

PORTOFOLIUL TITLURILOR DE STAT EMISE PE PIATA INTERNA

30-Nov-13

I. CERTIFICATE DE TREZORERIE

COD ISIN	Data emisiunii	Data scadenței	Nr. zile/an	Rata medie a discountului (%)	Valoare adjudecata
<i>cu scadența la 182 și 198 zile</i>					
RO1313CTN088	13-May-13	27-Nov-13	198	3.91	500.0
RO1314CTN0A5	17-Jul-13	15-Jan-14	182	4.15	300.0
Total					800.0
% din total portofoliu titluri de stat					0.8%

cu scadența la 364 zile

RO1213CTN0R1	5-Dec-12	4-Dec-13	364	5.77	499.9
RO1213CTN0S9	12-Dec-12	11-Dec-13	364	5.91	500.0
RO1213CTN0T7	19-Dec-12	18-Dec-13	364	5.95	1,081.7
RO1314CTN011	9-Jan-13	8-Jan-14	364	5.87	1,089.5
RO1314CTN029	16-Jan-13	15-Jan-14	364	5.71	1,395.8
RO1314CTN045	6-Feb-13	5-Feb-14	364	5.52	500.0
RO1314CTN052	20-Feb-13	19-Feb-14	364	5.22	499.9
RO1314CTN060	13-Mar-13	12-Mar-14	364	5.27	500.0
RO1314CTN078	20-Mar-13	19-Mar-14	364	5.02	500.0
RO1314CTN094	15-May-13	14-May-14	364	4.78	800.0
RO1314CTN0B3	7-Aug-13	6-Aug-14	364	3.83	300.0
RO1314CTNOC1	18-Sep-13	17-Sep-14	364	3.73	1,000.0
RO1314CTNOD9	9-Oct-13	8-Oct-14	364	3.52	700.0
Total					9,366.7
% din total portofoliu titluri de stat					8.9%

TOTAL CERTIFICATE DE TREZORERIE	10,166.7
% din total portofoliu titluri de stat	9.6%

II. OBLIGAȚIUNI DE STAT

COD ISIN	Data emisiunii	Data scadenței	Nr. zile/an	Rata cuponului (%)	Valoare adjudecata
Obligațiuni de stat cu scadența la 2 ani					
RO1214DBN027	7-Mar-12	23-Apr-14	2 ani	5.95	5,187.4
RO1214DBN068	9-Jul-12	28-Jul-14	2 ani	5.85	5,808.2
total					10,995.6
% din total portofoliu titluri de stat					10.4%
Obligațiuni de stat cu scadența la 3 ani					
RO1114DBN011	11-Apr-11	25-Oct-14	3 ani	6.25	6,389.0
RO1215DBN073	15-Oct-12	26-Oct-15	3 ani	5.80	6,544.3
RO1316DBN053	10-Jun-13	29-Aug-16	3 ani	4.75	3,136.9
total					16,070.2
% din total portofoliu titluri de stat					15.2%
Obligațiuni de stat cu scadența la 4 ani					
RO1216DBN030	9-Apr-12	27-Jan-16	4 ani	5.75	6,558.3
total					6,558.3
% din total portofoliu titluri de stat					6.2%
Obligațiuni de stat denumite în Eur (echiv. Ron) cu scadența la 3 ani					
RO1114DBE010 (1.281,0 mil Eur)	6-May-11	6-May-14	3 ani	4.50	5,688.9
RO1316DBE011 (1.420,38 mil Eur)	24-Jan-13	26-Feb-16	3 ani	3.25	6,974.4
total 4.020,9 mil Eur					12,663.3
% din total portofoliu titluri de stat					12.0%
Obligațiuni de stat denumite în Eur (echiv. Ron) cu scadența la 4 ani					
RO1115DBE025 (884.1 mil Eur)	29-Jul-11	27-Jul-15	4 ani	4.70	3,926.4
total 1.331,1 mil Eur					3,926.4
% din total portofoliu titluri de stat					3.7%

Obligațiuni de stat cu scadența la 5 ani						
RO0914DBN049	12-Jan-09	5-Mar-14	5 ani	11.00		3,992.5
RO1015DBN010	8-Mar-10	30-Apr-15	5 ani	6.00		7,027.6
RO1116DBN024	18-Apr-11	30-Apr-16	5 ani	6.00		6,441.9
RO1217DBN046	23-Apr-12	26-Jul-17	5 ani	5.90		7,689.8
RO1318DBN034	8-Apr-13	28-Nov-18	5 ani	5.60		5,390.0
total						30,541.8
% din total portofoliu titluri de stat						28.9%
Obligațiuni de stat cu scadența la 7 ani						
RO1220DBN057	20-May-12	27-Jan-20	7 ani	5.85		417.2
RO1320DBN022	20-Mar-13	29-Apr-20	7 ani	5.75		2,000.0
total						2,417.2
% din total portofoliu titluri de stat						2.3%
Obligațiuni de stat cu scadența la 10 ani						
RO0515DBN0H8	11-Apr-05	11-Apr-15	10 ani	6.75		32.8
RO0515DBN0T3	6-Jun-05	6-Jun-15	10 ani	7.50		40.1
RO0515DBN119	20-Jul-05	20-Jul-15	10 ani	7.85		100.0
RO0515DBN143	17-Aug-05	17-Aug-15	10 ani	7.49		100.0
RO0717DBN038	11-Jun-07	11-Jun-17	10 ani	6.75		3,948.2
RO1121DBN032	27-Jun-11	11-Jun-21	10ani	5.95		2,385.2
RO1323DBN018	28-Jan-13	26-Apr-23	10 ni	5.85		4,786.6
total						11,392.9
% din total portofoliu titluri de stat						10.8%
Obligațiuni de stat cu scadența la 12 ani						
RO0517DBN0K0	18-Apr-05	18-Apr-17	12 ani	7.00		37.4
RO0517DBN0X3	20-Jun-05	20-Jun-17	12 ani	7.25		46.8
total						84.2
% din total portofoliu titluri de stat						0.1%
Obligațiuni de stat cu scadența la 15 ani						
RO0520DBN0L3	18-Apr-05	18-Apr-20	15 ani	7.25		50.0
RO0520DBN0Y6	20-Jun-05	20-Jun-20	15 ani	7.30		50.0
RO1227DBN011	27-Feb-12	26-Jul-27	15 ani	5.80		748.0
total						848.0
% din total portofoliu titluri de stat						0.8%
TOTAL OBLIGAȚIUNI DE STAT						95,497.8
TOTAL PORTOFOLIU TITLURI DE STAT						105,664.5

curs valutar la data de 30 noiembrie 2013
EUR 4.4421