

ANEXA I - Regulamentul UE 200/2016

Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR

Data de referință	30.06.2017
Denumirea entității	SSIF BRK Financial Group SA
Nivelul de aplicare	Individual

Tabelul LRSum: Rezumatul reconcilierii activelor contabile și a expunerilor pentru calcularea indicatorului efectului de levier

		Suma aplicabila
1	Total active conform situațiilor financiare publicate	108,229,488.00
2	Ajustarea pentru entitățile consolidate în scop contabil, dar care nu intră în sfera consolidării reglementare	-
3	[Ajustarea pentru activele fiduciare recunoscute în bilanț în conformitate cu cadrul contabil aplicabil, dar excluse din indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier, în conformitate cu articolul 429 alineatul (13) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013]	-
4	Ajustări pentru instrumentele financiare derivate	-
5	Ajustare pentru tranzacțiile de finanțare prin titluri („ <i>securities financing transactions-SFT</i> ”)	-
6	Ajustare pentru elementele extrabilanțiere (și anume conversia expunerilor extrabilanțiere în sume de credit echivalente)	-
EU-6A	[Ajustarea pentru expunerile intragrup excluse din indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier, în conformitate cu articolul 429 alineatul (7) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013]	-
EU-6B	[Ajustarea pentru expunerile excluse din indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier, în conformitate cu articolul 429 alineatul (14) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013]	-
7	Alte ajustari	-
8	Indicatorul de Masurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului de levier	-

Tabelul LRCom: Prezentarea informațiilor comune cu privire la indicatorul efectului de levier

		Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR
Expuneri bilantiere (cu exceptia instrumentelor financiare derivate si a SFT)		
1	Elemente bilantiere (cu exceptia instrumentelor financiare derivate, a SFT si a activelor fiduciare, dar incluzand garantiile reale)	109,024,546.16
2	(valoarea activelor deduse in momentul stabilirii fondurilor proprii de nivel 1)	-1,726,211.75
3	Total expuneri bilantiere (cu exceptia instrumentelor financiare derivate, a SFT si a activelor fiduciare) (suma liniilor 1 si 2)	110,750,757.91
Expuneri la instrumente financiare derivate		
4	Costul de înlocuire a <i>tuturor</i> tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (și anume fără marja de variație în numerar eligibilă)	7,166,954.00
5	Sume suplimentare pentru expunerea potențială viitoare (Potential Future Exposure – „PFE”) aferente <i>tuturor</i> tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (metoda marcării la piață)	402,681.00
Eu-5A	Expunerea stabilită în conformitate cu metoda expunerii inițiale	-
6	Valoarea brută a garanțiilor reale constituite pentru instrumentele financiare derivate în cazul în care au fost deduse din activele bilanțului, în conformitate cu cadrul contabil aplicabil	-
7	(Deducerea creanțelor înregistrate ca active pentru marja de variație în numerar constituită pentru tranzacțiile cu instrumente financiare derivate)	-
8	(Componenta CPC exceptată a expunerilor pentru tranzacțiile compensate de client)	-
9	Valoarea noțională efectivă ajustată a instrumentelor financiare derivate de credit subscrise	-
10	(Compensările valorilor noționale efective ajustate și deduceri suplimentare pentru instrumentele financiare derivate de credit subscrise)	-
11	Total expuneri la instrumente financiare derivate (suma liniilor 4 – 10)	7,569,635.00
Expuneri la SFT		
12	Active SFT brute (fără recunoașterea compensării), după ajustarea tranzacțiilor contabile de vânzare	-
13	(Valori compensate ale sumelor de încasat și de plătit în numerar ale activelor SFT brute)	-
14	Expunerea la riscul de credit al contrapărții aferentă activelor SFT	-
EU-14a	Derogare pentru SFT: Expunerea la riscul de credit al contrapărții în conformitate cu articolul 429b alineatul (4) și cu articolul 222 din Regulamentul (UE) nr. 575/2013	-
15	Expunerile la tranzacțiile instituției în calitate de agent	-
EU-15a	(Componenta CPC exceptată a expunerilor la SFT compensate de client)	-
16	Total expuneri la tranzacțiile de finanțare prin titluri (suma liniilor 12 – 15a)	0,00
Alte expuneri extrabilanțiere		
17	Expuneri extrabilanțiere exprimate în valoarea noțională brută	-



18	(Ajustări pentru conversia în sume de credit echivalente)	
19	Alte expuneri extrabilanțiere (suma liniilor 17 și 18)	0,00
Expuneri exceptate în conformitate cu articolul 429 alineatele (7) și (14) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (bilanțiere și extrabilanțiere)		
EU-19a	[Expuneri intragrup (nivel individual) exceptate în conformitate cu articolul 429 alineatul (7) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (bilanțiere și extrabilanțiere)]	-
EU-19b	[Expuneri exceptate în conformitate cu articolul 429 alineatul (14) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (bilanțiere și extrabilanțiere)]	-
Fonduri proprii și indicatorul de măsurare a expunerii totale		
20	Fonduri proprii de nivel 1	51,547,373.07
21	Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, EU- 19a și EU-19b)	118,320,392.91
22	Indicatorul efectului de levier	0.47
Decizia privind dispozițiile tranzitorii și cuantumul elementelor fiduciare nerecunoscute		
EU-23	Decizia privind dispozițiile tranzitorii în scopul definirii indicatorului de măsurare a capitalului	-
EU-24	Cuantumul elementelor fiduciare derecunoscute, în conformitate cu articolul 429 alineatul (11) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013	-

Tabelul LRSpl: Defalcarea expunerilor bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a expunerilor exceptate)

		Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR
EU-1	Totalul expunerilor bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a expunerilor exceptate), din care:	110,750,757.91
EU-2	Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare	24,853,682.00
EU-3	Expuneri aferente portofoliului bancar, din care:	85,897,075.52
EU-4	Obligațiuni garantate	0.00
EU-5	Expuneri considerate ca fiind suverane	0.00
EU-6	Expuneri față de administrații regionale, bănci de dezvoltare multilaterală, organizații internaționale și entități din sectorul public, care nu sunt tratate ca entități suverane	0.00
EU-7	Instituții	60,618,315.85
EU-8	Expuneri garantate cu ipotecă asupra bunurilor imobile	0.00
EU-9	Expuneri de tip retail	1,436,816.33
EU-10	Societăți	581,415.06
EU-11	Expuneri în stare de nerambursare	13,563,362.58
EU-12	Alte expuneri (de exemplu, titluri de capital, securitizări și alte active care nu corespund unor obligații de credit)	23,134,583.08

Monica Ivan
Director General Adjunct

Alina Haricleia Sas
Administrator risc