

# SWISS CAPITAL

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

**31.12.2021**

|       |  | <b>Suma aplicabilă</b> |
|-------|--|------------------------|
| 1     | Total active conform situațiilor financiare publicate  | <b>188.370.658</b>     |
| 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 („securities financing transactions-SFT”)   |                        |
| 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 ajustări  |                        |
| 8     | <b>Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier</b>  | <b>189.310.542,34</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 bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare)</b> |  |

Autorizată și reglementată de către Autoritatea de Supraveghere Financiară  
cu autorizația nr 2674/2003, Nr. Registru PJR01SSIF/400054.

SWISS CAPITAL S.A.

Bd. Dacia nr. 20, Clădirea Romana Offices, et.4, sector 1, București • România

Tel.: + 40 21 408.42.00

Fax: + 40 21 408.42.27

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

CUI: 8450 590

Registru Comertului București: 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>derivate și a SFT)</b>                          |   |                       |
|--|---|-----------------------|
| 1  | Elemente bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare, dar incluzând garanțiile reale).   | <b>189.310.542,34</b> |
| 2  | (Valoarea activelor deduse în momentul stabilirii fondurilor proprii de nivel 1)  |                       |
| <b>3</b>   | <b>Total expuneri bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare) (suma liniilor 1 și 2)</b>  | <b>189.310.542,34</b> |
| <b>Expuneri la instrumente financiare derivate</b> |   |                       |
| 4  | Costul de înlocuire a tuturor tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (și anume fără marja de variație în numerar eligibilă)   |                       |
| 5  | Sume suplimentare pentru expunerea potențială viitoare (Potential Future Exposure – „PFE”) aferente tuturor tranzacțiilor cu instrumente financiare derivate (metoda marcării la piață)       |                       |
| 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)  |                       |
| <b>11</b>  | <b>Total expuneri la instrumente financiare derivate (suma liniilor 4 – 10)</b>   |                       |
| <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  |                       |

Autorizată și reglementată de către Autoritatea de Supraveghere Financiară  
cu autorizația nr 2674/2003, Nr. Registru PJR01SSIF/400054.

SWISS CAPITAL S.A.

Bd. Dacia nr. 20, Clădirea Romana Offices, et.4, sector 1, București • România

Tel.: + 40 21 408.42.00

Fax: + 40 21 408.42.27

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

CUI: 8450 590

Registru Comertului București: 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

|  |   |                       |
|--|---|-----------------------|
| 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)  |                       |
| <b>16</b>  | <b>Total expuneri la tranzacțiile de finanțare prin titluri (suma liniilor 12 – 15a)</b>  |                       |
| <b>Alte expuneri extrabilanțiere</b>   |   |                       |
| 17   | Expuneri extrabilanțiere exprimate în valoarea noțională brută  |                       |
| 18   | (Ajustări pentru conversia în sume de credit echivalente)   |                       |
| <b>19</b>  | <b>Alte expuneri extrabilanțiere (suma liniilor 17 și 18)</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   | Fonduri proprii de nivel 1  | <b>108.035.130,79</b> |
| 21   | Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE-19a și UE-19b)                            | <b>189.310.542,34</b> |
| <b>Indicatorul efectului de levier</b>   |   |                       |
| 22   | Indicatorul efectului de levier   | <b>0,57%</b>          |
| <b>Decizia privind dispozițiile tranzitorii și cuantumul elementelor fiduciare derecunoscute</b>   |   |                       |
| EU-23  | Decizia privind dispozițiile tranzitorii în scopul definirii indicatorului de măsurare a capitalului  | aplicare integrala    |
| 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)**

Autorizată și reglementată de către Autoritatea de Supraveghere Financiară  
cu autorizația nr 2674/2003, Nr. Registru PJR01SSIF/400054.

SWISS CAPITAL S.A.

Bd. Dacia nr. 20, Clădirea Romana Offices, et.4, sector 1, București • România

Tel.: + 40 21 408.42.00

Fax: + 40 21 408.42.27

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

CUI: 8450 590

Registrul Comerțului București: 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

|       |  | 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:   | <b>124.579.188,58</b>   |
| EU-2  | Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare  | <b>122.647.294,97</b>   |
| EU-3  | Expuneri aferente portofoliului bancar, din care:  | <b>69.948.491,5</b>   |
| EU-4  | Obligațiuni garantate  | 0   |
| EU-5  | Expuneri considerate ca fiind suverane   | 0   |
| 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   |
| EU-7  | Instituții   | <b>59.023.282,54</b>  |
| EU-8  | Expuneri garantate cu ipotecă asupra bunurilor imobile   |   |
| EU-9  | Expuneri de tip retail   | <b>2.870.210,32</b>   |
| EU-10 | Societăți  | <b>3.968.598,50</b>   |
| EU-11 | Expuneri în stare de nerambursare  |   |
| EU-12 | Alte expuneri (de exemplu, titluri de capital, securitizări și alte active care nu corespund unor obligații de credit);  | <b>4.086.400,14</b>   |
|       | <b>Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR –</b>  |   |
|       | <b>Tabelul LRQua: Rubrici în care se poate introduce text liber în scopul prezentării informațiilor privind elementele calitative</b>  |   |
|       |  | <b>Coloană</b>  |
|       |  | Text liber  |
| Rând  |  |   |

Autorizată și reglementată de către Autoritatea de Supraveghere Financiară  
cu autorizația nr 2674/2003, Nr. Registru PJR01SSIF/400054.

SWISS CAPITAL S.A.

Bd. Dacia nr. 20, Clădirea Romana Offices, et.4, sector 1, București • România

Tel.: + 40 21 408.42.00

Fax: + 40 21 408.42.27

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

CUI: 8450 590

Registrul Comerțului București: 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

|   |   |  |
|---|---|--|
| 1 | Descrierea proceselor utilizate pentru a administra riscul efectului de levier excesiv  |  |
| 2 | Descrierea factorilor care au influențat indicatorul efectului de levier în perioada la care se referă indicatorul efectului de levier publicat |  |

---

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

Registrul 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