

Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP

Kapitál (DIS20_01)

DOCOS40

Sestavil:

Telefon:

Podpis oprávněné osoby:

64579018

Údaje v tis. Kc

***		S01
R001	Kapitál	27978
R002	Původní kapitál (Tier1)	28085
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	-418
R013	Zisk za běžné účetní období	
R014	Ztráta za běžné účetní období	-13754
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	-1863
R018	Goodwill	
R019	Nehmotný majetek jiný než goodwill	-1863
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)	-107
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	-107
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. Kc

***		S01
R001	Kapitálové požadavky celkem	9670
R002	Kap. pož. k úvěrovému riziku celkem	9670
R003	Kap. pož. k úvěr. riziku při STA celkem	9670
R004	Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k expozicím celkem	9670
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	70
R011	Kap. pož. při STA k podnikovým expoz.	
R012	Kap. pož. při STA k retailovým expoz.	1005
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.	8595
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 k 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	

Česká národní banka (OCP20110101.01)

Axa - Investiční společnost

Stav ke dni: 31.12.2011

Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP

Kapitálová přiměřenost a doplňující informace (DIS20_03)

DOCOS40

Sestavil:

Telefon:

Podpis oprávněné osoby:

64579018

Údaje v tis. Kc

***		S01
R001	Původní kapitál (Tier 1) pro propočten kapit. přiměřenosti	27978
R002	Dodatkový kapitál (Tier 2) pro propočten kapit. přiměřenosti	
R003	Kapitál relev. pro výpočet limitů ang. a limitů kval. účastí	27978
R004	Přebyt./nedost. kapitálu před zápočtem přech. kap. pož.	9675
R005	Kapit. přiměřenost před zápočtem přech. kap. pož.	12,23
R006	Přebytek/nedostatek kapitálu	9675
R007	Kapitálová přiměřenost	12,23
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	

Česká národní banka (OCP20110101.01)

Axa - Investiční společnost

Stav ke dni:

31.12.2011

Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP

Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem (DIS20_60)

DOCOS40

Sestavil:

Telefon:

Podpis oprávněné osoby:

64579018

Údaje v tis. Kč

		Hrubá hodnota expozice	Úprava ocenění expozic a rezervy k podrozvah. položkám	Čistá hodnota expozice	Expozice po zohlednění substitučního vlivu zajištění	Plně upravená hodnota expozice E*	Hodnota expozice po konverzi	Rizikově vážená expozice	Kapitálový požadavek
***		S01	S02	S03	S04	S05	S06	S07	S08
R001	Celkem:	136899		136899	136899	136899	136899	120873	9670

Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP

Dodatečné informace ke kapitálu a kap. požadavkům pro OCP (DOC040_14)

DOCOS40

Sestavil:

Telefon:

Podpis oprávněné osoby:

64579018

Údaje v tis. Kc

***		S01
R001	Nelikvidní aktiva	107
R002	Hmotný majetek a zásoby	107
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	