

Cálculo de los Fondos Propios Consolidados a 30 de junio de 2011

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 2011
ANEXO

Riesgo de crédito geográfico (en miles de CHF)									
Compromisos de crédito	Suiza	Europa	Caribe	América del Norte	América del Sur	Asia	África	Oceanía	Total sin metales
Balance / créditos:									
Tesorería	224'249	239'477	0	182	5	1	0	0	463'914
Créditos sobre bancos	988'645	6'264'861	1'935	109'804	537	42'254	1'093	100'222	7'509'349
- incluye pactos de reventa	760'992	5'161'262	0	0	0	0	0	0	5'922'254
Créditos sobre clientes	394'449	881'089	277'256	29'484	13'496	32'849	30'882	8'255	1'667'759
Créditos hipotecarios	11'179	2'900	0	0	0	0	0	0	14'079
La cartera de efectos / De negociación									
Inmovilizado financiero / Participaciones	565'239	136'733	5'755	12'379	2'660	2'810	0	16'648	742'224
Otros activos	42'214	84'979	13'631	1'503	59	468	0	1	142'856
Valores de sustitución positivos	105'054	161'342	16'438	1'897	230	956	451	914	287'282
Fuera del balance									
Compromisos contingentes /									
Créditos por compromisos	67'921	32'885	44'059	2'395	2'772	1'530	2'738	396	154'695
Compromisos irrevocables	6'590	8'869	0	0	0	0	0	0	15'459
Compromiso de liberar									
desembolsos adicionales	2'500	0	0	0	0	0	0	0	2'500
Incrementos ("add-on")	73'322	120'796	7'924	1'321	293	824	297	681	205'458
Total a 30.06.2011	2'481'361	7'933'929	366'998	158'965	20'052	81'692	35'460	127'117	11'205'574
Total a 31.12.2010	2'741'178	8'321'099	411'470	197'569	18'183	90'247	32'404	41'095	11'853'245

Presentación de los préstamos a los clientes compromiso según las zonas geográficas									30.06.2011	31.12.2010
Compromisos (importe bruto)	8'692	63	21	2	50	78	7	0	8'913	10'014
Correcciones de valores individuales	8'692	63	21	2	50	78	7	0	8'913	10'014

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2011
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 sin metales
Balance / créditos:								
Tesorería	454'323	0	0	0	0	0	9'591	463'914
Créditos sobre bancos	48'284	7'437'619	0	21'350	2'096	0	0	7'509'349
- incluye pactos de reventa	0	5'922'254	0	0	0	0	0	5'922'254
Créditos sobre clientes	2'538	68'291	683	899'303	694'232	0	2'712	1'667'759
Créditos hipotecarios	0	362	0	546	13'171	0	0	14'079
La cartera de efectos / De negociación								
Inmovilizado financiero / Participaciones	496'738	91'527	16'984	86'900	0	41'774	8'300	742'224
Otros activos	0	20'256	0	24'760	376	0	97'464	142'856
Valores de sustitución positivos	78	194'082	49	69'535	23'316	0	223	287'282
Fuera del balance								
Compromisos contingentes /								
Créditos por compromisos	264	57'759	1'198	47'682	47'678	0	114	154'695
Compromisos irrevocables	0	0	6'590	0	8'869	0	0	15'459
Compromiso de liberar								
desembolsos adicionales	0	0	0	2'500	0	0	0	2'500
Incrementos ("add-on")	239	137'212	121	55'903	11'777	0	204	205'458
Total a 30.06.2011	1'002'464	8'007'108	25'626	1'208'479	801'515	41'774	118'607	11'205'574
Total a 31.12.2010	955'440	8'950'468	24'824	953'543	804'066	40'621	124'283	11'853'245

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2011
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 sin metales
Balance / créditos:										
Tesorería	463'914	0	0	0	0	0	0	0	0	463'914
Créditos sobre bancos	5'970'544	1'388'610	0	139'316	0	10'878	0	0	0	7'509'349
- incluye pactos de reventa	5'922'254	0	0	0	0	0	0	0	0	5'922'254
Créditos sobre clientes	1'006'780	41'569	0	298	113'456	505'055	0	601	0	1'667'759
Créditos hipotecarios	2'180	0	0	0	0	11'899	0	0	0	14'079
La cartera de efectos / De negociación										
Inmovilizado financiero / Participaciones	494'732	125'927	0	59'874	0	35'821	0	25'871	0	742'224
Otros activos	288	20'244	0	7	114	122'203	0	0	0	142'856
Valores de sustitución positivos	85'432	90'799	0	94'603	2'547	13'901	0	0	0	287'282
Fuera del balance										
Compromisos contingentes /										
Créditos por compromisos	67'217	2'680	0	54'660	4'464	25'674	0	0	0	154'695
Compromisos irrevocables	0	6'590	0	0	0	8'869	0	0	0	15'459
Compromiso de liberar										
desembolsos adicionales	0	0	0	0	0	2'500	0	0	0	2'500
Incrementos ("add-on")	53'287	90'748	0	41'788	2'594	17'041	0	0	0	205'458
Total a 30.06.2011	8'144'372	1'767'167	0	390'546	123'175	753'841	0	26'472	0	11'205'574
Total a 31.12.2010	7'962'927	2'407'441	0	480'734	105'294	869'114	0	27'735	0	11'853'245

GRUPO BANQUE PRIVÉE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2011
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	Garantía hipotecaria	otros	Sin garantías	Total sin metales
Balance / créditos:						
Tesorería 1)	0	0	0	0	463'914	463'914
Créditos sobre bancos	6'350'815	0	0	0	1'158'534	7'509'349
- incluye pactos de reventa	5'922'254	0	0	0	0	5'922'254
Créditos sobre clientes	1'485'968	41'149	0	12'058	128'584	1'667'759
Créditos hipotecarios	2'180	0	11'835	0	63	14'079
La cartera de efectos / De negociación						
Inmovilizado financiero / Participaciones	0	0	0	0	742'224	742'224
Otros activos	287	362	0	0	142'206	142'856
Valores de sustitución positivos	85'289	364	0	143	201'486	287'282
Fuera del balance						
Compromisos contingentes /						
Créditos por compromisos	64'932	571	0	1'397	87'794	154'695
Compromisos irrevocables	0	0	0	0	15'459	15'459
Compromiso de liberar desembolsos adicionales	0	0	0	0	2'500	2'500
Incrementos ("add-on")	53'268	0	0	19	152'172	205'458
Total a 30.06.2011	8'042'739	42'446	11'835	13'618	3'094'935	11'205'574
Total a 31.12.2010	8'668'247	29'374	14'177	151'523	2'989'924	11'853'245

1) incluye KCHF 454'323 directamente a la vista, en el Banco Nacional Suizo y el Banco Central de Luxemburgo.