

SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA

Decizie autorizare: PJR05SAIR/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 ComodisRO

Decizie autorizare: 377/27.02.2008
 Cod inscriere: CSC06FDIR/400049

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2010 - 30.06.2011

Denumire element	Inceputul perioadei de raportare			Sfarsitul perioadei de raportare			Diferente
	% din activul net	% din activul total	Lei	% din activul net	% din activul total	Lei	
I Total active	100.312%	100.000%	122,644,409.66	100.298%	100.000%	131,659,118.38	9,014,708.70
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	23.082%	23.010%	28,220,439.08	25.955%	25.878%	34,070,283.84	5,849,844.74
Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	0.061%	0.061%	74,271.49	3.163%	3.153%	4,151,608.13	4,077,336.64
Obligatiuni, din care:	0.061%	0.061%	74,271.49	3.163%	3.153%	4,151,608.13	4,077,336.64
Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.000%	0.000%	0.00	3.107%	3.098%	4,078,586.86	4,078,586.86
Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	0.061%	0.061%	74,271.49	0.056%	0.055%	73,021.28	-1,250.21
Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	23.021%	22.949%	28,146,167.59	22.792%	22.724%	29,918,675.69	1,772,508.10
Obligatiuni	23.021%	22.949%	28,146,167.59	22.792%	22.724%	29,918,675.69	1,772,508.10
Obligatiuni tranzactionate corporative	19.831%	19.769%	24,245,470.43	21.424%	21.361%	28,123,329.02	3,877,858.57
Obligatiuni emise de administratia publica locala denuminate in valuta	1.660%	1.655%	2,029,524.38	1.368%	1.364%	1,795,346.69	-234,177.69
Obligatiuni emise de administratia publica centrala	1.530%	1.526%	1,871,172.79	0.000%	0.000%	0.00	-1,871,172.79
Disponibil in cont curent	0.764%	0.762%	934,455.36	0.482%	0.481%	633,206.09	-301,249.26
ALPHA BANK ROMANIA	0.000%	0.000%	28.48	0.000%	0.000%	569.73	541.25
BANCA ROMANEASCA	0.000%	0.000%	100.00	0.001%	0.001%	1,960.29	1,860.29
BRD-GROUP SOCIETATE GENERAL	0.000%	0.000%	391.77	0.000%	0.000%	436.72	44.95
CEC BANK	0.001%	0.001%	738.25	0.001%	0.001%	728.69	-9.56
OTP BANK ROMANIA	0.757%	0.754%	925,273.50	0.428%	0.427%	562,306.75	-362,966.75
PIRAEUS BANK ROMANIA	0.000%	0.000%	50.00	0.001%	0.001%	1,721.29	1,671.29
Banca Transilvania	0.001%	0.001%	1,348.34	0.001%	0.001%	1,318.34	-30.00
Procredit Bank	0.000%	0.000%	63.39	0.000%	0.000%	63.39	0.00
MKB Romexterra BANK	0.000%	0.000%	396.58	0.000%	0.000%	356.70	-39.88
Banc Post SA	0.000%	0.000%	297.14	0.045%	0.045%	59,279.64	58,982.50
Banca Italo-Romana	0.000%	0.000%	0.74	0.001%	0.001%	1,626.20	1,625.46
Banca Comerciala Romana - EURO	0.005%	0.005%	5,765.03	0.000%	0.000%	0.00	-5,765.03
PIRAEUS BANK - EURO	0.000%	0.000%	2.14	0.000%	0.000%	31.42	29.27
Banca Carpatica	0.000%	0.000%	0.00	0.002%	0.002%	2,806.94	2,806.94
3 Depozite bancare:	72.670%	72.444%	88,848,528.61	30.674%	30.583%	40,265,570.67	-48,582,957.93
Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	72.670%	72.444%	88,848,528.61	30.674%	30.583%	40,265,570.67	-48,582,957.93
OTP BANK ROMANIA	2.866%	2.857%	3,503,964.62	3.330%	3.320%	4,370,847.28	866,882.67
ALPHA BANK ROMANIA	18.750%	18.692%	22,924,225.56	0.000%	0.000%	0.00	-22,924,225.56
BANCA ROMANEASCA	16.893%	16.840%	20,653,509.72	1.222%	1.218%	1,604,116.80	-19,049,392.92
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.038%	0.037%	45,911.86	0.073%	0.073%	96,459.56	50,547.70
PIRAEUS BANK ROMANIA	18.822%	18.763%	23,012,120.79	5.729%	5.712%	7,519,847.00	-15,492,273.79
Banc Post SA	0.000%	0.000%	0.00	13.236%	13.196%	17,374,163.88	17,374,163.88
Banca Italo-Romana	15.302%	15.255%	18,708,796.07	7.085%	7.064%	9,300,136.15	-9,408,659.92
4 Instrumente financiare derivate tranzactionate in afara pietelor reglementate	0.002%	0.002%	2,050.00	-0.064%	-0.064%	-84,270.00	-86,320.00
Contracte Forward	0.002%	0.002%	2,050.00	-0.064%	-0.064%	-84,270.00	-86,320.00
5 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranz pe o piata reglementata cf art 101 (1) lit g:	0.000%	0.000%	0.00	39.960%	39.841%	52,454,619.50	52,454,619.50
Titluri de stat emise de administratia publica centrala	0.000%	0.000%	0.00	0.022%	0.022%	28,551.43	28,551.43
Contracte reverse-repo <1an	0.000%	0.000%	0.00	39.938%	39.820%	52,426,068.07	52,426,068.07
6 Titluri de participare la OPCVM/AOPC	3.794%	3.782%	4,638,937.61	3.291%	3.281%	4,319,709.27	-319,228.34
7 Alte active, din care:	0.000%	0.000%	-1.00	0.000%	0.000%	-1.00	0.00
Sume in curs de rezolvare	0.000%	0.000%	-1.00	0.000%	0.000%	-1.00	0.00
II Total obligatii			381,346.72			391,455.00	10,108.28
CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligatii)	0.312%	0.311%	381,346.72	0.298%	0.297%	391,455.00	10,108.30
Comisioane datorate soc. de admin.	0.148%	0.148%	181,422.57	0.103%	0.103%	135,341.84	-46,080.73
Comisioane datorate depozitarului	0.012%	0.012%	14,984.21	0.013%	0.013%	16,745.42	1,761.21
Taxa CNVM	0.000%	0.000%	0.00	0.009%	0.009%	11,661.05	11,661.05
Cheltuieli de audit	0.003%	0.003%	3,427.84	0.001%	0.001%	1,258.09	-2,169.73
Comision custode	0.001%	0.001%	1,107.15	0.001%	0.001%	1,092.67	-14.48
Rascumparari neplatite	0.148%	0.147%	180,404.95	0.172%	0.171%	225,355.93	44,950.98
III Valoarea activului net (I - II)			122,263,062.94			131,267,663.38	9,004,600.44

Denumire element	La data de 31.12.2010	La data de 30.06.2011	Diferente
Valoare activ net	122,263,062.94	131,267,663.38	9,004,600.44
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	9,320,072.40	9,705,345.58	385,273.18
Valoarea unitara a activului net	13.1183	13.5253	0.41

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

FDI OTP ComodisRO – Situatia detaliata a investitiilor la data de 30/06/2011

I. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania

1. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
PRIMARIA CRAIUTA	ORV27	-	741		13-May-08	15-Apr-11	13-Oct-11	lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Total								97,00	0,02	1.5442	-	-	73.021.27	1.2350%	0.050%

2. Obligatiuni admise la tranzactionare emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice centrale

Serie	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret piata	Valoare totala	Banca intermediara	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
RO1116DBN024	-	1		27-May-11	30-Apr-11	30-Apr-12	9.472.44	1.93	101.64	10.26	-	9.584.34	Citi Bank	0.0000%	0.007%
RO1114DBN011	-	400		15-Jun-11	25-Oct-10	24-Oct-11	3.897.114.04	768.71	170.547.95	1340.53		4.069.002.52	Citi Bank	0.0065%	3.091%
Total												4.078.586.68			3.098%

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru

1. Obligatiuni cotate corporative denuminate in valuta

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EURRON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
FIAT Finance & Trade	XS0465889912	-	500		27-Oct-10	13-Feb-11	12-Feb-12	1.072.50	0.14	25.99	-11.4061	-	4.2341	2.301.417.74	0.0333%	1.748%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	XS0503453275	-	275		24-May-11	20-Apr-11	19-Apr-12	993.10	0.03	11.56	0.1218	-	4.2341	1.169.941.92	0.0367%	0.889%
OTP BANK UNGARIA	XS0288320800	-	290		24-Dec-10	19-Sep-10	18-Sep-11	866.00	0.21	41.15	12.0830	-	4.2341	1.128.715.27	0.0577%	0.857%
OTP BANK UNGARIA	XS0288320800	-	280		24-Dec-10	19-Sep-10	18-Sep-11	870.00	0.21	41.15	11.7222	-	4.2341	1.094.108.63	0.0553%	0.831%
OTP BANK UNGARIA	XS0288320800	-	200		24-May-11	19-Sep-10	18-Sep-11	930.00	0.03	41.15	1.3676	-	4.2341	823.546.78	0.0398%	0.626%
OTP BANK UNGARIA	XS0214084252	-	12		13-Oct-10	4-Mar-11	3-Jun-11	39.750.00	8.68	68.92	1668.9021	-	4.2341	2.107.963.23	0.0024%	1.601%
OTP BANK UNGARIA	XS0214084252	-	10		7-Jan-11	4-Mar-11	3-Jun-11	38.500.00	9.87	68.92	1326.6314	-	4.2341	1.689.217.70	0.0020%	1.283%
OTP BANK UNGARIA	XS0214084252	-	2		14-Jun-11	6-Jun-11	4-Sep-11	41187.50	0.00	68.92	110.2373	-	4.2341	350.301.16	0.0004%	0.266%
ZAGREBACKI HOLDING DOO	XS0309688918	-	10		6-Oct-10	10-Jul-10	9-Jul-11	42.225.00	10.68	2682.15	843.9445	-	4.2341	1.937.148.88	0.1667%	1.471%
Total														12.662.361.31		9.572%

2. Obligatiuni cotate corporative RON

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
CITI GROUP FUNDING Inc	XS0531330701	-	5		25-Jan-11	12-Aug-10	19-Sep-11	504.976.78	112.63	43140.41	-3283.0000	-	2.724.170.94	0.0237%	2.069%
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	10		12-Apr-10	7-Apr-11	6-Apr-12	250.000.00	52.69	4470.63	0.0001	-	2.544.706.28	0.3386%	1.933%
Bank Of Ireland	XS0544792869	-	6		4-Oct-10	4-Oct-11	3-Oct-11	250.000.00	67.81	1838.22	0.0000	-	1.609.949.32	0.0200%	1.223%
CEPPA BANK PLC	XS0296421414	-	476		8-Nov-10	9-May-12	8-May-12	4.878.09	1.14	48.87	52.2772	-	2.370.120.18	1.1900%	1.800%
Unicredit Group Bank Austria	XS0454824995	-	6		3-Dec-10	19-Aug-10	18-Aug-11	526.866.90	124.23	47832.88	-5699.0385	-	4.552.005.88	0.0012%	3.457%
Unicredit Group Bank Austria	XS0454824995	-	3		25-Jan-11	19-Aug-10	18-Aug-11	530.679.34	118.63	47832.88	-5140.5077	-	1.720.115.12	0.0005%	1.306%
Total													15.520.967.71		11.789%

3. Obligatiuni emise de catre administratia publica locala denuminate in EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data scadentei cupon	Valoare initiala	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EURRON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
City of Bucharest	XS0222425471		9	26-May-11	31-May-11	22-Jun-10	21-Jun-11	47.000.00	7.67	50.72	62.7107	-	4.2341	1.795.346.69	0.0900%	1.364%
Total														1.795.346.69		1.364%

III. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere in activul total al OPC
	lei	%
Alpha Bank	569.73	0.000%
Banca Romaneasca	1.960.29	0.001%
Banc Post SA	59.279.64	0.045%
Banca Comerciala Romana	0.00	0.000%
BRD Groupe Societe Generale	288.27	0.000%
Banca Transilvania	1.318.34	0.001%
Banca Comerciala Carpatica	2.806.94	0.002%
CEC Bank SA	728.69	0.001%
Citi Bank	0.00	0.000%
BANCA ITALO-ROMENA	1.626.20	0.001%
OTP BANK ROMANIA	173.312.00	0.132%
OTP BANK ROMANIA	1.750.00	0.001%
OTP BANK ROMANIA	15.439.75	0.012%
OTP BANK ROMANIA	53.073.75	0.040%
OTP BANK ROMANIA	53.073.75	0.040%
OTP BANK ROMANIA	53.255.00	0.040%
OTP BANK ROMANIA	53.247.50	0.040%
OTP BANK ROMANIA	53.247.50	0.040%
OTP BANK ROMANIA	53.016.25	0.040%
OTP BANK ROMANIA	32.891.25	0.040%
PIRAEUS BANK	1.721.29	0.001%
Procredit Bank	63.39	0.000%
Romexterra Bank	356.70	0.000%
Total	633.026.23	0.481%

2. Disponibil în conturi curente și numerar denominate în valută

Denumire banca	Valoarea curentă	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea actualizată lei	Pondere în activul total al OPC
	eur	lei	lei	%
Banca Comercială Română	0.00	4.2341	0.00	0.000%
BRD Groupe Societate Generale	35.06	4.2341	148.45	0.000%
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.2341	0.00	0.000%
PIRAEUS BANK	7.42	4.2341	31.42	0.000%
Total			179.88	0.000%

Denumire banca	Data constituirii	Data scadenței	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Valoarea totală	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%
Total						0.00	0.000%
Banc Post SA	10-Jun-11	12-Jul-11	10,289,590.00		2186.54	45,917.30	7.850%
PIRAEUS BANK	3-Jun-11	4-Jul-11	5,031,761.11		1048.28	29,351.94	3.844%
BANCA ITALO-ROMENA	14-Mar-11	30-Sep-11	4,000,000.00		838.36	91,380.82	3.108%
Banc Post SA	3-Jun-11	4-Jul-11	3,999,700.00		833.27	23,331.58	3.056%
BANCA ITALO-ROMENA	7-Mar-11	7-Sep-11	3,130,500.00		664.70	77,104.64	2.436%
Banc Post SA	6-Jun-11	6-Jul-11	3,000,000.00		625.00	15,625.00	2.290%
PIRAEUS BANK	2-Jun-11	2-Jul-11	2,443,968.31		509.16	14,765.64	1.867%
OTP BANK ROMANIA	30-Jun-11	1-Jul-11	2,367,194.18		201.05	201.05	1.798%
OTP BANK ROMANIA	22-Jun-11	22-Jul-11	2,000,000.00		383.56	3,452.05	1.529%
BANCA ITALO-ROMENA	28-Jun-11	28-Sep-11	2,000,000.00		383.56	1,150.68	1.500%
Banca Romaneasca	15-Jun-11	15-Jul-11	1,599,000.00		319.80	1,604,116.80	1.218%
Banca Comercială Română	30-Jun-11	1-Jul-11	30,739.87		2.90		0.023%

IV. Depozite bancare

1. Depozite bancare denominate în lei

2. Depozite bancare denominate în valută

Denumire banca	Data constituirii	Data scadenței	Valoarea inițială*	Creștere zilnică*	Dobanda cumulată*	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei		lei	%
Banca Comercială Română	30-Jun-11	1-Jul-11	15520.54	0.30		4.2341	65,716.78	0.050%
Total							65,716.78	0.050%

V. Instrumente financiare derivate negociate în afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

Contrapartă	Cantitate	Tip contract	Data achiziției	Data scadenței	Pret de exercitare	Curs valutar BNR EUR/RON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoarea totală	Pondere în activul total al OPC
					lei	lei		lei	lei	%
OTP BANK ROMANIA	100,000.00	V	14-Jun-11	18-Jul-11	4.1759	4.2341	4.2406	-0.0647	-6,470.00	-0.005%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	17-Jun-11	21-Sep-11	4.2459	4.2341	4.2694	-0.0235	-11,750.00	-0.009%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	17-Jun-11	21-Sep-11	4.2459	4.2341	4.2694	-0.0235	-11,750.00	-0.009%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	20-Jun-11	22-Sep-11	4.2604	4.2341	4.2699	-0.0095	-4,750.00	-0.004%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	28-Jun-11	30-Sep-11	4.2313	4.2341	4.2740	-0.0427	-21,350.00	-0.016%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	C	3-May-11	18-Jul-11	4.1360	4.2341	4.2406	0.1046	52,300.00	0.040%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	14-Apr-11	14-Iun-11	4.1325	4.2341	4.2406	-0.1081	-54,050.00	-0.041%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	21-Jun-11	23-Sep-11	4.2598	4.2341	4.2704	-0.0106	-5,300.00	-0.004%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	21-Jun-11	23-Sep-11	4.2598	4.2341	4.2704	-0.0106	-5,300.00	-0.004%
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	27-Jun-11	28-Sep-11	4.2413	4.2341	4.2730	-0.0317	-15,850.00	-0.012%
Total									-84,270.00	-0.064%

VI. Instrumente ale pieței monetare, altele decât cele tranzacționate pe o piață reglementată, conf. art. 101(1), lit.d din legea nr 297/2004

Serie emisiuni	Tipul de instrument	Nr. titluri deținute	Data achiziției	Data scadenței	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Valoarea totală	Banca intermediară	Pondere în total obligațiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al OPC
					lei	lei	lei	lei		%	%
RO1112CTN0E1	Repo	851	25-May-11	27-Jun-11	-7,987,277.09	-1,349.40	-5,324.85	-7,992,601.94	PIRAEUS BANK	0.0137%	-6.071%
RO10130BN023	Repo	1,000	10-Jun-11	12-Jul-11	-10,289,587.57	-1,686.35	-35,413.33	-10,325,000.90	PIRAEUS BANK	0.0161%	-7.842%
RO09120BN070	Repo	900	24-Jun-11	24-Aug-11	-10,077,828.68	-1,879.64	-11,757.47	-10,089,586.15	PIRAEUS BANK	0.0145%	-7.863%
RO10150BN010	Reverse Repo	1,048	3-Jun-11	4-Jul-11	10,104,253.12	1,982.79	55,797.93	10,160,051.05	PIRAEUS BANK	0.0169%	7.717%
RO10150BN010	Reverse Repo	812	20-Jun-11	20-Jul-11	7,867,285.56	1,551.80	17,067.64	7,884,353.20	PIRAEUS BANK	0.0131%	5.968%
RO11160BN024	Reverse Repo	553	23-Jun-11	25-Jul-11	5,292,320.87	1,043.76	8,350.11	5,300,670.98	PIRAEUS BANK	0.0089%	4.026%
RO11160BN024	Reverse Repo	1,270	24-Jun-11	25-Jul-11	12,156,494.64	2,397.53	16,782.72	12,173,277.36	PIRAEUS BANK	0.0205%	9.246%
RO11160BN024	Reverse Repo	847	27-Jun-11	27-Jul-11	8,112,204.11	1,599.91	6,396.63	8,118,603.74	PIRAEUS BANK	0.0137%	6.166%
RO11140BN011	Reverse Repo	846	29-Jun-11	29-Jul-11	8,580,257.68	1,717.65	3,435.3031	8,583,692.98	PIRAEUS BANK	0.0137%	6.526%
TOTAL								23,821,460.28			18.933%

Seria emisiuni	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Numar obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prime cumulate (a)	Pret plată	Valoarea totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al fondului	
							lei	lei	lei	lei		lei		%	%	
RO10130BN023		1,000		1-Apr-11	25-Jul-11	25-Jul-13	9,799,127.42	1,949.77	583,904.11	21,606.86	-	10,404,638.39	BRD Groupe Societate	0.0161%	7.903%	
RO09120BN070		900		3-May-11	25-Oct-10		9,511,920.00	1,827.72	690,719.1777	-55,628.61	-	10,146,810.56	Citi Bank	0.0145%	7.707%	
RO1112CTN0E1		851		25-May-11	2-May-11	2-May-12	7,997,919.86	1,492.95		0.00	55,238.97	-	8,053,158.83	BRD Groupe Societate	0.0137%	6.117%
TOTAL												28,604,607.78			21.726%	

lei	Tip de instrument	Nr. titluri deținute	Data achiziției	Data Decontare	Data scadenței	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prime cumulate (a)	Valoarea totală	Banca intermediară	Pondere în total obligațiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al OPC
						lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO1112CTN0C5	Certificat de trezorerie	1		2-May-11	11-Apr-12	9,396.66	1.75	0.00	104.93	9,501.59	BCR	0.0000%	0.007%
RO1112CTN0B7	Certificat de trezorerie	1		2-May-11	4-Apr-12	9,408.17	1.75	0.00	105.08	9,513.23	BCR	0.0000%	0.007%
RO1112CTN0A9	Certificat de trezorerie	1		2-May-11	21-Mar-12	9,431.29	1.76	0.00	105.32	9,536.61	BCR	0.0000%	0.007%
Total										28,551.43			0.022%

VII. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denuminate in lei

Denumire fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare	Pondere in activul total al OPC
			lei	lei	lei	%	%
CERTINVEST MONETAR		13.718.508734	69.8900		958.786.58	14.3617%	0.728%
CERTINVEST OBLIGATIUNI		81.652.257445	22.2800		1.819.212.30	14.5566%	1.382%
OTP OBLIGATIUNI		63.177	11.1300		703.158.79	16.2781%	0.534%
Total					3.481.137.64		2.644%

2. Titluri de participare denuminate in valuta

Denumire Fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total titluri de participare	Pondere in activul total al OPC
		eur	eur	lei	lei	lei	%	%
BRD EURO FOND		1.461.3625	107.5469		4.2341	665.452.35	0.2080%	0.505%
OTP EURO BOND		3.979.1888	10.2740		4.2341	173.099.26	0.6284%	0.131%
Total						838.551.62		0.637%

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	86.955.105.04	97.224.955.37	131.287.663.38
VUAN	11.57	12.5750	13.5253

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu