

**Raport trimestrial aferent trimestrului III 2011**  
**al administratorului OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA**  
**pentru Fondul Inchis de Investitii cu Capital Garantat OTP WiseRO**

**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 :** 30.09.2011

**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 WiseRO**

**Aviz CNVM nr:** 11/11.06.2009

**Numar de inregistrare in Registrul**

**CNVM :** CSC08FIIR/400015/2009

**COD ISIN:** ROFIIN0000B4

**Piata reglementata pe care se tranzactioneaza**

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

simbol entitate tranzactionata : WRO

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 30.09.2011, erau inregistrati un numar de 665 investitori din care 652 persoane fizice si 13 persoane juridice. Valoarea unitara a activului net la 30.09.2011 este de 191,26 Ron.

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

Denumire element	31.12.2010			30.09.2011			Diferente
	% din activul net	% din activul total	Lei	% din activul net	% din activul total	Lei	Lei
<b>I Total active</b>	<b>101.83%</b>	<b>100.00%</b>	<b>8,632,906.19</b>	<b>100.71%</b>	<b>100.00%</b>	<b>8,617,102.69</b>	<b>-15,803.50</b>
<b>2 Disponibil in cont curent</b>	<b>0.05%</b>	<b>0.05%</b>	<b>4,450.67</b>	<b>0.84%</b>	<b>0.83%</b>	<b>71,732.79</b>	<b>67,282.12</b>
<b>ALPHA BANK ROMANIA</b>	<b>0.02%</b>	<b>0.02%</b>	<b>1,937.82</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>289.28</b>	<b>-1,648.54</b>
<b>BANCA COMERCIALA ROMANA</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>384.91</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>579.41</b>	<b>194.50</b>
<b>BANCA ROMANEASCA</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>500.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>50.75</b>	<b>-449.25</b>
<b>BRD-GROUP SOCIETE GENERAL</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>97.54</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>28.48</b>	<b>-69.06</b>
<b>CEC BANK</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>498.89</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>499.43</b>	<b>0.54</b>
<b>OTP BANK BUDAPESTA</b>	<b>0.01%</b>	<b>0.01%</b>	<b>663.97</b>	<b>0.82%</b>	<b>0.81%</b>	<b>69,906.67</b>	<b>69,242.70</b>
<b>OTP BANK ROMANIA</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>135.52</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>-135.52</b>
<b>PIRAEUS BANK ROMANIA</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>48.25</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>100.00</b>	<b>51.75</b>
<b>Procredit Bank</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>183.77</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>183.77</b>	<b>0.00</b>
<b>Credit Europr Bank SA</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>95.00</b>	<b>95.00</b>
<b>3 Depozite bancare:</b>	<b>107.19%</b>	<b>105.27%</b>	<b>9,087,527.70</b>	<b>103.42%</b>	<b>102.70%</b>	<b>8,849,595.14</b>	<b>-237,932.56</b>
<i>Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania</i>	<b>85.95%</b>	<b>84.41%</b>	<b>7,287,155.78</b>	<b>82.14%</b>	<b>81.56%</b>	<b>7,028,241.06</b>	<b>-258,914.72</b>
<b>OTP BANK ROMANIA</b>	<b>21.61%</b>	<b>21.23%</b>	<b>1,832,477.02</b>	<b>21.00%</b>	<b>20.85%</b>	<b>1,796,643.40</b>	<b>-35,833.63</b>
<b>ALPHA BANK ROMANIA</b>	<b>21.73%</b>	<b>21.34%</b>	<b>1,841,929.95</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>-1,841,929.95</b>
<b>BANCA ROMANEASCA</b>	<b>21.25%</b>	<b>20.87%</b>	<b>1,801,521.85</b>	<b>19.14%</b>	<b>19.01%</b>	<b>1,637,988.23</b>	<b>-163,533.61</b>
<b>PIRAEUS BANK ROMANIA</b>	<b>21.36%</b>	<b>20.98%</b>	<b>1,811,226.96</b>	<b>21.08%</b>	<b>20.94%</b>	<b>1,804,156.51</b>	<b>-7,070.45</b>
<b>Credit Europe Bank SA</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>20.91%</b>	<b>20.77%</b>	<b>1,789,452.92</b>	<b>1,789,452.92</b>
<i>depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru</i>	<b>21.24%</b>	<b>20.85%</b>	<b>1,800,371.93</b>	<b>21.29%</b>	<b>21.14%</b>	<b>1,821,354.08</b>	<b>20,982.16</b>
<b>OTP BANK BUDAPESTA</b>	<b>21.24%</b>	<b>20.85%</b>	<b>1,800,371.93</b>	<b>21.29%</b>	<b>21.14%</b>	<b>1,821,354.08</b>	<b>20,982.16</b>

<b>Instrumente financiare derivate</b>							
<b>5 tranzactionate in afara pietelor reglementate</b>	<b>-5.41%</b>	<b>-5.32%</b>	<b>-459,022.14</b>	<b>-3.56%</b>	<b>-3.53%</b>	<b>-304,225.20</b>	<b>154,796.94</b>
<b>Contracte swap</b>	<b>-5.41%</b>	<b>-5.32%</b>	<b>-459,022.14</b>	<b>-3.56%</b>	<b>-3.53%</b>	<b>-304,225.20</b>	<b>154,796.94</b>
<b>9 Alte active, din care:</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>-50.04</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>-0.04</b>	<b>50.00</b>
<b>Sume in curs de rezolvare</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>-50.04</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>-0.04</b>	<b>50.00</b>
<b>II Total obligatii</b>			<b>155,002.96</b>			<b>60,505.71</b>	<b>-94,497.22</b>
<b>CHELTUIELILE FONDULUI (sold oblig)</b>	<b>1.83%</b>	<b>1.80%</b>	<b>155,002.96</b>	<b>0.71%</b>	<b>0.70%</b>	<b>60,505.71</b>	<b>-94,497.23</b>
<b>Comisioane datorate soc. de admin.</b>	<b>0.28%</b>	<b>0.27%</b>	<b>23,352.29</b>	<b>0.37%</b>	<b>0.37%</b>	<b>31,657.28</b>	<b>8,304.99</b>
<b>Comision de garantie bancara</b>	<b>1.42%</b>	<b>1.39%</b>	<b>120,310.58</b>	<b>0.20%</b>	<b>0.20%</b>	<b>16,904.35</b>	<b>-103,406.21</b>
<b>Comisioane datorate depozitarului</b>	<b>0.09%</b>	<b>0.09%</b>	<b>7,912.25</b>	<b>0.09%</b>	<b>0.09%</b>	<b>7,919.71</b>	<b>7.46</b>
<b>Taxa CNVM</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00</b>	<b>0.02%</b>	<b>0.02%</b>	<b>1,419.53</b>	<b>1,419.53</b>
<b>Cheltuieli de audit</b>	<b>0.04%</b>	<b>0.04%</b>	<b>3,427.84</b>	<b>0.03%</b>	<b>0.03%</b>	<b>2,604.85</b>	<b>-822.99</b>
<b>III Valoarea activului net (I - II)</b>			<b>8,477,903.24</b>			<b>8,556,596.98</b>	<b>78,693.72</b>

#### Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	31.12.2010	30.09.2011	Diferente
<b>Valoare activ net</b>	<b>8,477,903.24</b>	<b>8,556,596.96</b>	<b>78,693.72</b>
<b>Numar unitati de fond/actiuni in circul</b>	<b>44,739.00</b>	<b>44,739.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Valoarea unitara a activului net</b>	<b>189.50</b>	<b>191.26</b>	<b>1.76</b>

Situatiile financiare intocmite pentru trimestrul III 2011 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	141,42
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	-