoarea actualizata	Pondere in activul total al OPC
	USD	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	4,484.13	3.2138	14,411.10	0.010%
CTP BANK ROMANIA	0.00	3.2138	0.00	0.000%
Cit Bank	0.00	3.2138	0.00	0.000%
BPC Grupa Societate Generale	0.00	3.2138	0.00	0.000%
TOTAL			14,411.10	0.010%

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denumite in lei

Denominare banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoarea initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoarea totala	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%
Alpha Bank	16-Jun-14	16-Jul-14	2,000,000.00	271.73	4,075.58	2,004,075.58	0.000%
Banca Comerciala Romana	30-Jun-14	1-Jul-14	851,186.24	18.10	18.10	507,203.39	0.000%
Banca Romaneasca	16-Jun-14	16-Jul-14	2,000,000.00	271.86	4,077.56	2,004,077.56	0.000%
BANCA VENETO BANCA	10-Oct-13	10-Oct-14	100,000.00	41.61	90,986.16	341,186.16	0.001%
BPC Grupa Societate Generale	30-Jun-14	1-Jul-14	105,680.31	0.00	0.00	105,680.31	0.011%
Cit Bank	30-Jun-14	1-Jul-14	881,694.00	11.97	11.97	360,502.83	0.000%
CREDIT EUROPE BANK SA	24-Apr-14	24-Jul-14	600,000.00	44.52	3,027.40	603,027.40	0.002%
CREDIT EUROPE BANK SA	16-Apr-14	16-Jul-14	1,000,000.00	89.04	6,989.04	1,006,989.04	1.120%
CREDIT EUROPE BANK SA	24-Apr-14	24-Jul-14	600,000.00	44.52	3,027.40	603,027.40	0.002%
CREDIT EUROPE BANK SA	13-Jun-14	13-Jul-14	1,000,000.00	139.89	2,901.75	1,002,901.75	1.000%
CREDIT EUROPE BANK SA	24-Apr-14	31-Jul-14	600,000.00	44.52	3,027.40	603,027.40	0.002%
Comert Bank	17-Jun-14	17-Jul-14	1,000,000.00	139.08	1,903.15	1,001,903.15	1.790%
Comert Bank	22-May-14	21-Aug-14	1,300,000.00	121.42	4,864.68	1,304,864.68	1.442%
Comert Bank	22-Apr-14	21-Oct-14	2,000,000.00	183.04	13,732.88	2,013,732.88	2.250%
Comert Bank	24-Jun-14	23-Sep-14	2,011,500.00	181.86	1,273.63	2,012,773.63	2.249%
Comert Bank	22-Apr-14	22-Jul-14	2,000,000.00	189.20	15,341.19	2,015,341.19	2.250%
Libra Internal Bank	30-Apr-14	30-Apr-15	1,000,000.00	116.44	7,219.18	1,007,219.18	1.130%
Libra Internal Bank	22-Apr-14	22-Jun-15	600,000.00	94.79	3,805.62	603,805.62	0.663%
Libra Internal Bank	22-Apr-14	21-Apr-15	1,000,000.00	116.44	6,160.68	1,006,160.68	1.132%
Libra Internal Bank	30-May-14	29-Aug-14	600,000.00	75.71	2,454.79	602,454.79	0.667%
Libra Internal Bank	22-Apr-14	27-Jun-15	600,000.00	94.79	3,805.62	603,805.62	0.663%
Libra Internal Bank	30-Jun-14	29-Aug-14	600,000.00	117.36	2,363.48	602,433.48	0.720%
CTP BANK ROMANIA	30-Jun-14	1-Jul-14	354,484.00	13.15	13.15	355,478.14	0.000%
PROELUS BANK	30-Jun-14	28-Jul-14	4,400,000.00	416.56	2,077.78	4,402,077.78	4.820%
PROELUS BANK	15-Jun-14	17-Jul-14	2,000,000.00	369.09	2,044.44	2,002,044.44	2.200%
Procredit Bank	8-May-14	9-Feb-15	674,375.00	93.45	5,045.20	679,420.20	0.693%
Total						21,896,784.27	0.000%

XI. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor regulate

1. Contracte forward

1.1. Contracte forward denumite in EUR

Contingente	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Preț de exercitare	Curs valutar BNR EUR/EUR	Curs forward	Profit / pierdere	Valoarea totala	Pondere in activul total al OPC
	EUR				lei	lei	lei	lei	lei	%
BPC Grupa Societate Generale	100,000.00	V	16-Apr-14	17-Jul-14	4.5446	4.3870	4.3869	0.1037	16,370.00	0.017%
BPC Grupa Societate Generale	100,000.00	V	24-Apr-14	26-Mar-15	4.5743	4.3870	4.4027	0.2116	16,340.00	0.020%
BPC Grupa Societate Generale	300,000.00	V	12-Apr-14	16-Jun-15	4.4937	4.3870	4.4706	0.2109	3,340.00	0.004%
BPC Grupa Societate Generale	800,000.00	V	31-Mar-14	3-Oct-14	4.4008	4.3870	4.4095	0.0913	75,040.00	0.082%
BPC Grupa Societate Generale	200,000.00	V	16-Apr-14	21-Jun-14	4.5457	4.3870	4.3917	0.1540	30,800.00	0.034%
Cit Bank	100,000.00	V	3-Apr-14	7-Oct-14	4.5116	4.3870	4.4108	0.1108	11,080.00	0.012%
Cit Bank	100,000.00	V	23-Apr-14	27-Oct-14	4.5108	4.3870	4.4109	0.1020	16,464.00	0.018%
Cit Bank	300,000.00	V	24-Apr-14	28-Oct-14	4.5120	4.3870	4.4161	0.0969	26,770.00	0.032%
Cit Bank	100,000.00	V	3-Apr-14	8-Mar-14	4.5035	4.3870	4.3967	0.1068	26,394.00	0.032%
Cit Bank	300,000.00	V	30-Apr-14	6-Nov-14	4.4975	4.3870	4.4182	0.0793	39,600.00	0.044%
Cit Bank	1,100,000.00	V	13-Jun-14	17-Jun-15	4.4662	4.3870	4.4708	-0.0046	-5,000.00	-0.005%
Cit Bank	100,000.00	V	23-Jun-14	25-Jun-15	4.4611	4.3870	4.4704	-0.0113	-1,130.00	-0.001%
Cit Bank	100,000.00	V	29-Mar-14	26-Mar-14	4.4738	4.4031	0.0027	5,370.00	0.006%	
Cit Bank	100,000.00	V	21-Jun-14	23-Jul-14	4.5089	4.3870	4.3921	0.1668	16,680.00	0.019%
Cit Bank	400,000.00	V	14-Mar-14	17-Mar-14	4.4655	4.3870	4.4013	0.0642	16,260.00	0.017%
Cit Bank	100,000.00	V	19-Mar-14	22-Sep-14	4.5482	4.3870	4.4068	0.1414	14,140.00	0.016%
Cit Bank	200,000.00	V	6-Jun-14	10-Jun-15	4.4819	4.3870	4.4693	0.0125	2,520.00	0.003%
Total									216,438.00	0.267%

1.2. Contracte forward denumite in USD

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Preț de exercitare	Curs valutar BNR USD/EUR	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totală	Pondere în activul total al OPC
	USD				lei	lei	lei	lei	lei	%
BPC Grupa Societate Generală	120.000,00	N	13-Mai-14	17-Nov-14	1,2215	1,2158	1,2286	0,0129	1.548,00	0,002%
OPC Grupa Societate Generală	100.000,00	N	24-Mai-14	28-Noi-15	1,3108	1,3118	1,2980	0,0048	1.290,00	0,004%
BPC Grupa Societate Generală	210.000,00	N	27-Nov-14	31-Mai-15	1,3110	1,3118	1,3017	0,0093	10.580,00	0,012%
BPC Grupa Societate Generală	600.000,00	N	31-Mai-14	2-Oct-14	1,2619	1,2158	1,2201	0,0316	19.080,00	0,011%
OPC Grupa Societate Generală	100.000,00	N	19-Mai-14	22-Mai-15	1,3100	1,3118	1,2985	0,0040	1.290,00	0,005%
OPC Bank	10.000,00	N	3-Mai-14	5-Mai-14	1,3720	1,3158	1,3151	0,1027	7.630,00	0,009%
TOTAL									46.598,00	0,022%

XII. Instrumente ale pietei monetare, afiate decât cele tranzacționate pe o piață reglementată, conform art.191 (1), lit.g, din Legea nr.287/2004
1. Contracte de report pe titluri emise de administrație publică centrală

Seria emitenții	Tipul de instrument	Nr. titluri deținute	Data achiziției	Data scadenței	Valoare inițială	Cresterea zilnică	Debitarea cumulată	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligațiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al OPC
					lei	lei	lei	lei		%	%
RO13110B0N034	Repo	400	10-Jun-14	10-Jun-14	-5.030.072,75	-258,49	-	-3.877,35	ING BANK	0,0008%	-5,626%
RO13170B0N046	Repo	300	17-Jun-14	17-Jun-14	-3.380.019,48	-164,31	-	-2.360,29	ING BANK	0,0018%	-3,780%
RO14100B0N114	Repo	400	26-Jun-14	26-Jun-14	-2.108.611,00	-133,00	-	-616,01	ING BANK	0,0014%	-3,192%
RO13110B0N034	Repo	200	26-Jun-14	26-Jun-14	-2.250.523,10	-131,28	-	-656,40	ING BANK	0,0012%	-3,516%
TOTAL								-(13.776.675,53)			-(14,776%)

Seria	Data ultimei scutiri în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data scadenței	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Cresterea zilnică	Debitarea cumulată	Discountingul cumulativ	Preț plată	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligațiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
							lei	lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO13110B0N034	-	100	-	10-Nov-13	20-Nov-13	20-Nov-14	1.038.000,00	132,73	32.866,30	-4.656,86	-	1.066.329,44	ING BANK	0,0006%	1,182%
RO13160B0N034	-	100	-	10-Nov-13	20-Nov-13	20-Nov-14	1.039.800,00	131,75	32.866,30	-4.677,45	-	1.067.908,85	ING BANK	0,0006%	1,183%
RO13160B0N034	-	200	-	7-Jan-14	20-Nov-13	20-Nov-14	2.062.068,84	260,90	65.972,60	-9.041,98	-	2.146.000,86	ING BANK	0,0012%	2,365%
RO13160B0N034	-	250	-	14-Jun-14	20-Nov-13	20-Nov-14	2.630.258,86	365,26	82.465,75	-11.352,73	-	2.708.571,88	ING BANK	0,0015%	3,057%
RO13170B0N046	-	300	-	10-Feb-14	26-Jun-13	26-Jun-14	3.174.144,84	346,94	164.876,71	-19.456,75	-	3.313.564,80	ING BANK	0,0018%	3,710%
RO14100B0N114	-	200	-	10-Mai-14	24-Jun-13	24-Jun-14	800.760,00	134,13	901,96	-362,96	-	801.131,93	ING BANK	0,0012%	1,209%
RO14100B0N114	-	200	-	26-Jun-14	24-Jun-13	24-Jun-14	1.062.240,00	85,61	901,96	-172,64	-	1.063.070,50	ING BANK	0,0012%	1,189%
TOTAL												12.338.189,27			13,811%

XIV. Titluri de participare la OPCVM / ACP

1. Titluri de participare denumite în lei

Denumire fond	Data ultimei scutiri în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (EUR)	Preț plată	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei	%	%
CONTINVEST TIZOLAR		1.033	81.890	81.890	87.432,46	1,080%	0,008%
CONTINVEST OIL GATELUM		116.396	56.7200	26.7200	3.110.088,16	11,476%	3,476%
CIP ComstarCO		237.507	16.1033	16.1033	3.824.044,05	0,000%	4,274%
Total					7.021.564,66		7,848%

2. Titluri de participare denumite în EUR

Denumire Fond	Data ultimei scutiri în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (EUR)	Preț plată	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%	%
CIP EURO BOND		26.468	11.8167	11.8167	4,2670	1.127.671,33	0,000%	1,531%
Total						1.127.671,33		1,531%

Evolutia activului net al a VOM în ultimii 3 ani			
	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	21.677.186,38	51.769.456,58	87.356.483,92
VALN	11.8759	12.7156	12.6492

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Director General

Dan Marius POPOVICI

Intocmit

Nadia Corina Chirlac















