

ANEXA NR. 10

SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA

Decizie autorizare: PJR05SAIR400023

CUI: 22264941

Capital social: 5.795.323 RON

Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007

Inregistrare ONRC: J40/15502/15.08.2007

Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

OTP Obligatiuni

Decizie autorizare: 375/27.02.2008

Cod inscriere: CSC06FDIR400048

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	
Total active	100.372%	100.000%	9,537,468.82	100.209%	100.000%	4,329,535.34	-5,207,933.48
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	71.065%	70.802%	6,752,686.06	67.791%	67.649%	2,928,907.66	-3,823,778.40
Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	32.593%	32.472%	3,097,006.15	43.106%	43.016%	1,862,414.54	-1,234,591.61
Actiuni Tranzactionate	29.335%	29.227%	2,787,484.40	0.000%	0.000%	0.00	-2,787,484.40
Obligatiuni, din care:	2.778%	2.767%	263,934.25	43.106%	43.016%	1,862,414.54	1,598,480.29
Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.000%	0.000%	0.00	37.101%	37.024%	1,602,965.29	1,602,965.29
Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	2.778%	2.767%	263,934.25	6.005%	5.993%	259,449.24	-4,485.01
Certificate de investitii	0.480%	0.478%	45,587.50	0.000%	0.000%	0.00	-45,587.50
Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	28.884%	28.777%	2,744,609.57	24.684%	24.633%	1,066,493.12	-1,678,116.45
Actiuni	0.341%	0.339%	32,372.09	0.000%	0.000%	0.00	-32,372.09
Obligatiuni	28.544%	28.438%	2,712,237.48	24.684%	24.633%	1,066,493.12	-1,645,744.36
Obligatiuni tranzactionate corporative	14.021%	13.968%	1,332,240.87	20.080%	20.038%	867,537.10	-464,703.77
Obligatiuni emise de administratia publica locala denumite in valuta	0.000%	0.000%	0.00	4.605%	4.595%	198,956.02	198,956.02
Obligatiuni emise de administratia publica centrala	14.523%	14.469%	1,379,996.61	0.000%	0.000%	0.00	-1,379,996.61
Alte val mob si instr ale pietei mon mentionate la art 102 (1) lit. a) din legea 297/2004, din care:	9.588%	9.553%	911,070.34	0.000%	0.000%	0.00	-911,070.34
Valori mobiliare, din care:	9.588%	9.553%	911,070.34	0.000%	0.000%	0.00	-911,070.34
Actiuni NECOTATE (prin prospect)	9.588%	9.553%	911,070.34	0.000%	0.000%	0.00	-911,070.34
2 Disponibil in cont curent	0.438%	0.436%	41,575.79	1.648%	1.645%	71,205.83	29,630.04
ALPHA BANK ROMANIA	0.000%	0.000%	5.58	0.009%	0.009%	380.68	375.10
BANCA COMERCIALA ROMANIA	0.000%	0.000%	0.00	0.195%	0.194%	8,409.63	8,409.63
BANCA ROMANEASCA	0.007%	0.007%	670.38	0.021%	0.021%	920.95	250.57
BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.002%	0.002%	235.23	0.006%	0.006%	268.20	32.97
CEC BANK	0.003%	0.003%	321.21	0.007%	0.007%	311.41	-9.80
OTP BANK ROMANIA	0.418%	0.416%	39,688.85	0.899%	0.897%	38,826.25	-862.60
PIRAEUS BANK ROMANIA	0.002%	0.002%	200.01	0.010%	0.010%	414.88	214.87
Banca Transilvania	0.002%	0.002%	156.60	0.003%	0.003%	126.60	-30.00
Procredit Bank	0.003%	0.003%	297.93	0.007%	0.007%	297.93	0.00
Banca Comerciala Romana - EURO	0.000%	0.000%	0.00	0.492%	0.491%	21,249.30	21,249.30
3 Depozite bancare:	18.342%	18.274%	1,742,890.49	13.879%	13.850%	599,640.35	-1,143,250.14
Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	18.342%	18.274%	1,742,890.49	13.879%	13.850%	599,640.35	-1,143,250.14
OTP BANK ROMANIA	0.000%	0.000%	0.00	13.879%	13.850%	599,640.35	599,640.35
ALPHA BANK ROMANIA	4.793%	4.775%	455,388.31	0.000%	0.000%	0.00	-455,388.31
BANCA COMERCIALA ROMANIA	3.073%	3.062%	292,013.94	0.000%	0.000%	0.00	-292,013.94
PIRAEUS BANK ROMANIA	10.477%	10.438%	995,488.24	0.000%	0.000%	0.00	-995,488.24
4 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata, din care:	0.070%	0.070%	6,650.00	0.000%	0.000%	0.00	-6,650.00
Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania, din care:	0.070%	0.070%	6,650.00	0.000%	0.000%	0.00	-6,650.00
Futures	0.070%	0.070%	6,650.00	0.000%	0.000%	0.00	-6,650.00
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate in afara pietelor reglementate	0.000%	0.000%	0.00	-0.392%	-0.391%	-16,920.00	-16,920.00
Contracte Forward	0.000%	0.000%	0.00	-0.392%	-0.391%	-16,920.00	-16,920.00
6 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranz pe o piata reglementata cf art 101 (1) lit g:	0.000%	0.000%	0.00	11.536%	11.512%	498,424.40	498,424.40
Contracte reverse-repo <1an	0.000%	0.000%	0.00	11.536%	11.512%	498,424.40	498,424.40
7 Titluri de participare la OPCVM/AOPC	9.137%	9.103%	868,205.82	4.357%	4.348%	188,259.04	-679,946.78
8 Dividende sau alte drepturi de incasat	0.217%	0.216%	20,608.02	0.000%	0.000%	0.00	-20,608.02
9 Alte active, din care:	1.103%	1.099%	104,852.64	1.389%	1.386%	60,018.07	-44,834.57
Sume la SSIF	1.104%	1.099%	104,856.64	1.389%	1.386%	60,000.22	-44,856.42
Sume in curs de rezolvare	0.000%	0.000%	-4.00	0.000%	0.000%	17.85	21.85
II Total obligatii			35,377.09			9,025.93	-26,351.16
CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligatii)	0.372%	0.371%	35,377.09	0.209%	0.208%	9,025.93	-26,351.16
Comisioane datorate soc. de admin.	0.298%	0.297%	28,334.48	0.150%	0.150%	6,481.20	-21,853.29
Comisioane datorate depozitarului	0.031%	0.031%	2,924.64	0.020%	0.020%	875.96	-2,048.68
Taxa CNVM	0.000%	0.000%	0.00	0.008%	0.008%	359.61	359.61
Cheltuieli de audit	0.036%	0.036%	3,427.84	0.022%	0.021%	930.68	-2,497.17
Comision custode	0.007%	0.007%	690.13	0.009%	0.009%	375.48	-314.65
Comision de subscriere	0.000%	0.000%	0.00	0.000%	0.000%	3.00	3.00
III Valoarea activului net (I - II)			9,502,091.73			4,320,905.41	-5,181,186.32

Denumire element	La data de 31.12.2010	La data de 30.06.2011	Diferente
Valoare activ net	9,502,091.73	4,320,905.41	-5,181,186.32
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	946,770.89	388,108.63	558,662.26
Valoarea unitara a activului net	10.04	11.13	-1.09

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

FDI OTP Obligatiuni – Situatia detaliata a activelor 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 decontare	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Primaria Lugoj	LGJ14	-	1.750	-	23-Jun-08	15-Jun-11	14-Sep-11	40.72	0.01	0.1130	0.00	-	71.457.83	5.0000%	1.650%
Primaria Orasului Oravita	ORV27	-	923	-	13-May-08	15-Apr-11	13-Oct-11	97.00	0.03	1.5443	0.00	-	90.956.32	1.5383%	2.101%
Municipiul Timisoara	TIM26C	-	990	-	7-Jul-08	15-May-11	14-Aug-11	86.00	0.01	0.6076	0.00	-	85.741.85	0.0660%	1.980%
TOTAL													248.156.00		5.732%

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 decontare	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Banca intermediara	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO10150BN010	-	90	-	31-Mar-11	30-Apr-10	30-Apr-11	859.793.46	174.51	9.147.54	2.480.89	-	871.421.89	Piraeus Bank	0.0014%	20.127%
RO10150BN010	-	20	-	28-Jun-11	30-Apr-11	30-Apr-12	191.945.60	38.53	2.032.79	17.23	-	193.995.62	Piraeus Bank	0.0003%	4.481%
RO05150BN0H8	-	1	-	27-Jun-11	11-Apr-11	11-Apr-12	9.851.36	1.95	149.39	0.43	-	10.001.17	Raffaellen Bank	0.0000%	0.231%
RO09140BN049	-	1	-	27-Jun-11	5-Mar-11	5-Mar-12	10.942.43	2.05	354.64	-3.84	-	11.293.24	Raffaellen Bank	0.0000%	0.261%
RO11140BN011	-	50	-	27-Jun-11	25-Oct-10	25-Oct-11	487.543.00	95.86	21.318.49	40.98	-	508.902.47	BCR	0.0008%	11.754%
RO11160BN024	-	1	-	27-Jun-11	30-Apr-11	30-Apr-12	9.305.50	1.92	101.64	1.12	-	9.608.26	BCR	0.0000%	0.222%
RO11210BN032	-	1	-	27-Jun-11	11-Jun-11	11-Jun-12	9.002.27	1.90	32.51	1.10	-	9.035.88	Piraeus Bank	0.0000%	0.209%
TOTAL												1.614.258.53			37.283%

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din alt stat membru

1. Obligatiuni cotate corporative

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data sadentei cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
Banca Comerciala Romana	XS0496326223	-	1	-	12-Apr-10	7-Apr-11	6-Apr-12	250.000.00	52.60	4470.63	0.00	-	254.470.63	0.0673%	5.878%
TOTAL													254.470.63		5.878%

2. Obligatiuni cotate corporative denumite in valuta

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data sadentei cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret piata	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
AGROKOR d.d.	XS0471612076	-	50	-	1-Jun-11	7-Dec-10	6-Jun-11	1.061.25	0.24	6.56	-0.9110	-	4.2341	225.867.30	0.0125%	5.217%
MOL Hungarian Oil and Gas Public Limited	XS0503453275	-	50	-	17-Jun-11	20-Apr-11	19-Apr-12	990.00	0.17	11.56	0.0656	-	4.2341	212.048.59	0.0067%	4.898%
OTP BANK RT	XS0214084252	-	1	-	14-Jun-11	6-Jun-11	4-Sep-11	41.187.50	9.24	68.92	170.2373	-	4.2341	175.150.38	0.0002%	1.045%
TOTAL														613.966.47		14.160%

1. Obligatiuni emise de administratia publica locala denumite in valuta

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data decontarii	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount/ prima cumulata(a)	Pret Piata	Curs valutar BNR EUR/IRON	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
CITY OF BUCHAREST	XS0222425471	-	1	-	1-Jun-11	22-Jun-10	21-Jun-11	46.875.00	7.76	50.72	63.2591	-	4.2341	198.956.02	0.0100%	4.595%
TOTAL														198.956.02		4.595%

III. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar în lei

Denumire banca	Valoare curenta	Pondere în activul total al OPC
	lei	%
Alpha Bank	380.68	0.009%
Banca Romaneasca	920.95	0.021%
Banca Comerciala Romana	8,409.63	0.194%
BRD Groupe Societe Generale	268.20	0.006%
Banca Transilvania	126.60	0.003%
CEC Bank SA	311.41	0.007%
Cib Bank	0.00	0.000%
OTP BANK ROMANIA	5,000.00	0.115%
OTP BANK ROMANIA	18,385.25	0.425%
OTP BANK ROMANIA	15,441.00	0.357%
PIRAEUS BANK	414.88	0.010%
Procredit Bank	297.93	0.007%
TOTAL	49,956.53	1.154%

2. Disponibil în conturi curente și numerar denuminate în valuta

Denumire banca	Valoare curenta	Curs valutar BNR EUR/ RON	Valoare actualizata	Pondere în activul total al OPC
	eur		lei	%
Banca Comerciala Romana	5,018.61	4.2341	21,249.30	0.491%
TOTAL			21,249.30	0.491%

IV. Depozite bancare

1. Depozite bancare denuminate în lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala	Dobanda zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei	lei	%
OTP BANK ROMANIA	30-Jun-11	1-Jul-11	599,589.43	50.92	50.92	599,640.35	13.850%
TOTAL						599,640.35	13.850%

VI. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denuminate în lei

Denumire fond	Data ultimei sedinte în care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond detinute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret plata	Valoare totala	Pondere în total titluri de participare ale OPCVM/AOPC	Pondere în activul total al OPC
			lei	lei	lei	%	%
CERTINVEST MONETAR	-	1,053,486.93	69.8900	-	73,628.18	1.1029%	1.701%
CERTINVEST OBLIGATIUNI	-	5,145,011.282	22.2800	-	114,630.85	0.8926%	2.648%
TOTAL					188,239.04		4.349%

VII. Instrumente financiare derivate negociate în afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR EUR/ RON	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totala	Pondere în activul total al OPC
					lei	lei	lei	lei	lei	%
OTP BANK ROMANIA	100,000	V	27-May-11	31-Aug-11	4.1541	4.2160	4.2445	-0.1050	-10,500.00	-0.243%
OTP BANK ROMANIA	100,000	V	14-Jun-11	18-Jul-11	4.1764	4.2160	4.2252	-0.0642	-6,920.00	-0.148%
TOTAL									-16,920.00	-0.391%

VI. Instrumente ale pietei monetare, altele decât cele tranzactionate pe o piata reglementata, conf. art. 101(1), lit.g din legea nr 297/2004

Serie emisiunii	Tipul de intrument	Nr. titluri detinute	Data achizitiei	Data scadența	Valoare inițială	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare totala	Banca intermediara	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al OPC
					lei	lei	lei	lei		%	%
ROT116DBN024	Reverse Repo	52	28-Jun-11	28-Jul-11	498129.67	98.24	294.73	498,424.40	PIRAEUS BANK	0.0000%	11.512%
Total								498,424.40			11.512%

Evolutia activului net si a VUAN în ultimii 3 ani

	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	9,101,096.35	7,950,805.28	4,320,905.41
VUAN	9.88	8.52	11.13

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu