

## Raport trimestrial aferent trimestrului I 2012

### al administratorului OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA pentru Fondul Inchis de Investitii cu Capital Garantat OTP Green Energy

#### A.

**Raportul trimestrial conform :** anexei nr. 30 a Regulamentului Comisiei Nationale a Valorilor Mobiliare nr. 1/2006 privind emitentii si operatiunile cu valori mobiliare

**Data raportului :** 31.03.2012

**Administrator:** OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

**Sediul social :** Bucuresti, Bd. Dacia nr. 83, sector 2

**Numarul de telefon/fax :** 031 308 55 50 / 031 308 55 65

**Codul unic de inregistrare:** 22264941

**Numar de ordine in Registrul**

**Comertului :** J40/15502/2007

**Capitalul social subscris si**

**varsat :** 5.795.323 RON

**Denumirea entitatii tranzactionate :** Fondul Inchis de Investitii cu Capital Garantat **OTP Green Energy**

**Aviz CNVM nr:** 56/27.10.2009

**Numar de inregistrare in Registrul CNVM :** CSC08FIIR/400016/2009

**COD ISIN:** ROFIIN0000C2

**Piata reglementata pe care se tranzactioneaza**

**valorile mobiliare emise :** sectiune BVB piata principala REGS

simbol entitate tranzactionata : GRE

1. Prezentarea evenimentelor importante care s-au produs in perioada de timp relevanta si impactul pe care acestea il au asupra pozitiei financiare a emitentului si a filialelor acestuia. – nu este cazul.

2. Descrierea generala a pozitiei financiare si a performantelor emitentului si ale filialelor acestuia aferente perioadelor de timp relevante.

In conformitate cu situatia activelor si obligatiilor certificata de Depozitar, in data de 31.03.2012, erau inregistrati un numar de 586 investitori din care 575 persoane fizice si 11 persoane juridice. Valoarea unitara a activului net la 31.03.2012 este de 214,03 Ron.

### SITUATIA ACTIVELOR SI OBLIGATIILOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT OTP Green Energy

Denumire element	31.12.2011				31.03.2012				
	% din activul	% din activul	Valuta (RON)	Lei	% din activul	% din activul	Valuta (RON)	Lei	
<b>Total active</b>	<b>100.44%</b>	<b>100.00%</b>	<b>9,286,999.93</b>	<b>9,286,999.93</b>	<b>100.44%</b>	<b>100.00%</b>	<b>9,369,070.33</b>	<b>9,369,070.33</b>	<b>82,070.40</b>
<b>1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:</b>	<b>69.96%</b>	<b>69.66%</b>	<b>6,469,116.94</b>	<b>6,469,116.94</b>	<b>32.21%</b>	<b>32.07%</b>	<b>3,004,756.80</b>	<b>3,004,756.80</b>	<b>-3,464,360.14</b>
11 Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	34.42%	34.27%	3,182,843.38	3,182,843.38	32.21%	32.07%	3,004,756.80	3,004,756.80	-178,086.58
113 Obligatiuni, din care:	34.42%	34.27%	3,182,843.38	3,182,843.38	32.21%	32.07%	3,004,756.80	3,004,756.80	-178,086.58
1132 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	34.42%	34.27%	3,182,843.38	3,182,843.38	32.21%	32.07%	3,004,756.80	3,004,756.80	-178,086.58
12 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	35.54%	35.39%	3,286,273.56	3,286,273.56	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-3,286,273.56
123 Obligatiuni	35.54%	35.39%	3,286,273.56	3,286,273.56	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-3,286,273.56
1231 Obligatiuni tranzactionate corporative	35.54%	35.39%	3,286,273.56	3,286,273.56	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-3,286,273.56
<b>2 Disponibil in cont curent</b>	<b>0.02%</b>	<b>0.02%</b>	<b>2,277.62</b>	<b>2,277.62</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>943.71</b>	<b>943.71</b>	<b>-1,333.91</b>
204 BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.02%	0.02%	2,237.53	2,237.53	0.01%	0.01%	524.10	524.10	-1,713.43
208 PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	40.09	40.09	0.00%	0.00%	8.08	8.08	-32.01
221 UNICREDIT TIRIAC BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	411.53	411.53	411.53
<b>3 Depozite bancare:</b>	<b>28.91%</b>	<b>28.78%</b>	<b>2,672,653.13</b>	<b>2,672,653.13</b>	<b>67.29%</b>	<b>67.00%</b>	<b>6,277,075.48</b>	<b>6,277,075.48</b>	<b>3,604,422.35</b>
31 Depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	28.91%	28.78%	2,672,653.13	2,672,653.13	67.29%	67.00%	6,277,075.48	6,277,075.48	3,604,422.35
311 OTP BANK ROMANIA	28.91%	28.78%	2,672,653.13	2,672,653.13	31.35%	31.22%	2,924,565.45	2,924,565.45	251,912.32
318 Banca Italo-Romena	0.00%	0.00%	0.00	0.00	8.08%	8.04%	753,451.18	753,451.18	753,451.18
320 Unicredit Tiriac BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	27.86%	27.74%	2,599,058.85	2,599,058.85	2,599,058.85
<b>4 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata, din care:</b>	<b>1.55%</b>	<b>1.54%</b>	<b>142,952.24</b>	<b>142,952.24</b>	<b>0.93%</b>	<b>0.92%</b>	<b>86,294.34</b>	<b>86,294.34</b>	<b>-56,657.90</b>
41 instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania, din care:	1.55%	1.54%	142,952.24	142,952.24	0.93%	0.92%	86,294.34	86,294.34	-56,657.90
412 Optiuni	1.55%	1.54%	142,952.24	142,952.24	0.93%	0.92%	86,294.34	86,294.34	-56,657.90
<b>9 Alte active, din care:</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.01</b>	<b>0.01</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>-0.01</b>
93 Sume in curs de rezolvare	0.00%	0.00%	0.01	0.01	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-0.01
<b>Total active</b>			<b>9,286,999.93</b>	<b>9,286,999.93</b>			<b>9,369,070.33</b>	<b>9,369,070.33</b>	<b>82,070.40</b>

<b>II Total obligatii</b>				40,697.27	40,697.27			40,945.69	40,945.69	248.42
10	CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligatii)	0.44%	0.44%	40,697.27	40,697.27	0.44%	0.44%	40,945.69	40,945.69	248.42
101	Comisioane datorate soc. de admin.	0.19%	0.19%	17,250.70	17,250.70	0.19%	0.19%	17,413.68	17,413.68	162.98
1011	Comision de garantie bancara	0.15%	0.15%	13,740.08	13,740.08	0.15%	0.15%	13,868.49	13,868.49	128.40
102	Comisioane datorate depozitarului	0.06%	0.06%	5,765.39	5,765.39	0.06%	0.06%	5,819.92	5,819.92	54.53
103	Taxa CNVM	0.01%	0.01%	770.39	770.39	0.01%	0.01%	777.22	777.22	6.83
106	Cheltuieli de audit	0.02%	0.02%	2,159.85	2,159.85	0.02%	0.02%	2,189.55	2,189.55	29.70
107	Comision custode	0.01%	0.01%	1,010.85	1,010.85	0.01%	0.01%	876.83	876.83	-134.02
<b>III Valoarea activului net (I - II)</b>				9,246,302.67	9,246,302.67			9,328,124.65	9,328,124.65	81,821.98

#### Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	La data de 31.12.2011	La data de 31.03.2012	Diferente
Valoare activ net	9,246,302.67	9,328,124.65	81,821.98
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	43,583.00	43,583.00	0.00
Valoarea unitara a activului net	212.15	214.03	1.88

Situatiile financiare intocmite pentru trimestrul I 2012 nu au fost auditate.

### 3. Semnaturi

#### OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat - Catalin Jianu Dan Iancu \_\_\_\_\_

Membru Directorat – Dan Marius Popovici \_\_\_\_\_

Director Control Intern – Mirela Liliana Chiritescu \_\_\_\_\_

### B. Indicatori economico-financiari

Denumire Indicator	Mod Calcul	Rezultat
1.Indicatorul lichiditatii curente	Active curente/Datorii curente	228,82
2.Indicatorul gradului de indatorare	Capital imprumutat/Capital propriu x 100	-
	Capital imprumutat/Capital angajat x 100	-
3.Viteza de rotatie a debitelor - clientii	Sold mediu clienti/Cifra de afaceri x 90	-
4.Viteza de rotatie a activelor imobilizate	Venituri din activitatea curenta/Active imobilizate	-