

SAI: SAI Carpatica Asset Management SA

FDI Carpatica OBLIGAȚIUNI

Situția activelor și obligațiilor FDI Carpatica Obligațiuni în perioada 01.01.2016 - 30.12.2016

Denumire element	Începutul perioadei de raportare				Sfârșitul perioadei de raportare				Diferențe
	% din activ net	% din activ total	Valută (RON)	Lei	% din activ net	% din activ total	Valută (RON)	Lei	
I Total active			61.454.981,55	61.454.981,55			85.777.594,08	85.777.594,08	24.322.612,53
1 Valori mobiliare și instrumente ale pieței monetare, din care:	60,49	60,23	37.015.412,20	37.015.412,20	65,53%	65,47%	56.154.901,27	56.154.901,27	19.139.489,07
11 val mob și instrum ale pieței monetare admise sau tranz pe o piață reglementată din RO, din care:	22,10	22,01	13.523.657,64	13.523.657,64	49,27%	49,22%	42.217.976,89	42.217.976,89	28.694.319,25
113 obligațiuni, din care:	22,10	22,01	13.523.657,64	13.523.657,64	49,27%	49,22%	42.217.976,89	42.217.976,89	28.694.319,25
1131 obligațiuni corporative cotate	4,23	4,21	2.587.437,74	2.587.437,74	3,46%	3,46%	2.965.357,96	2.965.357,96	377.920,22
1132 obligațiuni municipale cotate	7,65	7,62	4.682.962,33	4.682.962,33	7,66%	7,65%	6.560.076,52	6.560.076,52	1.877.114,19
1133 obligațiuni de stat cotate	10,22	10,18	6.253.257,57	6.253.257,57	38,15%	38,11%	32.692.542,41	32.692.542,41	26.439.284,84
12 val mob și instrum ale pieței monetare admise sau tranz pe o piață reglementată din UE, din care:	38,05	37,88	23.279.143,01	23.279.143,01	15,73%	15,71%	13.478.714,77	13.478.714,77	-9.800.428,24
123 obligațiuni, din care:	38,05	37,88	23.279.143,01	23.279.143,01	15,73%	15,71%	13.478.714,77	13.478.714,77	-9.800.428,24
1231 obligațiuni corporative cotate	13,91	13,85	8.510.539,39	8.510.539,39	5,92%	5,91%	5.072.816,17	5.072.816,17	-3.437.723,22
1233 Obligațiuni de stat cotate	24,14	24,03	14.768.603,62	14.768.603,62	9,81%	9,80%	8.405.898,60	8.405.898,60	-6.362.705,02
14 valori mobiliare nou emise, din care:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,54%	0,54%	458.209,61	458.209,61	458.209,61
141 obligațiuni corporative necotate ÎNCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,54%	0,54%	458.209,61	458.209,61	458.209,61
15 alte val mob și instr ale pieței mon menționate la art 102 (1) lit. a) din Legea nr.297/2004, din care:	0,35	0,35	212.611,55	212.611,55	0,00%	0,00%	0,00	0,00	-212.611,55
151 valori mobiliare, din care:	0,35	0,35	212.611,55	212.611,55	0,00%	0,00%	0,00	0,00	-212.611,55
1513 obligațiuni de stat necotate	0,35	0,35	212.611,55	212.611,55	0,00%	0,00%	0,00	0,00	-212.611,55
2 Disponibil în cont curent și numerar, din care:	3,29	3,27	2.011.685,09	2.011.685,09	2,65%	2,65%	2.269.691,07	2.269.691,07	258.005,98
3 Depozite bancare, din care:	37,55	37,38	22.973.585,26	22.973.585,26	32,44%	32,40%	27.795.299,74	27.795.299,74	4.821.714,48
31 depozite bancare constituite la instituții de credit din România	37,55	37,38	22.973.585,26	22.973.585,26	32,44%	32,40%	27.795.299,74	27.795.299,74	4.821.714,48
5 Instrumente financiare derivate tranzacționate pe o piață nereglementată, din care	-0,54	-0,54	-332.631,00	-332.631,00	-0,21%	-0,21%	-176.618,00	-176.618,00	156.013,00
51 Instrumente financiare derivate tranzacționate pe o piață nereglementată din România, din care	-0,54	-0,54	-332.631,00	-332.631,00	-0,21%	-0,21%	-176.618,00	-176.618,00	156.013,00
511 Contracte forward	-0,54	-0,54	-332.631,00	-332.631,00	-0,21%	-0,21%	-176.618,00	-176.618,00	156.013,00
9 Alte active, din care:	-0,35	-0,35	-213.070,00	-213.070,00	-0,31%	-0,31%	-265.680,00	-265.680,00	-52.610,00
94 Sume în curs de rezolvare	-0,35	-0,35	-213.070,00	-213.070,00	-0,31%	-0,31%	-265.680,00	-265.680,00	-52.610,00
II Total obligații			266.664,20	266.664,20			86.342,65	86.342,65	-180.321,55
10 CHELTUIELILE FONDULUI (sold obligații)	0,44	0,43	266.664,20	266.664,20	0,10%	0,10%	86.342,65	86.342,65	-180.321,55
101 Comisioane datorate soc. de admin.	0,08	0,08	48.497,22	48.497,22	0,08%	0,08%	68.059,87	68.059,87	19.562,65
102 Comisioane datorate depozitarului	0,01	0,01	9.138,50	9.138,50	0,01%	0,01%	11.599,08	11.599,08	2.460,58
103 Taxa ASF	0,01	0,01	4.925,94	4.925,94	0,01%	0,01%	6.683,70	6.683,70	1.757,76
107 Obligație de răscumpărare	0,33	0,33	204.102,54	204.102,54	0,00%	0,00%	0,00	0,00	-204.102,54
III Valoarea activului net (I - II)			61.188.317,35	61.188.317,35			85.691.251,43	85.691.251,43	24.502.934,08

Situția valorii unitare a activului net

Denumire element	La data de 31.12.2015	La data de 31.12.2016	Diferențe
Valoare activ net	61.182.121,13	85.691.251,43	-24.509.130,30
Număr unități de fond/acțiuni în circulație	4.967.601,60	6.685.206,21	-1.717.604,61
Valoarea unitară a activului net	12,3162	12,8180	-0,5018

FDI Carpatica OBLIGAȚIUNI – Situația detaliată a activelor la data de 31/12/2016

I.Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din România

5.Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale/obligațiuni corporative

Emitent	Simbol obligațiune	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. Obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Creșterea zilnică	Dobânda cumulată	Discount/primă cumulate (a)	Preț piață	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
Primaria Municipiului Alba Iulia	ALB25A	N/A	9.081	28-Aug-13	23-Aug-13	14-Apr-17	32,69	0,01	0,1514	0,3388	N/A	301.269,91	0,0000%	0,351%
MUNICIPIUL TIMIȘOARA	TIM26C	N/A	1.549	3-Dec-15	15-Nov-16	15-Feb-17	34,78	0,01	0,0461	0,2768	N/A	54.368,23	0,5163%	0,063%
MUNICIPIUL TIMIȘOARA	TIM26	N/A	1.000	25-Mar-13	15-Nov-16	15-Feb-17	44,16	0,00	0,0461	0,1496	N/A	44.355,74	0,3333%	0,052%
PRIMARIA EFORIE	EFO17	N/A	1.047	10-Jan-14	7-Jan-14	16-Jun-17	7,65	0,00	0,0058	0,0602	N/A	8.078,62	0,0000%	0,009%
PRIMARIA EFORIE	EFO17	N/A	1.198	21-Jan-14	16-Jan-14	16-Jun-17	7,65	0,00	0,0058	0,0602	N/A	9.243,73	0,0000%	0,011%
PRIMARIA EFORIE	EFO17	N/A	1.198	19-Feb-14	14-Feb-14	16-Jun-17	7,83	0,00	0,0058	0,0521	N/A	9.449,76	0,0000%	0,011%
ORAȘUL PREDEAL	PRD26	N/A	4.000	19-Jun-14	16-Jun-14	15-May-17	30,00	0,01	0,0979	0,2710	N/A	121.475,87	0,0000%	0,142%
CITY OF Bucharest	PMB20	N/A	31	22-oct-15	4-mai-16	4-mai-17	10.085,48	0,93	237,3590	-22,5539	N/A	319.308,95	0,0000%	0,372%
CITY OF Bucharest	PMB20	N/A	60	16-nov-15	4-mai-16	4-mai-17	10.150,00	0,89	237,3588	-37,8909	N/A	620.968,08	0,0000%	0,724%
CITY OF Bucharest	PMB20	N/A	70	7-ian-16	4-mai-16	4-mai-17	10.178,00	0,87	237,3589	-40,5826	N/A	726.234,33	0,0000%	0,847%
CITY OF Bucharest	PMB20	N/A	100	13-mai-16	4-mai-16	4-mai-17	10.214,00	0,83	237,3589	-34,3402	N/A	1.041.701,87	0,0000%	1,214%
CITY OF Bucharest	PMB22	N/A	200	04-mai-15	4-mai-16	4-mai-17	10.000,00	1,21	293,7151	0,0000	N/A	2.058.743,01	0,0000%	2,400%
CITY OF Bucharest	PMB22	N/A	20	03-mar-16	4-mai-16	4-mai-17	10.300,00	1,08	293,7150	-40,4794	N/A	211.064,72	0,0000%	0,246%
CITY OF Bucharest	PMB25	N/A	100	04-mai-15	4-mai-16	4-mai-17	10.000,00	1,40	338,1370	0,0000	N/A	1.033.813,70	0,0000%	1,205%
ENGIE ROMANIA SA	GSER17	N/A	17	30-oct-12	31-oct-16	30-oct-16	10.000,00	2,06	127,4447	0,0000	N/A	172.166,56	0,0680%	0,201%
GARANTI BANK	GBR19	N/A	40	03-iun-14	16-mai-16	15-mai-17	10.000,00	1,50	345,6318	0,0000	N/A	413.825,27	0,0000%	0,603%
Raiffeisen Bank	RORFZBDBC036	N/A	50	14-mai-14	16-mai-16	15-mai-17	10.000,00	1,47	337,1232	0,0000	N/A	516.856,16	0,0000%	0,482%
Transselectrica S.A.	ROSELDBC013	N/A	35	23-dec-13	19-dec-16	19-dec-17	10.000,00	1,67	21,7260	0,0000	N/A	350.760,41	0,1750%	0,409%
Transselectrica S.A.	ROSELDBC013	N/A	60	18-apr-14	19-dec-16	19-dec-17	10.087,60	1,62	21,7260	-50,7815	N/A	603.512,48	0,3000%	0,704%
Transselectrica S.A.	ROSELDBC013	N/A	50	26-nov-14	19-dec-16	19-dec-17	10.773,00	1,15	21,7260	-399,5223	N/A	519.760,19	0,2500%	0,606%
Transselectrica S.A.	ROSELDBC013	N/A	35	5-Aug-16	19-dec-16	19-Dec-17	10.930,00	0,60	21,7260	-160,0115	N/A	377.710,01	0,1750%	0,440%
Transselectrica S.A.	ROSELDBC013	N/A	1	5-Aug-16	19-dec-16	19-Dec-17	10.900,00	0,63	21,7300	-154,8499	N/A	10.766,88	0,0050%	0,013%
Total												9.525.434,48		11,105%

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

Serie	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. Obligațiunii deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobandă cumulată	Discount/primă cumulată(ă)	Preț piață	Valoare totală	Banca intermediară	Pondere în total obligațiuni emitenț	Pondere în activul total al OPC
B2106A	N/A	80	6-Mar-14	11-Jun-16	11-Jun-17	833.366,58	117,84	26.603,84	-12.974,50	N/A	846.995,92	N/A	0,03%	0,987%
B2106A	N/A	50	16-Sep-15	11-Jun-16	11-Jun-17	576.011,00	45,23	16.627,40	-17.161,43	N/A	575.476,96	N/A	0,02%	0,671%
B2106A	N/A	50	16-Sep-15	11-Jun-16	11-Jun-17	575.726,50	45,36	16.627,40	-17.097,20	N/A	575.256,69	N/A	0,02%	0,671%
B2106A	N/A	60	7-Nov-16	11-Jun-16	11-Jun-17	693.599,98	42,00	19.952,88	-3.069,77	N/A	710.483,09	N/A	0,02%	0,828%
B2304A	N/A	150	14-Oct-16	26-Apr-16	26-Apr-17	1.780.195,70	122,93	60.102,74	-9.281,12	N/A	1.831.017,32	N/A	0,00%	2,135%
B2304A	N/A	100	11-Nov-16	26-Apr-16	26-Apr-17	1.164.480,59	90,49	40.068,49	-3.558,98	N/A	1.200.990,11	N/A	0,00%	1,400%
B2304A	N/A	100	18-Nov-16	26-Apr-16	26-Apr-17	1.154.551,22	94,50	40.068,49	-2.893,73	N/A	1.191.725,99	N/A	0,00%	1,389%
B2304A	N/A	100	16-Dec-16	26-Apr-16	26-Apr-17	1.148.863,54	96,16	40.068,49	-1.025,76	N/A	1.187.906,27	N/A	0,00%	1,385%
B2502A	N/A	100	3-May-16	24-Feb-16	24-Feb-17	541.529,46	51,99	20.245,90	-3.135,03	N/A	558.640,33	Raiffeisen Bank	0,00%	0,651%
B2502A	N/A	100	16-May-16	24-Feb-16	24-Feb-17	542.975,50	51,49	20.245,90	-3.083,08	N/A	560.138,32	Raiffeisen Bank	0,00%	0,653%
B2103A	N/A	100	30-Dec-15	22-Mar-16	22-Mar-17	512.712,43	37,86	12.688,36	-2.450,59	N/A	522.950,20	N/A	0,00%	0,610%
B2103A	N/A	22	24-Feb-16	22-Mar-16	22-Mar-17	113.249,62	8,04	2.791,44	-547,16	N/A	115.493,90	N/A	0,00%	0,135%
B2103A	N/A	500	30-Sep-16	22-Mar-16	22-Mar-17	2.621.781,60	148,07	63.441,78	-6.931,27	N/A	2.678.292,12	N/A	0,00%	3,122%
B2103A	N/A	400	5-Oct-16	22-Mar-16	22-Mar-17	2.095.054,64	119,73	50.753,42	-5.134,93	N/A	2.140.673,13	N/A	0,00%	2,496%
B2103A	N/A	400	6-Oct-16	22-Mar-16	22-Mar-17	2.091.963,39	121,59	50.753,42	-4.914,51	N/A	2.137.802,31	N/A	0,00%	2,492%
B2212A	N/A	100	23-May-16	19-Dec-16	19-Dec-17	508.773,50	44,30	623,29	-814,87	N/A	508.581,93	N/A	0,15%	0,593%
B2212A	N/A	300	28-Sep-16	19-Dec-16	19-Dec-17	1.581.918,00	107,80	1.869,86	-3.423,76	N/A	1.580.364,10	N/A	0,45%	1,842%
B2212A	N/A	300	14-Oct-16	19-Dec-16	19-Dec-17	1.569.104,28	113,22	1.869,86	-2.418,80	N/A	1.568.555,34	N/A	0,45%	1,829%
B2212A	N/A	400	26-Oct-16	19-Dec-16	19-Dec-17	2.095.743,64	149,13	2.493,15	-2.857,38	N/A	2.095.379,41	N/A	0,60%	2,443%
B2212A	N/A	400	26-Oct-16	19-Dec-16	19-Dec-17	2.095.397,41	149,29	2.493,15	-2.847,05	N/A	2.095.043,51	N/A	0,60%	2,442%
B2212A	N/A	600	7-Nov-16	19-Dec-16	19-Dec-17	3.123.381,00	232,42	3.739,73	-3.038,94	N/A	3.124.081,79	N/A	0,90%	3,642%
B2002A	N/A	300	10-Nov-16	26-Feb-16	25-Feb-17	1.520.145,08	75,46	28.586,07	-870,78	N/A	1.547.860,37	Raiffeisen Bank	0,24%	1,805%
B2002A	N/A	200	5-Dec-16	26-Feb-16	25-Feb-17	1.010.348,90	52,69	19.057,38	-237,20	N/A	1.029.169,08	Raiffeisen Bank	0,16%	1,200%
B2002A	N/A	200	7-Dec-16	26-Feb-16	25-Feb-17	1.008.308,13	54,42	19.057,38	-176,62	N/A	1.027.188,89	Raiffeisen Bank	0,16%	1,198%
B2002A	N/A	250	22-Dec-16	26-Feb-16	25-Feb-17	1.258.728,79	69,32	23.821,72	-75,18	N/A	1.282.475,33	Raiffeisen Bank	0,20%	1,495%
Total (lei)											32.692.542,41			38,113%

II. Valori mobiliare admise sau tranzacționate pe o piață reglementată din alt stat membru

2.1. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice locale, obligațiuni corporative denumite în lei

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. Obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială*	Creșterea zilnică*	Dobânda cumulată*	Discount/primă cumulate (ă)*	Preț piață*	Curs valutar BNR	Valoare totală	Pondere în total obligațiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al OPC
Raiffeisen International AG	AT00B013784	N/A	2	3-May-16	3-May-16	3-May-17	500.000,00	34,93	8.488,36	0,00	N/A	1,00	1.016.976,71	0,0000%	1,186%
Total (lei)													1.016.976,71		1,186%

2. Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației locale, obligațiuni corporative denumite în euro

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. Obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială*	Creșterea zilnică*	Dobânda cumulată*	Discount/primă cumulate(ă)*	Preț piață*	Curs valutar BNR	Valoare totală (lei)	Pondere în total obligațiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al OPC
CABLE Communications SYSTEMS N.V.	XS1405770576	N/A	100	26-Oct-16	26-Oct-16	15-Apr-17	1.000,00	0,14	9,03	0,00	N/A	4,5411	458.209,61	0,00%	0,534%
CROATIAN BANK FOR RECONS & DEV	XS0961637542	N/A	200	22-Aug-13	8-May-16	8-May-17	996,25	0,17	39,12	1,88	N/A	4,5411	942.053,10	0,00%	1,098%
JEFFERIES GROUP LLC	XS1069522057	N/A	100	6-Oct-15	20-May-16	20-May-17	983,50	0,07	14,71	4,43	N/A	4,5411	455.305,90	0,00%	0,531%
JEFFERIES GROUP LLC	XS1069522057	N/A	125	19-Feb-16	20-May-16	20-May-17	941,60	0,10	14,71	11,93	N/A	4,5411	549.605,84	0,00%	0,641%
NE Property Cooperatief	XS1325078308	N/A	100	19-Feb-16	26-Feb-16	26-Feb-17	987,00	0,11	31,76	2,25	N/A	4,5411	463.650,53	0,00%	0,541%
SPP Infrastructure FINANCING B.V.	XS0953958641	N/A	146	6-Aug-15	18-Jul-16	18-Jul-17	1.074,80	0,06	17,16	-21,27	N/A	4,5411	709.869,75	0,00%	0,828%
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI	XS1077629225	N/A	200	5-Mar-15	17-Jun-16	17-Jun-17	1.019,00	0,08	18,99	-8,11	N/A	4,5411	935.354,34	0,00%	1,090%
Total (lei)													4.514.049,07		5,263%

3.1 Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale

3.1 Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în euro

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. Obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Creșterea zilnică	Dobânda cumulată	Discount/primă cumulat(ă)	Preț piață	Curs valutar BNR	Valoare totală (lei)	Pondere în total obligațiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al OPC
Ministerul Finanțelor	XS0972758741	N/A	50	26-Sep-14	18-Sep-16	18-Sep-17	1.136,80	0,06	13,30	-51,86	N/A	4,5411	249.361,11	0,00%	0,291%
Ministerul Finanțelor	XS1060842975	N/A	130	24-Jun-15	24-Apr-16	24-Apr-17	1.076,60	0,08	25,03	-13,22	N/A	4,5411	642.532,73	0,00%	0,749%
Ministerul Finanțelor	XS1060842975	N/A	220	13-Jul-15	24-Apr-16	24-Apr-17	1.055,00	0,08	25,03	-9,22	N/A	4,5411	1.069.777,76	0,00%	1,247%
Ministerul Finanțelor	XS1312891549	N/A	135	25-Feb-16	29-Oct-16	29-Oct-17	1.016,88	0,07	4,82	-1,49	N/A	4,5411	625.442,16	0,00%	0,729%
Ministerul Finanțelor	XS1420357318	N/A	500	5-Oct-16	26-May-16	26-May-17	1.073,88	0,06	17,33	-1,53	N/A	4,5411	2.474.171,52	0,05%	2,884%
Republic of Croatia	XS1028953989	N/A	200	28-Jul-16	30-May-16	30-May-17	1.029,90	0,09	22,93	-2,71	N/A	4,5411	953.743,21	0,00%	1,112%
Total (lei)													6.015.028,49		7,012%

3.2 Obligațiuni admise la tranzacționare emise sau garantate de autorități ale administrației publice centrale denumite în usd

Emitent	Cod ISIN	Data ultimei ședințe în care s-a tranzacționat	Nr. obligațiuni deținute	Data achiziției	Data cupon	Data scadenței cupon	Valoare inițială	Creșterea zilnică	Dobânda cumulată	Discount/primă cumulat(ă)	Preț piață	Curs valutar BNR	Valoare totală (lei)	Pondere în total obligațiuni ale unui emitent	Pondere în activul total al OPC
REPUBLIC OF CROATIA	XS0464257152	N/A	320	5-Feb-14	5-Nov-16	5-May-17	1.075,00	0,15	10,50	-37,91	N/A	4,3033	1.442.588,85	0,02%	1,682%
REPUBLIC OF CROATIA	XS0525827845	N/A	200	28-Jul-14	14-Jul-16	14-Jan-17	1.120,00	0,13	30,73	-48,93	N/A	4,3033	948.281,26	0,02%	1,106%
Total (lei)													2.390.870,11		2,787%

IX. Disponibil în conturi curente și numerar

1. Disponibil în conturi curente și numerar denumite în lei

Denumire bancă	Valoare curentă	Pondere în activul total al OPC
ALPHA BANK	504,20	0,001%
BANCA COMERCIALĂ CARPATICA S.A.	3.522,16	0,004%
BANCA COMERCIALĂ CARPATICA S.A.	265.680,00	0,310%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	8,69	0,000%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	1.947.896,56	2,271%
BANCA COMERCIALĂ ROMÂNĂ	43.014,07	0,050%
Credit Europe Bank	368,58	0,000%
INTESA SAN PAOLO	57,30	0,000%
LIBRA BANK	41,16	0,000%
RAIFFEISEN BANK	5.357,90	0,006%
Total	2.266.450,62	2,642%

2. Disponibil în conturi curente și numerar valută denumite în euro

Denumire bancă	Valoare curentă*	Curs valutar BNR	Valoare actualizată lei	Pondere în activul total al OPC
BANCA COMERCIALA ROMANA	698,43	4,5411	3.171,64	0,004%
Credit Europe Bank	3,15	4,5411	14,30	0,000%
RAIFFEISEN BANK	1,90	4,5411	8,63	0,000%
Total (lei)			3.194,57	0,004%

2. Disponibil în conturi curente și numerar valută denumite în usd

Denumire bancă	Valoare curentă*	Curs valutar BNR	Valoare actualizată lei	Pondere în activul total al OPC
BANCA COMERCIALA ROMANA	10,21	4,3033	43,94	0,000%
RAIFFEISEN BANK	0,45	4,3033	1,94	0,000%
Total (lei)			45,88	0,000%

X. Depozite bancare

1. Depozite bancare denumite în lei

Denumire bancă	Data constituirii	Data scadenței	Valoare inițială	Creștere zilnică	Dobânda cumulată	Valoare totală	Pondere în activul total al OPC
ALPHA BANK	28-Sep-16	28-Mar-17	2.000.000,00	82,19	7.808,22	2.007.808,22	2,341%
ALPHA BANK	6-Oct-16	6-Apr-17	800.000,00	32,88	2.860,27	802.860,27	0,936%
ALPHA BANK	6-Oct-16	6-Apr-17	1.000.000,00	41,10	3.575,34	1.003.575,34	1,170%
BANCA COMERCIALĂ CARPATICA S.A.	7-Jul-16	7-Jul-17	1.500.000,00	84,25	14.995,89	1.514.995,89	1,766%
BANCA COMERCIALĂ CARPATICA S.A.	13-Jul-16	13-Jul-17	3.500.000,00	196,58	33.810,96	3.533.810,96	4,120%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	19-Aug-16	20-Feb-17	250.000,00	10,76	1.453,13	251.453,13	0,293%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	19-Aug-16	20-Feb-17	400.000,00	17,22	2.325,00	402.325,00	0,469%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	26-Aug-16	27-Feb-17	700.000,00	31,11	3.982,22	703.982,22	0,821%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	2-Sep-16	2-Mar-17	300.000,00	12,92	1.562,92	301.562,92	0,352%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	12-Sep-16	13-Mar-17	950.000,00	40,90	4.540,21	954.540,21	1,113%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	23-Sep-16	23-Mar-17	1.000.000,00	44,44	4.444,44	1.004.444,44	1,171%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	26-Sep-16	27-Mar-17	1.200.000,00	53,33	5.173,33	1.205.173,33	1,405%
BANCA COMERCIALĂ FERROVIARĂ	30-Dec-16	30-Jan-17	600.000,00	12,50	25,00	600.025,00	0,700%
Credit Europe Bank	17-Jun-16	19-Jun-17	171.638,00	2,82	558,65	172.196,65	0,201%
Credit Europe Bank	4-Apr-16	4-Apr-17	61.875,00	1,02	276,66	62.151,66	0,072%
Credit Europe Bank	15-Apr-16	13-Apr-17	236.722,50	3,89	1.015,64	237.738,14	0,277%
Credit Europe Bank	19-Feb-16	17-Feb-17	182.568,75	2,85	903,79	183.472,54	0,214%
Credit Europe Bank	25-Feb-16	24-Feb-17	295.509,37	2,43	755,37	296.264,74	0,345%
Credit Europe Bank	16-Mar-16	16-Mar-17	101.475,00	1,67	485,41	101.960,41	0,119%
Credit Europe Bank	24-Mar-16	24-Mar-17	95.625,00	1,57	444,85	96.069,85	0,112%
Credit Europe Bank	11-Jan-16	11-Jan-17	114.025,00	2,81	1.000,92	115.025,92	0,134%
INTESA SAN PAOLO	16-Nov-16	16-May-17	141.500,00	5,82	267,49	141.767,49	0,165%
LIBRA BANK	25-Nov-16	27-Feb-17	1.350.000,00	49,93	1.847,47	1.351.847,47	1,576%
LIBRA BANK	8-Dec-16	9-Jan-17	1.204.000,00	36,28	870,84	1.204.870,84	1,405%
LIBRA BANK	14-Oct-16	14-Apr-17	1.531.900,00	62,95	4.973,43	1.536.873,43	1,792%
LIBRA BANK	26-Oct-16	26-Jan-17	2.000.000,00	76,71	5.139,73	2.005.139,73	2,338%
LIBRA BANK	4-Nov-16	6-Feb-17	600.000,00	23,01	1.334,79	601.334,79	0,701%
LIBRA BANK	6-Oct-16	6-Jan-17	705.800,00	27,07	2.355,24	708.155,24	0,826%
LIBRA BANK	13-Dec-16	13-Mar-17	360.000,00	13,32	252,99	360.252,99	0,420%
LIBRA BANK	16-Dec-16	16-Mar-17	1.000.000,00	36,99	591,78	1.000.591,78	1,166%
LIBRA BANK	16-Dec-16	16-Mar-17	505.400,00	18,69	299,09	505.699,09	0,590%
LIBRA BANK	22-Dec-16	22-Jun-17	1.501.400,00	59,64	596,45	1.501.996,45	1,751%
LIBRA BANK	28-Dec-16	28-Jun-17	1.008.400,00	40,06	160,24	1.008.560,24	1,176%
RAIFFEISEN BANK	10-Nov-16	11-Jan-17	316.721,00	3,08	52,36	316.773,36	0,369%
Total (lei)						27.795.299,74	32,404%

XII. Instrumente financiare derivate negociate în afara piețelor reglementate

1. Contracte forward denumite în euro

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achiziției	Data scadenței	Preț de exercitare	Curs valutar BNR	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totală (lei)	Pondere în activul total al OPC
Credit Europe Bank	420.000	Vânzare	18-Apr-16	13-Apr-17	4,5090	4,5411	4,5541	-0,0451	-18.942,00	-0,022%
Credit Europe Bank	110.000	Vânzare	4-Apr-16	4-Apr-17	4,5000	4,5411	4,5529	-0,0529	-5.819,00	-0,007%
Credit Europe Bank	300.000	Vânzare	17-Jun-16	19-Jun-17	4,5770	4,5411	4,5638	0,0132	3.960,00	0,005%
Credit Europe Bank	200.000	Vânzare	11-Jan-16	11-Jan-17	4,5610	4,5411	4,5423	0,0187	3.740,00	0,004%
Credit Europe Bank	170.000	Vânzare	24-Mar-16	24-Mar-17	4,5000	4,5411	4,5514	-0,0514	-8.738,00	-0,010%
Credit Europe Bank	180.000	Vânzare	16-Mar-16	16-Mar-17	4,5100	4,5411	4,5503	-0,0403	-7.254,00	-0,008%
Credit Europe Bank	325.000	Vânzare	19-Feb-16	17-Feb-17	4,4940	4,5411	4,5468	-0,0528	-17.160,00	-0,020%
Credit Europe Bank	525.000	Vânzare	25-Feb-16	24-Feb-17	4,5030	4,5411	4,5476	-0,0446	-23.415,00	-0,027%
Total (lei)									-73.628,00	-0,086%

1. Contracte forward denumite în usd

Contraparte	Cantitate	Tip contract	Data achiziției	Data scadenței	Preț de exercitare	Curs valutar BNR	Curs forward	Profit / pierdere	Valoare totală (lei)	Pondere în activul total al OPC
RAIFFEISEN BANK	350.000	Vânzare	11-Oct-16	11-Jan-17	4,0355	4,3033	4,3029	-0,2674	-93.590,00	-0,109%
RAIFFEISEN BANK	200.000	Vânzare	9-Dec-16	9-Jan-17	4,2560	4,3033	4,3030	-0,0470	-9.400,00	-0,011%
Total (lei)									-102.990,00	-0,120%

Evoluția activului net și a VUAN în ultimii 3 ani

	An T-2	An T-1	An T
Activ net	48.199.369,09	61.182.121,13	85.691.251,43
VUAN	11,8696	12,3162	12,818