

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 Real Estate & Construction

Decizie autorizare: 206/13.07.2018
Cod inscriere: CSC06FDIR/400109

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	0.00%	0.00%	0.00	0.00	100.22%	100.00%	4,522,889.60	4,522,889.60	4,522,889.60
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	52.63%	52.52%	2,375,334.67	2,375,334.67	2,375,334.67
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:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	5.82%	5.80%	262,508.42	262,508.42	262,508.42
1.1.3. obligatiuni, din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	5.82%	5.80%	262,508.42	262,508.42	262,508.42
1.1.3.1. Obligatiuni corporative cotate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	5.82%	5.80%	262,508.42	262,508.42	262,508.42
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:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	11.98%	11.95%	540,617.07	540,617.07	540,617.07
1.2.1. actiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	7.11%	7.09%	320,803.56	320,803.56	320,803.56
1.2.3. obligatiuni, din care:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	4.87%	4.86%	219,813.50	219,813.50	219,813.50
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	4.87%	4.86%	219,813.50	219,813.50	219,813.50
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:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	34.84%	34.76%	1,572,209.18	1,572,209.18	1,572,209.18
1.3.1. actiuni	0.00%	0.00%	0.00	0.00	34.84%	34.76%	1,572,209.18	1,572,209.18	1,572,209.18
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
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:	0.00%	0.00%	0.00	0.00	40.73%	40.64%	1,838,010.26	1,838,010.26	1,838,010.26
5.1. depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	0.00%	0.00%	0.00	0.00	40.73%	40.64%	1,838,010.26	1,838,010.26	1,838,010.26
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.26%	0.26%	11,643.00	11,643.00	11,643.00
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.26%	0.26%	11,643.00	11,643.00	11,643.00
6.4.1. Contracte forward	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.26%	0.26%	11,643.00	11,643.00	11,643.00
7 Conturi curente si numerar	0.00%	0.00%	0.00	0.00	6.13%	6.12%	276,621.14	276,621.14	276,621.14
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.	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
10 Dividende sau alte drepturi de incasat	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.47%	0.47%	21,280.53	21,280.53	21,280.53
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	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.22%	0.22%	9,791.67	9,791.67	9,791.67
1. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate S.A.I.	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.15%	0.15%	6,946.73	6,946.73	6,946.73
2. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate depozitarului	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.02%	0.02%	739.69	739.69	739.69
3. Cheltuieli cu comisiunile datorate intermediarilor	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.02%	0.02%	731.27	731.27	731.27
7. Cheltuieli cu plata comisiunilor/tarifelor datorate A.S.F.	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	352.26	352.26	352.26
8. Cheltuielile cu auditul financiar	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.02%	0.02%	800.00	800.00	800.00
9. Alte cheltuieli aprobate	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	221.73	221.73	221.73
III Valoarea activului net (I - II)	0.00%	0.00%	0.00	0.00	100.00%	99.78%	4,513,097.93	4,513,097.93	4,513,097.93

*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
Valoarea activ net	4,513,097.93	0.00	4,513,097.93
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	9,545.5123	0.0000	9,545.5123
Valoarea unitara a activului net	472.7979	0.0000	472.7979

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL-GRIGORE

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

5.2. Obligatiuni tranzactionate corporative denuminate in RON

Emitent	Simbol obligatiune	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadenta cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulat(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emisiune	Pondere in activul total al OPCVM
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IIB21	ROXR6Y7LQ1H7	-	26	15-Oct-18	15-Oct-18	15-Jan-19	4.5700%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
TOTAL									10,000.00	1.27	96.48	0.00	-	262,508.42	0.008	5.804

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

1.1 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in 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 OPCVM
				EUR	EUR	lei	lei	%	%
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	ES0167050915	31-Dec-18	980	0.5000	33.8300	4.6639	164,624.14	0.000	3.419
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	31-Dec-18	900	0.0000	39.5900	4.6639	166,179.42	0.000	3.874
TOTAL							320,803.56		7.093

2. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale, obligatiuni corporative

2.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denuminate in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data cupon	Data scadentei cupon	Rata cuponului	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulat(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							%	EUR	EUR			EUR	lei	EUR	%	%
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	51	19-Dec-18	7-Nov-18	7-Feb-19	2.6830%	915.00	0.07	4.10	-	920.04	4.6639	219,813.50	0.000	4.860
TOTAL														219,813.50		4.860

III. Valorile mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat terț

1.1 Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) in USD

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				USD	USD	lei	lei	%	%
AMERICAN HOMES 4 RENT - A	US0266513068	31-Dec-18	1800	0.0407	19.85	4.0736	145,549.73	0.000	3.218
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	US0357104092	31-Dec-18	1500	0.0407	9.82	4.0736	60,004.13	0.000	1.327
AVALONBAY COMMUNITIES INC	US0834841012	31-Dec-18	200	0.0407	174.05	4.0736	141,802.02	0.000	3.135
CHIMERA INVESTMENT CORP	US1693402084	31-Dec-18	2,100	0.0407	17.82	4.0736	152,442.26	0.000	3.370
LEXINGTON REALTY TRUST	US5290431015	31-Dec-18	5520	0.0004	8.21	4.0736	184,612.29	0.000	4.082
MGM GROWTH PROPERTIES LLC	US55303A1051	31-Dec-18	1300	0.0000	26.41	4.0736	139,858.91	0.000	3.092
PHYSICIANS REALTY TRUST	US71943U1043	31-Dec-18	1200	0.0407	16.03	4.0736	78,359.77	0.000	1.733
PROLOGIS INC	US74340W1036	31-Dec-18	300	0.0407	58.72	4.0736	71,760.54	0.000	1.587
SIMON PROPERTY GROUP INC	US8288061091	31-Dec-18	140	0.0004	167.99	4.0736	95,805.37	0.000	2.118
STARWOOD PROPERTY TRUST INC	US85571B1052	31-Dec-18	2000	0.0407	19.71	4.0736	160,581.31	0.000	3.550
STORE CAPITAL CORP	US8621211007	31-Dec-18	1,600	0.0407	28.31	4.0736	184,517.79	0.000	4.080
TWO HARBORS INVESTMENT CORP	US90187B4086	31-Dec-18	3000	4.0736	12.84	4.0736	156,915.07	0.000	3.469
TOTAL							1,572,209.16		34.761

IX. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in RON

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	%
Banca Comerciala Romana	73.69	0.002
BRD - GROUPE SOCIETÉ GENERALE S.A.	10,272.00	0.227
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000
NUMERAR IN CASIERIE	0.00	0.000
TOTAL	10,345.69	0.229

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 OPCVM
	EUR	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	56,380.28	4.6639	262,951.89	5.814
Banca Romaneasca	0.74	4.6639	3.45	0.000
TOTAL			262,955.34	5.814

3. Disponibil in conturi curente si numerar denuminate 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	815.03	4.0736	3,320.11	0.073
TOTAL			3,320.11	0.073

FDI OTP Real Estate & Construction – Situatia detaliata a investitiilor la data de 31.12.2018

X. Depozite bancare constituite la instituii de credit din România

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 OPCVM
			%	lei	lei	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	28-Dec-18	7-Jan-19	2.0000%	667.800.00	37.10	148.40	667.948.40	14.768
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-18	3-Jan-19	1.7000%	437.843.29	20.39	20.39	437.863.68	9.681
TOTAL							1,105,812.08	24.449

2. Depozite bancare denuminate 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	eur	lei	lei	%
Banca Romaneasca	28-Dec-18	27-Dec-19	1.2000%	28.995.00	0.95	3.81	4.6639	135,247.56	2.990
Banca Romaneasca	9-Oct-18	9-Oct-19	1.8500%	44.995.00	2.28	191.57	4.6639	210,745.63	4.660
Banca Romaneasca	6-Nov-18	6-Nov-19	1.8500%	22.995.00	1.17	65.27	4.6639	107,550.78	2.378
TOTAL								453,543.98	10.028

2. Depozite bancare denuminate in USD

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Rata dobanzii	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Curs valutar BNR USD/RON	Valoare totala	Pondere in activul total al OPC
			%	usd	usd	usd	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	28-Dec-18	7-Jan-19	1.5000%	16,400.00	0.68	2.73	4.0736	66,818.17	1.477
Banca Comerciala Romana	31-Dec-18	3-Jan-19	1.5000%	52,000.00	2.17	2.17	4.0736	211,836.03	4.684
TOTAL								278,654.20	6.161

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

1.1 Contracte forward denuminate in EUR

Contraparte	Canitate	Tip contract	Data achiziției	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.	50,000.00	Vanzare	27-Dec-18	27-Mar-19	4.6881	4.6639	4.6991	-0.0110	-550.00	-0.012
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	60,000.00	Vanzare	5-Nov-18	5-Feb-19	4.6995	4.6639	4.6782	0.0213	1,278.00	0.028
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	80,000.00	Vanzare	4-Oct-18	7-Jan-19	4.7040	4.6639	4.6666	0.0374	2,992.00	0.066
TOTAL									3,720.00	0.092

1.2 Contracte forward denuminate in USD

Contraparte	Canitate	Tip contract	Data achiziției	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	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	215,000.00	Vanzare	27-Dec-18	27-Mar-19	4.0795	4.0736	4.0742	0.0053	1,139.50	0.025
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	70,000.00	Vanzare	28-Nov-18	28-Feb-19	4.1275	4.0736	4.0746	0.0529	3,703.00	0.082
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	55,000.00	Vanzare	3-Dec-18	1-Mar-19	4.1054	4.0736	4.0747	0.0307	1,688.50	0.037
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	40,000.00	Vanzare	6-Dec-18	21-Feb-19	4.1093	4.0736	4.0745	0.0348	1,392.00	0.031
TOTAL									7,923.00	0.178

XV. Dividende sau alte drepturi de primit

1. Dividende de incasat denuminate in USD

Emitent	Simbol actiune	Data ex-dividend	Nr. actiuni detinute	Dividend brut	Curs valutar BNR USD/RON	Suma de incasat	Pondere in activul total al OPCVM
				USD	lei	lei	%
AMERICAN HOMES 4 RENT - A	US02665T3068	31-Dec-18	1800	0.0500	4.0736	366.62	0.008
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	US0357104092	28-Dec-18	1500	0.3000	4.0736	1,283.18	0.028
AVALONBAY COMMUNITIES INC	US0534841012	28-Dec-18	200	1.4700	4.0736	838.35	0.019
CHIMERA INVESTMENT CORP	US16934Q2084	28-Dec-18	2100	0.5000	4.0736	2,994.10	0.066
INVESCO MORTGAGE CAPITAL INC	US46131B1008	24-Dec-18	1000	0.4200	4.0736	1,197.64	0.026
LEXINGTON REALTY TRUST	US5290431015	28-Dec-18	5520	0.1775	4.0736	2,793.92	0.062
MGM GROWTH PROPERTIES LLC	US55303A1051	28-Dec-18	1300	0.4475	4.0736	2,369.82	0.052
STARWOOD PROPERTY TRUST INC	US85571B1052	28-Dec-18	2000	0.4800	4.0736	3,910.66	0.086
STORE CAPITAL CORP	US8621211007	28-Dec-18	1600	0.3300	4.0736	1,505.60	0.033
TWO HARBORS INVESTMENT CORP	US90187B4086	28-Dec-18	3000	0.4700	4.0736	4,020.64	0.089
TOTAL						21,280.53	0.471

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	31-Dec-16	31-Dec-17	31-Dec-18
Activ net	-	-	4,513,097.93
VUAN	-	-	472.7979

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Flion ANGHEL