

ANEXA I - Regulamentul UE 200/2016

Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR

| | |
|---------------------|--|
| Data de referință | 31.12.2023 |
| Denumirea entității | S.S.I.F. Blue Rock Financial Services S.A. |
| Nivelul de aplicare | individual |

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

| | | Suma aplicabilă |
|-------|--|-----------------|
| 1 | Total active conform situațiilor financiare publicate | 90770277 |
| 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 ajustări | - |
| 8 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier | 30.991.664 |

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

| | | Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR |
|--|--|--|
| Expuneri bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate și a SFT) | | |
| 1 | Elemente bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare, dar incluzând garanțiile reale). | 90770277 |
| 2 | (Valoarea activelor deduse în momentul stabilirii fondurilor proprii de nivel 1) | - |
| 3 | Total expuneri bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare) (suma liniilor 1 și 2) | 90770277 |
| | | Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR |
| 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) | - |
| 5 | Sume suplimentare pentru expunerea potențială viitoare (Potential Future Exposure – „PFE”) aferente <i>tuturor</i> 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 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) | - |
| 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) | - |
| Alte expuneri extrabilanțiere | | |
| 17 | Expuneri extrabilanțiere exprimate în valoarea noțională brută | - |

| | | Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR |
|--|---|---|
| 18 | (Ajustări pentru conversia în sume de credit echivalente) | - |
| 19 | Alte expuneri extrabilanțiere (suma liniilor 17 și 18) | - |
| 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 | 5946057 |
| 21 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE-19a și UE-19b) | 90770277 |
| Indicatorul efectului de levier | | |
| 22 | Indicatorul efectului de levier | 0.07 |
| Decizia privind dispozițiile tranzitorii și quantumul elementelor fiduciar re derecunoscute | | |
| EU-23 | Decizia privind dispozițiile tranzitorii în scopul definirii indicatorului de măsurare a capitalului | - |
| EU-24 | Cuquantumul 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: | - |
| EU-2 | Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare | - |
| EU-3 | Expuneri aferente portofoliului bancar, din care: | - |
| EU-4 | Obligațiuni garantate | - |
| EU-5 | Expuneri considerate ca fiind suverane | - |
| EU-6 | Expuneri față de administrații regionale, bănci de dezvoltare multilaterală, organizații internaționale și entități din sectorul public, care <u>nu</u> sunt tratate ca entități suverane | - |
| | | Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR |
| EU-7 | Instituții | - |
| EU-8 | Expuneri garantate cu ipoteci asupra bunurilor imobile | - |
| EU-9 | Expuneri de tip retail | - |
| EU-10 | Societăți | - |
| 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); | - |

Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR

| | | Coloană |
|-------------|---|----------------|
| | | Text liber |
| Rând | | |
| 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 | - |



Expert 3A srl

Compartiment Control Intern

Ilie Gabriel
Ilie Gabriel

Stefan NM Ungureanu
Director General
Stefan NM Ungureanu

