

SITUATIA ACTIVELOR SI OBLIGATIILOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT OTP GarantisRO

Inceputul perioadei de raportare 31.12.2009

Sfarsitul perioadei de raportare 30.06.2010

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:	-	-	-	-	-	-	-
1.1. Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	-	-	-	-	-	-	-
1.2. Valori mobiliare si instrumente monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-
2. Valori mobiliare nou emise	-	-	-	-	-	-	-
3. Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare mentionate la art.102 (1) lit.a) L297/2004	-	-	-	-	-	-	-
4. DISPONIBIL IN CONTURI CURENTE SI NUMERAR	0.46	0.46	20,169.18	1.10	1.10	51,043.66	30,874.48
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	-	-	99.86	-	-	69.86	(30.00)
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.01	0.01	249.41	0.02	0.02	771.14	521.73
BANCA ROMANEASCA SA	-	-	0.47	0.01	0.01	347.71	347.24
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.01	0.01	591.97	0.01	0.01	465.97	(126.00)
CEC BANK SA	-	-	45.14	-	-	45.20	0.06
OTP BANK BUDAPESTA	0.01	0.01	409.82	0.80	0.79	36,736.08	36,326.26
OTP BANK ROMANIA	0.41	0.40	17,656.48	-	-	197.62	(17,458.86)
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	0.03	0.03	1,116.03	0.26	0.25	11,740.88	10,624.85
PROCREDIT BANK	-	-	-	0.01	0.01	669.20	669.20
5. DEPOZITE BANCARE din care:	112.35	111.34	4,896,999.53	106.04	104.94	4,880,694.94	(16,304.59)
5.1. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	90.74	89.92	3,954,929.55	85.57	84.68	3,938,726.47	(16,203.08)
OTP BANK ROMANIA	21.61	21.42	942,064.99	20.46	20.25	941,966.17	(98.82)
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
BANCA COMERCIALA ROMANA	21.61	21.42	942,069.99	20.46	20.25	941,968.48	(101.51)
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	21.61	21.42	942,074.69	20.47	20.25	941,983.13	(91.56)
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	21.61	21.42	942,069.99	20.46	20.25	941,968.48	(101.51)
BANCA ROMANEASCA SA	4.28	4.24	186,649.89	0.00	0.00	0.00	(186,649.89)
PROCREDIT BANK	-	-	-	3.71	3.67	170,840.21	170,840.21
5.2. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	21.61	21.42	942,069.98	20.46	20.25	941,968.48	(101.50)
OTP Bank Ungaria	21.61	21.42	942,069.98	20.46	20.25	941,968.48	(101.50)
5.3. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat nemembru	-	-	-	-	-	-	0.00
6. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA:	(12.41)	(12.30)	(541,064.10)	(6.10)	(6.03)	(280,656.40)	260,407.70
6.1. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania	-	-	-	-	-	-	-
6.2. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
6.3. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat nemembru	-	-	-	-	-	-	-
6.4. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE	(12.41)	(12.30)	(541,064.10)	(6.10)	(6.03)	(280,656.40)	260,407.70
7. INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE, ALTELE DECAT CELE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA, CONF. ART.101(1), lit.g DIN LEGEA NR.297/2004	-	-	-	-	-	-	-
8. TITLURI DE PARTICIPARE LA OPCVM/AOPC	-	-	-	-	-	-	-
9. ALTE ACTIVE	0.50	0.50	21,999.31	-	-	(0.69)	(22,000.00)
I. TOTAL ACTIVE	100.90	100.00	4,398,103.92	101.04	100.00	4,651,081.51	252,977.59
Impozit pe venit	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli estimate	-	-	-	-	-	-	-
Comisioane luni precedente	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli de emisiune	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli cu auditul financiar	0.08	0.08	3,382.56	0.04	0.04	1,706.98	-1,675.58
Comision scrisoare garantie bancara	0.44	0.44	19,197.45	0.62	0.61	28,333.60	9,136.15
Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)	-	-	4,375,523.91	-	-	4,621,040.93	245,517.02
Comisioane Depozitar	0.09	0.09	3,851.48	0.09	0.09	4,314.18	462.70
Comisioane Administrare	0.29	0.30	12,919.11	0.30	0.30	13,888.92	969.81
Comisioane custodie + procesare tranzactii/transferuri	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli CNVM	-	-	-	-	-	-	-
II. TOTAL OBLIGATII	0.89	0.90	39,350.60	1.05	1.04	48,243.68	8,893.08
III. ACTIV NET (I - II)			4,358,753.32			4,602,837.83	244,084.51

Situatia valorii unitare a activului net			
Denumire element	Perioada curenta 30.06.2010	Perioada corespunzatoare anului precedent 30.06.2009	Diferente
Valoare activ net	4,602,837.83	4,216,698.27	386,139.56
Numar de unitati de fond in circulatie	4,709.00	4,709.00	-
Valoare unitara a activului	977.46	895.46	82.0000

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit

Alina Mihaescu

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT OTP GarantisRO LA DATA DE 30.06.2010

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	30-Jun-10	30-Sep-10	941,800.00	166.17	166.17	941,966.17	20.253%
Procredit Bank	5-May-10	5-Sep-10	100,000.00	19.86	1,132.19	101,132.19	2.174%
Procredit Bank	7-Jun-10	7-Jul-10	69,400.00	12.83	308.02	69,708.02	1.499%
Banca Comerciala Romana	30-Jun-10	30-Sep-10	941,800.00	168.48	168.48	941,968.48	20.253%
PIRAEUS BANK	30-Jun-10	30-Sep-10	941,800.00	183.13	183.13	941,983.13	20.253%
BRD Groupe Societe Generale	30-Jun-10	30-Sep-10	941,800.00	168.48	168.48	941,968.48	20.253%
TOTAL						3,938,726.47	84.684%

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	30-Jun-10	30-Sep-10	941,800.00	168.48	168.48	941,968.48	20.253%
TOTAL						941,968.48	20.253%

II. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE

1. Contracte swap pe actiuni

Contraparte	Capital initial (notional)	Data achizitie	Data scadentei	Data cotație	Cotație contraparte	Profit	Pondere în activul total al fondului
	lei				%	lei	%
SOCIETE GENERALE	4,709,000.00	12-Aug-08	30-Jun-11	30-Jun-10	(5.96)	(280656.40)	-6.034%
TOTAL						(280656.40)	-6.034%

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	AN T-2 (29.08.2008)	AN T-1 (30.06.2009)	AN T (30.06.2010)
Activ Net	5,039,842.19	4,216,698.27	4,602,837.83
VUAN	1070.26	895.46	977.46

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit

Alina Mihaescu