

10_ Informování o dodržování kapitálové přiměřenosti

10_01 Struktura kapitálu

		Účetní hodnota	Upravená hodnota
A	B	1	2
Tier 1	1		
Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku	2		
Splacené emisní ážio	3		
Povinné rezervní fondy	4		
Ostatní rezervní fondy	5		
Nerozdělený zisk z předchozích období	6		
Neuhrazená ztráta z předchozích období	7		
Ztráta běžného období	8		
Nehmotný majetek s výjimkou goodwillu	9		
Goodwill	10		
Vlastní akcie	11		
Tier 2	12		
Rezervy na krytí obecných rizik	13		
Podřízený dluh A	14		
Ostatní kapitálové fondy	15		
Tier 3	16		
Omezený tier 3 (1. omezení § 7 odst. 8)	17		
Omezený tier 3 (2. omezení § 7 odst. 9)	18		
Využitelný tier 3	19		
Nevyužitelný tier 3	20		
Využitý tier 3	21		
Nevyužitý tier 3	22		
Odečitatelné položky (§ 7 odst. 5)	23		
kapitálové investice do bank a finančních institucí nad 10 %	24		
kapitálové investice do bank a finančních institucí do 10 %	25		
Ostatní kapitálové investice	26		
Hmotný majetek	27		
Vklady se zbytkovou splatností nad 90 dnů	28		
Poskytnuté úvěry a Ostatní pohledávky se zbytkovou splatností nad 90 dnů	29		
Zásoby	30		
*kapitál	31		

10_ Informování o dodržování kapitálové přiměřenosti

10_02 kapitálové požadavky

A	B	1
Kapitálový požadavek A	1	
Kapitálový požadavek B	2	
Kapitálový požadavek k úvěrovému riziku obchodního portfolia	3	
Kapitálový požadavek k riziku angažovanosti obchodního portfolia	4	
Kapitálový požadavek k obecnému úrokovému riziku	5	
Kapitálový požadavek k obecnému akciovému riziku	6	
Kapitálový požadavek k měnovému riziku	7	
Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku	8	

10 Informování o dodržování kapitálové přiměřenosti

10_03 Propočet kapitálové přiměřenosti

A	B	1
Kapitálová přiměřenost	1	
Kapitálová přiměřenost nevyužitého tier 3	2	

10 Informování o kapitálové přiměřenosti

10_04 Propočet rizikově vážených aktiv investičního portfolia

		Souhrn účetních hodnot a úvěrových ekvivalentů	Vážená hodnota
A	B	1	2
Aktiva investičního portfolia celkem vč. úvěr. ekviv.	1		
Pokladní hodnoty a jiná aktiva zajištěná penězi	2		
Pohledávky za centrálními vládami států zóny A a ES	3		
Pohledávky za centrálními bankami států zóny A	4		
Pohledávky za centrálními vládami států zóny B	5		
Pohledávky za centrálními bankami států zóny B	6		
Reálné hodnoty pevných termínových operací a opcí	7		
Pohledávky zajištěné zástavním právem k dluhopisům	8		
Odečitatelné položky	9		
Pohledávky za bankami ve státech zóny A	10		
Pohledávky za bankami zóny B s pův. splatností do 1 roku včetně	11		
Pohledávky za mezinárodními finančními institucemi	12		
Pohledávky za vládami územních celků států zóny A	13		
Pohledávky za orgány územní samosprávy států zóny A	14		
Pohled. za institucemi podporovanými centrálními vládami států zóny A	15		
Pohledávky za obchodníky zóny A	16		
Pohledávky za osobami provádějícími vypořádání	17		
Finanční nástroje v procesu inkasa a podobné nástroje	18		
kapitálové investice do bank a finančních institucí, které nejsou odečitatelnou položkou	19		
kapitálové investice do právnických osob kromě bank a finančních institucí, které nejsou odečitatelnou položkou	20		
Pohledávky za právnickými a fyzickými osobami kromě bank a finančních institucí, které nejsou odečitatelnou položkou	21		
Pohledávky za centrálními vládami zóny B, kterým nepřísluší riziková váha 0	22		
Pohledávky za centrálními bankami zóny B, kterým nepřísluší riziková váha 0	23		
Pohledávky za vládami územních celků a orgánů samosprávy zóny B	24		
Pohledávky za bankami zóny A a zóny B a investičními firmami v konkursu, likvidaci a nucené správě	25		
Pohledávky za bankami zóny B s původní splatností nad 1 rok	26		
Nesplacena část emise akcií a dluhopisů	27		
Pohledávky za právnickými osobami - finančními institucemi, kterým nepřísluší riziková váha 0,2	28		
Náklady a příjmy příštích období a dohadné účty aktivní	29		
Ostatní aktiva investičního portfolia	30		

10 Informování o kapitálové přiměřenosti

10_05 Konverze vybraných podrozvahových aktiv investičního portfolia

		Účetní hodnota	Úvěrový ekvivalent
A	B	1	2
Vybraná podrozvahová aktiva investičního portfolia celkem	1		
Poskyt. odvolatelné úvěrové přísliby	2		
Poskytnuté úvěrové přísliby ostatní	3		
Poskytnuté platební záruky	4		
Poskytnuté záruky z převedených směnek	5		
Poskytnuta směnečná rukojemství	6		
Poskytnuta přijetí směnek	7		
Pohledávky na vklady, úvěry, dluhopisy, směnky a akcie z pevných termínových operací a delta ekvivalenty opcí	8		

10 Informování o kapitálové přiměřenosti

10_08 Kapitálový požadavek k úvěrovému riziku obchodního portfolia

		Pozice	Kapitálový požadavek
A	B	1	2
Kapitálový požadavek ke specifickému úrokovému riziku	1		
Vládní nástroje	2		
Kvalifikované nástroje se zbytkovou splatností do 6 měsíců včetně	3		
Kvalifikované nástroje se zbytkovou splatností od 6 do 24 měsíců včetně	4		
Kvalifikované nástroje se zbytkovou splatností vyšší než 24 měsíců	5		
ostatní nástroje	6		
Opce ke specifickému úrokovému riziku	7		
Kapitálový požadavek ke specifickému akciovému riziku	8		
Hrubá akciová pozice národních trhů zemí OECD	9		
Hrubá akciová pozice ostatních národních trhů	10		
Hrubá akciová pozice diverzifikovaného portfolia	11		
Opce ke specifickému akciovému riziku	12		
Kapitálový požadavek k vypořádacímu riziku	13		
Kapitálový požadavek k reverzním repům a repům, půjčkám cenných papírů a komodit	14		
Kapitálový požadavek k pevným termínovým operacím a opcím	15		
Kapitálový požadavek ke zbývajícím nástrojům obchodního portfolia	16		

10_Informování o kapitálové přiměřenosti

10_10 Kapitálový požadavek k obecnému úrokovému riziku obchodního portfolia

A	B	1
Kapitálový požadavek k obecnému úrokovému riziku	1	
Kapitálový požadavek k CZK	2	
Kapitálový požadavek k EUR	3	
Kapitálový požadavek k USD	4	
Kapitálový požadavek k ostatním měnám	5	
Kapitálový požadavek zbytkových měn	6	
Kapitálový požadavek k úrokovým futures	7	
Kapitálový požadavek k opcím k obecnému úrokovému riziku	8	

10_Informování o kapitálové přiměřenosti

10_08 Kapitálový požadavek k obecnému akciovému riziku obchodního portfolia

		Pozice	Kapitálový požadavek
A	B	1	2
Kapitálový požadavek k obecnému akciovému riziku	1		
Čistá akciová pozice národních trhů zemi OECD	2		
Čistá akciová pozice ostatních národních trhů	3		
Kapitálový požadavek k akciovým futures	4		
Kapitálový požadavek k opcím (k obecnému akciovému riziku)	5		

10_Informování o kapitálové přiměřenosti

10_09 Kapitálový požadavek k měnovému riziku

		Pozice	Kapitálový požadavek
A	B	1	2
Kapitálový požadavek k měnovému riziku	1		
Kompenzované pozice silně korelovaných měn	2		
Celková měnová pozice	3		
Kapitálový požadavek k měnovým futures	4		
Kapitálový požadavek k opcím (k měnovému riziku)	5		

10_Informování o kapitálové přiměřenosti

10_10 Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku

A	B	1
Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku	1	
Kapitálový požadavek ke komoditnímu riziku bez futures a opcí	2	
Kapitálový požadavek ke komoditním futures	3	
Kapitálový požadavek k opcím (ke komoditnímu riziku)	4	

11 Informování kapitálové přiměřenosti

11_01

o Angažovanost vůči fyzickým a právnickým osobám

Obchodní firma / Jméno	1
Identifikační údaj	2
Sídlo / Bydliště	3
Limit angažovanosti investičního portfolia	4
Hrubá Angažovanost investičního portfolia	5
Čistá Angažovanost investičního portfolia	6
Poměr čisté angaž. investičního portfolia ke kapitálu	7
Opravné položky k hrubé angažovanosti investičního portf.	8
Angažovanost obchodního portfolia	9
Angažovanost obchod. portfolia - součet zbýv. dlouhých pozic	10

11 Informování
kapitálové přiměřenosti

11_02
o Angažovanost vůči
ekonomicky spjaté
skupině osob

Označení ekon. spjaté skupiny osob	1	Celkem vůči skupině	Člen skupiny
Obchodní firma / Jméno	2		
Identifikační údaj	3		
Sídlo / Bydliště	4		
Limit angažovanosti investičního portfolia	5		
Hrubá Angažovanost investičního portfolia	6		
Čistá Angažovanost investičního portfolia	7		
Poměr čisté angaž.investičního portfolia ke kapitálu	8		
Opravné položky k hrubé angažovanosti investičního portf.	9		
Angažovanost obchodního portfolia	10		
Angažovanost obchod. portfolia - součet zbýv. dlouhých pozic	11		