

**Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP**

Kapitál (DIS20\_01)

DOCOS40

64579018

Údaje v tis. Kč

Sestavil:

Telefon:

Podpis oprávněné osoby:

| ***  |  | S01   |
|------|--|-------|
| R001 | Kapitál  | 39311 |
| R002 | Původní kapitál (Tier1)  | 39856 |
| R003 | Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku        | 25487 |
| R004 | Vlastní podíly   |       |
| R005 | Emisní ážio  | 20077 |
| R006 | Rezervní fondy a nerozdělený zisk                              | -1444 |
| R007 | Povinné rezervní fondy   | 2597  |
| R008 | Ostatní fondy z rozdělení zisku                                |       |
| R009 | Nerozdělený zisk z předchozích období                          |       |
| R010 | Zisk za účetní období po zdanění                               |       |
| R011 | Neuhrazená ztráta z předchozích období                         | -4041 |
| R012 | Výsledné kurzové rozdíly z konsolidace                         | -349  |
| R013 | Zisk za běžné účetní období                                    |       |
| R014 | Ztráta za běžné účetní období                                  | -883  |
| R015 | Čistý zisk z kapitalizace budouc. příjmů ze sekuritizace       |       |
| R016 | Zisk/ztráta z ocenění závazků v RH z titulu úvěr. rizika       |       |
| R017 | Další odčitatelné položky z původního kapitálu                 | -3032 |
| R018 | Goodwill   |       |
| R019 | Nehmotný majetek jiný než goodwill                             | -3032 |
| R020 | Negat. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. kapitál. nástrojů       |       |
| R021 | Účastnické CP vydané osobou s kvalifikov. účastí v bance       |       |
| R022 | Hybridní nástroje celkem                                       |       |
| R023 | Hybridní nástroje zohledňované do výše původního kapitálu      |       |
| R024 | Hybridní nástroje zohledňované do výše 35% původ. kapitálu     |       |
| R025 | Hybridní nástroje zohledňované do výše 15% původ. kapitálu     |       |
| R026 | Dodatkový kapitál (Tier 2)                                     |       |
| R027 | Hlavní dodatkový kapitál                                       |       |
| R028 | Přebytek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB             |       |
| R029 | Překročení limitů pro hybridní nástroje                        |       |
| R030 | Vedlejší dodatkový kapitál                                     |       |
| R031 | Podřízený dluh A   |       |
| R032 | Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů    |       |
| R033 | Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)   | -545  |
| R034 | Kapitálové investice nad 10 % do bank a ost.fin.institucí      |       |
| R035 | Kapitálové investice nad 10 % do pojišťoven                    |       |
| R036 | Kapitálové investice do 10 % do institucí a fin. institucí     |       |
| R037 | Význ.obezř.úpravy při tržním oceňování n. oceňování modelem    |       |
| R038 | Expozice ze sekuritizace s rizik. váhou 1250%                  |       |
| R039 | Nedostatek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB           |       |
| R040 | Převýšení jiných než význ.obezř.úprav nad podřiz.dluhem B      | -545  |
| R041 | Odpočet u volných dodávek                                      |       |
| R042 | Kapitál na krytí tržního rizika (Tier 3)                       |       |
| R043 | Podřízený dluh B   |       |
| R044 | Jiné než význ. obezř. úpravy při trž. oceň. nebo oceň. modelem |       |

**Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP**

Přehled kapitálových požadavků (DIS20\_02)

DOCOS40

Sestavil:  
Telefon:  
Podpis oprávněné osoby:

64579018

Údaje v tis. Kč

| ***  |   | S01  |
|------|---|------|
| R001 | Kapitálové požadavky celkem                                       | 8624 |
| R002 | Kap. pož. k úvěrovému riziku celkem                               | 8624 |
| R003 | Kap. pož. k úvěr. riziku při STA celkem                           | 8624 |
| R004 | Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k expozicím celkem               | 8624 |
| R005 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči centr. vládám a bankám            |      |
| R006 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči reg. vládám a míst. orgánům       |      |
| R007 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči org. veřejného sektoru a ost.     |      |
| R008 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči mezinárodním rozvoj. bankám       |      |
| R009 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči mezinárodním organizacím          |      |
| R010 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči institucím                        | 227  |
| R011 | Kap. pož. při STA k podnikovým expoz.                             |      |
| R012 | Kap. pož. při STA k retailovým expoz.                             | 855  |
| R013 | Kap. pož. při STA k expoz. zajištěným nemovitostmi                |      |
| R014 | Kap. pož. při STA k expoz. po splatnosti                          |      |
| R015 | Kap. pož. při STA k regulatorně vysoce rizikovým expoz.           |      |
| R016 | Kap. pož. při STA k expoz. v krytých dluhopisech                  |      |
| R017 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči inst. a podn. - s krátk. ratingem |      |
| R018 | Kap. pož. při STA k expoz. vůči fondům kolekt. investování        |      |
| R019 | Kap. pož. při STA k ostatním expoz.                               | 7542 |
| R020 | Kap. pož. k úvěr. riziku při STA v IRB k expozicím celkem         |      |
| R021 | Kap. pož. při STA v IRB k expoz. vůči centr. vládám a bankám      |      |
| R022 | Kap. pož. při STA v IRB k expoz. vůči institucím                  |      |
| R023 | Kap. pož. při STA v IRB k podnikovým expoz.                       |      |
| R024 | Kap. pož. při STA v IRB k retailovým expoz.                       |      |
| R025 | Kap. pož. při STA v IRB k akciovým expoz.                         |      |
| R026 | Kap. pož. při STA v IRB k ostatním expoz.                         |      |
| R027 | Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k sekuritizovaným expozicím      |      |
| R028 | Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB celkem                           |      |
| R029 | Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k vybr. expozicím celkem         |      |
| R030 | Kap. pož. při IRB k expoz. vůči centr. vládám a bankám            |      |
| R031 | Kap. pož. při IRB k expoz. vůči institucím                        |      |
| R032 | Kap. pož. při IRB k podnikovým expoz.                             |      |
| R033 | Kap. pož. při IRB k retailovým expoz.                             |      |
| R034 | Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k akciovým expozicím             |      |
| R035 | Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k sekuritizovaným expozicím      |      |
| R036 | Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k ostatním expozicím             |      |
| R037 | Kap. pož. k vypořádacímu riziku                                   |      |
| R038 | Kap. pož. k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku celkem       |      |
| R039 | Kap. pož. k trž. riziku při stand. přístupu (STA) celkem          |      |
| R040 | Kap. pož. při STA k úrokovému riziku                              |      |
| R041 | Kap. pož. při STA k akciovému riziku                              |      |
| R042 | Kap. pož. při STA k měnovému riziku                               |      |
| R043 | Kap. pož. při STA ke komoditnímu riziku                           |      |
| R044 | Kap. pož. k trž. riziku při přístupu založ. na vl. modelech       |      |
| R045 | Kap. pož. k operačnímu riziku celkem                              |      |
| R046 | Kap. pož. k oper. riziku při BIA                                  |      |
| R047 | Kap. pož. k oper. riziku při TSA                                  |      |
| R048 | Kap. pož. k oper. riziku při ASA                                  |      |
| R049 | Kap. pož. k oper. riziku při AMA                                  |      |
| R050 | Kap. pož. k riziku angažovanosti obch. portfolia                  |      |
| R051 | Kap. pož. k ostatním nástrojům obch. portfolia                    |      |
| R052 | Přechodný kap. pož. - dorovnání k Basel 1                         |      |

**Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP**

Kapitálová přiměřenost a doplňující informace (DIS20\_03)

DOCOS40

64579018

Údaje v tis. Kč

| ***  |  | S01   |
|------|--|-------|
| R001 | Původní kapitál (Tier 1) pro propočet kapit. přiměřenosti    | 39311 |
| R002 | Dodatkový kapitál (Tier 2) pro propočet kapit. přiměřenosti  |       |
| R003 | Kapitál relev. pro výpočet limitů ang.a limitů kval. účastí  | 39311 |
| R004 | Přebyt./nedost. kapitálu před zápočtem přech. kap. pož.      | 21008 |
| R005 | Kapit. přiměřenost před zápočtem přech. kap. pož.            | 17,18 |
| R006 | Přebytek/nedostatek kapitálu                                 | 21008 |
| R007 | Kapitálová přiměřenost                                       | 17,18 |
| R008 | Přebytek/nedostatek v krytí oček. ztrát při IRB              |       |
| R009 | Úpravy ocenění expozic a rezervy k podrozv. položkám při IRB |       |
| R010 | Opravné položky k portfoliím expozic při IRB                 |       |
| R011 | Opravné položky k individuálním expozicím při IRB            |       |
| R012 | Ost.úpravy ocenění expozic a rezervy k podrozv.polož.při IRB |       |
| R013 | Očekávané úvěrové ztráty při IRB                             |       |
| R014 | Celková výše podřízeného dluhu                               |       |

Sestavil:

Telefon:

Podpis oprávněné osoby:

**Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP**

Dodatečné informace ke kapitálu a kap. požadavkům pro OCP (DOCO40\_14)

DOCOS40

Sestavil:  
Telefon:  
Podpis oprávněné osoby:

64579018

Údaje v tis. Kč

| ***  |  | S01   |
|------|--|-------|
| R001 | Nelikvidní aktiva                                | 545   |
| R002 | Hmotný majetek a zásoby                          | 545   |
| R003 | Pohledávky se zbytkovou splatností nad 90 dnů    |       |
| R004 | Ostatní kapitálové investice                     |       |
| R005 | Nelikvidní aktiva pro Tier 3                     |       |
| R006 | Kap. pož. pro OCP s omezeným rozsahem IS 1       | 18303 |
| R007 | Kap. pož. pro OCP s omezeným rozsahem IS 2       |       |
| R008 | Kap. pož. na základě režijních nákladů           | 18303 |
| R009 | Kap. pož. k úvěrovému riziku invest. portfolia   |       |
| R010 | Kap. pož. k úvěrovému riziku obchod. portfolia   |       |
| R011 | Kap. pož. k riziku protistrany obchod. portfolia |       |
| R012 | Kap. pož. k volným dodávkám obch. portfolia      |       |