

Formular 1: CA
 Acoperirea riscului la riscuri

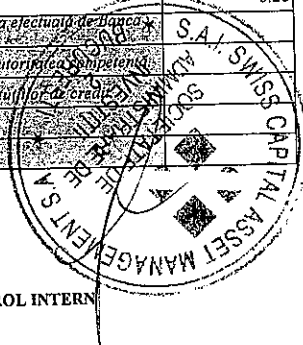
Indicativ	*Nr. Crt	Eticheta	Valoare (LEI)
T	1	FONDURI PROPRII TOTALE	2.489.203 16
T	1.1	FONDURI PROPRII DE NIVEL 1	2.489.203 16
T	1.1.1	Capital eligibil	430.000 00
N	1.1.1*	din care: instrumente non-inovative subiect al limitei	
N	1.1.1**	din care: instrumente inovative subiect al limitei	
T	1.1.1.1	Capital social subscris și vărsat	430.000 00
T	1.1.1.2	(-) Acțiuni proprii	
T	1.1.1.3	Prime de capital	
C	1.1.1.4	Alte instrumente eligibile de capital	
T	1.1.2	Rezerve eligibile	2.059.203 16
T	1.1.2.1	Rezerve	2.059.203 16
T	1.1.2.1.01	Rezerve (inclusiv diferențe din evaluare)	
C	1.1.2.1.02	Parte a rezervelor care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
C	1.1.2.2	Interes minoritar	0,00
C	1.1.2.2.01	Interes minoritar (inclusiv diferențe din evaluare)	
C	1.1.2.2.02	Parte a interesului minoritar care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
C	1.1.2.2.03	(-) Ajustări la interesul minoritar	
N	1.1.2.2*	din care: instrumente non-inovative supuse limitării	
N	1.1.2.2**	din care: instrumente inovative supuse limitării	
T	1.1.2.3	Rezultatul net al exercițiului financiar curent reprezentând profit	0,00
T	1.1.2.3.01	Profit auditat din anul curent	
C	1.1.2.3.02	Parte a profitului auditat din anul curent, care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
T	1.1.2.4a	Pierdere perioadei curente	0,00
T	1.1.2.4a.01	Rezultatul neauditat (profit sau pierdere) din anul curent	
C	1.1.2.4a.02	Parte a rezultatului neauditat din anul curent, care urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
T	1.1.2.4b	Rezultatul net al exercițiului financiar curent reprezentând pierdere	
T	1.1.2.4b.01	(-) Profit sau pierdere curentă	
C	1.1.2.4b.02	Parte a rezultatului negativ din anul curent ce urmează să fie ajustată potrivit filtrelor aplicate diferențelor din evaluare	
T	1.1.2.5	(-) Câștiguri nete din capitalizarea profiturilor viitoare din active ce fac obiectul operațiunilor de securitizare	
C	1.1.2.6	Diferențe din evaluare eligibile pentru includerea în fondurile proprii de nivel 1	0,00
C	1.1.2.6.01	Diferențe din evaluarea instrumentelor de capitaluri proprii clasificate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.02	Ajustări la diferențele din evaluarea instrumentelor de capitaluri proprii clasificate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.03	Diferențe din evaluarea creditelor și creanțelor înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.04	Ajustări la diferențele din evaluarea creditelor și creanțelor înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.05	Diferențe din evaluarea altor active înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.06	Ajustări la diferențele din evaluarea altor active înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.07	Diferențe din evaluarea datorilor financiare la valoarea justă determinate de modificarea propriei calități de credit	
C	1.1.2.6.08	Ajustări la diferențele din evaluarea datorilor financiare la valoarea justă determinate de modificarea propriei calități de credit	
C	1.1.2.6.09	Diferențe din evaluare provenite din operațiuni de acoperire a fluxurilor de trezorerie privind activele care nu sunt înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare	
C	1.1.2.6.10	Ajustări la diferențele din evaluare determinate de operațiuni de acoperire a fluxurilor de trezorerie	
C	1.1.2.6.11	Diferențe din evaluarea investițiilor imobiliare	
C	1.1.2.6.12	Ajustări la diferențele din evaluarea investițiilor imobiliare	
C	1.1.2.6.13	Diferențe din evaluarea imobilizărilor corporale (construcții, terenuri și echipamente)	
C	1.1.2.6.14	Ajustări la diferențele din evaluarea imobilizărilor corporale (construcții, terenuri și echipamente)	
C	1.1.2.6.15	Alte diferențe din evaluare care afectează rezervele eligibile	
C	1.1.2.6.16	Ajustări la alte diferențe din evaluare care afectează rezervele eligibile	
N	1.1.3	Fonduri pentru riscurile bancare generale	
C	1.1.4	Alte fonduri proprii de nivel 1 specifice României	0,00
N	1.1.4.1	Instrumente non inovative supuse limitării	
N	1.1.4.2	Instrumente inovative supuse limitării	
N	1.1.4.3	Filtru prudencial pozitiv adoptat la aplicarea pentru prima dată a IFRS	
C	1.1.4.4	Alte filtre prudentiale	
T	1.1.5	(-) Alte deduceri din fondurile proprii de nivel 1	0,00
T	1.1.5.1	(-) Imobilizări necorporale	
N	1.1.5.2	Sume ce depășesc limite stabilite pentru instrumente non inovative	
N	1.1.5.3	Sume ce depășesc limite stabilite pentru instrumente inovative	
T	1.1.5.4	(-) Alte deduceri specifice României din fondurile proprii de nivel 1	0,00
N	1.1.5.4.1	(-) Filtru prudencial negativ adoptat la aplicarea pentru prima dată a IFRS	
T	1.1.5.4.2	(-) Alte filtre prudentiale	
T	1.2	FONDURI PROPRII DE NIVEL 2	0,00
T	1.2.1	Fonduri proprii de nivel 2 de bază	0,00
N	1.2.1.1	Sume ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii de nivel 1, incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	
C	1.2.1.2	Ajustări la diferențele din evaluare deduse din fondurile proprii de nivel 1 și incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	0,00
C	1.2.1.2.01	Ajustări la diferențele din evaluarea instrumentelor de capitaluri proprii clasificate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	

C	1.2.1.2.02	Ajustări la diferențele din evaluarea altor active înregistrate în categoria activelor financiare disponibile pentru vânzare incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	
C	1.2.03	Ajustări la diferențele din evaluarea investițiilor imobiliare incluse în fondurile proprii de nivel 2	
C	1.2.1.2.04	Ajustări la diferențele din evaluarea imobilizărilor corporale (construcții, terenuri și echipamente) incluse în fondurile proprii de nivel 2	
C	1.2.1.2.05	Alte ajustări la diferențele din evaluare care atectează rezervele eligibile, incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	
T	1.2.1.3	Rezerve din reevaluare	0.00
N	1.2.1.4	Ajustări de valoare a pozițiilor de risc de credit în abordarea standard	
T	1.2.1.5	Alte elemente, din care:	
T	1.2.1.6	Titluri pe durată nedeterminată și alte instrumente:	
T	1.2.1.7	Excedent de provizioane în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.2.1.8	Fonduri proprii de nivel 2 de bază specifice României	
T	1.2.2	Fonduri proprii de nivel 2 suplimentar	0.00
N	1.2.2.1	Angajamente ale membrilor instituțiilor de credit înființate ca și societăți cooperatiste	
T	1.2.2.2	Acțiuni preferențiale cumulative pe durată determinată	
T	1.2.2.3	Împrumuturi subordonate	
T	1.2.2.4	Fonduri proprii de nivel 2 suplimentar, specifice României	
T	1.2.2.5	(-) Suma ce excede limitele prevăzute pentru nivelul fondurilor proprii de nivel 2 suplimentar	
T	1.2.3	(-) Deduceri din fondurile proprii de nivel 2	0.00
T	1.2.3.1	(-) Suma ce excede limitele prevăzute pentru nivelul fondurilor proprii de nivel 2	
T	1.2.3.2	(-) Alte elemente deductibile din fondurile proprii de nivel 2 suplimentar, specifice României	
T	1.3	(-) ELEMENTE DEDUCTIBILE DIN FONDURILE PROPRII DE NIVEL 1 SI 2	0.00
T	1.3 T1*	Din care: (-) Din fondurile proprii de nivel 1	
T	1.3 T2*	(-) Din fondurile proprii de nivel 2	
T	1.3.1	(-) Valoarea acțiunilor și a altor titluri de capital deținute în alte instituții de credit sau financiare, care depășesc 10% din capitalul social al acestora	0.00
T	1.3.2	(-) Creanțe subordonate și alte instrumente înregistrate în instituții de credit și financiare în care sunt înregistrate dețineri de acțiuni și alte titluri de capital ce depășesc 10% din capitalul social al acestora	
T	1.3.3	(-) Suma ce excede limita stabilită pentru deținerea de acțiuni și alte titluri de capital, creanțe subordonate și alte elemente înregistrate în instituții de credit și financiare în care sunt înregistrate	
T	1.3.4	(-) Participații deținute în societăți de asigurare, societăți de reasigurare, societăți holding de asigurare	
T	1.3.5	(-) Alte instrumente deținute în societăți de asigurare, societăți de reasigurare, societăți holding de asigurare în care este menținută o participație	
T	1.3.6	(-) Elemente deductibile din fondurile proprii de nivel 1 și 2, specifice României	
C	1.3.EM	Element memorandum Fonduri proprii relevante pentru limitele aplicate expunerilor mari atunci când nu se utilizează fonduri proprii de nivel 3 pentru acoperirea riscurilor de piață și pentru	
T	1.3.7	(-) Anumite expuneri din securizare neincluse în activele ponderate la risc	
T	1.3.8	(-) Deficit de provizioane și valoarea pierderilor așteptate aferente creanțelor provenind din titluri de capital în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.3.9	(-) Participații calificate în instituții din afara sectorului financiar	
T	1.3.10	(-) Tranzacții incomplete aflate în perioada cuprinsă în intervalul de la 5 zile lucrătoare după al doilea semestru al tranzacției (convențând plată/ livrare contractuală) și până la sfârșitul	
T	1.3.11	(-) Alte elemente deductibile din fondurile proprii de nivel 1 și 2, specifice României	
T	1.4	TOTAL FONDURI PROPRII DE NIVEL 1	2,489,203.16
T	1.5	TOTAL FONDURI PROPRII DE NIVEL 2	0.00
T	1.6	TOTAL FONDURI PROPRII DE NIVEL 2 SPECIFICE PENTRU ACOPERIREA RISCURILOR DE PIATĂ	0.00
T	1.6.1	Suma ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii de nivel 2, transferată la total fonduri proprii de nivel 2 specifice pentru acoperirea riscurilor de piață	
T	1.6.2	Profituri nete aferente portofoliului de tranzacționare	0.00
T	1.6.3	Capital sub formă de împrumut subordonat pe termen scurt	
N	1.6.4	(-) Active nelichide	
T	1.6.5	(-) Suma ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii specifice pentru acoperirea riscurilor de piață	
T	1.6.EM	Element memorandum: Fonduri proprii totale relevante pentru limitele expunerilor mari în situația în care nu sunt utilizate	
N	1.6.6	(-) Elemente deductibile din Fondurile proprii specifice pentru acoperirea riscurilor de piață, specifice României	
T	1.6.7	(-) Elemente neutilizate dar eligibile pentru includerea în fondurile proprii specifice pentru acoperirea riscurilor de piață	
T	1.7	(-) DEDUCERI DIN TOTAL FONDURI PROPRII	0.00
T	1.7.1	Elemente deductibile din total fonduri proprii, specifice României	
N	1.7.2	Participații în entități de asigurare	
T	1.8	Elemente Memorandum:	
T	1.8.1	Excedent/Deficit de provizioane în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	0.00
T	1.8.1.1	Valoarea provizioanelor în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.8.1.1*	Din care: Provizioane pentru depreciere identificate la nivelul grupurilor de active financiare	
T	1.8.1.1**	Din care: Provizioane specifice pentru depreciere identificate la nivel individual	
T	1.8.1.1***	Din care: Ajustări de valoare și provizioane specifice României precum și alte ajustări și provizioane incluse în calculul excedentului / deficitului (-) de provizioane în cazul aplicării	
T	1.8.1.2	(-) Valoarea pierderilor așteptate în cazul utilizării abordării bazate pe modele interne de rating	
T	1.8.2	Valoarea brută a împrumuturilor subordonate	
T	1.8.3	Capitalul inițial minim solicitat	422,712.50
T	2	CERINȚE DE CAPITAL	993,699.08
I	2a	Din care: Firme de investiții prevăzute la art.11 (2) și art. 13	
I	2b	Din care: Firme de investiții prevăzute la art. 11 (3) și art. 14	
T	2.1	TOTAL CERINȚE DE CAPITAL PENTRU RISCUL DE CREDIT, RISCUL DE CREDIT AL CONTRAPARTIDEI, RISCUL DE DIMINUARE A VALORII CREANȚEI ȘI PENTRU TRANZACȚII INCOMPLETE	0.00
T	2.1.1	Abordarea standard	0.00

T	2.1.1a	Clasele de expuneri potrivit abordării standard cu excepția pozițiilor din securitizare	0.00
T	2.1.1.1a.01	Administrații centrale sau bănci centrale	
T	2.1.1.1a.02	Administrații regionale sau autorități locale	
T	2.1.1.1a.03	Organisme administrative și entități fără scop lucrativ	
T	2.1.1.1a.04	Bănci multilaterale de dezvoltare	
T	2.1.1.1a.05	Organizații internaționale	
T	2.1.1.1a.06	Instituții	
T	2.1.1.1a.07	Societăți	
T	2.1.1.1a.08	De tip retail	
T	2.1.1.1a.09	Garantate cu proprietăți imobiliare	
T	2.1.1.1a.10	Elemente restante	
T	2.1.1.1a.11	Elemente ce aparțin categoriilor reglementate ca având risc ridicat	
T	2.1.1.1a.12	Obligațiuni garantate	
T	2.1.1.1a.13	Creanțe pe termen scurt față de instituții și societăți	
T	2.1.1.1a.14	Creanțe sub forma titlurilor de participare deținute în organismele de plasament colectiv	
T	2.1.1.1a.15	Alte elemente	
T	2.1.1.1b	Clasele de expuneri potrivit abordării bazate pe modele interne de rating cu excepția pozițiilor din securitizare	0.00
T	2.1.1.1b.01	Administrații centrale și bănci centrale	
T	2.1.1.1b.02	Instituții	
T	2.1.1.1b.03	Societăți	
T	2.1.1.1b.04	De tip retail	
T	2.1.1.1b.05	Creanțe provenind din titluri de capital	
T	2.1.1.1b.06	Active, altele decât cele care reprezintă creanțe de natura creditelor	
T	2.1.1.2	Poziții din securitizare potrivit abordării standard	
T	2.1.2	Abordarea bazată pe modele interne de rating	0.00
T	2.1.2.1	Abordări bazate pe modele interne de rating atunci când nu sunt utilizate estimările proprii ale pierderii în caz de nerambursare și nici ale factorilor de conversie	
T	2.1.2.1.01	Administrații centrale și bănci centrale	
T	2.1.2.1.02	Instituții	
T	2.1.2.1.03	Societăți	
T	2.1.2.2	Abordări bazate pe modele interne de rating atunci când sunt utilizate estimările proprii ale pierderii în caz de nerambursare și/sau ale factorilor de conversie	
T	2.1.2.2.01	Administrații centrale și bănci centrale	
T	2.1.2.2.02	Instituții	
T	2.1.2.2.03	Societăți	
T	2.1.2.2.04	De tip retail	
T	2.1.2.3	Expuneri din titluri de capital potrivit abordării bazate pe modele interne de rating	
T	2.1.2.4	Poziții din securitizare potrivit abordării bazate pe modele interne de rating	
T	2.1.2.5	Active, altele decât cele care reprezintă creanțe de natura creditelor	
T	2.2	RISC DE DECONTARE/LIVRARE	
T	2.3	CERINȚE TOTALE DE CAPITAL PENTRU RISCUL DE POZIȚIE, RISCUL VALUTAR ȘI RISCUL DE MAREĂ	566,626.06
T	2.3.1	Riscurile de poziție, valutar și de marfă potrivit abordării standard	566,626.06
T	2.3.1.1	Riscul de poziție aferent titlurilor de creanță tranzacționate	
T	2.3.1.2	Riscul de poziție aferent titlurilor de capital	566,626.06
T	2.3.1.3	Riscul valutar	
T	2.3.1.4	Riscul de marfă	
T	2.3.2	Riscurile de poziție, valutar și de marfă potrivit modelelor interne	
T	2.4	TOTAL CERINȚE DE CAPITAL PENTRU RISCURILE OPERAȚIONALE	274,972.77
T	2.4.1	Abordarea de bază	274,972.77
T	2.4.2	Abordarea standard/Abordarea standard alternativă	
T	2.4.3	Abordarea avansată de evaluare	
I	2.5	CERINȚE DE CAPITAL AFERENTE CHELTUIELILOR GENERALE FIXE	152,100.25
T	2.6	ALTE CERINȚE DE CAPITAL ȘI CERINȚE DE CAPITAL TRANZITORII	0.00
T	2.6.1	Cerințe complementare pragului general stabilit pentru cerințele de capital	
N	2.6.2	Cerințe complementare pragului general stabilit pentru cerințele de capital, în cazul firmelor de investiții prevăzute la art 26 din Directiva 2006/49/CE	
T	2.6.3	Alte cerințe de fonduri proprii	
T	3	ELEMENTE MEMORANDUM:	
T	3.1	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii înainte aplicării altor cerințe de capital și a cerințelor de capital tranzitorii	1,495,504.08
T	3.1.a	Indicatorul de solvabilitate înainte aplicării altor cerințe de capital și a cerințelor de capital tranzitorii	0.20
T	3.2	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii	1,495,504.08
T	3.2.a	Indicatorul de solvabilitate (%)	0.20
N	3.3	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii luând în considerare verificarea echivalenței de Banca	
N	3.3.a	Indicatorul de solvabilitate luând în considerare verificarea echivalenței de autoritatea competentă	
N	3.4	Excedent (+) / Deficit (-) de capital în urma evaluărilor interne ale instituțiilor de credit	
N	3.4.1	Avantajul intern de capital al titlurilor	
N	3.4.2	Avantajul intern de capital al necesităților de capital	

Intențit
 AVRAM IOANA VALERIA (telefon 40.84.200)
 (numele, prenumele și telefonul)

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN
 Valis Ionela
 (numele, prenumele și funcția)



TITLURI DE CAPITAL DIN PORTOFOLIUL DE TRANZACționARE

- LEI -

TOATE POZIȚIILE	SCURTE		POZITII NETE	SCURTE		POZITII NETE SUPUSE CERINTELOR DE	CERINȚA DE CAPITAL
	LUNGI (1)	(2)		(4)	(5)		
1 Risc general	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85	377,750.71
2 Risc specific	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85	188,875.35
3 Abordare specială pentru riscul de poziție aferent OPC-urilor	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85	188,875.35
4 Abordare pe bază de marjă pentru futures și opțiuni tranzacționate pe bursă							
5 Abordare pe bază de marjă pentru futures și opțiuni tranzacționate pe OTC							
6 Riscuri aferente opțiunilor, altele decât riscul delta							

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN
Valis Ionela
(numele, prenumele și funcția)

CONDUCATORUL SSIF
Valis Ionela, director general adjuncț
(numele, prenumele și funcția)



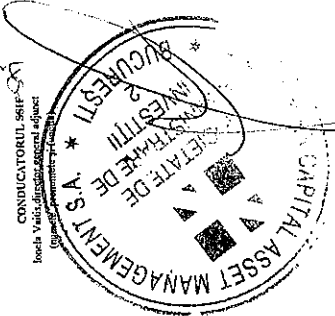
INTOCMIT
Valeria Avram, director general (telefon 4084200)
(numele, prenumele și telefonul)

ACTIVITATI	INDICATORUL RELEVANT			CREDITE SI AVANSURI (IN CAZUL UTILIZARII SA)			CERINTE DE CAPITAL			ELEMENTE IERARHIZATE A MA DE RISCURI DACA ESTE CAZUL		
	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT	8	7	10	11	12	13
							DIN CARE: DATORITA UNUI MECANISM DE ALOCARE		CERINTE DE CAPITAL INAINTE DE REDUCEREA DATORATA PIERDERII AȘTEPTATE SI MECANISMUL DE TRANSFER AL RISCULUI	CERINTELE DE CAPITAL DATORATE AȘTEPTATE DE TRANSFER AL RISCULUI IN PRACTICILE INTERNE	CERINTELE DE CAPITAL DATORATE DE TRANSFER AL RISCULUI DATORITA MECANISMELOR DE TRANSFER AL RISCULUI	EXCEDENT AL MECANISMELOR DE TRANSFER AL RISCULUI PEȘTE LIMITA DE REDUCERE A CAPITALULUI
1. TOTAL ACTIVITATI CE FAC OBIECTUL ABORDARII DE RISCURI	2,011,328.00	1,996,628.40	17,972.77									
2. TOTAL ACTIVITATI CE FAC OBIECTUL ABORDARII DE RISCURI / ABORDARII STANDARD ALTERNATIVE (ASA)												
OBIECTUL SITE												
FRANȚA COURMAYEUR (FC)												
FRANȚA COURMAYEUR SI VANZARII (TV)												
FRANȚA COURMAYEUR (FB)												
ACTIVITATE BANCARA COMERCIALA (ABC)												
ACTIVITATE BANCARA DE RETAIL (ABR)												
PLATI SI RECONTABILI (PR)												
SERVICII DE AGENTII (AS)												
ADMINISTRAREA ACTIVELOR (AA)												
OBIECTUL ASII												
ACTIVITATE BANCARA COMERCIALA (ABC)												
ACTIVITATE BANCARA DE RETAIL (ABR)												
3. TOTAL ACTIVITATI CE FAC OBIECTUL ABORDARII AVANSAȚE DE EVALUARE AMA (A)												

(e) Informații cu privire la indicațiile relevante pentru activitățile ce fac obiectul calculului AMA vor fi furnizate în cazul utilizării combinate de metodologii diferite în conformitate cu art. 30-31 din Regulamentul nr. 2472/2006.

Inocent
Valeria Avram (telefon 08-2109)
(nume, prenume și telefon)

CONDUCATORUL SA
Inocent Valeria Avram (telefon 08-2109)
(nume, prenume și telefon)



REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERNE
Valeria Ionescu
(nume, prenume și funcție)

(Handwritten signature)

Formular 17: RS

Raportare suplimentara

RON			
#RLAC17RS01	Expuneri mari	20%	800%
Fonduri proprii	10%	497,841	622,301
2,489,203.16	248,920		19,913,625

RON			
#RLAC17RS02	Expunerea mare inregistrata fata de un client sau un grup de clienti		
DENUMIRE CLIENT/	Expunere brută	PONDEREA REDUSĂ DE RISC	Expunerea Netă
GRUP DE CLIENTI			% DIN FONDURI PROPRII
Total			LIMITA APLICABILA (%)

RON			
#RLAC17RS03	Expunere mare inregistrata fata de un client sau un grup de clienti afați in relații speciale (societatea-mamă, filiala instituijii de credit și/sau una sau mai multe filiale ale aceleia societății-mamă)		
DENUMIRE CLIENT/	Expunere brută	PONDEREA REDUSĂ DE RISC	Expunerea Netă
GRUP DE CLIENTI			% DIN FONDURI PROPRII
Total			LIMITA APLICABILA (%)

RON			
#RLAC17RS04	Expunere agregate		
DENUMIRE CLIENT/	EXPUNERE AREGGATA	% DIN FONDURI PROPRII	LIMITA APLICABILA
GRUP DE CLIENTI	(TOTAL EXPUNERI MARI)		(%)

RON			
#RLAC17RS05	Participații calificate		
Fonduri proprii	15%		60%
2,489,203.16	37380		1493522

RON			
#RLAC17RS06			
DENUMIRE	VALOAREA	% DIN FONDURI PROPRII	LIMITA APLICABILA
ENTITATE	PARTICIPAȚIEI		(%)
Total			DREPTURILE DE VOT ALE ENTITAȚII*

RON			
#RLAC17RS07	Participații calificate		
Fonduri proprii	25%		
2,489,203.16	622301		

RON			
#RLAC17RS08	Cheltuieli fixe		
Cod cont	Denumire Cont	VALOAREA	
clasa 61		229,377	
clasa 62		13,192	
clasa 63		36,093	
clasa 64		317,625	
clasa 65		12,114	
Total		608,401	



TABEL 4 RISC GENERAL SI SPECIFIC PE TITLURI DE CAPITAL

PORTOFOLIUL DE TITLURI	RISC GENERAL		RISC SPECIFIC	
	PORTOFOLIUL ORIGINIUT	PORTOFOLIUL CALIFICAT	PORTOFOLIUL ORIGINIUT	PORTOFOLIUL CALIFICAT
long	0.00	0.00	0.00	0.00
short	4721883.85	4721883.85	0.00	0.00
long	0.00	0.00	0.00	0.00
short	0.00	0.00	0.00	0.00
COEFICIENT	0.08	0.04	0.04	0.02
TOTAL	377750.71	188875.35	0.00	0.00
INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE PE INDICI	0	0	0.00	0.00
GERINTIA DE CAPITAL TOTALA	377750.71	188875.35	0.00	566626.06

denumire	Cantitate		Valoare		Valoare unitară simbol		Cantitate
	short	long	short	long	short	long	
AVZU		2,376,500		65,591.40		0.0276	
GRU		5,887		824.18		0.1400	
IMP		497,500		57,212.50		0.1150	
MOB		518,146		77,721.90		0.1500	
SIF 4		5716,500		4,401,705.00		0.7700	
CEON		19,500		397.80		0.0204	
COBS		134,428		118,431.07		0.8810	
TOTAL				566626.06			

denumire	Poziție brută (cambiate)		Poziție brută (valoare)		Poziție netă	
	short	long	short	long	short	long
AVZU		2,376,500		65,591.40		65,591.40
GRU		5,887		824.18		824.18
IMP		497,500		57,212.50		57,212.50
MOB		518,146		77,721.90		77,721.90
SIF 4		5,716,500		4,401,705.00		4,401,705.00
CEON		19,500		397.80		397.80
COBS		134,428		118,431.07		118,431.07
Poziție totală netă			0.00	4,721,883.85	0.00	4,721,883.85
Poziție totală brută				4,721,883.85		4,721,883.85