

Standardizovaný formulář pro podávání hlášení o kapitálové přiměřenosti a angažovanosti ovládající osoby za regulovaný konsolidovaný celek

12_Kapitálová přiměřenost

12_01 Struktura kapitálu

Popis	Č.ř.	Účetní hodnota	Upravená hodnota
A	B	001	002
Tier 1	001		
Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku	002		
Splacené emisní ažio	003		
Povinné rezervní fondy	004		
Ostatní rezervní fondy	005		
Nerozdělený zisk z předchozích období	006		
Část menšinového vlastního kapitálu (kreditní zůstatek)	007		
Neuhrazená ztráta z předchozích období	008		
Ztráta běžného období	009		
Nehmotný majetek s výjimkou goodwillu	010		
Goodwill	011		
Vlastní akcie	012		
Podíl menšinových společníků na vlastním kapitálu (debetní zůstatek)	013		
Tier 2	014		
Rezervy na krytí obecných rizik	015		
Podřízený dluh A	016		
Ostatní kapitálové fondy	017		
Tier 3	018		
Omezený tier 3 (1. omezení dle § 7 odst. 8 vyhlášky o kapitálové přiměřenosti)	019		
Omezený tier 3 (2. omezení dle § 7 odst. 9 vyhlášky o kapitálové přiměřenosti)	020		
Využitelný tier 3	021		
Nevyužitelný tier 3	022		
Využitý tier 3	023		
Nevyužitý tier 3	024		
Odečitatelné položky (odst. 5)	025		
Kapitálové investice do bank a finančních institucí nad 10 %	026		
Kapitálové investice do bank a finančních institucí do 10 %	027		
Ostatní kapitálové investice	028		
Hmotný majetek	029		
Vklady se zbytkovou splatností nad 90 dnů	030		
Poskytnuté úvěry a ostatní pohledávky se zbytkovou splatností nad 90 dnů	031		
Zásoby	032		
Kapitál	033		

Poznámka: Vyšrafované datové pole se nevyplňuje.

12_Kapitálová přiměřenost

12_02 Kapitálové požadavky

Popis	Č.ř.	Hodnota
A	B	001
Kapitálový požadavek A	001	
Kapitálový požadavek B	002	
Kapitálový požadavek k úvěrovému riziku obchodního portfolia	003	
Kapitálový požadavek k riziku angažovanosti obchodního portfolia	004	
Kapitálový požadavek k obecnému úrokovému riziku	005	
Kapitálový požadavek k obecnému akciovému riziku	006	
Kapitálový požadavek k měnovému riziku	007	
Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku	008	

12 Kapitálová přiměřenost

12_03 Propočet kapitálové přiměřenosti

Popis	Č.ř.	Hodnota
A	B	001
Kapitálová přiměřenost	001	
Kapitálová přiměřenost nevyužitého tier 3	002	

12 Kapitálová přiměřenost

12_04 Propočet rizikově vážených aktiv investičního portfolia

Popis	Č.ř.	Souhrn účetních hodnot a úvěrových ekvivalentů	Vážená hodnota
A	B	001	002
Aktiva investičního portfolia celkem vč. úvěrových ekvivalentů	001		
Pokladní hodnoty a jiná aktiva zajištěná penězi	002		
Pohledávky za centrálními vládami států zóny A a ES	003		
Pohledávky za centrálními bankami států zóny A	004		
Pohledávky za centrálními vládami států zóny B	005		
Pohledávky za centrálními bankami států zóny B	006		
Reálné hodnoty pevných termínových a opčních kontraktů	007		
Pohledávky zajištěné zástavním právem k dluhopisům	008		
Odečitatelné položky	009		
Pohledávky za bankami ve státech zóny A	010		
Pohledávky za bankami zóny B s původní splatností do 1 roku včetně	011		
Pohledávky za mezinárodními finančními institucemi	012		
Pohledávky za vládami územních celků států zóny A	013		
Pohledávky za orgány územní samosprávy států zóny A	014		
Pohledávky za institucemi podporovanými centrálními vládami států zóny A	015		
Pohledávky za obchodníky zóny A	016		
Pohledávky za osobami provádějícími vypořádání	017		
Finanční nástroje v procesu inkasa a podobné nástroje	018		
Kapitálové investice do bank a finančních institucí, které nejsou odečitatelnou položkou	019		
Kapitálové investice do právnických a fyzických osob kromě bank a finančních institucí	020		
Pohledávky za právnickými a fyzickými osobami kromě bank a finančních institucí	021		
Pohledávky za centrálními vládami zemí B, kterým nepřísluší riziková váha 0	022		
Pohledávky za centrálními bankami zóny B, kterým nepřísluší riziková váha 0	023		
Pohledávky za vládami územních celků a orgánů samosprávy zemí B	024		
Pohledávky za bankami zemí A, B a obchodníky s cennými papíry v konkursu, likvidaci, nucené správě	025		
Pohledávky za bankami zóny B s původní splatností nad 1 rok	026		
Nesplacená část emisí akcií a dluhopisů	027		
Pohledávky za právnickými osobami - finančními institucemi, kterým nepřísluší riziková váha 0,2	028		
Náklady a příjmy příštích období a dohadné účty aktivní	029		
Ostatní aktiva investičního portfolia	030		

12 Kapitálová přiměřenost

12_05 Konverze vybraných podrozvahových aktiv investičního portfolia

Popis	Č.ř.	Účetní hodnota	Úvěrový ekvivalent
A	B	001	002
Vybraná podrozvahová aktiva investičního portfolia celkem	001		
Poskytnuté odvolatelné úvěrové přísliby	002		
Poskytnuté úvěrové přísliby ostatní	003		
Poskytnuté platební záruky	004		
Poskytnuté záruky z převedených směnek	005		
Poskytnutá směnečná rukojemství	006		
Poskytnutá přijetí směnek	007		
Pohledávky na vklady, úvěry, dluhopisy, směnky a akcie z pevných termínových kontraktů a delta ekvivalentů opcí	008		

12 Kapitálová přiměřenost

12_06 Kapitálový požadavek k úvěrovému riziku obchodního portfolia

Popis	Č.ř.	Pozice	Kapitálový požadavek
A	B	001	002
Kapitálový požadavek ke specifickému úrokovému riziku	001		
Vládní nástroje	002		
Kvalifikované nástroje se zbytkovou splatností do 6 měsíců včemě	003		
Kvalifikované nástroje se zbytkovou splatností od 6 do 24 měsíců včetně	004		
Kvalifikované nástroje se zbytkovou splatností vyšší než 24 měsíců	005		
Ostatní nástroje	006		
Opční kontrakty ke specifickému úrokovému riziku	007		
Kapitálový požadavek ke specifickému akciovému riziku	008		
Hrubá akciová pozice národních trhů zemí OECD	009		
Hrubá akciová pozice ostatních národních trhů	010		
Hrubá akciová pozice diverzifikovaného portfolia	011		
Opční kontrakty ke specifickému akciovému riziku	012		
Kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku	013		
Kapitálový požadavek k reverzním repo operacím a repo operacím, výpůjčkám a půjčkám cenných papírů a komodit	014		
Kapitálový požadavek k pevným termínovým kontraktům a opcím	015		
Kapitálový požadavek ke zbývajícím nástrojům obchodního portfolia	016		

Poznámka: Vyšrafovaná datová pole se nevyplňují.

12 Kapitálová přiměřenost**12_07 Kapitálový požadavek k obecnému úrokovému riziku obchodního portfolia**

Popis	Č.ř.	Hodnota
A	B	001
Kapitálový požadavek k obecnému úrokovému riziku	001	
Kapitálový požadavek k CZK	002	
Kapitálový požadavek k EUR	003	
Kapitálový požadavek k USD	004	
Kapitálový požadavek k ostatním měnám	005	
Kapitálový požadavek zbytkových měn	006	
Kapitálový požadavek k úrokovým futures	007	
Kapitálový požadavek k opčním kontraktům k obecnému úrokovému riziku	008	

12 Kapitálová přiměřenost**12_08 Kapitálový požadavek k obecnému akciovému riziku obchodního portfolia**

Popis	Č.ř.	Pozice	Kapitálový požadavek
A	B	001	002
Kapitálový požadavek k obecnému akciovému riziku	001		
Čistá akciová pozice národních trhů zemí OECD	002		
Čistá akciová pozice ostatních národních trhů	003		
Kapitálový požadavek k akciovým futures	004		
Kapitálový požadavek k opčním kontraktům	005		

Poznámka: Vyšrafovaná datová pole se nevyplňují.

12 Kapitálová přiměřenost**12_09 Kapitálový požadavek k měnovému riziku**

Popis	Č.ř.	Pozice	Kapitálový požadavek
A	B	001	002
Kapitálový požadavek k měnovému riziku	001		
Kompenzované pozice silně korelovaných měn	002		
Celková měnová pozice	003		
Kapitálový požadavek k měnovým futures	004		
Kapitálový požadavek k opčním kontraktům	005		

Poznámka: Vyšrafovaná datová pole se nevyplňují.

12 Kapitálová přiměřenost**12_10 Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku**

Popis	Č.ř.	Hodnota
A	B	001
Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku	001	
Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku bez futures a opčních kontraktů	002	
Kapitálový požadavek ke komoditním futures	003	
Kapitálový požadavek k opčním kontraktům	004	

12 Kapitálová přiměřenost**12_11 Aktiva investičního a obchodního portfolia**

	Č.ř.	Hodnota
A	B	001
Investiční portfolio (aktivní)	001	
Rozvahové položky investičního portfolia (aktivní)	002	
Podrozvahové položky investičního portfolia (aktivní)	003	
Obchodní portfolio (aktivní)	004	
Rozvahové položky obchodního portfolia (aktivní)	005	
Podrozvahové položky obchodního portfolia (aktivní)	006	

12 Kapitálová přiměřenost**12_12 Pasiva investičního a obchodního portfolia**

	Č.ř.	Hodnota
A	B	001
Investiční portfolio (pasivní)	001	
Rozvahové položky investičního portfolia (pasivní)	002	
Podrozvahové položky investičního portfolia (pasivní)	003	
Obchodní portfolio (pasivní)	004	
Rozvahové položky obchodního portfolia (pasivní)	005	
Podrozvahové položky obchodního portfolia (pasivní)	006	

13 Angažovanost**13_01 Angažovanost vůči fyzickým a právnickým osobám**

Č.ř.	Obchodní firma / Jméno	IČ / Datum narození	Sídlo / Bydliště	Hrubá angažovanost investičního portfolia	Čistá angažovanost investičního portfolia
A	001	002	003	004	005
001					

Poměr čisté angažovanosti investičního portfolia ke kapitálu	Opravné položky k hrubé angažovanosti investičního portfolia	Angažovanost obchodního portfolia	Angažovanost obchodního portfolia – součet zbývajících dlouhých pozic
006	007	008	009

13 Angažovanost**13_02 Angažovanost vůči ekonomicky spjaté skupině osob**

Označení ekonomicky spjaté skupiny osob:

Č.f.		Obchodní firma / Jméno	IČ / Datum narození	Sídlo / Bydliště	Snížený limit	Hrubá angažovanost investičního portfolia	Čistá angažovanost investičního portfolia
A	001	002	003	004	005	006	007
001	Celkem vůči skupině						
002	Člen skupiny						

Poznámka: Vyšrafovaná datová pole se nevyplňují.

Poměr čisté angažovanosti investičního portfolia ke kapitálu	Opravné položky k hrubé angažovanosti investičního portfolia	Angažovanost obchodního portfolia	Angažovanost obchodního portfolia - součet zbývajících dlouhých pozic
008	009	010	011

14 Konsolidační a regulovaný konsolidační celek

14_01 Informace o ovládající osobě

Č.f.	Obchodní firma	IČ	Předmět podnikání zapsaný v obchodním rejstříku	Skutečně prováděné činnosti	Upsaný základní kapitál	Splacený základní kapitál
A	001	002	003	004	005	006
001						
...						

Obchodní firma	Další osoby s kvalifikovanou účastí na ovládající osobě					Auditor/auditorská společnost	Orgán dozoru	Sídlo orgánu dozoru
	Výše přímého podílu na základním kapitálu	Výše nepřímého podílu na základním kapitálu	Výše přímého podílu na hlasovacích právech	Výše nepřímého podílu na hlasovacích právech	Jiný způsob výkonu významného vlivu			
007	008	009	010	011	012	013	014	015

14 Konsolidační a regulovaný konsolidační celek**14_02 Přehled ovládaných osob a přidružených společností**

Č.ř.	Obchodní firma	IČ	Předmět podnikání zapsaný v obchodním rejstříku	Skutečně prováděné činnosti	Upsaný základní kapitál	Splacený základní kapitál
A	001	002	003	004	005	006
001						
...						

Způsob výkonu významného či rozhodujícího vlivu ovládající osobou nebo smíšenou holdingovou společností				
Výše přímého podílu na základním kapitálu	Výše nepřímého podílu na základním kapitálu	Výše přímého podílu na hlasovacích právech	Výše nepřímého podílu na hlasovacích právech	Jiný způsob
007	008	009	010	011

Další osoby s kvalifikovanou účastí na ovládané osobě					
Obchodní firma	Výše přímého podílu na základním kapitálu	Výše nepřímého podílu na základním kapitálu	Výše přímého podílu na hlasovacích právech	Výše nepřímého podílu na hlasovacích právech	Jiný způsob výkonu významného vlivu
012	013	014	015	016	017

14 Konsolidační a regulovaný konsolidační celek**14_03 Přehled členů statutárních orgánů, dozorčích rad nebo jiných kontrolních orgánů ovládající osoby a všech ovládaných osob**

Č.ř.	Obchodní firma	Označení orgánu	Jméno a příjmení člena	Datum narození	Obchodní firma další společnosti, v jejíchž orgánech člen působí	Předmět podnikání společnosti podle sloupce 005
A	001	002	003	004	005	006
001						
002						
...						

14 Konsolidační a regulovaný konsolidační celek**14_04 Přehled služeb vzájemně poskytovaných mezi členy konsolidačního celku**

Č.ř.	Poskytovatel (obchodní firma)	IČ	Poskytovaná služba	Příjemce (obchodní firma)	IČ
A	001	002	003	004	005
001					
002					
...					