

SITUATIA ACTIVELOR SI OBLIGATIILOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO

Inceputul perioadei de raportare 31.12.2008

Sfarsitul perioadei de raportare 31.12.2009

Definire elemente	Inceputul perioadei de raportare 31.12.2008		Sfarsitul perioadei de raportare 31.12.2009		Diferente		
	% activul net	% activul total	Valoare RON	% activul net	% activul total	Valoare RON	RON
1. VALORI MOBILIARE SI INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE	60.79	60.56	4,418,811.22	52.47	52.27	4,566,604.71	147,793.49
1.1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	47.80	47.62	3,549,832.28	36.98	36.85	3,216,772.48	-331,059.80
Actiuni tranzactionate	16.75	16.68	1,243,612.60	26.58	26.48	2,313,483.16	1,069,870.56
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	7.01	6.99	610,292.22	18,698.19
Obligatiuni emise de catre administratia publica locala	3.44	3.42	255,252.34	3.39	3.38	294,997.10	39,744.76
Obligatiuni tranzactionate corporative	15.27	15.22	1,134,253.31	-	-	-	-1,134,253.31
1.2 Valori mobiliare si instrumente monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	11.70	11.66	868,978.94	15.49	15.43	1,347,832.23	478,853.29
Actiuni tranzactionate	0.57	0.56	41,972.58	0.63	0.63	55,093.45	13,120.87
Obligatiuni tranzactionate	11.14	11.09	827,006.36	14.85	14.80	1,292,738.78	465,732.42
1.3 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise la cota oficiala a unei burse dintr-un stat membru sau negociate pe o alta piata reglementata dintr-un stat membru, care opereaza in mod regulat si este recunoscuta si deschisa publicului, aprobate de CNVM	-	-	-	-	-	-	-
2. Valori mobiliare nou emise	1.29	1.29	95,953.73	-	-	-	-95,953.73
Obligatiuni emise de catre administratia publica locala noi	1.29	1.29	95,953.73	-	-	-	-95,953.73
Obligatiuni tranzactionate corporative noi	-	-	-	-	-	-	-
3. Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare mentionate la art.102 (1) lit.a) L 297/2004	-	-	-	2.26	2.26	197,000.20	197,000.20
Valori mobiliare netranzactionate pe o piata reglementata	-	-	-	2.26	2.26	197,000.20	197,000.20
Actiuni	-	-	-	2.26	2.26	197,000.20	197,000.20
Obligatiuni emise de administratia publica locala	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni corporative	-	-	-	-	-	-	-
4. DISPONIBIL IN CONTURI CURENTE SI NUMERAR	0.14	0.14	10,103.01	0.25	0.25	21,945.76	11,842.75
Disponibil in cont curent	0.14	0.14	10,103.01	0.25	0.25	21,945.76	11,842.75
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	-	-	-	-	-	426.94	426.94
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00	0.00	0.03	0.01	0.01	466.00	465.97
BANCA ROMANEASCA SA	-	-	-	-	-	0.65	0.65
BANCA TRANSILVANIA	0.00	0.00	80.80	-	-	20.80	-60.00
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.13	0.13	9,516.09	0.07	0.07	6,176.11	-3,339.98
CEC BANK SA	0.00	0.00	158.25	0.17	0.17	14,168.33	14,000.08
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.00	49.00	-	-	199.00	150.00
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	0.00	0.00	0.91	-	-	200.00	199.09
PROCREDIT BANK S.A.	0.00	0.00	297.93	-	-	297.93	-
5. DEPOZITE BANCARE	26.97	26.87	2,002,732.23	37.06	36.93	3,225,771.51	1,223,039.30
5.1 Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	26.97	26.87	2,002,732.23	37.06	36.93	3,225,771.51	1,223,039.30
OTP BANK ROMANIA	14.28	14.22	1,060,175.84	14.59	14.54	1,270,062.09	209,886.25
CEC BANK SA	-	-	-	3.05	3.04	265,355.45	265,355.45
BANCA ROMANEASCA SA	-	-	-	11.10	11.06	966,275.24	966,275.24
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	4.26	4.25	371,185.50	367,549.49
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	2.49	2.48	184,650.70	4.05	4.04	352,893.23	168,242.53
MARFIN BANK (ROMANIA) S.A.	4.47	4.46	332,242.62	-	-	-	-332,242.62
5.2 Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
5.3 Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
6. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE PE O PIATA REGLEMENTATA	-	-	-	-	-	-	-
6.1 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania	-	-	-	-	-	-	-
6.2 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
6.3 Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	-	-	-	-	-	-	-
6.4 INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE	-	-	-	-	-	-	-
7. INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE, ALTELE DECAT CELE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA, 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	-	-	-	-	-	-	-
8. TITLURI DE PARTICIPARE LA OPCVM/AOPC	1.34	1.34	99,775.78	8.33	8.29	724,615.08	624,839.30
9. ALTE ACTIVE	-	-	-4.00	-	-	-4.00	-
Sume in tranzit bancar	-	-	-	-	-	-	-

Sume virate la SSIF	-	-	-	-	-	-	-	-
Sume aflate la distribuitori	-	-	-	-	-	-	-	-
Sume in curs de rezolvare	-	-	-4.00	-	-	-	-4.00	-
TOTAL ACTIVE	100.38	100.00	7,454,497.47	100.37	100.00	8,735,933.26	1,281,435.79	
impozit pe venit	-	-	-	-	-	-	-	-
Comisioane luni precedente	-	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli de emisiune	-	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli cu auditul financiar	0.09	0.09	6,696.48	0.04	0.04	3,382.56	-3,313.92	
Comision subscriere	0.00	0.00	6.00	-	-	-	-6.00	
Rascumparari de achitat	-	-	-	-	-	-	-	-
Comision scrisoare garantie bancara	-	-	-	-	-	-	-	-
Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)			7,447,794.99			8,732,550.70		
Comisioane Depozitar	0.03	0.03	2,200.33	0.03	0.03	2,599.47	399.14	
Comisioane Administrare	0.25	0.25	18,525.14	0.30	0.30	26,232.58	7,707.44	
Comisioane custodie+ procesare tranzactii/transferuri	0.01	0.01	579.45	0.02	0.01	551.41	-28.04	
Cheltuieli CNVM	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL CHELTUIELI	0.38	0.38	28,007.42	0.37	0.37	32,766.02	4,758.60	
ACTIV NET			7,426,490.07			8,703,167.24	1,276,677.17	

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 31.12.2009	Perioada corespunzatoare anului precedent 31.12.2008	Diferente
Valoare activ net	8,703,167.24	7,426,490.07	1,276,677.17
Numar de unitati de fond in circulatie	933,064.44	933,149.18	-84.74
Valoare unitara a activului net (VUAN)	9.33	7.96	1.37

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOI FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2009

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

1. Actiuni tranzactionate

Emitent	Simbol actiune	Data ultimei sedinta 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	24-12-2009	85,000.00	0.1000	0.3740	31,790.00	0.0130	0.364
ALRO S.A.	ALR	24-12-2009	9,000.00	0.5000	2.4000	21,600.00	0.0013	0.247
ARMAX GAZ SA Medias	ARAX	24-12-2009	117,800.00	0.1000	0.0972	11,450.16	0.0195	0.131
MOTRUST SA ARAD (ARCONSERV)	ARCV	24-12-2009	1,500.00	0.1000	0.0868	130.20	0.0005	0.001
AEROSTAR S.A.	ARS	24-12-2009	1,000.00	0.2500	0.5950	595.00	0.0009	0.007
ANTIBIOTICE S.A.	ATB	24-12-2009	39,400.00	0.1000	0.6300	24,822.00	0.0087	0.284
BANCA COMERCIALA CARPATICA S.A.	BCC	24-12-2009	130,000.00	0.1000	0.0990	12,870.00	0.0057	0.147
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	BRD	24-12-2009	27,100.00	1.0000	13.0000	352,300.00	0.0039	4.033
COMPA S. A.	CMP	24-12-2009	28,000.00	0.1000	0.2900	8,120.00	0.0128	0.093
CONCEFA SA SIBIU	COFI	24-12-2009	30,000.00	0.1000	0.2500	7,500.00	0.0159	0.086
IMPACT DEVELOPER & CONTRACTOR S.A.	IMP	24-12-2009	20,000.00	1.0000	0.7050	14,100.00	0.0100	0.161
PROSPECTIUNI SA BUCURESTI	PRSN	24-12-2009	81,400.00	0.1000	0.2100	17,094.00	0.0113	0.196
ROMPETROL WELL SERVICES S.A.	PTR	24-12-2009	60,000.00	0.1000	0.4200	25,200.00	0.0216	0.288
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	24-12-2009	90,700.00	0.1000	1.1300	102,491.00	0.0165	1.173
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	24-12-2009	338,500.00	0.1000	1.1400	385,890.00	0.0652	4.417
SIF TRANSILVANIA S.A.	SIF3	24-12-2009	120,000.00	0.1000	0.6800	81,600.00	0.0110	0.934
SIF MUNTENIA S.A.	SIF4	24-12-2009	145,000.00	0.1000	0.7100	102,950.00	0.0180	1.178
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	24-12-2009	207,000.00	0.1000	1.2700	262,890.00	0.0357	3.009
PETROM S.A.	SNP	24-12-2009	1,045,200.00	0.1000	0.2490	260,254.80	0.0018	2.979
C.N.T.E.E. TRANSELECTRICA	TEL	24-12-2009	12,900.00	10.0000	13.5000	174,150.00	0.0176	1.993
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	24-12-2009	1,698.00	10.0000	157.0000	266,586.00	0.0144	3.052
BANCA TRANSILVANIA S.A.	TLV	24-12-2009	70,000.00	1.0000	2.1300	149,100.00	0.0064	1.707
TOTAL						2,313,483.16		26.482

2. Obligatiuni emise de catre administratia publica centrala

Seria emisiunii	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitie	Data scadenta cupon	Valoare initiala	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Discount cumulata	Valoare actualizata	Banca intermediara	Pondere in total titluri emise de stat	Pondere in activul total al fondului
				lei	lei	lei	lei	lei	%	%	
RO0710DBN017	21	21-08-2008	25-10-2010	193,056.07	55.83	2,347.40	10,613.93	206,017.40	PIRAEUS BANK ROMAN	0.0005	2.358
RO0710DBN017	31	19-05-2008	25-10-2010	287,780.30	75.95	3,465.21	14,796.47	306,041.98	BANCA COMERCIALA R	0.0008	3.503
RO0811DBN013	4	21-07-2008	25-10-2010	37,596.36	10.79	596.16	1,067.61	39,260.13	BANCA COMERCIALA R	0.0001	0.449
RO0811DBN013	3	21-07-2008	25-10-2010	28,236.84	8.06	447.12	783.13	29,467.10	BANCA COMERCIALA R	0.0001	0.337
RO0811DBN013	3	21-07-2008	25-10-2010	28,306.14	8.00	447.12	752.35	29,505.62	BANCA COMERCIALA R	0.0001	0.338
TOTAL								610,292.23			6.986

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

Emitent	Simbol obligatiune	Nr. obligatiuni detinute	Data cupon	Data scadenta cupon	Valoare initiala (pt. perioada cupon)	Crestere zilnica	Dobanda cumulata	Valoare actualizata	Pondere in total obligatiuni emitent	Pondere in activul total al fondului
					lei	lei	lei	%	%	
ORAS LUGOJ	LGJ14	1,750	15.12.2009	14.03.2010	59.44	0.02	0.30	104,542.27	5.0000	1.197
ORAS ORAVITA	ORV27	926	15.10.2009	14.04.2010	100.00	0.03	2.32	94,747.00	1.5433	1.085
MUNICIPIUL TIMISOARA	TIM26C	1,000	15.11.2009	14.02.2010	95.40	0.03	1.31	95,707.83	0.0588	1.096
TOTAL								294,997.10		3.377

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

SITUATIA DETALIATA A ACTIVEI FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2009

1. Actiuni necotate

Emitent	Nr. actiuni detinute	Valoare actiune	Valoare totala	Pondere in total obligatiuni ale unui emitent	Pondere in activul total al fondului
		lei	lei	%	%
S.C. Fondul Proprietatea S.A.	1,000,001.00	0.1970	197,000.20	0.0070	2.2550
TOTAL			197,000.20		2.2550

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 sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. actiuni detinute	Valoare actiune	Curs valutar BNR RON/ EURO	Valoare totala	Pondere in capitalul social al emitentului	Pondere in activul total al fondului
				EUR	lei	lei	%	%
ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG	AT0000652011	31.12.2009	500	26.06	4.2282	55,093.45	0.0002	0.631
TOTAL						55,093.45		0.631

2. Obligatiuni tranzactionate corporative

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni detinute	Data cupon	Data scadența cupon	Valoare inițială (pt. perioada cupon)	Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere in total obligatiuni ale unui emitent	Pondere in activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%
METRO FINANCE BV	XS0437761009	1	23-07-2009	22-07-2010	250,000.00	79.11	12,815.75	262,815.75	0.0050	3.008
KREDITANSTAL FUR WIEDERAUFBAU	XS0366362118	350	03.06.2009	02.06.2010	1,000.00	0.27	58.08	370,328.77	0.0700	4.238
ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG	XS0356938828	44	12.10.2009	10.01.2010	10,000.00	2.90	235.12	450,345.39	0.0701	5.155
TOTAL								1,083,489.91		12.403

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni detinute	Data achizitiei	Data scadența cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Discount cumul	Valoare actualizată	Pondere in total obligatiuni ale unui emitent	Pondere in activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	lei	%	%
RABOBANK	XS0361123283	201	20-02-2009	6/5/2010	903.00	0.51	68.75	69.29	209,248.87	0.0402	2.395
TOTAL									209,248.87		2.395

IV. Depozite bancare

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere in activul total al fondului
			lei	lei	lei	lei	%
BANCA COMERCIALA ROMANA	30.12.2009	06.01.2010	371,000.00	92.75	185.50	371,185.50	4.249
BANCA ROMANEASCA SA	28.12.2009	29.03.2010	965,059.00	304.06	1,216.24	966,275.24	11.061
CEC BANK SA	10.08.2009	02.01.2010	265,450.00	94.54	-94.54	265,355.46	3.038
OTP BANK ROMANIA	28.12.2009	04.01.2010	299,600.00	88.16	352.63	299,952.63	3.434
OTP BANK ROMANIA	29.12.2009	05.01.2010	969,253.07	285.46	856.39	970,109.46	11.105
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	29.12.2009	29.01.2010	352,555.36	112.62	337.87	352,893.23	4.040
TOTAL						3,225,771.52	36.928

SITUATIA DETALIATA A ACTIVEIOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO LA DATA DE 31.12.2009

V. 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	%
AVIVA INVESTORS CAPITAL PLUS	11.210.762332	9.6300	107.959.64	1.236
OMNITRUST	173.700.49	2.75	477.919.53	5.471
OMNINVEST	33.494.10	4.14	138.735.91	1.588
TOTAL			724.615.08	8.295

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
VUAN	-	7.96	9.33

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu