

# SWISS CAPITAL

## INDICATORI RISC

### PRIVIND FONDURILE PROPRII SI CERINTE DE FONDURI PROPRII

<b>Adecvarea capitalului la riscuri la 31.12.2019 conform Regulamentului (UE) nr. 575/2013</b>	
<b>DENUMIRE</b>	<b>VALOARE (lei)</b>
<b>FONDURI PROPRII TOTALE</b>	<b>43.586.193,88</b>
Fonduri proprii de nivel I	43.586.193,88
Fonduri proprii de nivel I de baza	43.586.193,88
<b>Valoarea totala a expunerii la risc</b>	<b>196.754.359,67</b>
Valorile expunerilor ponderate la riscul de credit, riscul de contraparte	4.809.880,80
Valoarea expunerii la risc pentru riscul de pozitie, riscul valutar si riscul de marfa	90.185.730,63
Riscul de pozitie aferent titlurilor de creanta	2.489.945,88
Riscul de pozitie aferent titlurilor de capital	84.406.651,25
Riscul valutar	3.289.133,50
Valoarea totala a expunerii la risc pentru riscul operational	29.475.862,44
<b>VALOAREA TOTALĂ A EXPUNERILOR LA RISC LEGATĂ DE EXPUNERILE MARI DIN PORTOFOLIUL DE TRANZACȚIONARE</b>	<b>72.282.885,80</b>

Autorizata si reglementata de catre Autoritatea de Supraveghere Financiara  
cu autorizatia nr 2674/2003, Nr. Registru PJR01SSIF/400054.

SWISS CAPITAL S.A.

Bd. Dacia nr. 20, Cladirea Romana Offices, et.4, sector 1, Bucuresti • Romania

Tel.: + 40 21 408.42.00

Fax: + 40 21 408.42.27

[www.swisscapital.ro](http://www.swisscapital.ro)

CUI: 8450 590

Registru Comertului Bucuresti: J40/4107/1996

BRD-Groupe Societe Generale, S.M.C.C.

RO66 BRDE 450S V239 9072 4500

Capital Social: 9.348.840 RON

## SWISS CAPITAL

<b>RATA FONDURILOR PROPRII</b>	
Rata fondurilor proprii de nivel 1 de baza	22,15%
Excedentul(+)/Deficitul(-) fondurilor proprii de nivel 1 de baza	34.732.247,69
Rata fondurilor proprii de nivel 1	22,15%
Excedentul(+)/Deficitul(-) fondurilor proprii de nivel 1	31.780.932,30
Rata fondurilor proprii totale	22,15%
<b>Excedentul (+)/Deficitul(-) fondurilor proprii totale</b>	<b>27.845.845,11</b>

---

Autorizata si reglementata de catre Autoritatea de Supraveghere Financiara  
cu autorizatia nr 2674/2003, Nr. Registru PJR01SSIF/400054.

SWISS CAPITAL S.A.

Bd. Dacia nr. 20, Cladirea Romana Offices, et.4, sector 1, Bucuresti • Romania

Tel.: + 40 21 408.42.00

Fax: + 40 21 408.42.27

[www.swisscapital.ro](http://www.swisscapital.ro)

CUI: 8450 590

Registru Comertului Bucuresti: J40/4107/1996

BRD-Groupe Societe Generale, S.M.C.C.

RO66 BRDE 450S V239 9072 4500

Capital Social: 9.348.840 RON