

Comisioane luni precedente	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli de emisiune	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli cu auditul financiar	0.19	0.19	10,044.72	0.08	0.08	3,382.56	-6,662.16
Comision scrisoare garantie bancara	0.16	0.16	8,291.09	0.44	0.44	19,197.45	10,906.36
Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)			5,163,433.57			4,375,523.91	-787,909.66
Comisioane Depozitar	0.09	0.09	4,488.95	0.09	0.09	3,851.48	-637.47
Comisioane Administrare	0.29	0.29	15,057.24	0.29	0.30	12,919.11	-2,138.13
Comisioane custodie + procesare tranzactii/transferuri	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli CNVM	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
II. TOTAL OBLIGATII	0.73	0.73	37,882.00	0.89	0.90	39,350.60	1,468.60
III. ACTIV NET (I - II)			5,143,887.38			4,358,753.32	-785,134.06

Situatia valorii unitare a activului net	
Denumire element	Perioada curenta 31.12.2009
Valoare activ net	4,358,753.32
Numar de unitati de fond in circulatie	4,709.00
Valoare unitara a activului	925,62

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

I. DEPOZITE BANCARE

1. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în activul total al fondului
			lei	lei	lei	lei	%
OTP BANK ROMANIA	31.12.2009	31.03.2010	941,800.00	264.99	264.99	942,064.99	21.420
BANCA COMERCIALA ROMANA	31.12.2009	31.03.2010	941,800.00	269.98	269.98	942,069.98	21.420
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	31.12.2009	31.03.2010	941,800.00	274.69	274.69	942,074.69	21.420
BANCA ROMANEASCA SA	16.12.2009	15.01.2010	185,815.00	52.18	834.89	186,649.89	4.244
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	16.12.2009	31.03.2010	941,800.00	269.98	269.98	942,069.98	21.420
TOTAL						3,954,929.53	89.924

2. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadentei	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în activul total al fondului
			lei	lei	lei	lei	%
OTP BANK UNGARIA	31.12.2009	31.03.2010	941,800.00	269.98	269.98	942,069.98	21.420
TOTAL						942,069.98	21.420

II. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE

1. Contracte swap pe rata dobanzii

Contraparte	Capital initial (notional)	Data achiziție	Data scadentei	Data cotație	Cotație contraparte	Profit	Pondere în activul total al fondului
	lei				%	lei	%
SOCIETE GENERALE	4,709,000.00	12.08.2008	30.11.2011	31.12.2009	-11.49	-541,064.10	-12.302
TOTAL						-541,064.10	-12.302

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Director Control Intern

Catalin Jianu Dan Iancu

Mirela Liliana Chiritescu