

ANEXA I - Regulamentul UE 200/2016

Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR

Data de referință	30.06.2018
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

		Suma aplicabila
1	Total active conform situațiilor financiare publicate	120,466,986.00
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)	188,728,622.65

2	(valoarea activelor deduse în momentul stabilirii fondurilor proprii de nivel 1)	-1,798,419.00
3	Total expuneri bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare) (suma liniilor 1 și 2)	186,930,203.65
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)	25,592,900.91
5	Sume suplimentare pentru expunerea potențială viitoare (Potential Future Exposure – „PFE”) aferente <i>tuturor</i> tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (metoda marcării la piață)	149,168.65
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)	25,742,069.56
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	2,486,144.21
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)	2,486,144.21
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	51,906,899.59
21	Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea	215,158,417.42

	indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE- 19a și UE-19b)	
22	Indicatorul efectului de levier	0.24
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 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)

		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:	186,930,203.65
EU-2	Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare	91,181,563.16
EU-3	Expuneri aferente portofoliului bancar, din care:	95,748,640.49
EU-4	Obligațiuni garantate	3,630,241.00
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	68,913,785.62
EU-8	Expuneri garantate cu ipoteци asupra bunurilor imobile	0.00
EU-9	Expuneri de tip retail	1,407,939.97
EU-10	Societăți	1,099,779.88
EU-11	Expuneri în stare de nerambursare	8,222.47
EU-12	Alte expuneri (de exemplu, titluri de capital, securitizări și alte active care nu corespund unor obligații de credit)	20,688,671.55

Razvan Rat
Director General Adjunct

Alina Haricleia Sas
Administrator risc