

## SAI: OTP Asset Management Romania SAI SA

Decizie autorizata: P:PROSSAIR/400023 Cod inregistrare: J40/15502/15.08.2007  
 CUI: 22265941 Inregistrare ONRC: J40/15502/15.08.2007  
 Capital social: 5.795.323 RON Adresa: Bld Dacia, Nr 83, sector 2, Bucuresti

## OTP ComodisRO

Decizie autorizata: 377/27.02.2008  
 Cod inregistrare: CSC06/FDIR/400049

## Situatia activelor si obligatiilor in perioada 31.12.2011 - 30.06.2012

Denumire element	Inceputul perioadei de raportare				Sfarsitul perioadei de raportare				Diferenta (lei)
	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	% din activul net	% din activul total	Valuta (RON)	Lei	
<b>Total active</b>	<b>100.209%</b>	<b>100.000%</b>	<b>132.557.606.92</b>	<b>132.557.606.92</b>	<b>100.112%</b>	<b>100.000%</b>	<b>147.891.066.10</b>	<b>147.891.066.10</b>	<b>15.333.459.18</b>
1 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare:	37.37%	37.29%	49,442,428.69	49,442,428.69	27.33%	27.30%	40,381,591.49	40,381,591.49	(9,060,837.20)
11 Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	10.92%	10.89%	14,447,695.43	14,447,695.43	0.98%	0.98%	1,455,855.15	1,455,855.15	(12,991,840.28)
113 Obligatiuni, din care:	10.92%	10.89%	14,447,695.43	14,447,695.43	0.98%	0.98%	1,455,855.15	1,455,855.15	(12,991,840.28)
1132 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	10.86%	10.84%	14,375,733.83	14,375,733.83	0.93%	0.93%	1,385,321.72	1,385,321.72	(12,990,412.11)
1133 Obligatiuni cotate emise de autoritati ale administratiei publice locale	0.05%	0.05%	71,961.59	71,961.59	0.04%	0.04%	70,533.43	70,533.43	(1,428.17)
12 Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru, din care:	26.45%	26.40%	34,994,733.26	34,994,733.26	26.35%	26.32%	38,925,736.34	38,925,736.34	3,931,003.08
123 Obligatiuni	26.45%	26.40%	34,994,733.26	34,994,733.26	26.35%	26.32%	38,925,736.34	38,925,736.34	3,931,003.08
1231 Obligatiuni tranzactionate corporative	24.05%	24.00%	31,822,583.95	31,822,583.95	24.17%	24.15%	35,718,693.27	35,718,693.27	3,896,109.33
1232 Obligatiuni emise de administratia publica locala denumite in valuta	1.42%	1.42%	1,886,425.02	1,886,425.02	1.29%	1.29%	1,915,985.32	1,915,985.32	29,560.30
1233 Obligatiuni emise de administratia publica centrala	0.97%	0.97%	1,285,724.30	1,285,724.30	0.87%	0.87%	1,291,057.75	1,291,057.75	5,333.45
2 Disponibil in cont curent	1.10%	1.10%	1,463,996.15	1,463,996.15	0.71%	0.71%	1,053,314.26	1,053,314.26	(410,681.90)
201 ALPHA BANK ROMANIA	0.00%	0.00%	479.73	479.73	0.00%	0.00%	389.73	389.73	(90.00)
203 BANCA ROMANIEASCA	0.00%	0.00%	2,492.29	2,492.29	0.00%	0.00%	2,484.29	2,484.29	(8.00)
204 BRD-GROUP SOCIETE GENERAL	0.00%	0.00%	119.57	119.57	0.00%	0.00%	2,554.01	2,554.01	2,434.44
205 CEC BANK	0.01%	0.01%	729.32	729.32	0.00%	0.00%	729.41	729.41	0.09
207 OTP BANK ROMANIA	1.07%	1.06%	1,416,135.13	1,416,135.13	0.70%	0.70%	1,038,624.25	1,038,624.25	(377,510.88)
208 PIRAEUS BANK ROMANIA	0.02%	0.02%	29,826.11	29,826.11	0.00%	0.00%	642.69	642.69	(29,183.42)
210 Procredit Bank	0.00%	0.00%	63.39	63.39	0.00%	0.00%	63.39	63.39	-
212 Banc Post SA	0.00%	0.00%	1,916.21	1,916.21	0.00%	0.00%	1,774.21	1,774.21	(142.00)
213 Banca Italo-Romana	0.00%	0.00%	139.01	139.01	0.00%	0.00%	519.18	519.18	380.17
214 Banca Comerciala Romana - EURO	0.00%	0.00%	9,158.15	9,158.15	0.00%	0.00%	158.98	158.98	(8,999.18)
218 Banca Carpatica	0.00%	0.00%	2,780.94	2,780.94	0.00%	0.00%	2,702.94	2,702.94	(78.00)
219 Credit Europ Bank SA	0.00%	0.00%	100.00	100.00	0.00%	0.00%	86.70	86.70	(13.30)
220 Garanti Bank	0.00%	0.00%	-	-	0.00%	0.00%	100.00	100.00	100.00
221 UNICREDIT TIRIAC BANK	0.00%	0.00%	56.30	56.30	0.00%	0.00%	2,424.59	2,424.59	2,368.29
222 Banca C.R. Firenze Romania	0.00%	0.00%	-	-	0.00%	0.00%	59.89	59.89	59.89
3 Depozite bancare:	62.54%	62.41%	82,736,794.03	82,736,794.03	66.16%	66.08%	97,736,396.16	97,736,396.16	14,999,602.13
31 Depozite bancare consultate la instituti de credit din Romania:	62.54%	62.41%	82,736,794.03	82,736,794.03	66.16%	66.08%	97,736,396.16	97,736,396.16	14,999,602.13
311 OTP BANK ROMANIA	0.94%	0.94%	1,253,340.37	1,253,340.37	8.42%	8.42%	12,456,809.52	12,456,809.52	11,203,469.14
3125 Credit Europe Bank SA	15.75%	15.72%	20,840,593.47	20,840,593.47	17.45%	17.43%	25,777,724.65	25,777,724.65	4,937,131.18
3126 Garanti Bank	17.10%	17.06%	22,626,534.74	22,626,534.74	2.88%	2.87%	4,253,997.77	4,253,997.77	(18,372,536.97)
314 BANCA COMERCIALA ROMANA	0.04%	0.04%	63,193.08	63,193.08	0.03%	0.03%	52,728.85	52,728.85	(10,464.23)
318 Banca Italo-Romana	11.14%	11.09%	14,701,268.41	14,701,268.41	13.95%	13.94%	20,621,726.82	20,621,726.82	5,920,458.41
320 Unicredit Tiriac BANK	17.57%	17.54%	23,251,863.96	23,251,863.96	5.74%	5.73%	8,483,575.00	8,483,575.00	(14,768,288.96)
322 BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	0.00%	0.00%	-	-	17.66%	17.64%	26,089,833.56	26,089,833.56	26,089,833.56
5 Instrumente financiare derivate tranzactionate in afara pietelor reglementate	-0.02%	-0.02%	(34,085.00)	(34,085.00)	-0.01%	-0.01%	(14,725.00)	(14,725.00)	19,360.00
51 Contracte Forward	-0.02%	-0.02%	(34,085.00)	(34,085.00)	-0.01%	-0.01%	(14,725.00)	(14,725.00)	19,360.00
6 Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranz pe o piata reglementata cf art.101 (1) lit g:	-0.08%	-0.07%	(8,050,898.91)	(8,050,898.91)	-0.07%	-0.07%	(117,100.11)	(117,100.11)	7,933,798.80
63 Titluri de stat emise de administratia publica centrala	0.02%	0.02%	29,518.36	29,518.36	0.00%	0.00%	-	-	(29,518.36)
64 Contracte reverse-repo <1an	-4.10%	-4.06%	(8,080,417.27)	(8,080,417.27)	-0.07%	-0.07%	(117,100.11)	(117,100.11)	7,963,317.16
7 Titluri de participare la OPCVM/ADPC	5.29%	5.28%	6,999,372.82	6,999,372.82	5.92%	5.96%	8,851,590.30	8,851,590.30	1,852,217.48
9 Alte active, din care:	0.00%	0.00%	(0.87)	(0.87)	0.00%	0.00%	(1.00)	(1.00)	(0.13)
93 Suma in curs de rezolvare	0.00%	0.00%	(0.87)	(0.87)	0.00%	0.00%	(1.00)	(1.00)	(0.13)
<b>Total obligatii</b>			<b>276,922.91</b>	<b>276,922.91</b>			<b>165,088.22</b>	<b>165,088.22</b>	<b>(111,834.69)</b>
10 CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligatii)	0.20%	0.20%	276,922.91	276,922.91	0.11%	0.11%	165,088.22	165,088.22	(111,834.69)
101 Comisioane datorate soc. de admin.	0.10%	0.10%	138,422.39	138,422.39	0.09%	0.09%	137,211.26	137,211.26	(1,211.14)
102 Comisioane datorate depozitarului	0.01%	0.01%	17,134.94	17,134.94	0.00%	0.00%	13,689.22	13,689.22	(3,445.72)
103 Taxa CNVM	0.00%	0.00%	11,021.75	11,021.75	0.00%	0.00%	11,885.29	11,885.29	863.54
106 Cheltuieli de audit	0.00%	0.00%	2,343.26	2,343.26	0.00%	0.00%	822.62	822.62	(1,520.64)
107 Comision custodie	0.00%	0.00%	1,143.43	1,143.43	0.00%	0.00%	1,093.43	1,093.43	(50.00)
108 Rasumprari neplatite	0.08%	0.08%	106,857.13	106,857.13	0.00%	0.00%	-	-	(106,857.13)
110 Cheltuieli estimate	0.00%	0.00%	-	-	0.00%	0.00%	386.40	386.40	386.40
<b>III Valoarea activului net (I - II)</b>			<b>132,280,684.01</b>	<b>132,280,684.01</b>			<b>147,725,977.88</b>	<b>147,725,977.88</b>	

Denumire element	La data de 31.12.2011	La data de 30.06.2012	Diferenta
Valoarea activ net	132,280,684.01	147,725,977.88	15,445,293.87
Numar unitati de fondfacturi in circulatie	9,471,054,1200	10,238,694,2966	768,639.18
Valoarea unitara a activului net	13.9668	14.4298	0.46

## OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu

FDI OTP ComodisRO – Situația detaliată a investițiilor la data de 29.06.2012

I. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piața reglementată din România

5. Obligatiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale

Emitent	Simbol obligatiune	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni defuzivă	Data achiziției	Data decontării	Data scadenței cupon	Valoarea inițială		Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(s)	Preț piață	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitenț		Pondere în activul total al OPC	
							lei	lei						lei	lei	%	%
PRIMARIA ORAVTA	ORV27	-	741	-	13-May-08	16-Apr-12	15-Sep-12	94,00	lei	0,02	lei	1,19	-	70,533.43	1,2500%	0,048%	
<b>TOTAL</b>														<b>70,533.43</b>		<b>0,048%</b>	

6. Obligatiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale

Serie	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni defuzivă	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Valoarea inițială		Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/prima cumulată(s)	Preț piață	Valoarea totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni emitenț		Pondere în activul total al OPC	
						lei	lei							lei	lei	%	%
RO1146BN24	-	1	-	22-Mar-12	30-Apr-12	30-Apr-12	9,927.66	1.69	100.27	4.82	-	10,002.76	BRD Grupa Societate Generale	0.0000%	0.007%		
RO1246BN27	-	125	-	8-May-12	29-Apr-12	29-Apr-12	1,260,433.49	188.17	13,856.16	-773.39	-	1,273,516.27	Banca Comercială Română	0.0019%	0.861%		
RO1246BN27	-	15	-	8-May-12	29-Apr-12	29-Apr-12	193,717.38	15.39	1,108.45	-63.18	-	193,717.39	Banca Comercială Română	0.0001%	0.095%		
<b>TOTAL</b>												<b>1,286,221.72</b>			<b>0.937%</b>		

II. Valori mobiliare admise sau tranzactionate pe o piața reglementată din alt stat membru

2. Obligatiuni admise la tranzacționare

2.1. Obligatiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni defuzivă	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon		Valoarea inițială	Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(s)	Preț piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitenț		Pondere în activul total al OPC	
							eur	eur								eur	eur	lei	lei
City of Bucharest	XS022426471	-	5	-	31-May-11	20-Jun-12	22-Jun-12	47,000.00	eur	7,67	eur	46,21	801.08	-	4,4684	1,916,985.32	0.0900%	1.286%	
<b>TOTAL</b>																<b>1,916,985.32</b>		<b>1.286%</b>	

2.2. Obligatiuni admise la tranzacționare corporative denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni defuzivă	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon		Valoarea inițială	Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(s)	Preț piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitenț		Pondere în activul total al OPC	
							eur	eur								eur	eur	lei	lei
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY	XS050403275	-	275	-	24-May-11	20-Apr-12	20-Apr-12	993.10	0.16	11.43	1.29	-	4,4694	1,230,702.15	0.0367%	0.832%			
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY	XS050403275	-	260	-	1-Nov-11	20-Apr-12	20-Apr-12	996.25	0.19	11.43	7.73	-	4,4694	1,155,252.71	0.0347%	0.747%			
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PUBLIC LIMITED COMPANY	XS050403275	-	550	-	8-May-12	20-Apr-12	20-Apr-12	940.00	0.19	11.43	1.76	-	4,4694	2,332,810.45	0.0733%	1.577%			
OTP BANK RT	XS0214084252	-	12	-	13-Oct-10	6-Jun-12	4-Sep-12	38,750.00	8.09	40.47	4,002.81	-	4,4694	2,338,245.51	0.0024%	1.581%			
OTP BANK RT	XS0214084252	-	10	-	7-Jan-11	6-Jun-12	4-Sep-12	38,500.00	9.27	40.47	4,393.01	-	4,4694	1,896,965.42	0.0020%	1.283%			
OTP BANK RT	XS0214084252	-	2	-	14-Jun-11	6-Jun-12	4-Sep-12	41,187.50	8.73	40.47	2,477.10	-	4,4694	398,923.62	0.0024%	0.252%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	260	-	24-Dec-10	19-Sep-11	19-Sep-12	870.00	0.21	41.04	34.36	-	4,4694	1,177,869.55	0.0574%	0.796%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	290	-	24-Dec-10	19-Sep-11	19-Sep-12	896.00	0.21	41.04	35.42	-	4,4694	1,216,073.98	0.0577%	0.822%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	260	-	24-May-11	19-Sep-12	19-Sep-12	960.00	0.18	41.04	14.58	-	4,4694	977,022.59	0.0388%	0.597%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	250	-	19-Oct-11	19-Sep-12	19-Sep-12	790.00	0.27	41.04	31.30	-	4,4694	944,123.29	0.0455%	0.647%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	260	-	18-Oct-11	19-Sep-12	19-Sep-12	790.00	0.28	41.04	29.90	-	4,4694	995,969.54	0.0517%	0.673%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	640	-	23-Nov-11	19-Sep-12	19-Sep-12	790.00	0.28	41.04	29.97	-	4,4694	2,386,577.18	0.1274%	1.600%			
OTP BANK NYRT	XS080820800	-	160	-	29-Jun-12	19-Sep-12	19-Sep-12	833.40	0.28	41.04	0.62	-	4,4694	369,167.96	0.0199%	0.263%			
ZAGREBACK HOLDING DOO	XS020989181	-	10	-	6-Oct-10	10-Jan-11	10-Jan-12	42,223.00	10.60	2,674.69	1,993.35	-	4,4694	2,098,462.53	0.1867%	1.211%			
<b>TOTAL</b>																<b>19,349,891.87</b>		<b>13.084%</b>	

2.3. Obligatiuni admise la tranzacționare corporative denumite în RON

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni defuzivă	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon		Valoarea inițială	Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(s)	Preț piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitenț		Pondere în activul total al OPC	
							lei	lei								lei	lei	lei	lei
Banca Comercială Română	XS049632023	-	7	-	12-Apr-10	7-Apr-12	7-Apr-12	250,000.00	52.74	4,430.14	0.00	-	1,781,010.98	0.0749%	1.024%				
Banca Comercială Română	XS073884734	-	12	-	14-Feb-12	31-Jan-12	31-Jan-12	250,641.03	48.97	7,529.37	-122.48	-	3,096,574.99	0.1278%	2.044%				
Bank Of Ireland	XS054476298	-	6	-	4-Oct-10	4-Oct-10	4-Oct-10	250,000.00	67.62	18,299.20	0.00	-	1,699,549.18	0.0280%	1.088%				
FINANCIERINGSGESELLSCHAFT N.V.	XS0483176342	-	8	-	21-Mar-11	12-Feb-12	12-Feb-12	257,516.74	30.99	8,070.36	-717.57	-	2,118,556.22	0.0549%	1.433%				
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS0454824995	-	8	-	9-Dec-10	19-Aug-11	19-Aug-12	526,899.50	123.82	47,732.19	-15,604.51	-	4,471,716.57	0.0001%	3.024%				
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS0454824995	-	3	-	29-Jan-11	19-Aug-11	19-Aug-12	540,079.24	118.21	47,782.19	-17,691.29	-	1,883,810.48	0.0000%	1.188%				
Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG	XS048182522	-	1	-	18-Oct-11	19-Nov-11	19-Nov-12	579,520.35	113.82	38,136.72	-12,823.27	-	542,864.00	0.0000%	0.395%				
Unicredit Bank AG	XS063382738	-	2	-	5-Aug-11	20-Oct-11	20-Oct-12	500,000.00	122.95	31,268.91	0.00	-	1,082,459.02	0.0003%	0.718%				
<b>TOTAL</b>																<b>16,969,061.46</b>		<b>11.688%</b>	

2.4. Obligatiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în EUR

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei sedințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligatiuni defuzivă	Data achiziției	Data decontării	Data cupon	Data scadenței cupon		Valoarea inițială	Creșterea zilnică	Dobanda cumulată	Discount/ prima cumulată(s)	Preț piață	Curs valutar BNR EUR/RON	Valoarea totală	Pondere în total obligatiuni emitenț		Pondere în activul total al OPC	
							eur	eur								eur	eur	lei	lei
Hungarian Development Bank	XS0632248802	-	300	-	23-Sep-11	31-May-12	31-May-12	955.00	0.19	4.63	7.39	-	4,4694	1,291,067.75	0.0600%	0.873%			
<b>TOTAL</b>																<b>1,291,067.75</b>		<b>0.873%</b>	

IX. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar în lei

Denumire banca	Valoare curentă	Pondere în activul total al OPC	
		lei	%
Alpha Bank	369.73	0.000%	
Bank Post SA	1,714.23	0.001%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	59.89	0.000%	
Banca Comercială Capitalia	2,702.94	0.002%	
Banca Comercială Romania	0.00	0.000%	
BANCA ITALICROMENA	519.18	0.002%	
Banca Romaneasca	2,484.29	0.002%	
BRD Grupa Societate Generale	2,554.01	0.002%	
CEC Bank SA	720.41	0.000%	
CEC Bank SA	0.00	0.000%	
CREDIT EUROPE BANK SA	86.70	0.000%	
Garanti Bank	100.00	0.000%	
OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000%	

OTP BANK ROMANIA	0.00	0.000%
OTP BANK ROMANIA	68.441.25	0.048%
OTP BANK ROMANIA	53.986.50	0.037%
OTP BANK ROMANIA	219.900.00	0.149%
OTP BANK ROMANIA	112.070.00	0.076%
OTP BANK ROMANIA	90.346.00	0.061%
OTP BANK ROMANIA	112.945.00	0.078%
OTP BANK ROMANIA	96.710.00	0.066%
OTP BANK ROMANIA	29.487.00	0.020%
OTP BANK ROMANIA	56.497.50	0.038%
PIRAEUS BANK	642.69	0.000%
PIRAEUS BANK	63.39	0.000%
PIRAEUS BANK	2.424.59	0.002%
OTP BANK ROMANIA	244.935.00	0.165%
<b>TOTAL</b>	<b>1,063,185.29</b>	<b>0.712%</b>

## 2. Disponibilii in conturi curente si numerar denuminate in EUR

Denumire banca	Valoare curenta		Curs valutar BNR EURRON		Valoare actualizata - lei		Pondere in activul total al OPC	
	eur	lei	lei	%	lei	%		%
Banca Comerciala Romana	50.73	4.484	0.00	0.000%	158.86	0.007%		
BRO Group Societe Generale	0.00	4.484	0.00	0.000%				
OTP BANK ROMANIA	0.00	4.484	0.00	0.000%				
PIRAEUS BANK	0.00	4.484	0.00	0.000%				
<b>TOTAL</b>			<b>158.86</b>	<b>0.007%</b>				

## X. Depozite bancare constituite la instituti de credit din Romania

### 1. Depozite bancare denuminate in lei

Denumire banca	Data constituirii	Data scadentei	Valoare initiala		Crestere zilnica		Dobanda cumulata	Valoare totala		Pondere in activul total al OPC
			lei	%	lei	%		lei	%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	21-May-12	12-Jul-12	3,000,000.00		493.15		19,726.03	3,019,726.03	2.042%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	21-May-12	2-Jun-12	2,648,900.00		436.01		17,400.33	2,666,300.33	1.801%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	21-May-12	9-Jun-12	3,000,000.00		493.15		19,726.03	3,019,726.03	2.042%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	22-Jun-12	22-Jun-12	4,999,950.00		805.01		6,894.46	5,006,844.46	3.380%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	19-Jun-12	19-Jun-12	9,592,000.00		1,569.03		17,379.39	9,579,620.61	6.477%	
BANCA C.R. FIRENZE ROMANIA S.A.	20-Jun-12	30-Jun-12	2,800,000.00		467.95		467.95	2,800,467.95	1.894%	
Banca Comerciala Romana	29-Jun-12	30-Jun-12	52,723.27		5.58		5.58	52,728.85	0.036%	
BANCA ITALO-ROMENA	7-Mar-12	6-Mar-12	3,358,750.00		632.22		72,705.01	3,431,455.01	2.307%	
BANCA ITALO-ROMENA	9-Sep-12	9-Aug-12	4,500,000.00		906.16		134,112.33	4,634,112.33	3.133%	
BANCA ITALO-ROMENA	7-Feb-12	7-Nov-12	5,094,500.00		1,039.84		149,736.43	5,244,236.43	3.549%	
BANCA ITALO-ROMENA	6-Mar-12	6-Mar-12	1,000,000.00		187.67		21,769.86	1,021,769.86	0.691%	
BANCA ITALO-ROMENA	9-Apr-12	9-Oct-12	2,186,660.00		462.76		53,777.13	2,240,437.13	1.503%	
BANCA ITALO-ROMENA	9-Apr-12	6-Aug-12	2,000,000.00		342.47		29,452.03	2,029,452.03	1.374%	
BANCA ITALO-ROMENA	9-Apr-12	9-Jun-12	2,000,000.00		328.77		28,273.87	2,028,273.87	1.371%	
CREDIT EUROPE BANK SA	6-Jun-12	6-Jun-12	1,016,700.00		167.13		4,011.09	1,020,711.09	0.690%	
CREDIT EUROPE BANK SA	19-Jun-12	19-Jun-12	4,755,000.00		781.71		8,589.98	4,763,589.98	3.207%	
CREDIT EUROPE BANK SA	19-Jun-12	20-Jun-12	3,500,000.00		575.34		6,328.77	3,506,328.77	2.371%	
CREDIT EUROPE BANK SA	19-Jun-12	27-Jun-12	3,500,000.00		575.34		6,328.77	3,506,328.77	2.371%	
CREDIT EUROPE BANK SA	19-Jun-12	31-Jul-12	3,000,000.00		493.15		5,424.66	3,005,424.66	2.029%	
CREDIT EUROPE BANK SA	20-Jun-12	30-Jun-12	3,607,700.00		592.68		1,188.09	3,608,888.09	2.440%	
CREDIT EUROPE BANK SA	20-Jun-12	30-Jun-12	6,944,900.00		1,048.28		1,048.28	6,945,948.28	4.304%	
Sarati Bank	11-Jun-12	11-Jun-12	4,241,447.28		860.55		12,550.51	4,253,997.77	2.876%	
OTP BANK ROMANIA	11-Jun-12	11-Jun-12	5,000,000.00		824.68		17,568.49	5,017,568.49	3.393%	
OTP BANK ROMANIA	20-Jun-12	20-Jun-12	1,000,000.00		164.93		384.68	1,000,384.68	0.677%	
OTP BANK ROMANIA	20-Jun-12	2-Jun-12	5,437,684.50		446.90		446.90	5,438,131.43	3.677%	
OTP BANK ROMANIA	20-Jun-12	30-Jun-12	1,000,000.00		164.93		184.93	1,000,184.93	0.679%	
UniCredit Trade Bank	19-Mar-12	15-Jan-13	1,300,000.00		292.78		27,047.22	1,327,047.22	0.897%	
UniCredit Trade Bank	7-Mar-12	7-Jan-13	7,000,000.00		1,381.11		156,327.79	7,156,327.79	4.839%	
<b>TOTAL</b>							<b>87,736,366.16</b>	<b>60.997%</b>		

## XII. Instrumente financiare derivate negociate in afara pietelor regulate

### 1. Contracte forward

Contigapate	Cantitate	Tip contract	Data achizitiei	Data scadentei	Preț de exercitare		Curs valutar BNR EURRON		Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totala		Pondere in activul total al OPC
					lei	%	lei	%			lei	%	
OTP BANK ROMANIA	250,000.00	V	10-Apr-12	12-Jun-12	4.3959		4.4894	4.4907	-0.0861		-18,525.00	-0.011%	
OTP BANK ROMANIA	800,000.00	V	19-Apr-12	16-Jun-12	4.3953		4.4894	4.4907	-0.0948		-31,840.00	-0.020%	
OTP BANK ROMANIA	200,000.00	V	17-Apr-12	16-Jun-12	4.3973		4.4894	4.4907	-0.0934		-12,880.00	-0.008%	
OTP BANK ROMANIA	1,000,000.00	V	21-Jun-12	25-Sep-12	4.5178		4.4894	4.4971	0.0207		20,700.00	0.014%	
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	27-Jun-12	29-Sep-12	4.4989		4.4894	4.4986	-0.0018		-900.00	-0.001%	
OTP BANK ROMANIA	200,000.00	V	27-Jun-12	29-Sep-12	4.4971		4.4894	4.4986	-0.0012		-240.00	0.000%	
OTP BANK ROMANIA	800,000.00	V	20-Jun-12	24-Sep-12	4.5173		4.4894	4.4966	0.0207		16,560.00	0.011%	
OTP BANK ROMANIA	1,000,000.00	V	19-Jun-12	21-Sep-12	4.5148		4.4894	4.4952	0.0196		18,600.00	0.013%	
OTP BANK ROMANIA	500,000.00	V	20-Jun-12	28-Sep-12	4.5198		4.4894	4.4986	0.0212		18,600.00	0.013%	
<b>TOTAL</b>											<b>-14,725.00</b>	<b>-0.010%</b>	

## XIII. Instrumente ale pietei monetare, altele decat cele tranzactionate pe o piata reglementata, conf. art. 101(1), lit.g din legea nr 297/2004

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

Serie emittenti	Tipul de instrument	Nr. titluri delimitate	Data achizitiei	Data scadentei	Valoare inițială		Crestere zilnică		Dobanda cumulată	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent		Pondere în activul total al OPC	
					lei	%	lei	%				lei	%	lei	%
RO114265011	Repo	500	19-Jun-12	19-Jul-12	-9,557,077.46		-1,473.38		-16,207.21	-9,573,284.67	BCR		0.010%		-4.473%
<b>TOTAL</b>										<b>-9,573,284.67</b>					<b>-4.473%</b>

Serie emittenti	Data ultimei emisiuni în care s-a tranzactionat	Numar obligatiuni delimitate	Data achizitiei	Data decontării	Data cupon	Data scadentei cupon		Valoare inițială		Crestere zilnică		Dobanda cumulată	Discount/prime cumulată (s)	Preț piață	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligatiuni ale unui emitent		Pondere în activul total al OPC	
						lei	%	lei	%	lei	%						lei	%	lei	%
RO101302623	-	500	-	1-Apr-11	25-Jul-11	25-Jul-12	5,380,520.08	1,099.80	305,209.81	58,549.46					5,789,539.25	BRO Group Societe Generale		0.000%		3.911%
RO101302623	-	300	-	27-Jul-11	29-Jul-11	29-Jul-12	3,468,292.52	641.77	203,808.09	14,744.63					3,686,845.21	Rafincoen Bank		0.004%		2.493%
<b>TOTAL</b>															<b>9,476,384.46</b>					<b>6.404%</b>

## XIV. Titluri de participare la OPCVM / AOPC

1. Titluri de participare denuminate in lei

Denumire fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond delimitate	Valoarea unitate de fond (VUAN)		Preț plată	Valoarea totală	Pondere in total titluri de participare	
			lei	lei			%	%
FDI CERTINVEST TEZAUJ	-	22,072,727(15)	74,80	-	1,651,040,00	22,290%	1,116%	
FDI CERTINVEST OBLIGATIUNI	-	231,895,895(29)	23,85	-	5,535,214,82	24,438%	3,743%	
FDI OTP OBLIGATIUNI	-	63,178,890(0)	11,812	-	748,389,93	3,537%	0,505%	
<b>TOTAL</b>					<b>7,932,644,55</b>		<b>5,364%</b>	

2. Titluri de participare denuminate in EUR

Denumire Fond	Data ultimei sedinte in care s-a tranzactionat	Nr. unitati de fond delimitate	Valoarea unitate de fond (VUAN)		Preț plată	Curs valutar BNR EURRON	Valoarea totală	Pondere in total titluri de participare	
			eur	eur				%	%
FDI OTP EURO BOND	-	19,243,599(0)	10,7007	-	4,4464	975,045,90	2,052%	0,621%	
<b>TOTAL</b>						<b>975,045,90</b>		<b>0,621%</b>	

Evoluția activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	An T-2	An T-1	An T
Activ net	122,263,062,99	132,280,684,00	147,729,977,88
VUAN	13,1163	13,5668	14,4263

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA  
Președinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Director Control Intern

Mirela Liliana Chiritescu