

SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA

Decizie autorizare: PJROSSAIR/400023 Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007
 CUI: 22264941 Inregistrare DNRC: J40/15502/15.08.2007
 Capital social: 5.795.323 RON Adresa: Blvd Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

FDI OTP Euro Bond

Decizie autorizare: 108320.08.2010
 Cod inscriere: CSC06FDIR/400069

Situatia activelor si obligatiilor

Denumire element	Inceputul perioadei de raportare 31.12.2009				Sfarsitul perioadei de raportare 31.12.2010				Diferenta (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (EUR)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (EUR)	Lei	
I Total active			0.00	0.00	100.08	100.00	1,794,129.72	7,687,487.01	7,687,487.01
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	0.00	0.00	0.00	0.00	79.56	79.50	1,426,309.19	6,111,449.62	6,111,449.62
Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	0.00	0.00	0.00	0.00	73.85	73.80	1,324,004.08	5,673,092.67	5,673,092.67
Obligatuni	0.00	0.00	0.00	0.00	73.85	73.80	1,324,004.08	5,673,092.67	5,673,092.67
Obligatuni tranzactionate corporative	0.00	0.00	0.00	0.00	32.95	32.92	590,686.35	2,530,972.87	2,530,972.87
Obligatuni emise de administratia publica locala denuminate in valuta	0.00	0.00	0.00	0.00	5.41	5.41	97,044.41	415,815.87	415,815.87
Obligatuni de stat cotate	0.00	0.00	0.00	0.00	35.49	35.46	636,273.32	2,726,303.93	2,726,303.93
Alte val mob si instr ale pietei mon mentionate la art 102 (1) lit. a) din legea 297/2004, din care:	0.00	0.00	0.00	0.00	5.71	5.70	102,305.11	438,356.95	438,356.95
Valori mobiliare, din care:	0.00	0.00	0.00	0.00	5.71	5.70	102,305.11	438,356.95	438,356.95
Obligatuni emise de administratia publica centrala	0.00	0.00	0.00	0.00	5.71	5.70	102,305.11	438,356.95	438,356.95
2 Disponibil in cont curent	0.00	0.00	0.00	0.00	0.57	0.57	10,268.31	43,997.66	43,997.66
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	89.63	384.05	384.05
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.57	0.56	10,132.29	43,414.83	43,414.83
PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	46.39	198.78	198.78
3 Depozite bancare:	0.00	0.00	0.00	0.00	19.58	19.56	350,944.23	1,503,725.85	1,503,725.85
Depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	0.00	0.00	0.00	0.00	19.58	19.56	350,944.23	1,503,725.85	1,503,725.85
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.00	0.00	0.00	18.86	18.84	338,083.01	1,448,618.07	1,448,618.07
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.72	0.72	12,861.23	55,107.78	55,107.78
6 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranz pe o piata reglementata cf art. 101 (1) lit g:	0.00	0.00	0.00	0.00	0.37	0.37	6,607.98	28,313.89	28,313.89
Titluri de stat emise de administratia publica centrala	0.00	0.00	0.00	0.00	0.37	0.37	6,607.98	28,313.89	28,313.89
II Total obligatii			0.00	0.00			1,411.72	6,048.94	6,048.94
CHELTUIELILE FONDULUI (solid obligati)	0.00	0.00	0.00	0.00	0.08	0.08	1,411.72	1,411.72	1,411.72
Comisioane datorate soc. de admin.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.06	0.06	1,026.46	1,026.46	1,026.46
Comisioane datorate depozitarului	0.00	0.00	0.00	0.00	0.01	0.01	203.43	203.43	203.43
Cheltuieli de audit	0.00	0.00	0.00	0.00	0.01	0.01	100.00	100.00	100.00
Comision custode	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	81.83	81.83	81.83
III Valoarea activului net (I - II)			0.00	0.00			1,792,718.00	7,681,438.07	7,681,438.07

Denumire element	EUR		
	La data de 31.12.2009	La data de 31.12.2010	Diferenta
Valoare activ net	0.00	1,792,718.00	1,792,718.00
Numar unitati de fond in circulatie	0.00	178,374,4990	178,374,4990
Valoarea unitara a activului net	0.00	10.0503	10.0503

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
 Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR "FDI OTP EURO BOND" LA DATA DE 31.12.2010

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

1. Obligatiuni cotate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Discount cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
OTP Bank Nyrt *	XS0268320800	100	21-Oct-10	18-Sep-11	915.00	0.18	15.02	2.83	93.284.92	0.0199%	5.199%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY *	XS0503453275	100	17-Nov-10	19-Apr-11	969.60	0.17	41.21	0.58	101.138.86	0.0133%	5.637%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY *	XS0503453275	100	17-Dec-10	19-Apr-11	925.00	0.19	41.21	0.49	96.669.12	0.0133%	5.388%
ZAGREBACKI HOLDING DOO *	XS0309688918	2	15-Nov-10	9-Jul-11	43.250.00	10.31	1.318.49	130.61	89.398.20	0.0333%	4.983%
PKOBP *	XS0545031642	100	30-Nov-10	20-Oct-11	960.51	0.12	7.36	0.71	96.858.13	0.0125%	5.399%
TOTAL									477.349.24		26.606%

* Obligatiuni admise la tranzactionare pe o piata reglementata, dar care nu au fost tranzactionate in ultimele 90 de zile, sunt evaluate cf. art. 99 din Reg 15/2004 prin metoda bazata pe recunoasterea zilnica a dobanzii calculata in functie de pretul net

Emitent	Simbol obligatiune	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Prima cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
GAZPROM *	XS0327237136	100	24-Nov-10	12-Feb-11	1.076.20	0.15	58.27	1.10	113.337.11	0.0055%	6.317%
TOTAL									113.337.11		6.317%

* Obligatiuni admise la tranzactionare pe o piata reglementata, dar care nu au fost tranzactionate in ultimele 90 de zile, sunt evaluate cf. art. 99 din Reg 15/2004 prin metoda bazata pe recunoasterea zilnica a dobanzii calculata in functie de pretul net

2. Obligatiuni emise de administratia publica locala

Emitent	Cod ISIN	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Discount cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
CITY OF BUCHAREST	XS0222425471	2	11/26/2010	6/21/2011	47.375.00	7.22	1.090.58	56.62	97.044.41	0.0200	5.409%
TOTAL									97.044.41		5.409%

* Obligatiuni admise la tranzactionare pe o piata reglementata, dar care nu au fost tranzactionate in ultimele 90 de zile, sunt evaluate cf. art. 99 din Reg 15/2004 prin metoda bazata pe recunoasterea zilnica a dobanzii calculata in functie de pretul net

3. Obligatiuni emise de catre administratia publica centrala

Emitent	Cod ISIN	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Prima cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
ROMANIA	XS0371163600	100	28-Oct-10	17-Jun-11	1.064.00	0.16	35.08	1.49	109.759.12	0.0133%	6.118%
ROMANIA	XS0371163600	100	30-Nov-10	17-Jun-11	1.051.50	0.16	35.08	0.60	108.598.44	0.0133%	6.053%
ROMANIA	XS0371163600	100	14-Dec-10	17-Jun-11	1.041.25	0.16	35.08	0.27	107.606.15	0.0133%	5.988%
TOTAL									325.963.71		18.168%

* Obligatiuni admise la tranzactionare pe o piata reglementata, dar care nu au fost tranzactionate in ultimele 90 de zile, sunt evaluate cf. art. 99 din Reg 15/2004 prin metoda bazata pe recunoasterea zilnica a dobanzii calculata in functie de pretul net

Emitent	Cod ISIN	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Discount cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%
ROMANIA	XS0495980095	100	5-Nov-10	17-Mar-11	997.50	0.14	39.58	0.09	103.717.84	0.0133%	5.781%
ROMANIA	XS0495980095	100	2-Dec-10	17-Mar-11	991.50	0.14	39.58	0.16	103.125.18	0.0133%	5.748%
ROMANIA	XS0495980095	100	8-Dec-10	17-Mar-11	995.00	0.14	39.58	0.08	103.466.59	0.0133%	5.767%
TOTAL									310.309.61		17.296%

* Obligatiuni admise la tranzactionare pe o piata reglementata, dar care nu au fost tranzactionate in ultimele 90 de zile, sunt evaluate cf. art. 99 din Reg 15/2004 prin metoda bazata pe recunoasterea zilnica a dobanzii calculata in functie de pretul net

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR "FDI OTP EURO BOND" LA DATA DE 31.12.2010

II. Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare, mentionate la art. 102 lit. a din Legea 297/2004, din care

1. Obligatiuni emise de administratia publica centrala

Serie	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Prima cumulată	Valoare actualizată	Banca intermediara	Pondere in total titluri emise de stat	Pondere in activul total al fondului
				EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	%	%	
RO0912DBE034	1	6-Oct-10	10-Nov-11	101.756.69	12.09	747.95	199.52	102.305.11	BCR	0.0000%	5.702%
TOTAL								102.305.11			5.702%

III. Depozite bancare

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere in activul total al fondului
			EUR	EUR	EUR	EUR	%
OTP BANK ROMANIA	30-Nov-10	4-Jan-11	10,000.00	0.89	28.49	10,028.49	0.559%
OTP BANK ROMANIA	30-Nov-10	6-Jan-11	10,000.00	0.89	28.49	10,028.49	0.559%
OTP BANK ROMANIA	30-Nov-10	6-Jan-11	10,000.00	0.89	28.49	10,028.49	0.559%
OTP BANK ROMANIA	30-Nov-10	11-Jan-11	10,000.00	0.92	29.37	10,029.37	0.559%
OTP BANK ROMANIA	30-Nov-10	11-Jan-11	10,000.00	0.92	29.37	10,029.37	0.559%
OTP BANK ROMANIA	30-Nov-10	4-Jan-11	10,000.00	0.89	28.49	10,028.49	0.559%
OTP BANK ROMANIA	6-Dec-10	13-Jan-11	20,000.00	1.78	46.30	20,046.30	1.117%
OTP BANK ROMANIA	15-Dec-10	18-Jan-11	10,000.00	0.96	16.30	10,016.30	0.558%
OTP BANK ROMANIA	15-Dec-10	18-Jan-11	7,000.00	0.67	11.41	7,011.41	0.391%
OTP BANK ROMANIA	15-Dec-10	18-Jan-11	7,000.00	0.67	11.41	7,011.41	0.391%
OTP BANK ROMANIA	17-Dec-10	20-Jan-11	10,000.00	0.96	14.38	10,014.38	0.558%
OTP BANK ROMANIA	17-Dec-10	20-Jan-11	10,000.00	0.96	14.38	10,014.38	0.558%
OTP BANK ROMANIA	20-Dec-10	25-Jan-11	10,000.00	0.92	11.01	10,011.01	0.558%
OTP BANK ROMANIA	20-Dec-10	25-Jan-11	10,000.00	0.92	11.01	10,011.01	0.558%
OTP BANK ROMANIA	22-Dec-10	27-Jan-11	10,000.00	0.92	9.18	10,009.18	0.558%
OTP BANK ROMANIA	22-Dec-10	27-Jan-11	10,000.00	0.92	9.18	10,009.18	0.558%
OTP BANK ROMANIA	27-Dec-10	1-Feb-11	10,000.00	0.92	4.59	10,004.59	0.558%
OTP BANK ROMANIA	27-Dec-10	1-Feb-11	10,000.00	0.92	4.59	10,004.59	0.558%
OTP BANK ROMANIA	27-Dec-10	3-Jan-11	70,000.00	1.92	9.59	70,009.59	3.902%
OTP BANK ROMANIA	29-Dec-10	3-Feb-11	10,000.00	0.92	2.75	10,002.75	0.558%
OTP BANK ROMANIA	30-Dec-10	3-Feb-11	10,000.00	0.92	1.84	10,001.84	0.557%
OTP BANK ROMANIA	30-Dec-10	3-Feb-11	10,000.00	0.92	1.84	10,001.84	0.557%
OTP BANK ROMANIA	31-Dec-10	3-Jan-11	53,730.16	0.37	0.37	53,730.53	2.995%
BANCA COMERCIALA ROMANA	31-Dec-10	1-Jan-11	12,861.19	0.04	0.04	12,861.23	0.717%
TOTAL						350,944.23	19.561%

IV. Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conf. art. 101 (1) lit. g din Legea 297/2004 :

1. Titluri emise de administratia publica centrala

Serie	Numar obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadentei cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobanda cumulată	Curs EUR/RON valutar	Valoare actualizată	Banca intermediara	Pondere in total titluri emise de stat	Pondere in activul total al fondului
				RON	RON	RON	EUR	%	%		
RO1011CTN104	1	2-Dec-10	23-Nov-11	9,343.09	1.85	55.36	4.28	2,193.44	BRD -GSG	0.0000%	0.122%
RO0111CTN120	1	2-Dec-10	9-Nov-11	9,373.96	1.83	54.92	4.28	2,200.54	BRD -GSG	0.0000%	0.123%
RO1011CTN0X3	1	2-Dec-10	12-Oct-11	9,432.33	1.81	54.24	4.28	2,214.00	BRD -GSG	0.0000%	0.123%
TOTAL								6,607.98			0.368%

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	EUR		
	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	-	-	1,792,718.00
VUAN	-	-	10,0503

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu