

Cálculo de los Fondos Propios Consolidados a 30 de junio de 2010

Anexo

Grupo
Banque Privée Edmond de Rothschild



BANQUE PRIVÉE
EDMOND DE ROTHSCHILD

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2010
ANEXO

Riesgo de crédito geográfico (en miles de CHF)

Compromisos de crédito	Suiza	Europa	Liechtenstein	Caribe	América del Norte	América del Sur	Asia	África	Oceanía	Total sin metales
Balance / créditos:										
Créditos sobre bancos	818'687	6'346'096	0	2'090	137'588	903	46'013	1'546	10'148	7'363'071
Créditos sobre clientes	133'022	838'658	1'643	358'547	24'870	10'687	32'467	33'774	8'102	1'441'770
Créditos hipotecarios	12'191	2'900	0	0	0	0	0	0	0	15'091
Inmovilizaciones financieras /										
Títulos de crédito / Valores	139'372	117'331	263	6'308	9'299	0	687	0	14'407	287'667
Otros activos /	46'062	94'035	4	13'423	85	106	2	0	1	153'718
Valores de sustitución positivos	51'666	340'789	861	40'281	5'703	1'099	1'323	172	775	442'669

Fuera del balance

Compromisos contingentes /										
Créditos por compromisos	10'852	62'283	316	48'666	2'217	2'826	1'706	3'001	590	132'457
Compromisos irrevocables	6'073	4'807	0	5'470	294	344	87	1'023	101	18'198
Compromiso de liberar										
desembolsos adicionales	2'751	0	0	0	0	0	0	0	0	2'751
Incrementos	64'911	124'095	78	19'611	5'491	736	1'659	159	860	217'600
Valores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Correcciones de valores y provisiones generales	-65'627	-23'779	0	-2	0	0	0	0	0	-89'408
Total a 30.06.10	1'219'960	7'907'215	3'165	494'394	185'547	16'701	83'944	39'675	34'984	9'985'584

Presentación de los préstamos a los clientes compromiso según las zonas geográficas

Préstamos a los clientes a 30.06.10

Compromisos (importe bruto)	10'661	181	5	219	4	44	1	6	0	11'121
Correcciones de valores individuales	10'661	181	5	219	4	44	1	6	0	11'121

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2010
ANEXO

Riesgo crédito / distribución según las partes en el contrato o sector (en miles de CHF)

Compromisos de crédito	Gobiernos centrales y Bancos centrales	Bancos y Comerciantes	Créditos sobre colectividades de derecho público	Empresas	Particulares	Títulos de participación	Otras exposiciones	Total
Balance / créditos:								
Créditos sobre bancos	0	7'362'266	0	0	805	0	0	7'363'071
Créditos sobre clientes	3'094	75'166	962	726'599	629'782	0	6'167	1'441'770
Créditos hipotecarios	0	373	0	587	14'131	0	0	15'091
Inmovilizaciones financieras /								
Títulos de crédito / Valores	80'774	104'253	17'032	37'405	0	41'609	6'594	287'667
Otros activos /	180	34'238	58'518	5'556	790	0	54'436	153'718
Valores de sustitución positivos	543	131'161	1'139	260'854	48'882	0	90	442'669
Fuera del balance								
Compromisos contingentes /								
Créditos por compromisos	360	3'146	1'276	57'889	69'724	0	62	132'457
Compromisos irrevocables	0	897	5'176	3'031	9'094	0	0	18'198
Compromiso de liberar								
desembolsos adicionales	0	0	0	2'751	0	0	0	2'751
Incrementos	1'074	130'902	163	58'928	26'339	0	194	217'600
Valores	0	0	0	0	0	0	0	0
Correcciones de valores y provisiones generales	0	0	0	0	0	0	-89'408	-89'408
Total a 30.06.10	86'025	7'842'402	84'266	1'153'600	799'547	41'609	-21'865	9'985'584

GRUPO BANQUE PRIVÉE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2010
ANEXO

Segmentación del riesgo crédito (en miles de CHF)										
Ponderaciones-riesgo reglamentarias										
Compromisos de crédito	0%	20/25%	35%	50%	75%	100%	125%	150%	250%	Total
Balance / créditos:										
Créditos sobre bancos	5'472'436	1'670'120	0	219'709	0	806	0	0	0	7'363'071
Créditos sobre clientes	726'056	35'772	0	218	82'523	596'580	0	621	0	1'441'770
Créditos hipotecarios	4'583	0	0	0	0	10'508	0	0	0	15'091
Inmovilizaciones financieras /										
Títulos de crédito / Valores	80'271	110'187	0	46'176	0	19'788	0	31'245	0	287'667
Otros activos /	639	33'866	0	2	66	119'145	0	0	0	153'718
Valores de sustitución positivos	239'658	76'681	0	47'063	2'519	76'742	0	6	0	442'669
Fuera del balance										
Compromisos contingentes /										
Créditos por compromisos	86'351	1'524	0	206	5'017	39'359	0	0	0	132'457
Compromisos irrevocables	5'394	5'176	0	897	6'107	616	0	8	0	18'198
Compromiso de liberar										
desembolsos adicionales	0	0	0	0	0	2'751	0	0	0	2'751
Incrementos	48'061	98'161	0	27'493	3'494	40'389	0	2	0	217'600
Valores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Correcciones de valores y provisiones generales	-89'408	0	0	0	0	0	0	0	0	-89'408
Total a 30.06.10	6'574'041	2'031'487	0	341'764	99'726	906'684	0	31'882	0	9'985'584

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2010
ANEXO

Riesgo de crédito / atenuación del riesgo de crédito (en miles de CHF)						
Compromisos de crédito	cubiertos por garantías financieras reconocidas	cubiertos por garantías y por derivados de crédito	caución base cubierta	otros	Sin garantías	Total
Balance / créditos:						
Créditos sobre bancos	5'987'785	0	0	0	1'375'286	7'363'071
Créditos sobre clientes	711'385	32'902	1'544	14'671	681'268	1'441'770
Créditos hipotecarios	4'583	0	10'480	0	28	15'091
Inmovilizaciones financieras /						
Títulos de crédito / Valores	0	0	0	0	287'667	287'667
Otros activos /	420	266	0	0	153'032	153'718
Valores de sustitución positivos	237'779	0	0	1'880	203'010	442'669
Fuera del balance						
Compromisos contingentes /						
Créditos por compromisos	86'038	0	0	1'439	44'980	132'457
Compromisos irrevocables	4'994	0	0	754	12'451	18'198
Compromiso de liberar						
desembolsos adicionales	0	0	0	0	2'751	2'751
Incrementos	47'662	0	0	399	169'539	217'600
Valores	0	0	0	0	0	0
Correcciones de valores y provisiones generales	0	0	0	0	-89'408	-89'408
Total a 30.06.10	7'080'646	33'168	12'024	19'143	2'840'604	9'985'584