

SITUATIA ACTIVELOR SI OBLIGATIILOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO

Inceputul perioadei de raportare 31.12.2009

Sfarsitul perioadei de raportare 30.06.2010

Definire elemente	% activul net	% activul total	Valoare	% activul net	% activul total	Valoare	Diferente
			RON			RON	RON
1. VALORI MOBILIARE SI INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE	52.47	52.27	4,566,604.71	48.61	48.44	4,415,897.76	(150706.95)
1.1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	36.98	36.85	3,218,772.48	32.51	32.40	2,953,395.53	(265376.95)
Actiuni tranzactionate	26.58	26.48	2,313,483.16	29.43	29.33	2,673,540.90	360,057.74
Actiuni netranzactionate in ultimele 90 zile	-	-	-	-	-	-	-
Drepturi de subscriere	-	-	-	-	-	4.50	4.50
centrala	7.01	6.99	610,292.22	-	-	-	(610292.22)
Obligatiuni emise de catre administratia publica locala	3.39	3.38	294,997.10	3.08	3.07	279,850.13	(15146.97)
Obligatiuni tranzactionate corporative	-	-	-	-	-	-	-
1.2 Valori mobiliare si instrumente monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	15.49	15.43	1,347,832.23	16.10	16.04	1,462,502.24	114,670.01
Actiuni tranzactionate	0.63	0.63	55,093.45	1.39	1.38	126,193.14	71,099.69
Obligatiuni tranzactionate	14.85	14.80	1,292,738.78	14.71	14.66	1,336,309.10	43,570.32
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	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni tranzactionate corporative noi	-	-	-	-	-	-	-
3. Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare mentionate la art.102 (1) lit.a) L297/2004	2.26	2.26	197,000.20	5.44	5.42	494,460.27	297,460.07
Valori mobiliare netranzactionate pe o piata reglementata	2.26	2.26	197,000.20	5.44	5.42	494,460.27	297,460.07
Actiuni	2.26	2.26	197,000.20	5.44	5.42	494,460.27	297,460.07
Obligatiuni emise de administratia publica locala	-	-	-	-	-	-	-
Obligatiuni corporative	-	-	-	-	-	-	-
4. DISPONIBIL IN CONTURI CURENTE SI NUMERAR	0.25	0.25	21,945.76	0.16	0.16	14,868.88	(7076.88)
Disponibil in cont curent	0.25	0.25	21,945.76	0.16	0.16	14,868.88	(7076.88)
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	-	-	426.94	0.01	0.01	396.94	(30.00)
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.01	0.01	466.00	-	-	-	(466.00)
BANCA ROMANEASCA SA	-	-	0.65	-	-	0.27	(0.38)
BANCA TRANSILVANIA	-	-	20.80	-	-	186.60	165.80
BRD - GROUPE SOCIETE GENERALE S.A.	0.07	0.07	6,176.11	0.15	0.15	13,385.81	7209.70
CEC BANK SA	0.17	0.17	14,158.33	-	-	320.93	(13837.40)
OTP BANK ROMANIA	-	-	199.00	-	-	-	(199.00)
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	-	-	200.00	-	-	280.40	80.40
PROCREDIT BANK S.A.	-	-	297.93	-	-	297.93	-
5. DEPOZITE BANCARE	37.06	36.93	3,225,771.51	29.41	29.31	2,671,657.11	(554114.41)
5.1 Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	37.06	36.93	3,225,771.51	29.41	29.31	2,671,657.11	(554114.41)
OTP BANK ROMANIA	14.59	14.54	1,270,062.09	0.92	0.92	83,305.46	(1186756.63)
CEC BANK SA	3.05	3.04	265,355.45	-	-	-	(265355.45)
BANCA ROMANEASCA SA	11.10	11.06	966,275.24	11.18	11.14	1,015,540.95	49,265.71
BANCA COMERCIALA ROMANA	4.26	4.25	371,185.50	6.82	6.79	619,116.26	247,930.76
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	4.05	4.04	352,893.23	10.50	10.46	953,694.44	600,801.21
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 nemembru	-	-	-	-	-	-	-
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 nemembru	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	5.98	5.96	543,606.93	543,606.93
Contracte de report pe titluri emise de administratia publica centrala	-	-	-	5.98	5.96	543,606.93	543,606.93
Titluri emise de administratia publica centrala	-	-	-	-	-	-	-
Certificat de depozit de catre administratia publica locala	-	-	-	-	-	-	-
8. TITLURI DE PARTICIPARE LA OPCVM/AOPC	8.33	8.29	724,615.08	9.90	9.86	899,060.75	174,445.67

9. DIVIDENDE SAU ALTE DREPTURI DE INCASAT	-	-	-	0.85	0.84	76,842.50	76,842.50
10. 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	100.37	100.00	8,735,933.26	100.36	100.00	9,116,390.20	380,456.94
Impozit pe venit	-	-	-	-	-	-	-
Comisioane luni precedente	-	-	-	-	-	24.00	24.00
Cheltuieli de emisiune	-	-	-	-	-	-	-
Cheltuieli cu auditul financiar	0.04	0.04	3,382.56	0.02	0.02	1,706.98	(1675.58)
Comision subscriere	-	-	-	-	-	12.00	12.00
Rascumparari de achitat	-	-	-	-	-	-	-
Comision scrisoare garantie bancara	-	-	-	-	-	-	-
Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)			8,732,550.70			9,114,647.23	
Comisioane Depozitar	0.03	0.03	2,599.47	0.03	0.03	2,854.63	255.16
Comisioane Administrare	0.30	0.30	26,232.58	0.30	0.30	27,643.34	1,410.76
Comisioane custodie+ procesare tranzactii/transferuri	0.02	0.01	551.41	0.01	0.01	694.01	142.60
Cheltuieli CNVM	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL CHELTUIELI	0.37	0.37	32,766.02	0.36	0.36	32,934.96	168.94
ACTIV NET			8,703,167.24			9,083,455.24	380,288.00

Situatia valorii unitare a activului net

Denumire element	Perioada curenta 30.06.2010	Perioada corespunzatoare anului precedent 30.06.2009	Diferente
Valoare activ net	9,083,455.25	7,950,805.28	1,132,649.97
Numar de unitati de fond in circulatie	956,023.88	933,064.44	22,959.44
Valoare unitara a activului net (VUAN)	9.50	8.52	0.98

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit

Mirela Vlase

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO LA DATA DE 30.06.2010

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 în capitalul social al emitentului	Pondere în activul total al fondului
				lei	lei	lei	%	%
Albalact SA	ALBZ	30-Jun-10	85,000	0.1000	0.2170	18,445.00	0.0130%	0.202%
IMOTRUST SA	ARCV	30-Jun-10	1,500	0.1000	0.0896	134.40	0.0005%	0.001%
Antibiotice Iasi	ATB	30-Jun-10	39,400	0.1000	0.4910	19,345.40	0.0087%	0.212%
Banca Comerciala Carpatica	BCC	30-Jun-10	130,000	0.1000	0.0865	11,245.00	0.0057%	0.123%
Banca Romana de Dezvoltare	BRD	30-Jun-10	30,000	1.0000	10.7000	321,000.00	0.0043%	3.521%
Compa Sibiu	CMP	30-Jun-10	28,000	0.1000	0.3300	9,240.00	0.0128%	0.101%
Condmag Brasov	COMI	30-Jun-10	60,000	0.1000	0.7700	46,200.00	0.0261%	0.507%
Prospectiuni SA Bucuresti	PRSN	30-Jun-10	439,250	0.0000	0.2080	91,364.00	0.0612%	1.002%
Rompetrol Rafinare	RRC	29-Jun-10	672,000	0.1000	0.0660	44,352.00	0.0032%	0.487%
SIF 1 Banat Crisana	SIF1	30-Jun-10	150,700	0.1000	0.9900	149,193.00	0.0275%	1.637%
SIF 2 Moldova	SIF2	30-Jun-10	330,000	0.1000	0.9400	310,200.00	0.0636%	3.403%
SIF 3 Transilvania	SIF3	30-Jun-10	350,000	0.1000	0.4720	165,200.00	0.0320%	1.812%
SIF 4 Muntenia	SIF4	30-Jun-10	115,000	0.1000	0.6000	69,000.00	0.0142%	0.757%
SIF 5 Oltenia	SIF5	30-Jun-10	245,000	0.1000	1.1800	289,100.00	0.0422%	3.171%
OMV Petrom SA	SNP	30-Jun-10	1,855,700	0.1000	0.3030	562,277.10	0.0033%	6.168%
Transelectrica S.A.	TEL	30-Jun-10	7,150	10.0000	16.1000	115,115.00	0.0098%	1.263%
Transgaz SA	TGN	30-Jun-10	2,100	10.0000	215.3000	452,130.00	0.0166%	4.960%
TOTAL						2,673,540.90		29.327%

2. Drepturi de preferinta

Denumire	Simbol	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Cantitate	Pret Curent	Valoare Totala	Pondere în activul total al fondului
IMOTRUST SA ARAD	ARCVR01	30-Jun-10	1,500	0.0030	4.50	0.000%
TOTAL					4.50	0.000%

3. 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)	Creștere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%
ORAS LUGOJ	LGJ14	1,750	15-Jun-10	14-Sep-10	53.20	0.01	307.39	93,407.39	5.0000	1.025%
ORAS ORAVITA	ORV26	926	15-Apr-10	14-Oct-10	100.00	0.02	1,461.11	94,061.11	1.5433	1.032%
MUNICIPIUL TIMISOARA	TIM26C	1,000	15-May-10	14-Aug-10	91.60	0.02	781.63	92,381.63	0.0588	1.013%
TOTAL								279,850.13		3.070%

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	lei	%	%
S.C. Fondul Proprietatea S.A.	1,800,001	0.2747	494,460.27	0.0126	5.424%
TOTAL			494,460.27		5.424%

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO LA DATA DE 30.06.2010

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	lei	%	%
ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG	AT0000652011	25-Jun-10	1,096.00	26.3550	4.3688	126.193.14	0.0003	1.384%
TOTAL						126,193.14		1.384%

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	lei	lei	%	%
METRO FINANCE BV	XS0437761009	1	23-Jul-09	22-Jul-10	250.000.00	79.11	27.134.59	277.134.59	0.005%	3.040%
BANCA COMERCIALA ROMANA	XS0496326223	3	7-Apr-10	6-Apr-11	250.000.00	52.74	4.482.88	763.448.63	0.101%	8.374%
TOTAL								1,040,583.22		11.414%

Emitent	Cod ISIN	Nr. obligatiuni deținute	Data achiziției	Data scadența cupon	Valoare inițială	Crestere zilnică	Dobânda cumulată	Prima cumulata	Valoare actualizată	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al fondului
					lei	lei	lei	lei	%	%	%
METRO FINANCE BV	XS0437761009	1	22-Jun-10	22-Jul-10	268.813.50	79.11	27.134.59	222.21	295.725.8800	0.032%	3.244%
TOTAL									295,725.8800	0.032%	3.244%

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	%
OTP BANK ROMANIA	30-Jun-10	1-Jul-10	83,294.05	11.41	11.41	83,305.46	0.914%
Banca Romaneasca	28-Jun-10	5-Jul-10	1,014,957.00	194.65	583.95	1,015,540.95	11.140%
Banca Comerciala Romana	30-Jun-10	1-Jul-10	619,021.17	95.09	95.09	619,116.26	6.791%
PIRAEUS BANK	15-Jun-10	15-Jul-10	950,000.00	230.90	3,694.44	953,694.44	10.461%
TOTAL						2,671,657.11	29.306%

V. Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranz pe o piata reglementata cf art 101 (1) lit g:

1. Contracte de report pe titluri emise de administratia publica centrala

Seria emisiunii	Nr. Obligatiuni deținute	Data achiziției	Data scadența cupon	Valoare inițială	Dobânda zilnică	Dobânda cumulata	Valoare curentă	Banca intermediara	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent	Pondere în activ fond
RO0914DBN049	47	7-Jun-10	7-Jul-10	540,938.30	555.96	2,668.63	543,606.93	PIRAEUS BANK	0.0010%	5.963%
TOTAL							543,606.93			5.963%

V. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

Denumire Fond	Nr. unitati de fond	Valoare unitate de fond	Valoare actualizata	Pondere în activul total al fondului
		lei	lei	%
AVIVA INVESTORS CAPITAL PLUS	11,210.762332	9.4300	105,717.49	1.160%
FDI OMNITRUST	173,700.49	3.5621	618,738.52	6.787%
FDI OMNINVEST	33,494.10	5.2130	174,604.74	1.915%
TOTAL			899,060.75	9.862%

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FONDULUI DESCHIS DE INVESTITII OTP BALANSISRO LA DATA DE 30.06.2010

VI. Dividende sau alte drepturi de incasat

1. Dividende de incasat

Emitent	Simbol actiune	Data ex-dividend	Nr.actiuni detinute	Suma de incasat		Pondere in activul total al fondului
				lei	%	
SIF BANAT CRISANA S.A.	SIF1	14-May-10	150,700.00	6,781.00	0.074%	
SIF MOLDOVA S.A.	SIF2	13-May-10	230,000.00	12,420.00	0.136%	
SIF TRANSILVANIA S.A.	SIF3	13-May-10	350,000.00	9,450.00	0.104%	
SIF MUNTENIA S.A.	SIF4	13-May-10	115,000.00	4,140.00	0.045%	
SIF OLTENIA S.A.	SIF5	13-May-10	145,000.00	20,880.00	0.229%	
C.N.T.E.E. TRANSELECTRICA	TEL	13-May-10	7,150.00	321.50	0.004%	
S.N.T.G.N. TRANSGAZ S.A.	TGN	13-May-10	1,950.00	22,850.00	0.251%	
TOTAL				76,842.50	0.843%	

Evolutia activului net si a VUAN in ultimii 3 ani

	AN T-2 (30.06.2008)	AN T-1 (30.06.2009)	AN T (30.06.2010)
Activ Net	9,101,096.35	7,950,805.28	9,083,455.25
VUAN	9.88	8.52	9.50

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA
Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit

Mirela Vlase