

SAI: OTP Asset Management Romania
SAI SA

Decizie autorizare: PJR05SAIR/400023

CUI: 22264941

Capital social: 5.795.323 RON

Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007

Inregistrare ONRC: J40/15502/15.08.2007

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 31.12.2017 - 31.12.2018

Denumire element	31.12.2017				31.12.2018				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.10%	100.00%	22,381,018.61	22,381,018.61	100.12%	100.00%	18,649,504.54	18,649,504.54	-3,731,514.07
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	82.41%	82.33%	18,425,886.83	18,425,886.83	77.38%	77.29%	14,413,954.91	14,413,954.91	-4,011,931.92
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:	62.47%	62.41%	13,968,919.02	13,968,919.02	62.43%	62.35%	11,628,731.85	11,628,731.85	-2,340,187.18
1.1.1. actiuni	62.47%	62.41%	13,968,919.02	13,968,919.02	62.43%	62.35%	11,628,731.85	11,628,731.85	-2,340,187.18
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:	15.75%	15.73%	3,520,799.77	3,520,799.77	14.95%	14.93%	2,785,223.06	2,785,223.06	-735,576.70
1.2.1. actiuni	15.75%	15.73%	3,520,799.77	3,520,799.77	14.95%	14.93%	2,785,223.06	2,785,223.06	-735,576.70
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 sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat terț, care operează în mod regulat și este recunoscută și deschisă publicului, aprobată de A.S.F., din care:	4.19%	4.18%	936,168.04	936,168.04	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-936,168.04
1.3.1. actiuni	4.19%	4.18%	936,168.04	936,168.04	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-936,168.04
2 valori mobiliare nou emise	5.37%	5.37%	1,201,615.80	1,201,615.80	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1,201,615.80
3 alte valori mobiliare și instrumente ale pietei monetare menționate 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 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
5 Depozite bancare din care:	9.68%	9.67%	2,165,045.10	2,165,045.10	8.43%	8.42%	1,570,348.89	1,570,348.89	-594,696.22
5.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	9.68%	9.67%	2,165,045.10	2,165,045.10	8.43%	8.42%	1,570,348.89	1,570,348.89	-594,696.22
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	0.03%	0.03%	6,792.00	6,792.00	0.27%	0.27%	50,160.00	50,160.00	43,368.00
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	0.03%	0.03%	6,792.00	6,792.00	0.27%	0.27%	50,160.00	50,160.00	43,368.00
6.4.1. Contracte forward	0.03%	0.03%	6,792.00	6,792.00	0.27%	0.27%	50,160.00	50,160.00	43,368.00
7 Conturi curente si numerar	0.08%	0.08%	17,855.19	17,855.19	5.43%	5.42%	1,010,813.06	1,010,813.06	992,957.87
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
9 Titluri de participare ale A.O.P.C./O.P.C.V.M.	2.52%	2.52%	563,823.69	563,823.69	8.61%	8.60%	1,604,227.68	1,604,227.68	1,040,403.99
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%	21,599.20	21,599.20	0.12%	0.12%	21,727.40	21,727.40	128.19
1. Cheltuieli pentru plata comisiunelor datorate S.A.I.	0.06%	0.06%	13,854.28	13,854.28	0.07%	0.07%	13,384.14	13,384.14	-470.13
2. Cheltuieli pentru plata comisiunelor datorate depozitarului	0.01%	0.01%	3,342.69	3,342.69	0.02%	0.02%	3,288.84	3,288.84	-53.85
3. Cheltuieli cu comisiunile datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	955.32	955.32	0.01%	0.01%	2,627.45	2,627.45	1,672.13
7. Cheltuieli cu plata comisiunelor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	1,627.24	1,627.24	0.01%	0.01%	1,451.39	1,451.39	-175.85
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.00%	0.00%	895.07	895.07	0.00%	0.00%	900.00	900.00	4.93
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	924.61	924.61	0.00%	0.00%	75.57	75.57	-849.03
III Valoarea activului net (I - II)	100.00%	99.90%	22,359,419.41	22,359,419.41	100.00%	99.88%	18,627,777.15	18,627,777.15	-3,731,642.26

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

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2018	Perioada corespunzatoare a anului precedent 31.12.2017	Diferente
Valoare activ net	18,627,777.15	22,359,419.41	-3,731,642.26
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1,442.1581	1,592.1581	-150.0000
Valoarea unitara a activului net	12,916.5985	14,043.4668	-1,126.8683

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

FDI OTP Expert – Situatia detaliata a activelor la data de 31.12.2018

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

1. Actiuni tranzactionate în ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucrătoare)

Emitent	Simbol actiune	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 OPC
					lei	lei	lei	%	%
ALRO SA	ALR	ROALROACNOR0	31-Dec-18	180,000	0.5000	3.0800	554,400.00	0.0252	2.973
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	BRD	ROBRDBACNOR2	31-Dec-18	9,000	1.0000	11.4000	102,600.00	0.0013	0.550
CONPET SA Ploiesti	COTE	ROCOTEACNOR7	31-Dec-18	7,287	3.3000	77.7000	566,199.90	0.0842	3.036
DIGI COMMUNICATIONS N.V.	DIGI	NL0012294474	31-Dec-18	20,010	0.0467	25.6000	512,256.00	0.0200	2.747
ELECTRICA SA	EL	ROELECACNOR5	31-Dec-18	68,670	10.0000	9.7000	666,099.00	0.0199	3.572
FONDUL PROPRIETATEA	FP	ROFPPTAACNOR5	31-Dec-18	1,935,875	0.5200	0.8830	1,709,377.63	0.0211	9.166
MedLife S.A.	M	ROMEDLACNOR6	31-Dec-18	35,238	0.2500	26.8000	944,378.40	0.1591	5.064
OMV PETROM S.A.	SNP	ROSNPPACNOR9	31-Dec-18	2,787,066	0.1000	0.2990	833,332.73	0.0049	4.468
PURCARI WINERIES PUBLIC COMPANY LIMITED	WINE	CY0107600716	31-Dec-18	65,600	0.0467	16.6000	1,088,960.00	0.3280	5.839
S.N. NUCLEARELECTRICA S.A.	SNN	ROSNNEACNOR8	31-Dec-18	85,932	10.0000	8.1600	701,205.12	0.0285	3.760
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	ROSNNGACNOR3	31-Dec-18	40,231	1.0000	27.8000	1,118,421.80	0.0104	5.997
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	ROTGNTACNOR8	31-Dec-18	1,250	10.0000	316.0000	395,000.00	0.0106	2.118
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	ROSIFAACNOR2	31-Dec-18	102,103	0.1000	2.0400	208,290.12	0.0197	1.117
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	ROSIFBACNOR0	31-Dec-18	267,758	0.1000	1.2080	323,451.66	0.0264	1.734
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	ROSIFEACNOR4	31-Dec-18	474,000	0.1000	2.0850	988,290.00	0.0817	5.299
Sphera Franchise Group	SFG	ROSFGPACNOR4	31-Dec-18	29,418	15.0000	19.7500	581,005.50	0.0758	3.115
Vrncart Adjud	VNC	ROVRJUACNOR7	31-Dec-18	1,950,372	0.1000	0.1720	335,463.98	0.1890	1.799
TOTAL							11,628,731.85		62.354

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau pe un sistem alternativ de tranzactionare din alt stat membru

1. Actiuni tranzactionate în ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucrătoare) - denumite în EUR

Emitent	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 OPC
				EUR	EUR	lei	lei	%	%
AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	AT0000969985	31-Dec-18	10,300	-	15.4	4.6639	739,787.82	0.0265	3.967
DAIMLER AG	DE0007100000	31-Dec-18	1,200	-	45.91	4.6639	256,943.58	0.0001	1.378
ERSTE GROUP BANK AG	AT0000652011	31-Dec-18	6,600	-	29.05	4.6639	894,209.55	0.0015	4.795
TOTAL							1,890,940.94		10.139

2. Actiuni tranzactionate în ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucrătoare) - denumite în HUF

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPC
				HUF	HUF	lei	lei	%	%
MOL HUNGARIAN OIL & GAS	HU0000153937	31-Dec-18	20,000	125.00	3078	0.0145	894,282.12	0.0024	4.795
TOTAL							894,282.12		4.795

IX. Disponibil în conturi curente si numerar

1. Disponibil în conturi curente si numerar în lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPC
	lei	%
Banca Comerciala Romana	83.28	0.000
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	350.14	0.002
CREDIT EUROPE BANK SA	0.00	0.000
Libra Internet Bank	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	2,648.07	0.014
NUMERAR IN CASERIE	0.00	0.000
Total	3,081.49	0.017

FDI OTP Expert – Situatia detaliata a activelor la data de 31.12.2018

2. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in EUR

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPC
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	208,148.51	4.6639	970,783.84	5.205
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	4.6639	0.00	0.000
TOTAL			970,783.84	5.205

4. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate in HUF

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR HUF/RON	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPC
	HUF	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	2,543,383.69	0.0145	36,947.73	0.198
TOTAL			36,947.73	0.198

X. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania

1. Depozite bancare denuminate in lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Rata dobanzii	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala	Pondere in activul total al OPC
			%	lei	lei	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	28-Dec-18	7-Jan-19	2.0000%	1,570,000.00	87.22	348.89	1,570,348.89	8.420
Total							1,570,348.89	8.420

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

1.1. Contracte forward denuminate in EUR

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
	eur				lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	400,000.00	Vanzare	18-Jan-18	18-Jan-19	4.7963	4.6639	4.6709	0.1254	50,160.00	0.269
Total									50,160.00	0.269

XIV. Titluri de participare la OPCVM/AOPC

1. Titluri de participare denuminate 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/AOPC	Pondere in activul total al OPC
				lei	lei	lei	%	%
OTP ComodisRO	ROFDIN0001C1	-	58,860.1580	17.7777	-	1,046,398.23	1.0397	5.611
TOTAL						1,046,398.23		5.611

2. Titluri de participare denuminate in valuta 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 OPC
				eur	eur	lei	lei	%	%
FDI OTP EURO BOND	ROFDIN0001J6	-	9,426.6860	12.6880	-	4.6639	557,829.45	0.3608	2.991
TOTAL							557,829.45		2.991

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	31-Dec-16	31-Dec-17	31-Dec-18
Activ net	17,428,106.85	22,359,419.41	18,627,777.15
VUAN	10,946.2162	14,043.4668	12,916.5985

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Filon ANGHEL