

## PORTOFOLIUL TITLURILOR DE STAT EMISE PE PIATA INTERNA

30-Sep-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
<b>Total</b>					<b>800.0</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>0.7%</b>

*cu scadența la 364 zile*

RO1213CTN0P5	7-Nov-12	6-Nov-13	364	5.75	794.1
RO1213CTN0Q3	14-Nov-12	13-Nov-13	364	5.73	799.9
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
RO1314CTN0C1	18-Sep-13	17-Sep-14	364	3.73	1,000.0
<b>Total</b>					<b>10,260.7</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>9.4%</b>

**TOTAL CERTIFICATE DE TREZORERIE** 11,060.7**% din total portofoliu titluri de stat** 10.1%

## II. OBLIGAȚIUNI DE STAT

COD ISIN	Data emisiunii	Data scadenței	Nr. zile/an	Rata cuponului (%)	Valoare adjudecata
<b>Obligațiuni de stat cu scadența la 2 ani</b>					
RO1113DBN047	19-Oct-11	19-Oct-13	2 ani	6.00	6,062.0
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
<b>total</b>					<b>17,057.6</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>15.6%</b>

**Obligațiuni de stat cu scadența la 3 ani**

RO1114DBN011	11-Apr-11	25-Oct-14	3 ani	6.25	5,389.1
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	2,136.9
<b>total</b>					<b>14,070.3</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>12.9%</b>

**Obligațiuni de stat cu scadența la 4 ani**

RO1216DBN030	9-Apr-12	27-Jan-16	4 ani	5.75	6,558.3
<b>total</b>					<b>6,558.3</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>6.0%</b>

**Obligațiuni de stat denumite în Eur (echiv. Ron) cu scadența la 3 ani**

RO1013DBE014 ( 1.319,55 mil Eur)	29-Nov-10	29-Nov-13	3 ani	4.80	5,885.7
RO1114DBE010 ( 1.281,0 mil Eur)	6-May-11	6-May-14	3 ani	4.50	5,713.5
RO1316DBE011 ( 1.420,38 mil Eur)	24-Jan-13	26-Feb-16	3 ani	3.25	6,335.5
<b>total 4.020,9 mil Eur</b>					<b>17,934.7</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>16.4%</b>

**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	3,943.4
<b>total 1.331,1 mil Eur</b>					<b>3,943.4</b>
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>					<b>3.6%</b>

<b>Obligațiuni de stat cu scadența la 5 ani</b>							
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	5,427.6		
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	6,689.8		
RO1318DBN034	8-Apr-13	28-Nov-18	5 ani	5.60	4,070.0		
<b>total</b>						<b>26,621.7</b>	
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>						<b>24.4%</b>	
<b>Obligațiuni de stat cu scadența la 7 ani</b>							
RO1220DBN057	20-May-12	27-Jan-20	7 ani	5.85	417.2		
RO1320DBN022	20-Mar-13	29-Apr-20	7 ani	5.75	1,300.0		
<b>total</b>						<b>1,717.2</b>	
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>						<b>1.6%</b>	
<b>Obligațiuni de stat cu scadența la 10 ani</b>							
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	3,348.2		
RO1121DBN032	27-Jun-11	11-Jun-21	10ani	5.95	2,385.2		
RO1323DBN018	28-Jan-13	26-Apr-23	10 ni	5.85	3,406.6		
<b>total</b>						<b>9,412.9</b>	
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>						<b>8.6%</b>	
<b>Obligațiuni de stat cu scadența la 12 ani</b>							
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		
<b>total</b>						<b>84.2</b>	
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>						<b>0.1%</b>	
<b>Obligațiuni de stat cu scadența la 15 ani</b>							
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		
<b>total</b>						<b>848.0</b>	
<b>% din total portofoliu titluri de stat</b>						<b>0.8%</b>	
<b>TOTAL OBLIGAȚIUNI DE STAT</b>						<b>98,248.3</b>	
<b>TOTAL PORTOFOLIU TITLURI DE STAT</b>						<b>109,309.0</b>	

curs valutar la data de 30 septembrie 2013  
EUR 4.4604