

SWISS CAPITAL

INDICATORI RISC

PRIVIND FONDURILE PROPRII SI CERINTE DE FONDURI PROPRII

Adecvarea capitalului la riscuri la 31.12.2016 conform Regulamentului (UE) nr. 575/2013	
DENUMIRE	VALOARE (lei)
FONDURI PROPRII TOTALE	18,435,294.40
Fonduri proprii de nivel I	18,435,294.40
Fonduri proprii de nivel I de baza	18,435,294.40
Valoarea totala a expunerii la risc	89,730,528.75
Valorile expunerilor ponderate la riscul de credit, riscul de contraparte	5,550,033.89
Valoarea expunerii la risc pentru riscul de pozitie, riscul valutar si riscul de marfa	36,261,606.00
Riscul de pozitie aferent titlurilor de creanta	0.00
Riscul de pozitie aferent titlurilor de capital	35,587,440.75
Riscul valutar	674,165.25
Valoarea totala a expunerii la risc pentru riscul operational	20,129,386.86
VALOAREA TOTALĂ A EXPUNERILOR LA RISC LEGATĂ DE EXPUNERILE MARI DIN PORTOFOLIUL DE TRANZACȚIONARE	27,789,502.00
RATA FONDURILOR PROPRII	
Rata fondurilor proprii de nivel 1 de baza	20.55%
Excedentul(+)/Deficitul(-) fondurilor proprii de nivel 1 de baza	14,397,420.61
Rata fondurilor proprii de nivel 1	20.55%
Excedentul(+)/Deficitul(-) fondurilor proprii de nivel 1	13,051,462.68
Rata fondurilor proprii totale	20.55%
Excedentul (+)/Deficitul(-) fondurilor proprii totale	11,256,852.10

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

CUI: 8450 590

Registru 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