

Kapitálová přiměřenost

31.12.2011

Kapitál

| A | B | 1 |
|---|-----------|---------------|
| Kapitál | 1 | 5 421 |
| Původní kapitál (Tier 1) | 2 | 7 312 |
| Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku | 3 | 4 000 |
| Vlastní akcie | 4 | 0 |
| Emisní ážio | 5 | 0 |
| Rezervní fondy a nerozdělený zisk | 6 | 3 312 |
| Povinné rezervní fondy | 7 | 331 |
| Ostatní fondy z rozdělení zisku | 8 | 0 |
| Nerozdělený zisk z předchozích období | 9 | 2 991 |
| Zisk za účetní období po zdanění | 10 | |
| Neuhrazená ztráta z předchozích období | 11 | -10 |
| Výsledné kurzové rozdíly z konsolidace | 12 | |
| Zisk za běžné účetní období | 13 | 0 |
| Ztráta za běžné účetní období | 14 | 0 |
| Čistý zisk z kapitalizace budouc. příjmů ze sekuritizace | 15 | |
| Zisk/ztráta z ocenění závazků v RH z titulu úvěr. rizika | 16 | |
| Další odčitatelné položky z původního kapitálu | 17 | 0 |
| Goodwill | 18 | |
| Nehmotný majetek jiný než goodwill | 19 | 0 |
| Negat. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. kapitál. nástrojů | 20 | |
| Účastnické CP vydané osobou s kvalifikov. účastí v bance | 21 | |
| Hybridní nástroje celkem | 22 | 0 |
| Hybridní nástroje zohledňované do výše původního kapitálu | 23 | |
| Hybridní nástroje zohledňované do výše 35% původ. kapitálu | 24 | |
| Hybridní nástroje zohledňované do výše 15% původ. kapitálu | 25 | |
| Dodatkový kapitál (Tier 2) | 26 | 0 |
| Hlavní dodatkový kapitál- přebytek v krytí oč.úv.ztrát u IRB | 27 | 0 |
| Přebytek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB | 28 | |
| Překročení limitů pro hybridní nástroje | 29 | |
| Vedlejší dodatkový kapitál | 30 | 0 |
| Podřízený dluh A | 31 | |
| Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů | 32 | |
| Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2) | 33 | -1 891 |
| Kapitálové investice nad 10 % do bank a ost.fin.institucí | 34 | |
| Kapitálové investice nad 10 % do pojišťoven | 35 | |
| Kapitálové investice do 10 % do institucí a fin. institucí | 36 | |
| Význ.obezř.úpravy při tržním oceňování n. oceňování modelem | 37 | |
| Expozice ze sekuritizace s rizik. váhou 1250% | 38 | |
| Nedostatek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB | 39 | |
| Převýšení jiných než význ.obezř.úprav nad podříz.dluhem B | 40 | -1 891 |
| Odpočet u volných dodávek | 41 | |
| Kapitál na krytí tržního rizika (Tier 3) | 42 | 0 |
| Podřízený dluh B | 43 | |
| Jiné než význ. obezř. úpravy při trž. oceň. nebo oceň. modelem | 44 | |

Kapitálová přiměřenost a doplňující informace

| A | B | 1 |
|---|----|--------|
| Původní kapitál (Tier 1) pro propočet kapit. přiměřenosti | 1 | 5 421 |
| Dodatkový kapitál (Tier 2) pro propočet kapit. přiměřenosti | 2 | |
| Kapitál relev. pro výpočet limitů ang.a limitů kval. účastí | 3 | 5 421 |
| Přebyt./nedost. kapitálu před zápočtem přech. kap. pož. | 4 | 3 769 |
| Kapit. přiměřenost před zápočtem přech. kap. pož. | 5 | 26,25% |
| Přebytek/nedostatek kapitálu | 6 | 3 769 |
| Kapitálová přiměřenost | 7 | 26,25% |
| Celková výše podřízeného dluhu | 14 | |

Přehled kapitálových požadavků

| A | B | 1 |
|--|----------|--------------|
| Kapitálové požadavky celkem | 1 | 1 652 |
| Kap. pož. k úvěrovému riziku celkem | 2 | 1 651 |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při STA celkem | 3 | 1 651 |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k expozicím celkem | 4 | 1 651 |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči centr. vládám a bankám | 5 | 0 |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči reg. vládám a míst. orgánům | 6 | |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči org. veřejného sektoru a ost. | 7 | |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči mezinárodním rozvoj. bankám | 8 | |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči mezinárodním organizacím | 9 | |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči institucím | 10 | 1 442 |
| Kap. pož. při STA k podnikovým expoz. | 11 | 209 |
| Kap. pož. při STA k retailovým expoz. | 12 | 0 |
| Kap. pož. při STA k expoz. zajištěným nemovitostmi | 13 | 0 |
| Kap. pož. při STA k expoz. po splatnosti | 14 | 0 |
| Kap. pož. při STA k regulatorně vysoce rizikovým expoz. | 15 | |
| Kap. pož. při STA k expoz. v krytých dluhopisech | 16 | |
| Kap. pož. při STA ke krátkod. expoz. vůči inst. a podn. expoz. | 17 | |
| Kap. pož. při STA k expoz. vůči fondům kolekt. investování | 18 | |
| Kap. pož. při STA k ostatním expoz. | 19 | |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při STA v IRB k expozicím celkem | 20 | 0 |
| Kap. pož. při STA v IRB k expoz. vůči centr. vládám a bankám | 21 | |
| Kap. pož. při STA v IRB k expoz. vůči institucím | 22 | |
| Kap. pož. při STA v IRB k podnikovým expoz. | 23 | |
| Kap. pož. při STA v IRB k retailovým expoz. | 24 | |
| Kap. pož. při STA v IRB k akciovým expoz. | 25 | |
| Kap. pož. při STA v IRB k ostatním expoz. | 26 | |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k sekuritizovaným expozicím | 27 | |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB celkem | 28 | 0 |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k vybr. expozicím celkem | 29 | |
| Kap. pož. při IRB k expoz. vůči centr. vládám a bankám | 30 | |
| Kap. pož. při IRB k expoz. vůči institucím | 31 | |
| Kap. pož. při IRB k podnikovým expoz. | 32 | |
| Kap. pož. při IRB k retailovým expoz. | 33 | |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k akciovým expozicím | 34 | |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k sekuritizovaným expozicím | 35 | |
| Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k ostatním expozicím | 36 | |
| Kap. pož. k vypořádacímu riziku | 37 | |
| Kap. pož. k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku celkem | 38 | 1 |
| Kap. pož. k poz., měn. a kom. riziku při st. přístupu (STA) celkem | 39 | 1 |
| Kap. pož. při STA k úrokovému riziku | 40 | 0 |
| Kap. pož. při STA k akciovému riziku | 41 | 0 |
| Kap. pož. při STA k měnovému riziku | 42 | 1 |
| Kap. pož. při STA ke komoditnímu riziku | 43 | |
| Kap. pož. k poz., měn. a kom. riziku při přístupu založ. na vl.m | 44 | 0 |
| Kap. pož. k operačnímu riziku celkem | 45 | 0 |
| Kap. pož. k oper. riziku při BIA | 46 | 0 |
| Kap. pož. k oper. riziku při TSA | 47 | |
| Kap. pož. k oper. riziku při ASA | 48 | |
| Kap. pož. k oper. riziku při AMA | 49 | |
| Kap. pož. k riziku angažovanosti obch. portfolia | 50 | 0 |
| Kap. pož. k ostatním nástrojům obch. portfolia | 51 | 0 |
| Přechodný kap. pož. - dorovnání k Basel 1 | 52 | 0 |