

Formular 1: CA  
Adecvarea capitalului la riscuri

RLAC CA01

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 semnificative	0.00
C	1.1.2.6	Diferențe din evaluare eligibile pentru includerea în fondurile proprii de nivel 1	
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 datoriilor financiare la valoarea justă determinate de modificarea propriei calități de credit	
C	1.1.2.6.08	Ajustări la diferențele din evaluarea datoriilor 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	0.00
C	1.1.4	Alte fonduri proprii de nivel 1 specifice României	
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 prudential pozitiv adoptat la aplicarea pentru prima dată a IFRS	
C	1.1.4.4	Alte filtre prudenciale	
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 prudential negativ adoptat la aplicarea pentru prima dată a IFRS	
T	1.1.5.4.2	(-) Alte filtre prudenciale	
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	Suma ce excede limitele stabilite pentru fondurile proprii de nivel 1, inclusă 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	1.2.1.2.03	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 afectează rezervele eligibile, incluse în fondurile proprii de nivel 2 de bază	0.00
T	1.2.1.3	Rezerve din reevaluare	
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 ȘI 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 securitizare 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 segment al tranzacției (tranzacționând până la termen contractual) și până la stingerea	
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 bazată 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 depreciări identificate la nivelul grupurilor de active financiare	
T	1.8.1.1**	Din care: Provizioane specifice pentru depreciări 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 (+) și 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	1,194,484.91
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 CREAȚEI ȘI PENTRU TRANZACȚII INCOMPLETE	0.00
T	2.1.1	Abordarea standard	0.00

T	2.1.1.1a	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	657,036.74
T	2.3.1	Riscurile de poziție, valutar și de marfă potrivit abordării standard	657,036.74
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	657,036.74
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	341,062.17
T	2.4.1	Abordarea de bază	341,062.17
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	196,386.00
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.46 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 înaintea aplicării altor cerințe de capital și a cerințelor de capital tranzitorii	1,294,718.25
T	3.1.a	Indicatorul de solvabilitate înaintea aplicării altor cerințe de capital și a cerințelor de capital tranzitorii	0.17
T	3.2	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii	1,294,718.25
T	3.2.a	Indicatorul de solvabilitate (%)	0.17
N	3.3	Excedent (+) / Deficit (-) de fonduri proprii luând în considerare verificarea efectuată de Banca Națională a României	
N	3.3.a	Indicatorul de solvabilitate luând în considerare verificarea efectuată de autoritatea competentă	
N	3.4	Excedent (+) / Deficit (-) de capital ca urmare a evaluărilor interne ale instituțiilor de credit	
N	3.4.1	Evaluarea internă a capitalului	
N	3.4.2	Evaluarea internă a necesităților de capital	

Intocmit  
 AVRAM IOANA VALERIA (telefon 40.8.200.200)  
 (numele, prenumele și telefonul)

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN  
 Sache Nicoleta  
 (numele, prenumele și funcția)



Denunțarea S.S.I.F. SAI SWISS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA

Formular 9: MKR SA EQU  
RISC DE PIATĂ: ABORDAREA STANDARD PENTRU RISCUL DE POZITIE AFERENT TITLURILOR DE CAPITAL

- LEI -

TITLURI DE CAPITAL DIN PORTOFOLIUL DE TRANZACȚIONARE

TOATE POZIȚIILE	SCURTE		EFFECTUL DE REDUCERE AL POZITIVILOR AFERENTE ANGAJAMENTELOR DE PRELUARE FERMA	POZITII NETE		SCURTE	POZITII NETE SUPUSE CERINTELOR DE	CERINȚA DE CAPITAL (%)	CERINȚE DE CAPITAL
	LUNGI	(2)		LUNGI	(4)				
	(1)	(3)		(5)	(6)				
1 Risc general	5,475,306.17	0.00	0.00	5,475,306.17	0.00	0.00	5,475,306.17	8.00	438,024.49
1.1 Contracte futures pe indici bursieri cu o largă diversificare, tranzacționate pe bursă, supuse unei abordări speciale	5,475,306.17	0.00	0.00	5,475,306.17	0.00	0.00	5,475,306.17		219,012.25
1.2 Titluri de capital, altele decât contractele futures pe indici bursieri cu o largă diversificare tranzacționate pe bursă	5,475,306.17	0.00	0.00	5,475,306.17	0.00	0.00	5,475,306.17		219,012.25
2 Risc specific									
2.1 Porțofolii diversificate, lichide și de foarte bună calitate, supuse unor cerințe de capital reduse									
2.2 Titluri de capital, altele decât portofoliile diversificate, lichide și de foarte bună calitate									
3 Abordare specială pentru riscul de poziție aferent OPC-urilor									
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									

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



REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN  
Sache Nicolae  
(numele, prenumele și funcția)

TABEL 4 RISC GENERAL SI SPECIFIC PE TITLURI DE CAPITAL

RISC GENERAL	RISC SPECIFIC	
	PORTOFOLIUL DE TITLURI	PORTOFOLIUL DE TITLURI CALIFICAT
AVZU	0.00	0.00
GRU	5475306.17	0.00
IMP	0.00	0.00
MOB	0.00	0.00
SIF 4	5475306.17	0.00
SIF 5	0.00	0.00
<b>TOTAL</b>	<b>5475306.17</b>	<b>0.00</b>
COEFICIENTI	0.08	0.02
CERINTA DE CAPITAL	438024.49	216012.25
pentru riscul general		
pentru riscul specific		
<b>CERINTA DE CAPITAL SUPLEMENTARA PENTRU INSTRUMENTE FINANCIARE DERIVATE PE INDICI</b>	<b>0</b>	<b>0.00</b>
<b>CERINTA DE CAPITAL TOTALA</b>		<b>657036.74</b>

denumire	Cantitate		Valoare		Valoare unitară simbol		Cantitate
	short	long	short	long	short	long	
AVZU		2,506,500		65,169.00		0.0260	
GRU		5,887		1,824.97		0.3100	
IMP		497,500		97,020.27		0.1950	
MOB		400,000		83,000.00		0.2200	
SIF 4		5,650,500		2,765,428.40		0.4884	
SIF 5		58,500		11,553.75		0.1975	
<b>TOTAL</b>				<b>657036.74</b>			

denumire	Pozitie bruta (cantitate)		Pozitie bruta (valoare)		Pozitie neta	
	short	long	short	long	short	long
AVZU		5,164,500		149,770.50		149,770.50
GRU		5,887		1,824.97		1,824.97
IMP		497,500		73,381.25		73,381.25
MOB		719,283		100,899.62		100,899.62
SIF 4		5,716,500		5,041,953.00		5,041,953.00
SIF 5		134,428		107,676.83		107,676.83
COBS						
<b>Pozitie totala neta</b>				<b>0.00</b>		<b>0.00</b>
<b>Pozitie totala bruta</b>				<b>5,475,306.17</b>		<b>5,475,306.17</b>

Denumire SAI SWIS CAPITAL ASSET MANAGEMENT SA

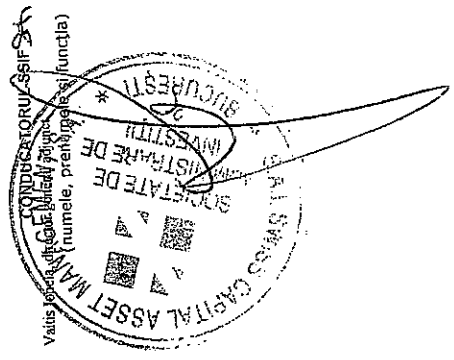
Formular 10: MKR SA FX  
RISC DE PIATA: ABORDARE STANDARD PENTRU RISCUL VALUTAR

#RLAC10MKRSAFX01

	TOATE POZIȚIILE				POZIȚII NETE			POZIȚII SUPUSE CERINȚELOR DE CAPITAL (Inclusiv redistribuirea pozițiilor nepuse în corepondență pe valutele care sunt supuse tratamentului special pentru pozițiile puse în corepondență)			CERINȚA DE CAPITAL (%)		CERINȚE DE CAPITAL
	LUNGI		SCURTE		LUNGI		SCURTE		LUNGI		SCURTE		
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)		
<b>POZIȚII TOTALE ÎN VALUTE, ALTELE DECÂT MONEDA DE RAPORTARE</b>	436,573.20	0.00	0.00	0.00	436,573.20	0.00	436,573.20	0.00	0.00	0.00	0.00	34,925.86	
1 Valute în a 2-a etapă a UEM												0.00	
2 Valute supuse acordurilor interguvernamentale												0.00	
3 Valute străine corelate												0.00	
4 Toate celelalte valute (inclusiv OPC-uri tratate ca valute diferite)	436,573.20	0.00	0.00	0.00	436,573.20	0.00	436,573.20	0.00	0.00	0.00	0.00	34,925.86	
5 Aur												0.00	
6 Riscuri aferente opțiunilor, altele decât riscul delta												0.00	
<b>Elemente memorandum: Poziții pe valute</b>													
Buro													
monede-ERM2													
DKK													
EEK													
LTL													
SIT													
GYP													
LVL													
MTL													
SKK													
GBP													
SEK													
CHF													
Alte monede EEA													
USD													
CAD													
AUD													
JPY													
Alte monede decât cele ale EEA													
OPC-uri tratate ca valute distincte													

REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN

Sache/Coleta  
(numele, prenumele și funcția)



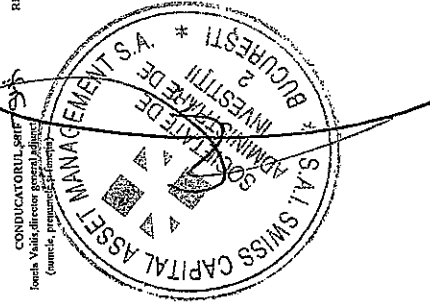
INTOCMIT  
Valeria Avram (telefon 4084200)  
(numele, prenumele și telefonul)

ACTIVITĂȚI	INDICATORUL RELEVANT			CREDITE ȘI AVANSURI (ÎN CAZUL UTILIZĂRII AȘA)			CERINȚE DE CAPITAL		ELEMENTE MEMORANDUM AMA DE RAPORTAT DACA ESTE COZUL				
	ANUL 3	ANUL 1	ANUL TRECUT	ANUL 3	ANUL 2	ANUL TRECUT	DIN CARE: DATORITĂ UNUL MECANISM DE ALOCARE	CERINȚE DE CAPITAL ÎNAINTE PIERDERII AȘTEPTATE ȘI MECANISMUL DE TRANSFER AL RISCULUI	(1) REDUCEREA CERINȚELOR DE CAPITAL DATORITĂ PIERDERII AȘTEPTATE REFLECTATE ÎN PRACTICILE INTERNE	(2) REDUCEREA DATORITĂȚII DE CAPITAL	(3) REDUCEREA DATORITĂȚII DE CAPITAL DATORITĂ MECANISMELOR DE TRANSFER AL RISCULUI	DIN CARE: DATORITĂ ZĂBZĂRIILOR	EXCEDENT AL MECANISMELOR DE TRANSFER AL RISCULUI PEȘTE LIMITA DE REDUCERE A CAPITALULUI
	2	3	4	5	6	7	8	9 = 7-10-11	10	11	12	13	
1. TOTAL ACTIVITĂȚI CE FAC OBIECTUL ABRDĂRII DE BAZĂ (BIA)	2.089.509,00	1.396.628,40	3.335.046,03										
2. TOTAL ACTIVITĂȚI CE FAC OBIECTUL ABRDĂRII STANDARD (ST) / ABRDĂRII STANDARD ALTERNATIVE (ASA)													
OBIECTUL ȘI:													
FINANȚARE CORPORATIVĂ (FC)													
TRANZACȚIONARE ȘI VÂNZĂRI (TV)													
BROKERAJ DE RETAIL (BR)													
ACTIVITĂȚE BANCARE COMERCIALE (ABC)													
ACTIVITĂȚE BANCARE DE RETAIL (ABR)													
PLĂȚI ȘI DECONTĂRI (PD)													
SERVICI DE AGENT (AG)													
ADMINISTRAȚIA ACTIVELOR (AA)													
OBIECTUL AȘA:													
ACTIVITĂȚE BANCARE COMERCIALE (ABC)													
ACTIVITĂȚE BANCARE DE RETAIL (ABR)													
3. TOTAL ACTIVITĂȚI CE FAC OBIECTUL ABRDĂRII AVANSATE DE EVALUARE (AVA) (6)													

(6) Informații se potrivește la indicațiile relevante pentru activitățile ce fac obiectul tabelului AMA vor fi furnizate în cazul utilizării combinașe de metodologii diferite în conformitate cu art. 30(3) din Regulamentul nr. 24/29/2006.

Înscris  
Valeriu Avram (telefon: 4098200)  
(numele, prenumele și telefonul)

CONDUCTORUL ȘEF  
Ioana Vais, director general Adjunct  
(numele, prenumele și numărul)



REPREZENTANTUL COMPARTIMENTULUI DE CONTROL INTERN  
Sasha Nuzica  
(numele, prenumele și funcția)

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

#RLAC17RS02	Expunerea mare înregistrată față de un client sau un grup de clienți	RON	
DENUMIRE CLIENT	Expunere brută	PONDEREA REDUSĂ DE RISC	Expunerea Netă
GRUP DE CLIENȚI			% DIN FONDURI PROPRII
Total			LIMITA APLICABILA (%)

#RLAC17RS03	Expunere mare înregistrată față de un client sau un grup de clienți aflați în relații speciale (societatea-mamă, fiiala instituției de credit și/sau una sau mai multe filiale ale aceleiași societăți-mamă)	RON	
DENUMIRE CLIENT/GRUP DE CLIENȚI	Expunere brută	PONDEREA REDUSĂ DE RISC	Expunerea Netă
Total			% DIN FONDURI PROPRII
			LIMITA APLICABILA (%)

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

#RLAC17RS05	Participații calificate	RON	
Fonduri proprii	15%	60%	
2,489,203.16	373380		1493522

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

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

#RLAC17RS08	Cheルトuile fixe	RON	
Cod cont	Denumire Cont	VALOAREA	
clasa 61		239,749	
clasa 62		93,004	
clasa 63		42,798	
clasa 64		402,501	
clasa 65		7,492	
Total		785,544	

