

Informování o kapitálové přiměřenosti

10_ Informovani o dodrzovani kapitalove primerenosti

10_01 Struktura kapitalu

		Ucetni hodnota	Upravena hodnota
A	B	1	2
Tier 1	1		
Splaceny zakladni kapital zapsany v obchodnim rejstriku	2		
Splacene emisni azio	3		
Povinne rezervni fondy	4		
Ostatni rezervni fondy	5		
Nerozdeleny zisk z predchozich obdobi	6		
Neuhrazena ztrata z predchozich obdobi	7		
Ztrata bezneho obdobi	8		
Nehmotny majetek s vyjimkou goodwillu	9		
Goodwill	10		
Vlastni akcie	11		
Tier 2	12		
Rezervy na kryti obecnych rizik	13		
Podrizeny dluh A	14		
Ostatni kapitalove fondy	15		
Tier 3	16		
Omezeny tier 3 (1. omezeni § 7 odst. 8)	17		
Omezeny tier 3 (2. omezeni § 7 odst. 9)	18		
Vyuzitelny tier 3	19		
Nevyuzitelny tier 3	20		
Vyuzity tier 3	21		
Nevyuzity tier 3	22		
Odecatelne polozky (§ 7 odst. 5)	23		
Kapitalove investice do bank a financnich instituci nad 10 %	24		
Kapitalove investice do bank a financnich instituci do 10 %	25		
Ostatni kapitalove investice	26		
Hmotny majetek	27		
Vklady se zbytkovou splatnosti nad 90 dnu	28		
Poskytnute uvery a ostatni pohledavky se zbytkovou splatnosti nad 90 dnu	29		
Zasoby	30		
*Kapital	31		

10_ Informovani o dodrzovani kapitalove primerenosti

10_02 Kapitalove pozadavky

A	B	1
Kapitalovy pozadavek A	1	
Kapitalovy pozadavek B	2	
Kapitalovy pozadavek k uverovemu riziku obchodniho portfolia	3	
Kapitalovy pozadavek k riziku angazovanosti obchodniho portfolia	4	
Kapitalovy pozadavek k obecnemu urokovemu riziku	5	
Kapitalovy pozadavek k obecnemu akciovemu riziku	6	
Kapitalovy pozadavek k menovemu riziku	7	
Kapitalovy pozadavek ke komoditnimu riziku	8	

10 Informovani o dodrzovani kapitalove primerenosti**10_03 Propocet kapitalove primerenosti**

A	B	1
Kapitalova primerenost	1	
Kapitalova primerenost nevyuziteho tier 3	2	

10 Informovani o kapitalove primerenosti**10_04 Propocet rizikove vazenych aktiv investicniho portfolia**

		Souhrn ucetnich hodnot a uverovych ekvivalentu	Vazena hodnota
A	B	1	2
Aktiva investicniho portfolia celkem vc. uver. ekviv.	1		
Pokladni hodnoty a jina aktiva zajistena penezi	2		
Pohledavky za centralnimi vladami statu zony A a ES	3		
Pohledavky za centralnimi bankami statu zony A	4		
Pohledavky za centralnimi vladami statu zony B	5		
Pohledavky za centralnimi bankami statu zony B	6		
Realne hodnoty pevných terminových operaci a opci	7		
Pohledavky zajistene zastavnim pravem k dluhopisum	8		
Odecitatelne polozky	9		
Pohledavky za bankami ve statech zony A	10		
Pohledavky za bankami zony B s puv. splatnosti do 1 roku včetne	11		
Pohledavky za mezinarodnimi financnimi institucemi	12		
Pohledavky za vladami uzemnich celku statu zony A	13		
Pohledavky za organy uzemni samospravy statu zony A	14		
Pohled. za institucemi podporovanymi centralnimi vladami statu zony A	15		
Pohledavky za obchodniky zony A	16		
Pohledavky za osobami provadejicimi vporadani	17		
Financni nastroje v procesu inkasa a podobne nastroje	18		
Kapitalove investice do bank a financnich instituci, které nejsou odecitatelnou polozkou	19		
Kapitalove investice do pravnickych osob krome bank a financnich instituci, které nejsou odecitatelnou polozkou	20		
Pohledavky za pravnickymi a fyzickymi osobami krome bank a financnich instituci, které nejsou odecitatelnou polozkou	21		
Pohledavky za centralnimi vladami zony B, kterym neprislusi rizikova vaha 0	22		
Pohledavky za centralnimi bankami zony B, kterym neprislusi rizikova vaha 0	23		
Pohledavky za vladami uzemnich celku a organu samospravy zony B	24		
Pohledavky za bankami zony A a zony B a investicnimi firmami v konkursu, likvidaci a nucene sprave	25		
Pohledavky za bankami zony B s puvodni splatnosti nad 1 rok	26		
Nesplacena cast emise akcií a dluhopisu	27		
Pohledavky za pravnickymi osobami - financnimi institucemi, kterym neprislusi rizikova vaha 0,2	28		
Naklady a prijmy pristich obdobi a dohadne ucty aktivni	29		
Ostatni aktiva investicniho portfolia	30		

10_ Informovani o kapitalove primerenosti**10_05 Konverze vybranych podrozvahovych aktiv investicniho portfolia**

		Ucetni hodnota	Uverovy ekvivalent
A	B	1	2
Vybrana podrozvahova aktiva investicniho portfolia celkem	1		
Poskyt. odvolatelne uverove prisliby	2		
Poskytnute uverove prisliby ostatni	3		
Poskytnute platebni zaruky	4		
Poskytnute zaruky z prevedenych smenek	5		
Poskytnuta smenecna rukojemstvi	6		
Poskytnuta prijati smenek	7		
Pohledavky na vklady, uvery, dluhopisy, smenky a akcie z pevných termimnových operaci a delta ekvivalenty opci	8		

10_ Informovani o kapitalove primerenosti**10_08 Kapitalovy pozadavek k uverovemu riziku obchodniho portfolia**

		Pozice	Kapitalovy pozadavek
A	B	1	2
Kapitalovy pozadavek ke specifickemu urokovemu riziku	1		
Vladni nastroje	2		
Kvalifikovane nastroje se zbytkovou splatnosti do 6 mesicu vcetne	3		
Kvalifikovane nastroje se zbytkovou splatnosti od 6 do 24 mesicu vcetne	4		
Kvalifikovane nastroje se zbytkovou splatnosti vyssi nez 24 mesicu	5		
Ostatni nastroje	6		
Opce ke specifickemu urokovemu riziku	7		
Kapitalovy pozadavek ke specifickemu akciovemu riziku	8		
Hruba akciová pozice narodnich trhu zemi OECD	9		
Hruba akciová pozice ostatnich narodnich trhu	10		
Hrubá akciová pozice diverzifikovaného portfolia	11		
Opce ke specifickemu akciovemu riziku	12		
Kapitalovy pozadavek k vyporadacimu riziku	13		
Kapitalovy pozadavek k reverznim repum a repum, pujckam cennych papiru a komodit	14		
Kapitalovy pozadavek k pevnym terminovym operacim a opcim	15		
Kapitalovy pozadavek ke zbyvajicim nastrojům obchodniho portfolia	16		

10_ Informovani o kapitalove primerenosti

10_10 Kapitalovy pozadavek k obecnemu urokovemu riziku obchodniho portfolia

A	B	1
Kapitalovy pozadavek k obecnemu urokovemu riziku	1	
Kapitalovy pozadavek k CZK	2	
Kapitalovy pozadavek k EUR	3	
Kapitalovy pozadavek k USD	4	
Kapitalovy pozadavek k ostatnim menam	5	
Kapitalovy pozadavek zbytkovych men	6	
Kapitalovy pozadavek k urokovym futures	7	
Kapitalovy pozadavek k opcim k obecnemu urokovemu riziku	8	

10_ Informovani o kapitalove primerenosti

10_08 Kapitalovy pozadavek k obecnemu akciovemu riziku obchodniho portfolia

		Pozice	Kapitalovy pozadavek
A	B	1	2
Kapitalovy pozadavek k obecnemu akciovemu riziku	1		
Cista akciová pozice narodnich trhu zemi OECD	2		
Cista akciová pozice ostatnich narodnich trhu	3		
Kapitalovy pozadavek k akciovym futures	4		
Kapitalovy pozadavek k opcim (k obecnemu akciovemu riziku)	5		

10_ Informovani o kapitalove primerenosti

10_09 Kapitalovy pozadavek k menovemu riziku

		Pozice	Kapitalovy pozadavek
A	B	1	2
Kapitalovy pozadavek k menovemu riziku	1		
Kompenzovane pozice silne korelovanych men	2		
Celkova menova pozice	3		
Kapitalovy pozadavek k menovym futures	4		
Kapitalovy pozadavek k opcim (k menovemu riziku)	5		

10_ Informovani o kapitalove primerenosti

10_10 Kapitalovy pozadavek ke komoditnimu riziku

A	B	1
Kapitalovy pozadavek ke komoditnimu riziku	1	
Kapitalovy pozadavek ke komoditnimu riziku bez futures a opci	2	
Kapitalovy pozadavek ke komoditnim futures	3	
Kapitalovy pozadavek k opcim (ke komoditnimu riziku)	4	

**11 Informovani o 11_01 Angazovanost
kapitalove primerenosti vuci fyzickym a
pravnicky m osobam**

Obchodni firma / Jmeno	1
IC / RC	2
Sidlo / Bydliste	3
Limit angažovanosti investicního portfolia	4
Hruba angazovanost investicního portfolia	5
Cista angazovanost investicního portfolia	6
Pomer ciste angaz.investicního portfolia ke kapitalu	7
Opravne položky k hrube angazovanosti investicního portf.	8
Angazovanost obchodního portfolia	9
Angazovanost obchod. portfolia - soucet zbyv. dlouhych pozic	10

**11 Informovani
kapitalove primerenosti**

**11_02
o Angazovanost vuci
ekonomicky spjate
skupine osob**

Oznaceni ekon. spjate skupiny osob	1	Celkem vuci skupine	Člen skupiny
Obchodni firma / Jmeno	2		
IC / RC	3		
Sidlo / Bydliste	4		
Limit angažovanosti investičního portfolia	5		
Hrubá angazovanost investicního portfolia	6		
Cista angazovanost investicního portfolia	7		
Pomer ciste angaz.investicního portfolia ke kapitalu	8		
Opravné položky k hrube angazovanosti investicního portf.	9		
Angazovanost obchodního portfolia	10		
Angazovanost obchod. portfolia - součet zbyv. dlouhých pozic	11		