

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 Expert

 Decizie autorizare: 134/05.07.2017
 Cod inscriere: CSC06FDIR/400104

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2016 - 31.12.2017

Denumire element	31.12.2016				31.12.2017				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.09%	100.00%	17,445,564.25	17,445,564.25	100.10%	100.00%	22,381,018.61	22,381,018.61	4,935,454.37
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	87.44%	87.35%	15,239,274.46	15,239,274.46	82.41%	82.33%	18,425,886.83	18,425,886.83	3,186,612.37
1.1. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania, din care:	65.74%	65.68%	11,457,972.31	11,457,972.31	62.47%	62.41%	13,968,919.02	13,968,919.02	2,510,946.72
1.1.1. actiuni	65.74%	65.68%	11,457,972.31	11,457,972.31	62.47%	62.41%	13,968,919.02	13,968,919.02	2,510,946.72
1.2. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	17.50%	17.48%	3,049,262.37	3,049,262.37	15.75%	15.73%	3,520,799.77	3,520,799.77	471,537.40
1.2.1. actiuni	17.50%	17.48%	3,049,262.37	3,049,262.37	15.75%	15.73%	3,520,799.77	3,520,799.77	471,537.40
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 dintr-un stat terț, care operează în mod regulat și este recunoscută și deschisă publicului, aprobată de A.S.F., din care:	4.20%	4.20%	732,039.79	732,039.79	4.19%	4.18%	936,168.04	936,168.04	204,128.25
1.3.1. actiuni	4.20%	4.20%	732,039.79	732,039.79	4.19%	4.18%	936,168.04	936,168.04	204,128.25
2 valori mobiliare nou emise	0.00%	0.00%	0.00	0.00	5.37%	5.37%	1,201,615.80	1,201,615.80	1,201,615.80
2.1. actiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	5.37%	5.37%	1,201,615.80	1,201,615.80	1,201,615.80
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
4 Depozite bancare din care:	6.34%	6.34%	1,105,854.90	1,105,854.90	9.68%	9.67%	2,165,045.10	2,165,045.10	1,059,190.21
4.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	6.34%	6.34%	1,105,854.90	1,105,854.90	9.68%	9.67%	2,165,045.10	2,165,045.10	1,059,190.21
4.1.1. OTP BANK ROMANIA	5.45%	5.44%	949,854.03	949,854.03	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-949,854.03
4.1.2. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.90%	0.89%	156,000.87	156,000.87	9.68%	9.67%	2,165,045.10	2,165,045.10	2,009,044.24
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.03%	0.03%	6,792.00	6,792.00	6,792.00
5.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.03%	0.03%	6,792.00	6,792.00	6,792.00
5.4.1. Contracte forward	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.03%	0.03%	6,792.00	6,792.00	6,792.00
6 Conturi curente si numerar	0.01%	0.01%	1,837.20	1,837.20	0.08%	0.08%	17,855.19	17,855.19	16,017.99
6.1. BANCA COMERCIALA ROMANA	0.01%	0.01%	925.66	925.66	0.00%	0.00%	409.73	409.73	-515.93
6.2. BRD-GROUP SOCIETATE GENERAL	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.04%	0.04%	9,488.90	9,488.90	9,488.90
6.3. OTP BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.02%	0.02%	5,536.83	5,536.83	5,536.83
6.4. Banca Comerciala Romana - EURO	0.01%	0.01%	911.54	911.54	0.01%	0.01%	2,399.28	2,399.28	1,487.74
6.5. Banca Comerciala Romana - HUF	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	20.45	20.45	20.45
7 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conform art. 82 lit.g) din O.U.G. nr. 32/2012	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
8 Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.	6.30%	6.30%	1,098,597.69	1,098,597.69	2.52%	2.52%	563,823.69	563,823.69	-534,774.00
9 Dividende sau alte drepturi de incasat	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
10 Alte active	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
II Total obligatii	0.09%	0.09%	16,468.70	16,468.70	0.10%	0.10%	21,599.20	21,599.20	5,130.50
1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate S.A.I.	0.06%	0.06%	11,163.74	11,163.74	0.06%	0.06%	13,854.28	13,854.28	2,690.54
1.1. Comision de administrare	0.06%	0.06%	11,163.74	11,163.74	0.06%	0.06%	13,854.28	13,854.28	2,690.54
2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	2,402.81	2,402.81	0.01%	0.01%	3,342.69	3,342.69	939.88
2.1. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	1,464.87	1,464.87	0.01%	0.01%	2,163.13	2,163.13	698.26
2.2. Cheltuieli pentru plata comisioanelor datorate custodelui	0.01%	0.01%	937.95	937.95	0.01%	0.01%	1,179.56	1,179.56	241.62
3. Cheltuieli cu comisioanele datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	534.15	534.15	0.00%	0.00%	955.32	955.32	421.17
7. Cheltuieli cu plata comisioanelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	1,317.85	1,317.85	0.01%	0.01%	1,627.24	1,627.24	309.39
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.01%	0.01%	897.54	897.54	0.00%	0.00%	895.07	895.07	-2.47
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	152.61	152.61	0.00%	0.00%	924.61	924.61	772.00
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.91%	17,429,095.55	17,429,095.55	100.00%	99.90%	22,359,419.41	22,359,419.41	4,930,323.86

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

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	La data de 31.12.2017	La data de 31.12.2016	Diferente
Valoare activ net	22,359,419.41	17,429,095.55	4,930,323.86
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1,592,1581	1,592,1581	0.0000
Valoarea unitara a activului net	14,043.4668	10,946.8372	3,096.6296

 OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
 Director General
 Dan Marius POPOVICI

 Intocmit
 Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

FDI OTP Expert – Situația detaliată a activelor la data de 31.12.2017

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

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

Emitent	Simbol acțiune	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 OPC
				lei	lei	lei	%	%
ANTIBIOTICE S.A.	ATB	29-Dec-17	382,089	0.1000	0.5380	205,563.88	0.0569	0.918
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	BRD	29-Dec-17	125,619	1.0000	12.9000	1,620,485.10	0.0127	7.240
BURSA DE VALORI BUCUREȘTI SA	BVB	29-Dec-17	8,040	10.0000	27.6000	221,904.00	0.0012	0.991
C.N.T.E.E. TRANSELECTRICA	TEL	29-Dec-17	17,650	10.0000	24.5500	433,307.50	0.2300	1.936
CONPET SA Ploiești	COTE	29-Dec-17	7,287	3.3000	99.4000	724,327.80	0.0099	3.236
DIGI COMMUNICATIONS N.V.	DIGI	29-Dec-17	20,010	0.0455	38.0000	760,380.00	0.2311	3.397
ELECTRICA SA	EL	29-Dec-17	81,670	10.0000	11.3000	922,871.00	0.0817	4.123
FONDUL PROPRIETATEA	FP	29-Dec-17	1,243,291	0.5700	0.8640	1,074,203.42	0.3594	4.800
OMV PETROM S.A.	SNP	29-Dec-17	2,113,270	0.1000	0.2860	604,395.22	0.0210	2.700
S.N. NUCLEARELECTRICA S.A.	SNN	29-Dec-17	29,000	10.0000	7.2000	208,800.00	0.0001	0.933
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	29-Dec-17	56,500	1.0000	31.3000	1,768,450.00	0.0187	7.902
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	29-Dec-17	2,500	10.0000	384.0000	960,000.00	0.0006	4.289
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	29-Dec-17	102,103	0.1000	2.7700	282,825.31	0.8672	1.264
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	29-Dec-17	500,000	0.1000	1.4100	705,000.00	0.0911	3.150
SIF OLTEȚIA S.A.	SIF5	29-Dec-17	504,465	0.1000	2.1800	1,099,733.70	0.0486	4.914
SIF TRANSILVANIA S.A.	SIF3	29-Dec-17	3,328,349	0.1000	0.2430	808,788.81	0.5737	3.614
Sphera Franchise Group	SFG	29-Dec-17	29,418	15.0000	40.7000	1,197,312.60	0.0013	5.350
Vrncart Adjud	VNC	29-Dec-17	1,950,372	0.1000	0.1900	370,570.68	19.8375	1.656
TOTAL						13,968,919.02		62.414

II. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din alt stat membru

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

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 OPC
				EUR	EUR	lei	lei	%	%
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	AT0000969985	29-Dec-17	5,511	-	23.54	4.6597	604,497.94	0.0142	2.701
DAIMLER AG	DE0007100000	29-Dec-17	1,200	-	70.8	4.6597	395,888.11	0.0001	1.769
ERSTE GROUP BANK AG	AT0000652011	29-Dec-17	12,300	-	36.105	4.6597	2,069,333.16	0.0029	9.246
TOTAL							3,069,719.22		13.716

2. Acțiuni tranzacționate în ultimele 30 de zile de tranzacționare (zile lucrătoare) - denumite în HUF

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPC
				EUR	EUR	lei	lei	%	%
MOL HUNGARIAN OIL & GAS	HU0000153937	29-Dec-17	10,000	125.00	3005	0.0150	451,080.55	0.0012	2.015
TOTAL							451,080.55		2.015

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

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

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Curs valutar BNR USD/RON	Piața de achiziție	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPC
				USD	USD	lei	USD	lei	%	%
Alphabet	US02079K1079	29-Dec-17	53	0.003892	1046.4	3.8915	-	215,819.48	0.0000	0.964
Apple Inc.	US0378331005	29-Dec-17	740	0	169.23	3.8915	-	487,333.32	0.0000	2.177
Microsoft Corp	US5949181045	29-Dec-17	700	0	85.54	3.8915	-	233,015.24	0.0000	1.041
TOTAL								936,168.04		4.183

VII. Valori mobiliare nou emise

1. Actiuni nou emise

Emitent	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală	Valoare acțiune	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al OPC
		EUR	lei	lei	%	%
MedLife S.A.	35,238	0.25	34.10	1,201,615.80	0.358	5.369
TOTAL				1,201,615.80		5.369

4. Drepturi de preferință/ drepturi de alocare

Emitent	Titlu de drept	Simbol	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. drepturi de alocare deținute	Valoare drept de preferință	Valoare totală	Pondere în activul total al O.P.C.V.M
						lei	%
MedLife S.A.	Drept de preferință/ Drept de alocare	MR02	N/A	35,238	0.000	0.00	0.00
TOTAL						0.00	0.000

IX. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar în lei

Denumire banca	Valoare curentă	Pondere în activul total al OPC
	lei	%
Banca Comercială Română	409.73	0.002
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	9,488.90	0.042
CREDIT EUROPE BANK SA	0.00	0.000
Libra Internet Bank	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	5,536.83	0.025
NUMERAR ÎN CASERIE	0.00	0.000
Total	15,435.46	0.069

2. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate în EUR

Denumire banca	Valoare curentă	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al OPC
	EUR	lei	lei	%
Banca Comercială Română	514.90	4.6597	2,399.28	0.011
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	0.00	4.6597	0.00	0.000
TOTAL			2,399.28	0.011

3. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate în USD

Denumire banca	Valoare curentă	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al OPC
	USD	lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIÉTÉ GÉNÉRALE S.A.	0.00	3.8915	0.00	0.000
TOTAL			0.00	0.000

4. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate în HUF

Denumire banca	Valoare curentă	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare actualizată	Pondere în activul total al OPC
	HUF	lei	lei	%
Banca Comercială Română	1,362.30	0.0150	20.45	0.000
TOTAL			20.45	0.000

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denuminate în lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadenței	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Valoare totală	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%
Banca Comercială Română	29-Dec-17	5-Jan-18	2,165,000.00	45.10	45.10	2,165,045.10	9.674
Total						2,165,045.10	9.674

1. Contracte forward

1.2. Contracte forward denominated in USD

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
	usd				eur	lei	lei	eur	eur	eur	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	240,000.00	Vanzare	14-Dec-17	15-Mar-18	3.921100	3.8915	3.8915	3.8928	0.0283	6,792.00	0.030
Total										6,792.00	0.030

2. Titluri de participare denominated in valuta

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 OPC
				eur	eur	lei	lei	%	%
FDI OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	9,426.6860	12.8359	-	4.6597	563,823.69	0.2926	2.519
TOTAL							563,823.69		2.519

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	31-Dec-15	31-Dec-16	31-Dec-17
Activ net	12,488,799.95	17,429,095.55	22,359,419.41
VUAN	10,507.0142	10,946.8372	14,043.4668

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Adriana CIOBANU