

## SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA

Decizie autorizare: PJR05SAIR/400023 Cod inscriere: J40/15502/15.08.2007  
 CUI: 22264941 Inregistrare ONRC: J40/15502/15.08.2007  
 Capital social: 5.795.323 RON Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

## FDI OTP BalansRO

Decizie autorizare: 375/27.02.2008  
 Cod inscriere: CSC06FDIR/400048

## Situatia activelor si obligatiilor

Denumire element	Incepul perioadei de raportare 31.12.2009				Sfarsitul perioadei de raportare 31.12.2010				
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	Diferenta (lei)
<b>I Total active</b>	<b>100.38</b>	<b>100.00</b>	<b>8,735,933.26</b>	<b>8,735,933.26</b>	<b>100.37</b>	<b>100.00</b>	<b>9,537,468.82</b>	<b>9,537,468.82</b>	<b>801,535.56</b>
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	52.47	52.27	4,566,604.71	4,566,604.71	71.07	70.80	6,752,686.06	6,752,686.06	2,186,081.35
Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	36.98	36.85	3,218,772.48	3,218,772.48	32.59	32.47	3,097,006.15	3,097,006.15	-121,766.33
Actiuni Tranzactionate	26.58	26.48	2,313,483.16	2,313,483.16	29.34	29.23	2,787,484.40	2,787,484.40	474,001.24
Obligatiuni emise de catre administratia publica centrala	7.01	6.99	610,292.22	610,292.22	0.00	0.00	0.00	0.00	-610,292.22
Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	3.39	3.38	294,997.10	294,997.10	2.78	2.77	263,934.25	263,934.25	-31,062.85
Certificate de investitii	0.00	0.00	0.00	0.00	0.48	0.48	45,587.50	45,587.50	45,587.50
Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	15.49	15.43	1,347,832.23	1,347,832.23	28.88	28.78	2,744,609.57	2,744,609.57	1,396,777.34
Actiuni	0.63	0.63	55,093.45	55,093.45	0.34	0.34	32,372.09	32,372.09	-22,721.36
Obligatiuni	0.00	0.00	0.00	0.00	28.54	28.44	2,712,237.48	2,712,237.48	2,712,237.48
Obligatiuni tranzactionate corporative	14.85	14.80	1,292,738.78	1,292,738.78	14.02	13.97	1,332,240.87	1,332,240.87	39,502.09
Obligatiuni de stat cotate	0.00	0.00	0.00	0.00	14.52	14.47	1,379,996.61	1,379,996.61	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:	2.26	2.26	197,000.20	197,000.20	9.59	9.55	911,070.34	911,070.34	714,070.14
Actiuni NECOTATE (prin prospect)	2.26	2.26	197,000.20	197,000.20	9.59	9.55	911,070.34	911,070.34	714,070.14
2 Disponibilii in cont curent	0.25	0.25	21,945.76	21,945.76	0.44	0.44	41,575.79	41,575.79	19,630.03
ALPHA BANK ROMANIA	0.00	0.00	426.94	426.94	0.00	0.00	5.58	5.58	-421.36
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.01	0.01	466.00	466.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-466.00
BANCA ROMANEASCA	0.00	0.00	0.65	0.65	0.01	0.01	670.38	670.38	669.73
BRD-GROUP SOCIETATE GENERAL	0.07	0.07	6,176.11	6,176.11	0.00	0.00	235.23	235.23	-5,940.88
CEC BANK	0.16	0.16	14,158.33	14,158.33	0.00	0.00	321.21	321.21	-13,837.12
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.00	199.00	199.00	0.42	0.42	39,688.85	39,688.85	39,489.85
PIRAEUS BANK ROMANIA	0.00	0.00	200.00	200.00	0.00	0.00	200.01	200.01	0.01
Banca Transilvania	0.00	0.00	20.80	20.80	0.00	0.00	156.60	156.60	135.80
Procredit Bank	0.00	0.00	297.93	297.93	0.00	0.00	297.93	297.93	0.00
3 Depozite bancare:	37.06	36.93	3,225,771.51	3,225,771.51	18.34	18.27	1,742,890.49	1,742,890.49	-1,482,881.02
Depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania	37.06	36.93	3,225,771.51	3,225,771.51	18.34	18.27	1,742,890.49	1,742,890.49	-1,482,881.02
ALPHA BANK ROMANIA	0.00	0.00	0.00	0.00	4.79	4.77	455,388.31	455,388.31	455,388.31
BANCA COMERCIALA ROMANA	4.26	4.25	371,185.50	371,185.50	3.07	3.06	292,013.94	292,013.94	-79,171.56
BANCA ROMANEASCA SA	11.10	11.06	966,275.24	966,275.24	0.00	0.00	0.00	0.00	-966,275.24
CEC BANK SA	3.05	3.04	265,355.45	265,355.45	0.00	0.00	0.00	0.00	-265,355.45
OTP BANK ROMANIA	14.59	14.54	1,270,062.09	1,270,062.09	0.00	0.00	0.00	0.00	-1,270,062.09
PIRAEUS BANK ROMANIA	4.05	4.04	352,893.23	352,893.23	10.48	10.44	995,488.24	995,488.24	642,595.01
4 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata, din care:	0.00	0.00	0.00	0.00	0.07	0.07	6,650.00	6,650.00	6,650.00
Futures	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.07	6,650.00	6,650.00	6,650.00
7 Titluri de participare la OPCVM/AOPC	8.33	8.29	724,615.08	724,615.08	9.14	9.10	868,265.82	868,265.82	143,590.74
8 Dividende sau alte drepturi de incasat	0.00	0.00	0.00	0.00	0.22	0.22	20,668.02	20,668.02	20,668.02
9 Alte active, din care:	0.00	0.00	-4.00	-4.00	1.10	1.10	104,852.64	104,852.64	104,856.64
Sume la SSIF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1.10	104,856.64	104,856.64	104,856.64
Sume in curs de rezolvare	0.00	0.00	-4.00	-4.00	0.00	0.00	-4.00	-4.00	0.00
<b>II Total obligatii</b>			<b>32,766.02</b>	<b>32,766.02</b>			<b>35,377.09</b>	<b>35,377.09</b>	<b>2,611.07</b>
10 CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligati)	0.38	0.38	32,766.02	32,766.02	0.37	0.37	35,377.09	35,377.09	2,611.07
101 Comisioane datorate soc. de admin.	0.30	0.30	26,232.58	26,232.58	0.30	0.30	28,334.48	28,334.48	2,101.90
102 Comisioane datorate depozitarului	0.03	0.03	2,599.47	2,599.47	0.03	0.03	2,924.64	2,924.64	325.17
106 Cheltuieli de audit	0.04	0.04	3,382.56	3,382.56	0.04	0.04	3,427.84	3,427.84	45.28
107 Comision custode	0.01	0.01	551.41	551.41	0.01	0.01	690.13	690.13	138.72
<b>III Valoarea activului net (I - II)</b>			<b>8,703,167.24</b>	<b>8,703,167.24</b>			<b>9,502,091.73</b>	<b>9,502,091.73</b>	<b>798,924.49</b>

Denumire element	La data de 31.12.2009	La data de 31.12.2010	Diferenta
Valoarea activ net	8,703,167.24	9,502,091.73	798,924.49
Numar unitati de fond/actiuni in circulatie	933,064.44	946,770.80	13,706.45
Valoarea unitara a activului net	9.33	10.04	0.71

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

## SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FDI OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2010

## I. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania

## 1. Actiuni tranzactionate

Emitent	Simbol actiune	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală		Valoare acțiune		Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului		Pondere în activul total al fondului	
				lei		lei			%	%		
ALBALACT SA Alba Iulia	ALBZ	12/30/2010	85.000,00	0.1000	0.25	20.833.50	0.0130	0.218				
MOTRUST SA ARAD (ARCONSERV)	ARCV	12/29/2010	1.500,00	0.1000	0.08	127.20	0.0005	0.001				
ANTIBIOTICE S.A.	ATB	12/30/2010	39.400,00	0.1000	0.62	24.428.00	0.0087	0.256				
BANCA COMERCIALA CARPATICA S.A.	BCC	12/30/2010	130.000,00	0.1000	0.08	10.400,00	0.0047	0.109				
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	BRD	12/30/2010	30.000,00	1.0000	12.35	370.500,00	0.0043	3.888				
COMPA S.A.	CMP	12/29/2010	28.000,00	0.1000	0.43	11.956,00	0.0128	0.129				
CONDIMAG S.A.	COMI	12/30/2010	81.000,00	0.1000	0.46	37.179,00	0.0353	0.390				
PROSPECTIUNI SA BUCURESTI	PRSN	12/30/2010	439.250,00	0.1000	0.24	105.771,40	0.0612	1.109				
ROMPETROL RAFINARE S.A.	RRC	12/30/2010	872.000,00	0.1000	0.06	38.640,00	0.0032	0.409				
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	12/30/2010	150.700,00	0.1000	1.01	152.809,80	0.0275	1.602				
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	12/30/2010	287.500,00	0.1000	1.16	334.075,00	0.0654	3.503				
SIF TRANSILVANIA S.A.	SIF3	12/30/2010	350.000,00	0.1000	0.54	190.225,00	0.0320	1.998				
SIF MUNTENIA S.A.	SIF4	12/30/2010	72.000,00	0.1000	0.64	46.368,00	0.0089	0.486				
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	12/30/2010	185.000,00	0.1000	1.26	233.100,00	0.0319	2.444				
OMV PETROM S.A.	SNP	12/30/2010	1.322.200,00	0.1000	0.34	442.937,00	0.0023	4.644				
S.N.T.E.E. TRANSELECTRICA	TEL	12/30/2010	7.150,00	10.0000	19.35	138.352,50	0.0098	1.451				
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	12/30/2010	2.133,00	10.0000	280,00	597.240,00	0.0181	6.283				
BANCA TRANSILVANIA S.A.	TLV	12/30/2010	26.500,00	1.0000	1.23	32.542,00	0.0020	0.341				
<b>TOTAL</b>						<b>2.787.484,40</b>		<b>29,227</b>				

## 2. Obligatiuni cotate emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Nr. obligatiuni deținute	Data cupon	Data scadența cupon	Valoare inițială (pt. perioada cupon)		Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni emitent		Pondere în activul total al fondului	
					lei					lei		%	%
DRAS LUGOJ	LGJ14	1.750	12/15/2010	3/14/2011	46,96	0,01	0,16	82.454,36	5,0000	0,865			
DRAS CRAVITA	ORV27	926	10/15/2010	4/14/2011	98,50	0,02	1,73	92.814,30	1,5433	0,973			
MUNICIPIUL TIMISOARA	TIM26C	990	11/15/2010	2/14/2011	88,80	0,02	0,76	88.665,58	0,0588	0,930			
<b>TOTAL</b>								<b>263.934,25</b>		<b>2,761</b>			

## 3. Certificate investitii

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare nominală		Valoare acțiune		Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului		Pondere în activul total al fondului	
				lei		lei			%	%		
DAX® Index Certificate	AT0000A04QY3	12/30/2010	50,00	227,17	301.3000	15.065,00	0,0050	0,158				
EuroSTOXX50® Index Certificate	AT0000A04QZ0	12/30/2010	250,00	137,60	122.0900	30.522,50	0,0250	0,320				
<b>TOTAL</b>						<b>45.587,50</b>		<b>0,478</b>				

## II. Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare mentionate la art. 102 (1) lit. a) din Legea nr. 297/2004 din care:

## 1. Actiuni necotate

Emitent	Nr. actiuni deținute	Valoare actiune		Valoare totala	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent		Pondere în activul total al fondului
		lei			%	%	
S.C. Fondul Proprietatea S.A.	2.650,001	0,3438	911,070,34	0,0186	9,553		
<b>TOTAL</b>			<b>911,070,34</b>		<b>9,553</b>		

## SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FDI OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2010

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

## 1. Actiuni tranzactionate - denumite in EURO

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. acțiuni deținute	Valoare acțiune		Curs valutar BNR RON/EURO	Valoare totală	Pondere în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al fondului
				EUR	lei				
ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG	AT0000652011	12/30/2010	215.00	35.140	4.2848	32.372.09	0.0001	0.339	
<b>TOTAL</b>						<b>32.372.09</b>		<b>0.339</b>	

## 2. Obligatiuni tranzactionate corporative

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni deținute	Data cupon	Data scadența cupon	Valoare inițială (pt. perioada cupon)		Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei					
METRO FINANCE BV	XS0437761009	1	7/23/2010	7/22/2011	250.000.00	79.11	12.815.75	262.815.75	0.0050	2.756	
BANCA COMERCIALA ROMANA	XS0496326223	3	4/7/2010	4/6/2011	250.000.00	52.74	14.186.99	792.560.96	0.1010	8.310	
<b>TOTAL</b>								<b>1.055.376.71</b>		<b>11.066</b>	

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data scadența cupon	Valoare inițială		Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Prima cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei						
METRO FINANCE BV	XS0437761009	1	6/22/2010	7/22/2011	268.813.50	54.42	12.815.75	4.765.10	276.864.15	0.0050	2.903	
<b>TOTAL</b>									<b>276.864.15</b>		<b>2.903</b>	

## 3. Obligatiuni emise de administratia publica centrala denumite in valuta

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data scadența cupon	Valoare inițială		Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Discount cumulată	Curs valutar BNR/RON	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					EUR	EUR							
ROMANIA	XS0495980095	100	11/5/2010	3/17/2011	997.50	0.14	39.59	0.09	4.2848	444.410.22	0.0133	4.660	
ROMANIA	XS0371163600	200	11/22/2010	6/17/2011	1.057.50	0.16	35.08	0.83	4.2848	935.586.39	0.0266	9.810	
<b>TOTAL</b>											<b>1.379.996.61</b>		<b>14.469</b>

## IV. Depozite bancare

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială		Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată		Pondere în activul total al fondului
			lei	lei			lei	lei	
Alpha Bank	12/13/2010	1/13/2011	453.441.00	102.49	1.947.31	455.388.31	4.775		
Banca Comerciala Romana	12/31/2010	1/1/2011	197.459.13	11.46	11.46	197.470.59	2.076		
Piraeus Bank	12/20/2010	1/20/2011	992.791.16	224.76	2.697.08	995.488.24	10.438		
<b>TOTAL</b>						<b>1.648.347.15</b>	<b>17.283</b>		

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială		Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Curs EUR/RON valutar		Pondere în activul total al fondului
			EUR	EUR			EUR	lei	
Banca Comerciala Romana	12/31/2010	1/1/2011	22.064.76	0.06	0.06	4.2848	94.543.35	0.991	
<b>TOTAL</b>							<b>94.543.35</b>	<b>0.991</b>	

## SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FDI OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2010

## V. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata in Romania

## 1. Futures

Contract	Nr. contracte	Tip Contract	Scadenta	Pret vanzare/ cumparare	Cotare	Marja	Profit	Valoare actualizata	Pondere in activul total al OPCVM
				RON	RON	RON	RON	RON	%
EUR/RON	50	V	3/18/2011	4.3145	4.3225	6.650.00	-400.00	6.250.00	0.06%
<b>Total</b>								<b>6.250.00</b>	<b>0.06%</b>

## VI. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

Denumire Fond	Nr. unitati de fond	Valoare unitate de fond	Valoare actualizata	Pondere in activul total al fondului
		lei	lei	%
FDI CERTINVEST PRUDENT	11,210,762,332	9.8700	110,650.22	1.16%
FDI CERTINVEST DINAMIC	15,856,729,783	4.3792	69,439.79	0.72%
FDI OMNITRUST	173,700.49	3.0171	524,071.75	5.49%
FDI OMNINVEST	33,494.10	4.8977	164,044.05	1.72%
<b>TOTAL</b>			<b>868,205.82</b>	<b>9.103%</b>

## VII. Dividende sau alte drepturi de incasat

## 1. Actiuni distribuite cu contraprestatie in bani

Emitent	Simbol actiune	Data ex-dividend	Nr.actiuni	Valoare actiuni	Valoare totala	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	%
CONDAMAG SA Brasov	COMI	24-Nov-10	54,000.00	0.4590	24,786.00	0.260%
<b>TOTAL</b>					<b>24,786.00</b>	<b>0.260%</b>

## 2. Suma de plata pentru actiuni distribuite cu contraprestatie in bani

Emitent	Simbol actiune	Data ex-dividend	Nr.actiuni	Pret subscriere	Valoare totala	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	%
CONDAMAG SA Brasov	COMI	24-Nov-10	54,000.00	0.1000	-5,400.00	-0.057%
<b>TOTAL</b>					<b>-5,400.00</b>	<b>-0.057%</b>

## 3. Actiuni distribuite fara contraprestatie in bani

Emitent	Simbol actiune	Data ex-dividend	Nr.actiuni	Valoare actiuni	Valoare totala	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	%
ANTIBIOTICE S.A.	ATB	29-Nov-10	1,971.00	0.6200	1,222.02	0.013%
<b>TOTAL</b>					<b>1,222.02</b>	<b>0.013%</b>

## Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	7,426,490.07	8,703,167.24	9,502,091.73
VUAN	7.96	9.33	10.04

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA  
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu