

SAI: OTP Asset Management Romania
SAI SA

Decizie autorizare: PJRO5SAIR/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 Premium Return

Decizie autorizare: Aviz 55/26.04.2016
Cod inscriere: CSCORFDIR/400099

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2018 - 31.12.2019

Denumire element	31.12.2018				31.12.2019				Diferente (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.23%	100.00%	14,285,709.14	14,285,709.14	101.49%	100.00%	13,078,513.99	13,078,513.99	-1,207,195.16
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare din care:	82.10%	81.91%	11,701,576.40	11,701,576.40	92.47%	91.11%	11,916,303.79	11,916,303.79	214,727.39
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:	22.20%	22.15%	3,163,696.73	3,163,696.73	41.29%	40.68%	5,320,241.02	5,320,241.02	2,156,544.29
1.1.1. actiuni	5.21%	5.19%	741,960.00	741,960.00	26.63%	26.23%	3,431,116.92	3,431,116.92	2,689,156.92
1.1.3. obligatiuni, din care:	16.99%	16.95%	2,421,736.73	2,421,736.73	14.66%	14.44%	1,889,124.10	1,889,124.10	-532,612.63
1.1.3.1. Obligatiuni corporative cotate	16.99%	16.95%	2,421,736.73	2,421,736.73	14.66%	14.44%	1,889,124.10	1,889,124.10	-532,612.63
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:	51.24%	51.12%	7,303,344.76	7,303,344.76	38.07%	37.51%	4,905,978.10	4,905,978.10	-2,397,366.66
1.2.1. actiuni	7.19%	7.17%	1,024,608.68	1,024,608.68	9.79%	9.65%	1,261,479.85	1,261,479.85	236,871.17
1.2.3. obligatiuni, din care:	44.05%	43.95%	6,278,736.09	6,278,736.09	28.28%	27.87%	3,644,498.26	3,644,498.26	-2,634,237.83
1.2.3.1. Obligatiuni corporative cotate	44.05%	43.95%	6,278,736.09	6,278,736.09	28.28%	27.87%	3,644,498.26	3,644,498.26	-2,634,237.83
1.3. valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat tert sau negociate pe o alta piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat tert, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobat de A.S.F., din care:	8.66%	8.64%	1,234,534.91	1,234,534.91	13.12%	12.92%	1,690,084.67	1,690,084.67	455,549.76
1.3.1. actiuni	8.66%	8.64%	1,234,534.91	1,234,534.91	13.12%	12.92%	1,690,084.67	1,690,084.67	455,549.76
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
3.1. valori mobiliare	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
3.2. instrumente ale pietei monetare	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
4.1. Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare din Romania	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4.2. Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat membru	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
4.3. Produse structurate admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau un sistem alternativ de tranzactionare dintr-un stat tert	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
5 Depozite bancare din care:	13.81%	13.78%	1,968,616.40	1,968,616.40	5.76%	5.68%	742,388.16	742,388.16	-1,226,228.23
5.1. depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	13.81%	13.78%	1,968,616.40	1,968,616.40	5.76%	5.68%	742,388.16	742,388.16	-1,226,228.23
5.2. depozite bancare constituite la instituti de credit dintr-un stat membru	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
5.3. depozite bancare constituite la instituti de credit dintr-un stat tert	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata	-0.13%	-0.13%	-18,178.10	-18,178.10	0.74%	0.73%	95,415.50	95,415.50	113,593.60
6.1. instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6.2. instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6.3. instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat tert	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
6.4. instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate	-0.13%	-0.13%	-18,178.10	-18,178.10	0.74%	0.73%	95,415.50	95,415.50	113,593.60
6.4.1. Contracte forward	-0.13%	-0.13%	-18,178.10	-18,178.10	0.74%	0.73%	95,415.50	95,415.50	113,593.60
7 Conturi curente si numerar	0.21%	0.20%	29,243.68	29,243.68	2.52%	2.48%	324,406.54	324,406.54	295,162.86
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
8.1. Titluri emise de administratia publica centrala	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00
8.2. 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.	4.24%	4.23%	604,450.77	604,450.77	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-604,450.77
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	0.23%	0.23%	32,930.84	32,930.84	1.49%	1.47%	192,100.09	192,100.09	159,169.25
1. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate S.A.I.	0.17%	0.17%	24,718.10	24,718.10	1.44%	1.42%	186,163.88	186,163.88	161,445.78
2. Cheltuieli pentru plata comisiunilor datorate depozitarului	0.02%	0.02%	2,853.44	2,853.44	0.02%	0.02%	2,111.02	2,111.02	-742.42
3. Cheltuieli cu comisiunile datorate intermediarilor	0.01%	0.01%	1,823.97	1,823.97	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1,823.97
7. Cheltuieli cu plata comisiunilor/tarifelor datorate A.S.F.	0.01%	0.01%	1,110.48	1,110.48	0.01%	0.01%	1,004.84	1,004.84	-105.64
8. Cheltuieli cu auditul financiar	0.01%	0.01%	1,035.00	1,035.00	0.01%	0.01%	1,035.00	1,035.00	0.00
9. Alte cheltuieli aprobate	0.01%	0.01%	1,389.85	1,389.85	0.01%	0.01%	1,785.35	1,785.35	395.50
III Valoarea activului net (I-II)	100.00%	99.77%	14,252,778.30	14,252,778.30	100.00%	98.53%	12,886,413.90	12,886,413.90	-1,366,364.41

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

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2019	Perioada corespunzatoare a anului precedent 31.12.2018	Diferente
Valoarea activ net	12,886,413.90	14,252,778.30	-1,366,364.41
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	1,044,445.0428	1,274,835.2777	-230,390.2349
Valoarea unitara a activului net	12.3380	11.1801	1.1579

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Director General
Dan Marius POPOVICI

Intocmit
Filon-Daniel ANGHEL

OTP Premium Return – Situatia detaliata a investitiilor la data de 31.12.2019

I. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata sau pe un sistem alternativ de tranzactionare din Romania
1. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare)

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 OPCVM
					lei	lei	lei	%	%
BANCA TRANSILVANIA S.A.	TLV	ROTLVACNR01	30-Dec-19	292.475	1.0000	2.5950	758.972.63	0.006	5.803
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	BRD	ROBRDBACNR02	30-Dec-19	17.500	1.0000	15.8400	277.200.00	0.003	2.120
DIGI COMMUNICATIONS N.V.	DIGI	NL0012294474	30-Dec-19	7.700	0.0467	33.4000	257.180.00	0.008	1.965
ELECTRICA SA	EI	ROELECACNR05	30-Dec-19	10.000	10.0000	10.6500	106.500.00	0.003	0.814
FONDUL PROPRIETATEA	FP	ROFPYAACNR05	30-Dec-19	355.344	0.5200	1.2100	429.966.24	0.005	3.288
OMV PETROM S.A.	SNP	ROSNPPAACNR09	30-Dec-19	978.631	0.1000	0.4470	437.448.06	0.002	3.345
PURCARI WINERIES PUBLIC COMPANY LIMITED	WINE	CY0107600716	30-Dec-19	27.750	0.0467	22.2000	616.050.00	0.139	4.710
S.N. NUCLEARELECTRICA S.A.	SNN	ROSNNEACNR08	30-Dec-19	15.000	10.0000	14.2600	213.900.00	0.005	1.636
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	SNG	ROSGNACNR03	30-Dec-19	9.000	1.0000	37.1000	333.900.00	0.002	2.553
TOTAL							3,431,116.92		26.235

5. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale/obligatiuni corporativ
5.1. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denuminate in le

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	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
								%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
UNICREDIT BANK ROMANIA	UCB24	ROUCTBDBC048	-	40	27-Jul-17	15-Jul-19	15-Jan-20	4.3900%	10.000.00	1.20	204.47	0.00	-	408,178.63	0.066	3.121
UNICREDIT BANK ROMANIA	UCB24	ROUCTBDBC048	-	50	31-Jul-18	15-Jul-19	15-Jan-20	4.3900%	10.000.00	1.20	204.47	0.00	-	510,223.29	0.082	3.901
Vrncart Adjud	VNC24	ROVRJUDBC011	-	2,500	17-Mar-17	25-Oct-19	25-Jan-20	5.0400%	100.00	0.01	0.94	0.00	-	252,347.40	0.654	1.929
TOTAL														1,170,749.31		6.952

5.2. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denuminate in EUR

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	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
								%	eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
BT Leasing Transilvania IFN	BTL24E	ROGDVSSSSKL4	-	1	12-Dec-19	12-Dec-19	12-Jun-20	1.7500%	100.000.00	4.86	97.22	0.00	-	4.7793	478,394.65	0.002	3.658
INTERNATIONAL INVESTMENT BANK	IB20E	ROIIBKDBC049	-	5	25-Sep-17	25-Sep-19	25-Sep-20	1.5930%	10.000.00	0.44	42.48	0.00	-	4.7793	239,980.12	0.008	1.835
TOTAL															718,374.78		5.493

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

1.1. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in EUI

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	%	%
NOKIA OYJ	FI0009000681	30-Dec-19	12.000	0.0000	3.2960	4.7793	189.030.87	0.000	1.445
WAREHOUSES DE PAUW SCA	BE0003763779	31-Dec-19	400	0.0000	162.2000	4.7793	310.080.98	0.010	2.371
ZAVAROVANICA TRIGLAV D.D.	SI0021111651	30-Dec-19	2.250	0.0000	33.3000	4.7793	358.089.05	0.010	2.738
TOTAL							857,200.91		6.554

1.4. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in HUI

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 OPCVM
				HUF	HUF	lei	lei	%	%
MOL HUNGARIAN OIL & GAS	HU0000153937	31-Dec-19	6.000	125.0000	2,940.0000	0.0145	255.056.76	0.001	1.950
TOTAL							255,056.76		1.950

1.5. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in SEI

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare nominala	Valoare actiune	Curs valutar BNR SEK/RON	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al OPCVM
				SEK	SEK	lei	lei	%	%
ERICSSON LM-B SHS	SE0000108656	31-Dec-19	4.000	23.8965	81.5600	0.4574	149.222.18	0.000	1.141
TOTAL							149,222.18		1.141

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

3.1. Obligatiuni admise la tranzactionare corporative denuminate in le

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	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							%	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Banca Comerciala Romani	XS0496326223	-	2	24-Jun-14	7-Apr-19	7-Apr-20	7.7000%	281,837.58	38.41	14.116.67	-30.376.72	-	531.155.04	0.169	4.061
Black Sea Trade and Development Ban	XS1917958651	-	1	11-Dec-18	11-Dec-19	11-Dec-20	4.9000%	500,000.00	66.94	1,405.74	0.00	-	501,405.74	0.629	3.834
TOTAL													1,032,560.78		7.895

3.2. 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	Creștere zilnică	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPCVM
							%	eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
EMERALD CAP	XS1523215116	-	200	2-Dec-16	5-Nov-19	5-Feb-20	1.7010%	1.000,00	0.05	2.69	-	1,053.3750	4.7793	958,434.37	0.103	7.328
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	19-Jun-17	20-Jun-19	20-Jun-20	2.8750%	1,008.75	0.08	15.32	-	1,053.4300	4.7793	255,393.28	0.005	1.953
GLOBALWORTH REAL ESTATE	XS1577957837	-	50	19-Jun-17	20-Jun-19	20-Jun-20	2.8750%	1,008.75	0.08	15.32	-	1,053.4300	4.7793	255,393.28	0.005	1.953
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	50	30-Sep-15	7-Nov-19	7-Feb-20	2.6000%	941.25	0.07	3.97	-	922.5350	4.7793	221,402.80	0.000	1.693
OTP BANK NYRT	XS0274147296	-	100	24-Nov-15	7-Nov-19	7-Feb-20	2.6000%	988.00	0.07	3.97	-	922.5350	4.7793	442,805.60	0.000	3.386
Societe General	XS1490846810	-	100	24-Nov-16	6-Dec-19	6-Jun-20	1.8750%	1.000,00	0.05	1.21	-	-	4.7793	478,508.16	0.000	3.659
TOTAL														2,611,937.48		19.971

III. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat ter

1.1. Actiuni tranzactionate in ultimele 30 de zile de tranzactionare (zile lucratoare) - denuminate in USI

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	%	%
KRAFT HEINZ CO	US007541064	31-Dec-19	2450	0.4261	32.1300	4.2608	335,403.78	0.000	2.565
Microsoft Corp	US949181045	31-Dec-19	400	0.0000	157.7000	4.2608	268,771.26	0.000	2.055
PROCTER & GAMBLE CO	US7427181091	31-Dec-19	1010	0.0000	124.9000	4.2608	537,495.66	0.000	4.110
VISA INC	US92826C8394	31-Dec-19	685	0.0005	187.9000	4.2608	548,413.96	0.000	4.193
TOTAL							1,690,084.67		12.923

IX. Disponibili in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPCVM
	lei	%
Banca Comerciala Romana	98.00	0.001
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	877.06	0.007
Citi Bank	4,947.80	0.038
CREDIT EUROPE BANK SA	356.43	0.003
Libra Internet Bank	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000
Numerar in casierie	0.00	0.000
Total	6,279.29	0.048

2.1. 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	62,688.52	4.7793	299,607.24	2.291
Banca Romaneasca	57.53	4.7793	274.95	0.002
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.00	4.7793	0.00	0.000
Citi Bank	0.00	4.7793	0.00	0.000
CREDIT EUROPE BANK SA	0.00	4.7793	0.00	0.000
Libra Internet Bank	0.00	4.7793	0.00	0.000
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.7793	0.00	0.000
TOTAL			299,882.20	2.293

2.2. 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	1,344.33	4.2608	5,727.92	0.044
OTP BANK ROMANIA	44.60	4.2608	190.03	0.001
TOTAL			5,917.95	0.045

2.3. 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 OPCVM
	HUF	lei	lei	%
Banca Comerciala Romana	852,555.20	0.0145	12,327.10	0.094
TOTAL			12,327.10	0.094

X. Depozite bancare constituite la institutii 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	30-Dec-19	6-Jan-20	2.3000%	80,000.00	5.11	10.22	80,010.22	0.612
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-19	3-Jan-20	1.7000%	140,977.32	6.57	6.57	140,983.89	1.078
Total							220,994.11	1.690

2.1. 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	31-Oct-19	30-Oct-20	1.0500%	108,900.00	3.13	194.23	4.7793	521,394.05	3.987
TOTAL								521,394.05	3.987

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

1.1. Contracte forward EUR/RON

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
					lei	lei	lei	lei	lei	%
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	100,000.00	Vanzare	30-Jul-19	30-Jul-20	4.8871	4.7736	4.8747	0.0124	1,240.00	0.009
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	300,000.00	Vanzare	29-May-19	27-May-20	4.9659	4.7736	4.8460	0.1199	35,970.00	0.275
Citi Bank	218,000.00	Vanzare	22-Jul-19	22-Jul-20	4.8876	4.7736	4.8711	0.0165	3,597.00	0.028
Citi Bank	150,000.00	Vanzare	22-Apr-19	22-Apr-20	4.9684	4.7736	4.8303	0.1381	20,715.00	0.158
ING BANK Romania	265,000.00	Vanzare	21-May-19	22-May-20	4.9717	4.7736	4.8438	0.1279	33,893.50	0.259
TOTAL									95,415.50	0.730

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 an

	31-Dec-17	31-Dec-18	31-Dec-19
Activ net	22,784,056.98	14,252,778.30	12,886,413.90
VUAN	11.8479	11.1801	12.3380

OTP Asset Management Romania SAI SA

Membru Directorat,
Dan POPOVICI

Intocmit,
Filon ANGHEL