

ANEXA NR. 10

SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA
Decizie autorizare: P_JROUSSAR/400023
CUI: 22264941
Capital social: 5.795.323 RON

OTP ComodiRO
Decizie autorizare: 37/27.02.2008
Cod inscriere: CSCOFRD/R400049

Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2010 - 31.12.2011

Denumire element	31.12.2010				31.12.2011				Diferente
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
I Total active	100.31%	100.00%	122.644.409.67	122.644.409.68	100.21%	100.00%	132.557.606.90	132.557.606.90	9.913.197.23
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	23.08%	23.01%	28.220.439.09	28.220.439.09	37.38%	37.30%	41.076.570.65	41.076.570.65	12.856.131.56
11 Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	0.06%	0.06%	74.271.49	74.271.49	10.92%	10.90%	6.081.837.39	6.081.837.39	6.007.565.91
113 Obligatiuni, din care:	0.06%	0.06%	74.271.49	74.271.49	10.92%	10.90%	6.081.837.39	6.081.837.39	6.007.565.91
1132 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.00%	0.00%	0.00	0.00	10.87%	10.84%	6.009.875.80	6.009.875.80	6.009.875.80
1133 Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	0.06%	0.06%	74.271.49	74.271.49	0.05%	0.05%	71.961.59	71.961.59	-2.309.89
12 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	23.02%	22.95%	28.146.167.60	28.146.167.60	26.45%	26.40%	34.994.733.26	34.994.733.26	6.848.565.66
123 Obligatiuni	23.02%	22.95%	28.146.167.60	28.146.167.60	26.45%	26.40%	34.994.733.26	34.994.733.26	6.848.565.66
1231 Obligatiuni tranzactionate corporative	19.83%	19.77%	24.245.470.44	24.245.470.44	24.06%	24.01%	31.822.583.94	31.822.583.94	7.577.113.50
1232 Obligatiuni emise de administratia publica locala denumite in valuta	1.66%	1.65%	2.029.524.38	2.029.524.38	1.43%	1.42%	1.886.425.02	1.886.425.02	-143.099.36
1233 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	1.53%	1.53%	1.871.172.79	1.871.172.79	0.97%	0.97%	1.285.724.30	1.285.724.30	-585.448.49
2 Disponibil in cont curent	0.76%	0.76%	934.455.36	934.455.36	1.11%	1.10%	1.463.996.15	1.463.996.15	529.540.79
201 ALPHA BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	28.48	28.48	0.00%	0.00%	479.73	479.73	451.25
203 BANCA ROMANEASCA	0.00%	0.00%	100.00	100.00	0.00%	0.00%	2.492.29	2.492.29	2.392.29
204 BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.00%	0.00%	391.77	391.77	0.00%	0.00%	119.57	119.57	-272.20
205 CEC BANK	0.00%	0.00%	738.25	738.25	0.00%	0.00%	729.32	729.32	-8.93
207 OTP BANK ROMANIA	0.76%	0.75%	925.273.50	925.273.50	1.07%	1.07%	1.416.135.13	1.416.135.13	490.861.63
208 PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	50.00	50.00	0.02%	0.02%	29.826.11	29.826.11	29.776.11
209 Banca Transilvania	0.00%	0.00%	1.348.34	1.348.34	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-1.348.34
210 Procredit Bank	0.00%	0.00%	63.39	63.39	0.00%	0.00%	63.39	63.39	0.00
211 MKB Romedema BANK	0.00%	0.00%	396.58	396.58	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-396.58
212 Banc Post SA	0.00%	0.00%	297.14	297.14	0.00%	0.00%	1.916.21	1.916.21	1.619.07
213 Banca Italo-Romana	0.00%	0.00%	0.74	0.74	0.00%	0.00%	139.01	139.01	138.27
214 Banca Comerciala Romana - EURO	0.00%	0.00%	5.765.03	5.765.03	0.01%	0.01%	9.158.15	9.158.15	3.393.13
216 PIRAEUS BANK - EURO	0.00%	0.00%	2.14	2.14	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-2.14
218 Banca Carpatica	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	2.780.94	2.780.94	2.780.94
219 Credit Europ Bank SA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	100.00	100.00	100.00
221 UNICREDIT TIRIAC BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	56.30	56.30	56.30
3 Depozite bancare:	72.67%	72.44%	88.848.528.61	88.848.528.61	62.55%	62.42%	82.736.794.03	82.736.794.03	-6.111.734.57
31 Depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	72.67%	72.44%	88.848.528.61	88.848.528.61	62.55%	62.42%	82.736.794.03	82.736.794.03	-6.111.734.57
311 OTP BANK ROMANIA	2.87%	2.86%	3.503.964.62	3.503.964.62	0.95%	0.95%	1.253.340.37	1.253.340.37	-2.250.624.24
312 ALPHA BANK ROMANIA	18.75%	18.69%	22.924.225.56	22.924.225.56	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-22.924.225.56
3125 Credit Europe Bank SA	0.00%	0.00%	0.00	0.00	15.75%	15.72%	20.840.593.47	20.840.593.47	20.840.593.47
3126 Garanti Bank	0.00%	0.00%	0.00	0.00	17.10%	17.07%	22.626.534.74	22.626.534.74	22.626.534.74
313 BANCA ROMANEASCA	16.89%	16.84%	20.653.509.72	20.653.509.72	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-20.653.509.72
314 BANCA COMERCIALA ROMANA	0.04%	0.04%	45.911.86	45.911.86	0.05%	0.05%	63.193.08	63.193.08	17.281.23
315 PIRAEUS BANK ROMANIA	18.82%	18.76%	23.012.120.79	23.012.120.79	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-23.012.120.79
318 Banca Italo-Romana	15.30%	15.25%	18.708.796.07	18.708.796.07	11.11%	11.09%	14.701.268.41	14.701.268.41	-4.007.527.66
320 Unicredit Tiriac BANK	0.00%	0.00%	0.00	0.00	17.58%	17.54%	23.251.863.96	23.251.863.96	23.251.863.96
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate in afara pietelor reglementate	0.00%	0.00%	2.050.00	2.050.00	-0.03%	-0.03%	-34.085.00	-34.085.00	-36.135.00
51 Contracte Forward	0.00%	0.00%	2.050.00	2.050.00	-0.03%	-0.03%	-34.085.00	-34.085.00	-36.135.00
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	-6.09%	-6.07%	314.959.12	314.959.12	314.959.12
63 Titluri de stat emise de administratia publica centrala	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.02%	0.02%	29.518.36	29.518.36	29.518.36
64 Contracte reverse-repo <1an	0.00%	0.00%	0.00	0.00	-6.11%	-6.10%	285.440.76	285.440.76	285.440.76
7 Titluri de participare la OPCVM/AOPC	3.79%	3.78%	4.638.937.61	4.638.937.61	5.29%	5.28%	6.999.372.82	6.999.372.82	2.360.435.21
9 Alte active, din care:	0.00%	0.00%	-1.00	-1.00	0.00%	0.00%	-0.87	-0.87	0.13
93 Suma in curs de rezolvare	0.00%	0.00%	-1.00	-1.00	0.00%	0.00%	-0.87	-0.87	0.13
II Total obligatii			381.346.72	381.346.72			276.922.91	276.922.91	-104.423.82
10 CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligatii)	0.31%	0.31%	381.346.72	381.346.72	0.21%	0.21%	276.922.91	276.922.91	-104.423.82
101 Comisioane datorate soc. de admin.	0.15%	0.15%	181.422.57	181.422.57	0.10%	0.10%	138.422.39	138.422.39	-43.000.18
102 Comisioane datorate depozitarului	0.01%	0.01%	14.984.21	14.984.21	0.01%	0.01%	17.134.94	17.134.94	2.150.73
103 Taxa CNVM	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.01%	0.01%	11.021.75	11.021.75	11.021.75
106 Cheltuieli de audit	0.00%	0.00%	3.427.84	3.427.84	0.00%	0.00%	2.343.26	2.343.26	-1.084.58
107 Comision custodie	0.00%	0.00%	1.107.15	1.107.15	0.00%	0.00%	1.143.43	1.143.43	36.28
108 Rascomparari nepaliate	0.15%	0.15%	180.404.95	180.404.95	0.08%	0.08%	106.857.13	106.857.13	-73.547.82
III Valoarea activului net (I-II)			122.263.062.95	122.263.062.95			132.280.684.00	132.280.684.00	10.017.621.05

Situatia valorii unitare a activului net

Unitate element	La data de 31.12.2010	La data de 31.12.2011	Diferente
Valoarea activ net	122,263,062.95	132,280,684.00	10,017,621.05
Numar unitati de fondaciuni in circulatie	9,320,072.40	9,471,054.12	150,981.72
Valoarea unitara a activului net	13.12	13.97	0.85

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Director Control Intern

Catalin Jianu Dan Iancu

Mirela Liliana Chiritescu

FDI OTP ComodisRO – Situația detaliată a investițiilor la data de 31.12.2011

I. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din România
 5. Obligatuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al OPC
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%
PRIMĂRIA ORĂVIȚA	ORV27	-	741	-	13-May-08	14-Oct-11	16-Apr-12	95.50	0.02	1.61	-	-	71.961.53	1.2350%	0.054%
TOTAL															0.054%

6. Obligatuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale

Serie	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(a)	Pret piață	Valoarea totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al OPC
							lei	lei	lei	lei	lei	lei		%	%
RO1116DBN024	-	1	-	27-May-11	30-Apr-11	30-Apr-12	9.472.44	1.93	403.28	64.19	-	9.939.91	BRD Groupe Societate Generale	0.0000%	0.007%
RO1114DBN011	-	400	-	15-Jun-11	25-Oct-11	25-Oct-12	3.897.114.04	786.84	46.448.09	16.756.67	-	3.960.318.80	Bankpost	0.0057%	2.988%
RO1114DBN011	-	207	-	12-Sep-11	25-Oct-11	25-Oct-12	2.039.704.14	406.42	24.036.89	5.876.07	-	2.039.871.39	Bankpost	0.0030%	1.539%
TOTAL												6.099.875.99			4.534%

II. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată dintr-un stat membru

2. Obligatuni admise la tranzacționare

2.1. Obligatuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
City of Bucharest	XS0222425471	-	9	-	31-May-11	22-Jun-11	22-Jun-12	47.000.00	7.66	1.087.60	-	434.93	4.3197	1.886.425.02	0.0900%	1.423%
TOTAL														1.886.425.02		1.423%

2.2. Obligatuni cotate corporative denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
FIAT Finance & Trade	XS0468889912	-	500	-	27-Oct-10	13-Feb-11	13-Feb-12	1.072.50	0.14	60.65	-	-19.90	4.3197	2.404.448.30	0.0333%	1.814%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY	XS0503453275	-	278	-	24-Mar-11	20-Apr-11	20-Apr-12	993.40	0.16	41.09	0.71	-	4.3197	1.229.379.05	0.0387%	0.927%
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY	XS0503453275	-	260	-	1-Nov-11	20-Apr-11	20-Apr-12	936.25	0.19	41.09	1.56	-	4.3197	1.099.862.36	0.0347%	0.830%
OTP BANK NYRT	XS0268320800	-	290	-	24-Dec-10	19-Sep-11	19-Sep-12	866.00	0.21	14.97	23.85	-	4.3197	1.133.481.33	0.0577%	0.850%
OTP BANK NYRT	XS0268320800	-	280	-	24-Dec-10	19-Sep-11	19-Sep-12	870.00	0.21	14.97	23.13	-	4.3197	1.098.372.86	0.0567%	0.829%
OTP BANK NYRT	XS0268320800	-	290	-	24-May-11	19-Sep-11	19-Sep-12	930.00	0.18	14.97	7.99	-	4.3197	922.324.22	0.0388%	0.521%
OTP BANK NYRT	XS0268320800	-	260	-	18-Oct-11	19-Sep-11	19-Sep-12	790.00	0.26	14.97	9.18	-	4.3197	914.391.72	0.0517%	0.690%
OTP BANK NYRT	XS0268320800	-	250	-	19-Sep-11	19-Sep-11	19-Sep-12	780.00	0.27	14.97	8.76	-	4.3197	867.873.08	0.0488%	0.655%
OTP BANK NYRT	XS0268320800	-	640	-	23-Nov-11	19-Sep-11	19-Sep-12	760.00	0.28	14.97	5.31	-	4.3197	2.157.187.94	0.1274%	1.627%
OTP BANK RT	XS0214084262	-	12	-	13-Oct-10	5-Dec-11	5-Mar-12	39.760.00	9.20	75.71	2.845.45	-	4.3197	2.211.919.24	0.0204%	1.669%
OTP BANK RT	XS0214084262	-	10	-	7-Jan-11	5-Dec-11	5-Mar-12	38.500.00	10.38	75.71	2.721.49	-	4.3197	1.783.915.25	0.0200%	1.346%
OTP BANK RT	XS0214084262	-	2	-	14-Jun-11	5-Dec-11	5-Mar-12	41.187.60	9.29	75.71	1.303.39	-	4.3197	367.749.94	0.0004%	0.277%
ZAGREBACKI HOLDING DOO	XS0306889918	-	10	-	6-Oct-10	10-Jul-11	10-Jul-12	42.225.00	10.66	1.314.89	1.423.37	-	4.3197	1.942.277.96	0.1687%	1.485%
TOTAL														18.034.263.24		13.995%

2.3. Obligatuni cotate corporative RON

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al OPC	
								lei	lei	lei	lei	lei	lei	%	%	
Banca Comercială Română	XS0496326223	-	7	-	12-Apr-10	7-Apr-11	7-Apr-12	250.000.00	52.80	14.148.22	0.00	-	1.849.037.57	0.0797%	1.395%	
Bank of Ireland	XS0544792989	-	63	-	4-Oct-10	4-Oct-11	4-Oct-12	292.000.00	67.62	6.018.44	0.00	-	1.536.110.86	0.0260%	1.159%	
DEPPA BANK PLC	XS0266421414	-	478	-	8-Nov-10	9-May-11	9-May-12	4.878.09	1.14	218.55	93.21	-	2.470.367.74	1.1900%	1.864%	
Erste Bank	XS0293715430	-	46	-	18-Oct-11	1-Feb-11	1-Feb-12	9.075.20	2.15	640.55	17.55	-	478.498.20	0.0700%	0.361%	
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS0454824995	-	8	-	9-Dec-10	19-Aug-11	19-Aug-12	526.886.90	123.82	20.379.10	-10.692.48	-	4.252.428.10	0.0001%	3.228%	
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS0454824995	-	3	-	25-Jun-11	19-Aug-11	19-Aug-12	539.879.34	118.21	20.379.10	-11.165.05	-	1.619.689.15	0.0000%	1.222%	
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS0468145502	-	1	-	18-Oct-11	10-Nov-11	10-Nov-12	519.500.55	113.80	8.524.59	-3.759.75	-	524.265.39	0.0000%	0.396%	
Unicredit Bank AG	XS0653827338	-	2	-	5-Aug-11	20-Oct-11	20-Oct-12	600.000.00	122.95	8.975.41	0.00	-	1.017.950.82	0.0002%	0.788%	
TOTAL														13.788.338.72		10.402%

2.4. Obligatuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoarea inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(a)	Pret piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al OPC
								eur	eur	eur	eur	eur	lei	lei	%	%
Hungarian Development Bank	XS0632248802	-	300	-	23-Sep-11	31-May-11	31-May-12	955.00	0.19	34.51	2.63	-	4.3197	1.285.724.30	0.0600%	0.970%
TOTAL														1.285.724.30		0.970%

IX. Disponibil in conturi curente si numerar

1. Disponibil in conturi curente si numerar in lei

Denumire banca	Valoare curenta		Pondere in activ total al OPC	
	lei	%	lei	%
Alpha Bank	478.73	0.002%		
Banc Post SA	1.916.21	0.003%		
Banca Comerciala Carpatica	2.780.94	0.002%		
Banca Comerciala Romana	0.00	0.000%		
BANCA ITALO-ROMENA	139.01	0.000%		
Banca Romaniasca	2.492.29	0.002%		
BRD Groupe Societe Generale	119.57	0.000%		
CEC Bank SA	729.32	0.001%		
Cib Bank	0.00	0.000%		
CREDIT EUROPE BANK SA	100.00	0.000%		
Garanti Bank	0.00	0.000%		
OTP BANK ROMANIA	19.896.26	0.010%		
OTP BANK ROMANIA	25.314.60	0.019%		
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000%		
OTP BANK ROMANIA	35.180.63	0.027%		
OTP BANK ROMANIA	853.650.00	0.643%		
OTP BANK ROMANIA	108.496.00	0.082%		
OTP BANK ROMANIA	54.378.75	0.041%		
OTP BANK ROMANIA	76.867.00	0.058%		
OTP BANK ROMANIA	96.946.00	0.073%		
OTP BANK ROMANIA	54.060.00	0.041%		
OTP BANK ROMANIA	54.016.25	0.041%		
OTP BANK ROMANIA	54.378.75	0.041%		
PIRAEUS BANK	29.826.11	0.023%		
Procredit Bank	63.39	0.000%		
UniCredit Tiriac Bank	66.30	0.000%		
TOTAL	1.454.638.00	1.098%		

2. Disponibil in conturi curente si numerar denumite in EUR

Denumire banca	Valoare curenta		Curs valutar BNR EUR/RON		Pondere in activ total al OPC	
	eur	lei	lei	%	lei	%
Banca Comerciala Romana	2.120.09	4.3197	9.158.15	0.007%		
BRD Groupe Societe Generale	0.00	4.3197	0.00	0.000%		
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.3197	0.00	0.000%		
PIRAEUS BANK	0.00	4.3197	0.00	0.000%		
TOTAL	0.00	4.3197	9.158.15	0.007%		

X. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania

1. Depozite bancare denumite in lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoarea initiala		Cresterile zilnice	Dobanda cumulata	Valoarea totala		Pondere in activ total al OPC	
			lei	%			lei	%		
Banca Comerciala Romana	31-Dec-11	1-Jan-12	63.186.71	6.37	6.37	63.193.08	0.048%			
BANCA ITALO-ROMENA	29-Sep-11	28-Mar-12	2.034.900.00	401.40	38.133.47	2.073.033.47	1.564%			
BANCA ITALO-ROMENA	30-Sep-11	30-Mar-12	4.168.000.00	822.18	76.462.82	4.244.462.82	3.202%			
BANCA ITALO-ROMENA	7-Sep-11	7-Mar-12	3.294.950.00	658.99	72.915.27	3.367.865.27	2.570%			
BANCA ITALO-ROMENA	7-Nov-11	7-Feb-12	5.000.000.00	1.027.40	56.506.85	5.566.506.85	3.815%			
CREDIT EUROPE BANK SA	5-Dec-11	5-Jan-12	6.038.800.00	1.215.99	32.831.79	6.071.431.79	4.580%			
CREDIT EUROPE BANK SA	15-Dec-11	15-Jan-12	1.538.200.00	311.85	4.969.67	1.543.169.67	1.194%			
CREDIT EUROPE BANK SA	7-Dec-11	9-Jan-12	5.034.910.00	1.013.79	25.343.96	5.059.653.96	3.817%			
CREDIT EUROPE BANK SA	9-Dec-11	9-Jan-12	2.000.000.00	402.74	9.263.01	2.009.263.01	1.516%			
CREDIT EUROPE BANK SA	28-Dec-11	30-Jan-12	3.544.400.00	718.99	2.874.36	3.547.274.36	2.676%			
CREDIT EUROPE BANK SA	29-Dec-11	30-Jan-12	2.638.194.33	528.18	1.596.35	2.639.790.68	1.999%			
Garanti Bank	15-Dec-11	16-Jan-12	3.400.000.00	689.92	11.718.36	3.411.718.36	2.574%			
Garanti Bank	8-Nov-11	8-Feb-12	9.262.000.00	1.837.73	99.237.21	9.361.237.21	7.054%			
Garanti Bank	30-Nov-11	3-Jan-12	9.800.000.00	1.966.85	63.679.18	9.863.679.18	7.441%			
OTP BANK ROMANIA	30-Dec-11	4-Jan-12	1.253.134.38	153.01	295.99	1.253.380.37	0.946%			
UNICREDIT GROUP	2-Dec-11	3-Jan-12	18.120.900.00	3.775.19	113.255.63	18.234.155.63	13.756%			
UniCredit Tiriac Bank	15-Dec-11	16-Jan-12	5.000.000.00	1.041.67	17.708.33	5.017.708.33	3.785%			
TOTAL						62.726.794.93	62.416%			

XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor reglementate

1. Contracte forward

Controparte	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Pret de exercitare	Curs valutar BNR EUR/RON		Curs forward	Profit / pierdere	Valoarea totala		Pondere in activ total al OPC	
						lei	%			lei	%		
OTP BANK ROMANIA	500.000.00	V	19-Dec-11	21-Mar-12	lei	4.3503	4.3197	4.3628	-0.0125	-5.250.00	-0.005%		
OTP BANK ROMANIA	700.000.00	V	21-Nov-11	18-Jan-12	lei	4.3924	4.3197	4.3295	0.0629	44.030.00	0.033%		
OTP BANK ROMANIA	500.000.00	V	19-Dec-11	21-Mar-12	lei	4.3503	4.3197	4.3628	-0.0125	-6.250.00	-0.005%		
OTP BANK ROMANIA	800.000.00	V	29-Mar-11	23-Mar-12	lei	4.3473	4.3197	4.3533	-0.0160	-12.800.00	-0.010%		
OTP BANK ROMANIA	500.000.00	V	28-Dec-11	30-Mar-12	lei	4.3213	4.3197	4.3675	-0.0462	-23.100.00	-0.017%		
OTP BANK ROMANIA	1.000.000.00	V	21-Dec-11	23-Mar-12	lei	4.3398	4.3197	4.3639	-0.0241	-24.100.00	-0.018%		
OTP BANK ROMANIA	500.000.00	V	23-Dec-11	28-Mar-12	lei	4.3248	4.3197	4.3665	-0.0417	-20.850.00	-0.016%		
OTP BANK ROMANIA	100.000.00	V	14-Oct-11	16-Jan-12	lei	4.3593	4.3197	4.3295	0.0296	2.980.00	0.002%		
OTP BANK ROMANIA	200.000.00	V	17-Oct-11	19-Jan-12	lei	4.3629	4.3197	4.3300	0.0329	6.680.00	0.005%		
OTP BANK ROMANIA	250.000.00	V	10-Oct-11	12-Jan-12	lei	4.3489	4.3197	4.3262	0.0227	5.675.00	0.004%		
TOTAL										-34.085.00	-0.026%		

FDI OTP ComodisRO – Situația detaliată a investițiilor la data de 31.12.2011

XIII. Instrumente ale pieței monetare, altele decât cele tranzacționate pe o piață reglementată, conf. art. 10(1), lit.d din Legea nr 297/2004

1. Contracte de report pe titluri emise de administrația publică centrală

Seria emisiunii	Tipul de instrument	Nr. titluri deținute	Data achiziției	Data scadenței	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al OPC
RO1013DBN023	Repo	1.820	2-Dec-11	3-Jan-12	-18.120.665,61	lei	-3.246,62	-18.218.064,19	OTP BANK	0,0250%	-13,744%
TOTAL								-18.218.064,19			-13,744%

Seria emisiunii	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prime cumulate (a)	Pret piață	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al OPC
RO1013DBN023	-	1.000	-	1-Apr-11	25-Jul-11	25-Jul-12	9.799.177,42	1,945,09	272.224,04	65.205,46	-	10.137.646,92	Bancpost	0,0143%	7,648%
RO1013DBN023	-	800	-	27-Jul-11	25-Jul-11	25-Jul-12	8.125.713,89	1,502,17	224.043,72	16.100,42	-	8.365.856,03	Partener Bank	0,0117%	8,311%
TOTAL												18.503.504,95			13,959%

2. Titluri emise de administrația publică centrală

Seria emisiunii	Tip de instrument	Nr. titluri deținute	Data achiziției	Data decontării	Data scadenței	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prime cumulate (a)	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni ale unui emitenț	Pondere în activul total al OPC
RO1112CTNDA9	Certificat de trezorerie	1	-	2-May-11	21-Mar-12	9.431,29	1,78	0,00	428,29	9.859,58	BCR	0,0000%	0,007%
RO1112CTNDB7	Certificat de trezorerie	1	-	2-May-11	4-Apr-12	9.408,17	1,75	0,00	427,24	9.835,41	BCR	0,0000%	0,007%
RO1112CTNDC5	Certificat de trezorerie	1	-	2-May-11	11-Apr-12	9.396,66	1,75	0,00	426,71	9.823,37	BCR	0,0000%	0,007%
TOTAL										29.518,36			0,022%

XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denumite în lei

Denumire fond	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piață	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare	Pondere în activul total al OPC
FDI CERTINVEST MONETAR	-	22.072.727,15	72,4600	-	1.599.389,84	22,0890%	1,207%
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	-	164.694.215,88	23,0900	-	3.802.789,44	22,1254%	2,869%
FDI OTP OBLIGATIUNI	-	63.176.893,00	11,4600	-	724.021,16	5,0027%	0,546%
TOTAL					6.126.198,44		4,622%

2. Titluri de participare denumite în EUR

Denumire Fond	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. unități de fond deținute	Valoare unitate de fond (VUAN)	Pret piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoare totală	Pondere în total titluri de participare	Pondere în activul total al OPC
FDI OTP EURO BOND	-	19.243.596,9	10,5043	-	4,3197	873.186,38	2,2739%	0,659%
TOTAL						873.186,38		0,659%

Evoluția activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	An T-2	An T-1	An T
Activ net	78.632.871,31	122.263.062,95	132.280.684,00
VUAN	12,1400	13,1183	13,9668

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Președinte Directorat

Director Control Intern

Catalin Jianu Dan Iancu

Mirela Liliana Chiriteșcu