

SITUATIA ACTIVELOR SI OBLIGATIILOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT OTP WiseRO

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 din care:	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1.1. Valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata din Romania:	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1.2. Valori mobiliare si instrumente monetare admise sau tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1.3. 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	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2. Valori mobiliare nou emise	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
3. Alte valori mobiliare si instrumente ale pietei monetare mentionate la art.102 (1) lit.a) L297/2004	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4. DISPONIBIL IN CONTURI CURENTE SI NUMERAR	0.02	0.02	1,351.19	0.06	0.06	4,694.92	3,343.73
APLHA BANK ROMANIA	0.00	0.00	106.33	0.00	0.00	30.47	-75.86
BANCA COMERCIALA ROMANA	0.00	0.00	64.11	0.01	0.01	619.77	555.66
BANCA ROMANEASCA	0.00	0.00	132.50	0.00	0.00	5.37	-127.13
CEC BANK	0.00	0.00	130.84	0.01	0.01	498.53	367.69
OTP BANK BUDAPESTA	0.01	0.01	674.35	0.01	0.01	876.66	202.31
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	0.00	0.01	243.06	0.00	0.00	34.36	-208.70
BRD	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	126.39	126.39
MKB ROMEXTERRA	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26.60	26.60
PROCREDIT BANK	0.00	0.00	0.00	0.03	0.03	2,476.77	2,476.77
DEPOZITE BANCARE	108.56	107.67	9,110,306.79	107.46	106.06	9,094,839.01	-15,467.78
5. DEPOZITE BANCARE din care:	108.56	107.67	9,110,306.79	107.46	106.06	9,094,839.01	-15,467.78
5.1. Depozite bancare constituite la institutii de credit din Romania	87.04	86.34	7,304,864.45	86.19	85.07	7,295,262.45	-9,602.00
CEC BANK	21.31	21.14	1,788,305.23	0.00	0.00	0.00	-1,788,305.23
OTP BANK ROMANIA	21.63	21.45	1,814,893.24	21.30	21.03	1,802,957.46	-11,935.78
BANCA ROMANEASCA S.A.	21.52	21.35	1,806,180.84	21.80	21.51	1,844,821.94	38,641.10
ALPHA BANK ROMANIA S.A.	21.53	21.35	1,806,769.19	21.79	21.50	1,844,057.34	37,288.15
PIRAEUS BANK ROMANIA S.A.	1.06	1.05	88,715.94	21.31	21.03	1,803,425.71	1,714,709.77
Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat nemembru		0.00	0.00		0.00	0.00	0.00
INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE PE O PIATA REGLEMENTATA		0.00	0.00		0.00	0.00	0.00
5.2. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat membru	21.51	21.34	1,805,442.35	21.26	20.99	1,799,576.57	-5,865.78
OTP Bank Ungaria	21.51	21.34	1,805,442.35	21.26	20.99	1,799,576.57	-5,865.78
5.3. Depozite bancare constituite la institutii de credit dintr-un stat nemembru	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
6. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA:	-7.75	-7.69	-650,505.06	-6.20	-6.11	-524,341.08	-1,174,846.14
6.1. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata din Romania		0.00	0.00		0.00	0.00	0.00
6.2. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat membru	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
6.3. Instrumente financiare derivate tranzactionate pe o piata reglementata dintr-un stat nemembru	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
6.4. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE TRANZACTIONATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE	-7.75	-7.69	-650,505.06	-6.20	-6.11	-524,341.08	-1,174,846.14
7. INSTRUMENTE ALE PIETEI MONETARE, ALTELE DECAT CELE TRANZACTIONATE PE O PIATA REGLEMENTATA, CONF. ART.101(1), lit.g DIN LEGEA NR.297/2004	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
8. TITLURI DE PARTICIPARE LA OPCVM/AOPC	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
9. ALTE ACTIVE	0.00	0.00	-50.00	0.00	0.00	-50.00	0.00
I. TOTAL ACTIVE	100.83	100.00	8,461,102.92	100.83	100.01	8,575,142.85	114,039.93

Impozit pe venit	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Cheltuieli estimate	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
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	0.04	0.04	3,382.56	0.02	0.02	1,706.98	-1,675.58
Comisioane subscriere	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Rascumparari de achitat	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Comision scrisoare garantie bancara	0.41	0.41	34,793.20	0.92	0.91	77,887.36	43,094.16
Activ net pentru calcul comisioane (ANCC)			8,422,927.17			8,973,801.50	550,874.33
Comisioane Depozitar	0.09	0.09	7,504.27	0.10	0.09	8,058.32	554.05
Comisioane Administrare	0.28	0.27	23,088.09	0.28	0.28	23,786.56	698.47
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	0.82	0.81	68,768.12	1.32	1.30	111,439.22	42,671.10
III. ACTIV NET (I - II)	RON	RON	8,392,334.80	RON	RON	8,463,703.63	71,368.83

Situatia valorii unitare a activului net	
Denumire element	Perioada curenta 31.03.2010
Valoare activ net	8,463,703.63
Numar de unitati de fond in circulatie	44,739.00
Valoare unitara a activului	189.18

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit

Alina Mihaescu

SITUATIA DETALIATA A ACTIVELOR FONDULUI INCHIS DE INVESTITII CU CAPITAL GARANTAT OTP WiseRO LA DATA DE 30.06.2010

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-May-10	31-Aug-10	1,789,560.00	318.69	9,879.35	1,799,439.35	20.984%
OTP BANK ROMANIA	30-Jun-10	1-Jul-10	3,517.87	0.24	0.24	3,518.11	0.041%
Alpha Bank	30-Jun-10	31-Jul-10	1,843,628.00	429.34	429.34	1,844,057.34	21.505%
Banca Romaneasca	30-Jun-10	30-Jul-10	1,844,400.00	421.94	421.94	1,844,821.94	21.514%
PIRAEUS BANK	30-Jun-10	30-Jun-10	1,803,000.00	425.71	425.71	1,803,425.71	21.031%
TOTAL						7,295,262.45	85.075%

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 BUDAPESTA	31-May-10	31-Aug-10	1,789,560.00	323.12	10,016.57	1,799,576.57	20.986%
TOTAL						1,799,576.57	20.986%

II. INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE NEGOCIATE IN AFARA PIETELOR REGLEMENTATE

1. Contracte swap pe rata dobanzii

Contraparte	Capital initial (notional)	Data achizitie	Data scadentei	Data coteliei	Cotatie contraparte	Profit	Pondere in activul total al fondului
	lei			lei	lei	lei	%
BRD Groupe Societe Generale	8,947,800.00	11-Aug-09	31-Dec-12	30-Jun-10	5.8600	524,341.08 -	-6.115%
TOTAL						-524,341.08	-6.115%

Evoluția activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	AN T-2	AN T-1	AN T
Activ Net	-	-	8,463,703.63
VUAN	-	-	189.18

OTP ASSET MANAGEMENT ROMANIA SAI SA

Presedinte Directorat

Catalin Jianu Dan Iancu

Intocmit

Alina Mihaescu