

## SITUATIA ACTIVELOR SI OBLIGATIILOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO

Inceputul perioadei de raportare 07.04.2008

Sfarsitul perioadei de raportare 31.12.2008

Definire elemente	% activul net	% activul total	Valoare		Diferente		
			RON	RON	RON	RON	
<b>VALORI MOBILIARE SI INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE</b>	-	-	-	<b>60.79</b>	<b>60.56</b>	<b>4,514,764.95</b>	<b>4,514,764.95</b>
Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	-	-	-	<b>47.80</b>	<b>47.62</b>	<b>3,549,832.28</b>	<b>3,549,832.28</b>
Actiuni tranzactionate	-	-	-	16.75	16.68	1,243,612.60	1,243,612.60
Actiuni netranzactionate in ultimele 90 zile	-	-	-	4.38	4.36	325,120.00	325,120.00
Drepturi de preferinta	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni emise de catre administratia publica centrala	-	-	-	7.97	7.94	591,594.03	591,594.03
Obligatiuni emise de catre administratia publica locala	-	-	-	3.44	3.42	255,252.34	255,252.34
Obligatiuni tranzactionate corporative	-	-	-	15.27	15.22	1,134,253.31	1,134,253.31
Valori mobiliare si instrumente monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	-	-	-	<b>11.70</b>	<b>11.66</b>	<b>868,978.94</b>	<b>868,978.94</b>
Actiuni tranzactionate	-	-	-	0.57	0.56	41,972.58	41,972.58
Obligatiuni tranzactionate	-	-	-	11.14	11.09	827,006.36	827,006.36
Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat nemembru sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat nemembru, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobate de CNVM	-	-	-	-	-	-	-
Valori mobiliare nou emise	-	-	-	<b>1.29</b>	<b>1.29</b>	<b>95,953.73</b>	<b>95,953.73</b>
Obligatiuni emise de catre administratia publica locala noi	-	-	-	1.29	1.29	95,953.73	95,953.73
Obligatiuni tranzactionate corporative noi	-	-	-	-	-	-	-
Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare mentionate la art.102 (1) lit.a) L297/2004	-	-	-	-	-	-	-
Valori mobiliare netranzactionate pe o piata reglementata	-	-	-	-	-	-	-
Actiuni	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni emise de administratia publica locala	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni corporative	-	-	-	-	-	-	-
Instrumente ale pietei monetare	-	-	-	-	-	-	-
Bilete la ordin	-	-	-	-	-	-	-
<b>DISPONIBIL IN CONTURI CURENTE SI NUMERAR</b>	-	-	-	<b>0.14</b>	<b>0.14</b>	<b>10,103.01</b>	<b>10,103.01</b>
Disponibil in cont curent	-	-	-	<b>0.14</b>	<b>0.14</b>	<b>10,103.01</b>	<b>10,103.01</b>
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	-	-	-	-	-	-	-
BANCA COMERCIALA ROMANA	-	-	-	0.00	0.00	0.03	0.03
BANCA ROMANEASCA SA	-	-	-	-	-	-	-
BANCA TRANSILVANIA	-	-	-	0.00	0.00	80.80	80.80
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	-	-	-	0.13	0.13	9,516.09	9,516.09
CEC BANK SA	-	-	-	0.00	0.00	158.25	158.25
MARFIN BANK (ROMANIA) S.A.	-	-	-	-	-	-	-
OTP BANK ROMANIA	-	-	-	0.00	0.00	49.00	49.00
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	-	-	-	0.00	0.00	0.91	0.91
PROCREDIT BANK S.A.	-	-	-	0.00	0.00	297.93	297.93
<b>DEPOZITE BANCARE</b>	<b>100.01</b>	<b>100.00</b>	<b>9,181,886.30</b>	<b>26.97</b>	<b>26.87</b>	<b>2,002,732.22</b>	<b>-7,179,154.08</b>
Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	<b>100.01</b>	<b>100.00</b>	<b>9,181,886.30</b>	<b>26.97</b>	<b>26.87</b>	<b>2,002,732.22</b>	<b>-7,179,154.08</b>
OTP BANK ROMANIA	100.01	100.00	9,181,886.30	14.28	14.22	1,060,175.84	-8,121,710.46
BANCA TRANSILVANIA	-	-	-	-	-	-	-
BANCA ROMANEASCA SA	-	-	-	-	-	-	-
PROCREDIT BANK S.A.	-	-	-	-	-	-	-
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	-	-	-	5.68	5.66	422,027.04	422,027.04
BANCA COMERCIALA ROMANA	-	-	-	0.05	0.05	3,636.01	3,636.01
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	-	-	-	2.49	2.48	184,650.70	184,650.70
MARFIN BANK (ROMANIA) S.A.	-	-	-	4.47	4.46	332,242.62	332,242.62
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	-	-	-	-	-	-	-
Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat nemembru	-	-	-	-	-	-	-
<b>INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE PE O PIATA REGLEMENTATA</b>	-	-	-	-	-	-	-

Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania	-	-	-	-	-	-	-
Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat nemembru	-	-	-	-	-	-	-
INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE IN AFARA PIETELOR RELEMENTATE	-	-	-	-	-	-	-
INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE, ALTELE DECAT CELE TRANZACTIONATE PE O PIATA RELEMENTATA, CONF. ART.101(1), lit.g DIN LEGEA NR.297/2004	-	-	-	11.14	11.10	827,125.50	827,125.50
Contracte de report pe titluri emise de administratia publica centrala	-	-	-	-	-	-	-
Titluri emise de administratia publica centrala	-	-	-	11.14	11.10	827,125.50	827,125.50
Certificate de depozit	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni emise de catre administratia publica locala	-	-	-	-	-	-	-
TITLURI DE PARTICIPARE LA OPCVM/AOPC	-	-	-	1.34	1.34	99,775.78	99,775.78
ALTE ACTIVE	-	-	-	-0.00	-0.00	-4.00	-4.00
Sume in tranzit bancar	-	-	-	-	-	-	-
Sume virate la SSIF	-	-	-	-	-	-	-
Sume aflate la distribuitori	-	-	-	-	-	-	-
Sume in curs de rezolvare	-	-	-	-0.00	-0.00	-4.00	-4.00
<b>TOTAL ACTIVE</b>	<b>100.01</b>	<b>100.00</b>	<b>9,181,886.30</b>	<b>100.38</b>	<b>100.00</b>	<b>7,454,497.47</b>	<b>-1,727,388.83</b>
Impozit pe venit	-	-	-	-	-	-	-
Comisioane luni precedente	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli de emisiune	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli cu auditul financiar	-	-	-	0.09	0.09	6,696.48	6,696.48
Comision subscriere	-	-	-	0.00	0.00	6.00	6.00
Rascumparari de achitat	-	-	-	-	-	-	-
Comision scrisoare garantie bancara	-	-	-	-	-	-	-
Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)			9,181,886.30			7,447,794.99	-1,734,091.31
Comisioane Depozitar	0.00	0.00	95.64	0.03	0.03	2,200.33	2,104.69
Comisioane Administrare	0.01	0.01	956.45	0.25	0.25	18,525.14	17,568.69
Comisioane custodie+ procesare tranzactii/transferuri	-	-	-	0.01	0.01	579.45	579.45
Cheltuieli CNVM	-	-	-	-	-	-	-
<b>TOTAL CHELTUIELI</b>	<b>0.01</b>	<b>0.01</b>	<b>1,052.09</b>	<b>0.38</b>	<b>0.38</b>	<b>28,007.42</b>	<b>26,955.33</b>
<b>ACTIV NET</b>	<b>RON</b>	<b>RON</b>	<b>9,180,834.21</b>	<b>RON</b>	<b>RON</b>	<b>7,426,490.06</b>	<b>-1,754,344.15</b>

Situatia valorii unitare a activului net	
Denumire element	Perioada curenta 31.12.2009
Valoare activ net	7,426,490.06
Numar de unitati de fond in circulatie	933,149.18
Valoare unitara a activului	7.96

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA  
Presedinte Directorat  
Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit  
Mirela Vlase

## SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FDI OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2008

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

## 1. Actiuni tranzactionate

Emitent	Simbol actiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni deținute	Valoare nominală	Valoare actiune	Valoare totală	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	lei	%	%
ALBALACT SA Alba Iulia	ALBZ	23.12.2008	100,000	0.1000	0.2100	21,000.00	0.0153	0.282
ALRO S.A.	ALR	23.12.2008	9,000	0.5000	1.2600	11,340.00	0.0013	0.152
ARMAX GAZ SA Medias	ARAX	23.12.2008	146,800	0.1000	0.0560	8,220.80	0.0243	0.110
AMOTRUST SA ARAD (ARCONSERV)	ARCV	23.12.2008	1,500	0.1000	0.0455	68.25	0.0005	0.001
AEROSTAR S.A.	ARS	23.12.2008	1,000	0.2500	0.5700	570.00	0.0009	0.008
ANTIBIOTICE S.A.	ATB	23.12.2008	39,400	0.1000	0.3600	14,184.00	0.0087	0.190
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	BRD	23.12.2008	26,000	1.0000	8.2500	214,500.00	0.0037	2.877
COMPA S. A.	CMP	23.12.2008	28,000	0.1000	0.0950	2,660.00	0.0128	0.036
CONCEFA SA SIBIU	COFI	23.12.2008	30,000	0.1000	0.1300	3,900.00	0.0159	0.052
DAFORA SA MEDIAS	DAFR	23.12.2008	110,000	0.1000	0.0391	4,301.00	0.0113	0.058
IMPACT DEVELOPER & CONTRACTOR S.A.	IMP	21.12.2008	200,000	0.1000	0.0314	6,280.00	0.0100	0.084
PROSPECTIUNI SA BUCURESTI	PRSN	23.12.2008	121,400	0.1000	0.1170	14,203.80	0.0169	0.191
ROMPETROL WELL SERVICES S.A.	PTR	23.12.2008	110,000	0.1000	0.3000	33,000.00	0.0395	0.443
ROMPETROL RAFINARE S.A.	RRC	23.12.2008	323,300	0.1000	0.0185	5,981.05	0.0015	0.080
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	23.12.2008	106,700	0.1000	0.5450	58,151.50	0.0194	0.780
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	23.12.2008	92,500	0.1000	0.5300	49,025.00	0.0178	0.658
SIF TRANSILVANIA S.A.	SIF3	23.12.2008	180,000	0.1000	0.2720	48,960.00	0.0165	0.657
SIF MUNTENIA S.A.	SIF4	23.12.2008	170,000	0.1000	0.6250	106,250.00	0.0211	1.425
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	23.12.2008	120,000	0.1000	0.5850	70,200.00	0.0207	0.942
PETROM S.A.	SNP	23.12.2008	1,225,200	0.1000	0.1810	221,761.20	0.0022	2.975
C.N.T.E. TRANSELECTRICA	TEL	23.12.2008	12,900	10.0000	11.0000	141,900.00	0.0176	1.304
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	23.12.2008	1,698	10.0000	122.0000	207,156.00	0.0144	2.779
<b>TOTAL</b>						<b>1,243,612.60</b>		<b>16.683</b>

## 2. Actiuni netranzactionate in ultimele 90 zile

Emitent	Simbol actiune	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni deținute	Valoare nominală	Valoare actiune / Pret referinta	Valoare totală	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	lei	%	%
<b>BANCA TRANSILVANIA S.A.</b>	<b>TLV</b>	<b>12.09.2008</b>	<b>1,280,000</b>	<b>0.1000</b>	<b>0.2540</b>	<b>325,120.00</b>	<b>0.0121</b>	<b>4.361</b>
<b>TOTAL</b>						<b>325,120.00</b>	<b>0.0121</b>	<b>4.361</b>

## 3. Obligatiuni emise de catre administratia publica centrala

Emitent	Nr. titluri	Data achizitie	Data scadenta cupon	Valoare inițială	Crestere zilnica	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Banca intermediara	Pondere in total titluri emise de stat	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	lei	lei		%	%
RO0710DBN017	21	21-08-2008	25-10-2009	193,056.07	55.83	5,182.04	198,238.12	PIRAEUS BANK	0.0011	2.658
RO0710DBN017	31	19-05-2008	25-10-2009	287,780.30	75.95	9,138.85	296,919.18	BCR	0.0016	3.983
RO0811DBN013	4	21-07-2008	25-10-2009	37,596.36	10.79	927.14	38,523.50	BCR	0.0002	0.517
RO0811DBN013	3	21-07-2008	25-10-2009	28,236.84	8.08	689.91	28,926.75	BCR	0.0002	0.388
RO0811DBN013	3	21-07-2008	25-10-2009	28,306.14	8.00	680.37	28,986.50	BCR	0.0002	0.389
<b>TOTAL</b>							<b>591,594.03</b>			<b>7.936</b>

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

Emitent	Simbol obligatiune	Nr. titluri	Data cupon	Data scadentei	Valoare inițială(pt. perioada cupon)	Crestere zilnica	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%
ORAS LUGOU	LGJ14	1,750	15.12.2008	14.03.2009	71.92	0.03	0.54	126,802.08	5.0000	1.701
MUNICIPIUL MEDGIDIA	MED09	1,050	19.12.2008	19.03.2009	25.00	0.01	0.14	26,401.67	5.0000	0.354
MUNICIPIUL TIMISOARA	TIM26C	1,000	15.11.2008	14.02.2009	100.00	0.04	2.05	102,048.59	0.0588	1.369
<b>TOTAL</b>								<b>255,252.34</b>		<b>3.424</b>

## Obligatiuni necotate emise sau garantate de autoritati ale administratiei publice locale

Emitent	Nr. titluri	Data cupon	Data scadentei	Valoare inițială(pt. perioada cupon)	Crestere zilnica	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	lei	lei	%	%
ORAS ORAVITA	926.00	13.10.2008	14.04.2009	100.00	0.05	3.62	95,953.73	1.5433	1.287
<b>TOTAL</b>							<b>95,953.73</b>		<b>1.287</b>

## SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FDI OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2008

## 5. Obligatiuni cotate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Nr. titluri	Data cupon	Data scadenței	Valoare inițială(pt. perioada cupon)	Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%
PROCREDIT BANK S.A.	PRCR09	500	15.08.2008	14.02.2009	500.00	0.12	16.18	258.090.71	0.6211	3.462
BANCA COMERCIALA ROMANA	BCR09	2.100	28.11.2008	27.05.2009	100.00	0.02	0.67	211.416.16	0.0865	2.836
BANCA EUROPEANA DE INVESTITII	IBRD09	210	18.09.2008	17.03.2009	1.000.00	0.18	18.70	213.928.36	0.0400	2.870
BANCA COMERCIALA CARPATICA S.A.	BCC09	1.970	28.11.2008	29.05.2009	100.00	0.05	1.55	200.059.06	0.5353	2.884
<b>TOTAL</b>								<b>863,492.29</b>		<b>11.852</b>

Emitent	Simbol obligatiune	Numar titluri	Data achizitiei	Data scadentei	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%
PROCREDIT BANK S.A.	PRCR09	492	22.12.2008	14.02.2009	492.05	0.26	17.63	250.761.05	0.6112	3.364
<b>TOTAL</b>								<b>250,761.05</b>		<b>3.364</b>

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

## 1. Actiuni tranzactionate - denumite în EURO

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzactionat	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	lei	%	%
ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG	AT0000652011	30.12.2008	650	16.20	3.9860	41,972.58	0.0002	0.563
<b>TOTAL</b>						<b>41,972.58</b>		<b>0.563</b>

## 2. Obligatiuni tranzactionate corporative

Emitent	Simbol obligatiune	Nr. titluri	Data cupon	Data scadenței	Valoare inițială(pt. perioada cupon)	Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%
KFW 2T	XS0366362118	350	03.06.2008	02.06.2009	1.000.00	0.27	58.08	370.328.76	0.0700	4.968
ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG	XS0356938828	44	10.10.2008	11.01.2009	10,000.00	4.57	379.04	456,677.60	0.0733	6.126
<b>TOTAL</b>								<b>827,006.36</b>		<b>11.094</b>

## III. Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conf art.101, lit.g) din Legea nr. 297/2004

## 1. Titluri emise de administratia publica centrala

Seria emisiunii	Numar titluri deținute	Data cupon (data achizitiei)	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Banca intermediara	Pondere în total titluri emise de stat	Pondere în activul total al fondului
				lei	lei	lei	lei		%	%
RO0809CTN029	32	14.08.2008	23.01.2009	305,562.24	89.12	12,477.08	318,039.32	ALPHA BANK	0.0017	4.266
RO0809CTN0E1	33	22.09.2008	24.07.2009	302,453.58	90.32	9,121.93	311,575.51	ALPHA BANK	0.0017	4.180
RO0809CTN0F8	20	15.08.2008	13.02.2009	189,463.80	57.89	8,046.88	197,510.68	BCR	0.0011	2.650
<b>TOTAL</b>							<b>827,125.50</b>			<b>11.096</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 ROMANIA S.A.	24.12.2008	07.01.2009	419,818.68	276.05	2,208.36	422,027.04	5.661
BANCA COMERCIALA ROMANA	31.12.2008	05.01.2009	3,635.00	1.01	1.01	3,636.01	0.049
MARFIN BANK (ROMANIA) S.A.	24.12.2008	07.01.2009	330,699.36	192.91	1,543.26	332,242.62	4.457
OTP BANK ROMANIA	09.12.2008	09.01.2009	500,000.00	260.27	5,986.30	505,986.30	6.788
OTP BANK ROMANIA	24.12.2008	05.01.2009	552,403.69	223.23	1,785.85	554,189.54	7.434
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	24.12.2008	07.01.2009	183,793.00	107.21	857.70	184,650.70	2.477
<b>TOTAL</b>						<b>2,002,732.22</b>	<b>26.866</b>

## V. Titluri de participare la OPCVM/AOPC

Denumire Fond	Nr unitati de fond	Valoare unitate de fond	Valoare actualizata	Pondere în activul total al OPCVM
		lei	lei	%
Aviva Investors Capital Plus	11,210.76	8.90	99,775.78	1.338
<b>TOTAL</b>			<b>99,775.78</b>	<b>1.338</b>

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA  
 Presedinte Directorat  
 Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit  
 Mirela Viase