

ANEXA I - Regulamentul UE 200/2016

**Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR**

Data de referință	30.09.2018
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**

		<b>Suma aplicabila</b>
1	Total active conform situațiilor financiare publicate	110.214.540
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	<b>Indicatorul de Masurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului de levier</b>	-

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

		<b>Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR</b>
<b>Expuneri bilantiere (cu exceptia instrumentelor financiare derivate si a SFT)</b>		
1	Elemente bilantiere (cu exceptia instrumentelor financiare derivate, a SFT si a activelor fiduciare, dar incluzand garantiile reale)	133.707.211,27
2	(valoarea activelor deduse in momentul stabilirii fondurilor proprii de nivel 1)	-1.798.413,25
3	<b>Total expuneri bilantiere (cu exceptia instrumentelor financiare derivate, a SFT si a activelor fiduciare) (suma liniilor 1 si 2)</b>	131.908.798
<b>Expuneri la instrumente financiare derivate</b>		
4	Costul de înlocuire a <i>tuturor</i> tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (și anume fără marja de variație în numerar eligibilă)	14.847.859,93

5	Sume suplimentare pentru expunerea potențială viitoare (Potential Future Exposure – „PFE”) aferente tuturor tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (metoda marcării la piață)	210.387,95
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 subscribe	-
10	(Compensările valorilor noționale efective ajustate și deduceri suplimentare pentru instrumentele financiare derivate de credit subscribe)	-
11	<b>Total expuneri la instrumente financiare derivate (suma liniilor 4 – 10)</b>	15.058.247,8
<b>Expuneri la SFT</b>		
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	3.506.465,76
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	<b>Total expuneri la tranzacțiile de finanțare prin titluri (suma liniilor 12 – 15a)</b>	3.506.465,76
<b>Alte expuneri extrabilanțiere</b>		
17	Expuneri extrabilanțiere exprimate în valoarea noțională brută	-
18	(Ajustări pentru conversia în sume de credit echivalente)	-
19	<b>Alte expuneri extrabilanțiere (suma liniilor 17 și 18)</b>	<b>0,00</b>
<b>Expuneri exceptate în conformitate cu articolul 429 alineatele (7) și (14) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (bilanțiere și extrabilanțiere)</b>		
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)]	-
<b>Fonduri proprii și indicatorul de măsurare a expunerii totale</b>		
20	<b>Fonduri proprii de nivel 1</b>	52.030.708,85
21	<b>Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE- 19a și UE-19b)</b>	152.271.924,91
22	<b>Indicatorul efectului de levier</b>	0,34
<b>Decizia privind dispozițiile tranzitorii și quantumul elementelor fiduciare nerecunoscute</b>		
EU-23	Decizia privind dispozițiile tranzitorii în scopul definirii indicatorului de măsurare a capitalului	-
EU-24	Quantumul elementelor fiduciare nerecunoscute, 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)**

		<b>Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR</b>
EU-1	Totalul expunerilor bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a expunerilor exceptate), din care:	133.707.211,27
EU-2	Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare	45.446.343
EU-3	Expuneri aferente portofoliului bancar, din care:	88.260.868,4
EU-4	Obligațiuni garantate	3.630.240,37
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 <b>nu</b> sunt tratate ca entități suverane	0.00
EU-7	Instituții	61.756.643
EU-8	Expuneri garantate cu ipotechi asupra bunurilor imobile	0.00
EU-9	Expuneri de tip retail	900.928
EU-10	Societăți	2.058.852
EU-11	Expuneri în stare de nerambursare	4.179
EU-12	Alte expuneri (de exemplu, titluri de capital, securitizări și alte active care nu corespund unor obligații de credit)	19.910.026

**Răzvan RAȚ**  
Director General Adjunct

**Ioana SECHEL**  
Persoana responsabilă cu preluarea atribuțiilor administratorului de risc