



SSIF VOLTINVEST SA CRAIOVA

Str.Tufanele nr.1 Craiova - 200767

Telefon/fax 0251/419342;415956

Aprobat,
Presedinte Consiliul de Administratie
Cristinel Popescu

RAPORT

privind publicarea „Indicatorului efectului de levier” la 31.12.2017 conform prevederilor
Regulamentului UE 200/2016

SSIF Voltinvest SA calculeaza „Indicatorul efectului de levier” conform prevederilor art. 429 din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 privind cerintele prudentiale pentru institutiile de credit si societatile de investitii, modificat prin Regulamentul (UE) nr.62/2015.

Acest indicator se raporteaza Autoritatii de Supraveghere Financiara, Sectorul Instrumente si Investitii Financiare in baza art. 430 alin (1) din respectivul regulament, iar informatiile care constituie baza de calcul, se fac publice asa cum stipuleaza art.451 din acelasi act normativ.

„Indicatorul efectului de levier” s-a calculat prin impartirea indicatorului de masurare a capitalului, la indicatorul de masurare a expunerii totale a societatii si se exprima ca procent (art. 429,alin. 2 din Regulamentul (UE) 575/2013 modificat prin Regulamentul (UE) 62/2015).

Totodata, potrivit aceluiasi articol:

- pentru calcularea „Indicatorul efectului de levier”, SSIF Voltinvest SA a utilizat ca indicator de masurare a capitalului, fondurile proprii de nivelul 1;
- indicatorul de masurare a expunerii totale a societatii noastre este format din valoarea activelor bilantiere, cu ajustarile corespunzatoare.

Valoarea indicatorului efectului de levier la data 31.12.2017, pentru SSIF Voltinvest SA este de 76,38% si a fost determinata pe baza elementelor din Anexa I, parte componenta a acestui raport.

Obligativitatea si formatul de prezentare a informatiilor relevante referitoare la acest indicator sunt prevazute in anexele I si II din Regulamentul (UE) nr.200/2016 de

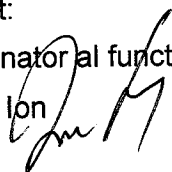
stabilire a standardelor tehnice de punere in aplicare privind publicarea de catre institutii a „Indicatorului efectului de levier”, in conformitate cu Regulamentul (UE) nr. 575/2013.

Precizam ca, in plus fata de publicarea pe site-ul propriu a elementelor componente si a valorii „ Indicatorului efectului de levier” pentru 31.12.2017, in cursul anului 2017 SSIF Voltinvest SA, a calculat acest indicator pentru fiecare sfarsit de trimestru; raportarea catre Autoritatea de Supraveghere Financiara facandu-se la termenele stabilite de Regulamentul (UE) nr. 680/2014.

Acestea sunt in esenta principalele consideratii privind modul de calcul si obligatiile privind publicarea „Indicatorul efectului de levier”.

Intocmit:

Coordonator al functiei de administrare a riscurilor
Berbec Ion



Reprezentant Compartiment Control Intern

Croitoru Anca Georgiana



ANEXA I

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

Data de referință	31.12.2017
Denumirea entității	SC VOLTINVEST SA
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	10.091.911,00
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	(1.603,90)
8	Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier	10.090.307,10

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).	10.090.307,10
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)	10.090.307,10

		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)	-
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	7.758.561,84
21	Indicatorul de măsurare a expunerii totale pentru calcularea indicatorului efectului de levier (suma liniilor 3, 11, 16, 19, UE-19a și UE-19b)	10.090.307,10
Indicatorul efectului de levier		
22	Indicatorul efectului de levier (rd 21/rd 22)	76,89%
Decizia privind dispozițiile tranzitorii și cuantumul elementelor fiduciare derecunoscute		
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)

		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:	10.090.307,10
EU-2	Expuneri aferente portofoliului de tranzacționare	7.566.608,46
EU-3	Expuneri aferente portofoliului bancar, din care:	2.523.698,64
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	112.129,00

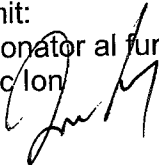
		Expuneri pentru calcularea indicatorului efectului de levier conform Regulamentului CRR
EU-7	Instituții	2.127.640,29
EU-8	Expuneri garantate cu ipoteți asupra bunurilor imobile	-
EU-9	Expuneri de tip retail	492,01
EU-10	Societăți	57.205,67
EU-11	Expuneri în stare de nerambursare	-
EU-12	Alte expuneri (de exemplu, titluri de capital, securitizări și alte active care nu corespund unor obligații de credit);	226.231,67

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	SSIF Voltinvest SA se finanteaza din fonduri proprii
2	Descrierea factorilor care au influențat indicatorul efectului de levier în perioada la care se referă indicatorul efectului de levier publicat	-

Intocmit:
Coordonator al funcției de administrare a riscurilor
Berbec Ion



Reprezentant Compartiment Control Intern
Croitoru Anca

