



Prin noi investiți în viitor!

ESTINVEST

Societate de servicii de investiții financiare, România

ANEXA I

Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR – Model de prezentare a informațiilor

| | |
|----------------------------|-------------------|
| Data de referință | 31.12.2018 |
| Denumirea entității | ESTINVEST |
| 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 | 24.446.860 |
| 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 aline | |
| 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 | -11.796.563 |
| 8 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier | 12.650.297 |

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). | 12.650.297 |
| 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) | 12.650.297 |



Prin noi investiți în viitor!

ESTINVEST

Societate de servicii de investiții financiare, România

| | | Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR |
|--|---|---|
| Expuneri la instrumente financiare derivate | | |
| 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) | |
| 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] | |
| 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 | |



Prin noi investiții în viitor!

ESTINVEST

Societate de servicii de investiții financiare, România

| | | 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 intra grup (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 | 5.230.537 |
| 21 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE-19a și UE-19b) | 12.650.297 |
| Indicatorul efectului de levier | | |
| 22 | Indicatorul efectului de levier | 0,413 |
| Decizia privind dispozițiile tranzitorii și quantumul elementelor fiduciare derecunoscute | | |
| EU_23 | Decizia privind dispozițiile tranzitorii în scopul definirii indicatorului de măsurare a capitalului | |
| EU_24 | Quantumul 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: | 12.650.297 |
| EU-2 | Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare | 2.791.464 |
| 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 nu sunt tratate ca entități suverane | |



Prin noi investiții în viitor!

ESTINVEST

Societate de servicii de investiții financiare, România

| | | Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR |
|-------|---|---|
| EU-7 | Instituții | 3.531.692 |
| EU-8 | Expuneri garantate cu ipoteci asupra bunurilor imobile | |
| EU-9 | Expuneri de tip retail | |
| EU-10 | Societăți | 306.477 |
| 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); | 6.020.664 |

Indicatorul efectului de levier conform Regulamentului CRR – Model de prezentare a informațiilor

Tabelul LRQua: Rubrici în care se poate introduce text liber în scopul prezentării informațiilor privind elementele calitative

| | | 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 | |