



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

<b>Data de referință</b>	<b>31.12.2019</b>
<b>Denumirea entității</b>	<b>ESTINVEST</b>
<b>Nivelul de aplicare</b>	<b>Individual</b>

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

		<b>Suma aplicabilă</b>
1	Total active conform situațiilor financiare publicate	<b>29.190.008</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 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	-13.292.631
<b>8</b>	<b>Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier</b>	<b>15.897.377</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 derivate și a SFT)</b>		
1	Elemente bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare, dar incluzând garanțiile reale).	<b>15.897.377</b>
2	(Valoarea activelor deduse în momentul stabilirii fondurilor proprii de nivel 1)	
3	<b>Total expuneri bilanțiere (cu excepția instrumentelor financiare derivate, a SFT și a activelor fiduciare) (suma liniilor 1 și 2)</b>	<b>15.897.377</b>



Prin noi investiți în viitor!

ESTINVEST

Societate de servicii de investiții financiare, România

		Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR
<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)	
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	<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	
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	<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	



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	<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 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)]	
<b>Fonduri proprii și indicatorul de măsurare a expunerii totale</b>		
20	<b>Fonduri proprii de nivel 1</b>	5.583.591
21	<b>Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE-19a și UE-19b)</b>	15.897.377
<b>Indicatorul efectului de levier</b>		
22	Indicatorul efectului de levier	0,352
<b>Decizia privind dispozițiile tranzitorii și quantumul elementelor fiduciare derecunoscute</b>		
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:	15.897.377
EU-2	Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare	4.322.588
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	4.524.461
EU-8	Expuneri garantate cu ipoteci asupra bunurilor imobile	
EU-9	Expuneri de tip retail	
EU-10	Societăți	135.141
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);	6.918.187

**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	