

SITUATIA ACTIVEI SI OBLIGATIILOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT OTP WiseRO

Inceputul perioadei de raportare 04.08.2009				Sfarsitul perioadei de raportare 31.12.2009			
Definire elemente	% activul net	% activul total	Valoare	% activul net	% activul total	Valoare	Diferente
			RON			RON	RON
1. VALORI MOBILIARE SI INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE din care:	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1.1. Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1.2. Valori mobiliare si instrumente monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1.3. Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat nemembru sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat nemembru, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobate de CNVM	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2. Valori mobiliare nou emise	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.102 (1) lit.a) L297/2004	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4. DISPONIBIL IN CONTURI CURENTE SI NUMERAR	0.00	0.00	0.00	0.02	0.02	1,351.19	1,351.19
APLHA BANK ROMANIA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	106.33	106.33
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	64.11	64.11
BANCA ROMANEASCA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	132.50	132.50
CEC BANK				0.00	0.00	130.84	130.84
OTP BANK BUDAPESTA				0.01	0.01	674.35	674.35
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.01	243.06	243.06
5. DEPOZITE BANCARE din care:	100.00	100.00	8,952,257.20	108.56	107.67	9,110,306.79	158,049.59
5.1. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	100.00	100.00	8,952,257.20	87.04	86.34	7,304,864.45	-1,647,392.75
CEC BANK	0.00	0.00	0.00	21.31	21.14	1,788,305.23	1,788,305.23
OTP BANK ROMANIA	100.00	100.00	8,952,257.20	21.63	21.45	1,814,893.24	-7,137,363.96
BANCA ROMANEASCA S.A.	0.00	0.00	0.00	21.52	21.35	1,806,180.84	1,806,180.84
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	0.00	0.00	0.00	21.53	21.35	1,806,769.19	1,806,769.19
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	0.00	0.00	0.00	1.06	1.05	88,715.94	88,715.94
5.2. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	0.00	0.00	0.00	21.51	21.34	1,805,442.35	1,805,442.35
OTP Bank Ungaria	0.00	0.00	0.00	21.51	21.34	1,805,442.35	1,805,442.35
5.3. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat nemembru	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00	0.00
6. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA:	0.00	0.00	0.00	-7.75	-7.69	-650,505.06	-650,505.06
6.1. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania	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
6.3. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat nemembru	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
6.4. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE	0.00	0.00	0.00	-7.75	-7.69	-650,505.06	-650,505.06
7. INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE, ALTELE DECAT CELE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA, CONF. ART. 101(1), lit.g DIN LEGEA NR.297/2004	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
8. TITLURI DE PARTICIPARE LA OPCVM/AOPC	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
9. ALTE ACTIVE	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-50.00	-50.00
Sume in curs de rezolvare	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-50.00	-50.00
I. TOTAL ACTIVE	100.00	100.00	8,952,257.20	100.83	100.00	8,461,102.92	-491,154.28
Impozit pe venit	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli estimate	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Comisioane luni precedente	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli de emisiune	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli cu auditul financiar	0.00	0.00	22.44	0.04	0.04	3,382.56	3,360.12
Comision subscriere	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Rascumparari de achitat	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Comision scrisoare garantie bancara	0.00	0.00	0.00	0.41	0.41	34,793.20	34,793.20

Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)			8,952,234.76			8,422,927.17	-529,307.59
Comisioane Depozitar	0.00	0.00	72.20	0.09	0.09	7,504.27	7,432.07
Comisioane Administrare	0.00	0.00	0.00	0.28	0.27	23,088.09	23,088.09
Comisioane custodie + procesare tranzactii/transferuri	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli CNVM	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
II. TOTAL OBLIGATII	0.00	0.00	94.64	0.82	0.81	68,768.12	68,673.48
III. ACTIV NET (I - II)	RON	RON	8,952,162.56	RON	RON	8,392,334.80	-559,827.76

Situatia valorii unitare a activului net	
Denumire element	Perioada curenta 31.12.2009
Valoare activ net	8,392,334.80
Numar de unitati de fond in circulatie	44,739.00
Valoare unitara a activului	187.58

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT *OTP WiseRO* LA DATA DE 31.12.2009

I. DEPOZITE BANCARE

1. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în activul total al fondului
			lei	lei	lei	lei	%
OTP BANK ROMANIA S.A.	02.12.2009	01.03.2010	1,789,560.00	522.16	15,664.78	1,805,224.78	21.336
OTP BANK ROMANIA S.A.	31.12.2009	04.01.2010	9,667.15	0.95	0.95	9,668.46	0.114
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	02.12.2009	02.03.2010	1,789,560.00	573.64	17,209.19	1,806,769.19	21.354
BANCA ROMANEASCA S.A	02.12.2009	01.03.2010	1,789,560.00	554.03	16,620.84	1,806,180.84	21.347
CEC BANK S.A.	11.08.2009	03.01.2010	1,789,580.00	637.38	-1,274.77	1,788,305.23	21.136
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	16.12.2009	16.01.2010	88,284.33	26.98	431.61	88,715.94	1.049
TOTAL						7,304,864.45	86.335

2. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în activul total al fondului
			lei	lei	lei	lei	%
OTP BANK UNGARIA	02.12.2009	01.03.2010	1,789,560.00	529.41	15,882.35	1,805,442.35	21.338
TOTAL						1,805,442.35	21.338

II. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE

1. Contracte swap pe rata dobanzii

Contraparte	Capital initial (notional)	Data achizitie	Data scadentei	Data cotatei	Cotatie contraparte	Profit	Pondere în activul total al fondului
	lei			lei	lei	lei	%
SOCIETE GENERALE	8,947,800.00	11.08.2009	31.12.2012	31.12.2009	-7.27	-650,505.06	-7.688
TOTAL						-650,505.06	-7.688

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	-	-	8,392,334.80
VUAN	-	-	187.58

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu