

Cálculo de los Fondos Propios Consolidados a 30 de junio de 2012

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 2012
ANEXO

Riesgo de crédito geográfico (en miles de CHF)									
Compromisos de crédito	Suiza	Europa	Caribe	América del Norte	América del Sur	Asia	África	Oceania	Total sin metales
Balance / créditos:									
Tesorería	2'872'702	944'638	0	295	5	361	0	0	3'818'001
Créditos sobre bancos	405'245	6'417'069	2'863	153'483	300	15'427	146	3'900	6'998'432
- incluye pactos de reventa	248'274	4'089'156	0	0	0	0	0	0	4'337'430
Créditos sobre clientes	335'032	1'086'162	215'054	49'664	9'218	42'538	14'228	9'883	1'761'780
Créditos hipotecarios	5'473	6'500	0	0	0	0	0	0	11'973
La cartera de efectos / De negociación									
Inmovilizado financiero / Participaciones	131'523	135'012	3'533	12'262	3'339	9'262	0	16'457	311'388
Otros activos	39'580	97'879	5'511	135	27	1'567	17	52	144'769
Valores de sustitución positivos	27'396	134'963	6'718	1'972	2'428	994	155	963	175'588
Fuera del balance									
Compromisos contingentes /									
Créditos por compromisos	72'615	47'601	34'894	2'795	3'937	2'079	4'955	1'301	170'178
Compromisos irrevocables	6'700	10'558	0	0	0	0	0	0	17'258
Compromiso de liberar									
desembolsos adicionales	2'178	0	0	0	0	0	0	0	2'178
Incrementos ("add-on")	50'689	85'571	8'607	1'887	3'734	1'781	364	998	153'632
Total a 30.06.2012	3'949'134	8'965'954	277'181	222'493	22'987	74'009	19'866	33'553	13'565'177
Total a 31.12.2011	3'193'470	9'279'247	327'680	214'669	29'304	77'213	23'706	31'791	13'177'079

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2012
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	0	0	0	0	0	0	3'818'001	3'818'001
Créditos sobre bancos	1'413'872	5'531'244	0	34'384	18'932	0	0	6'998'432
- incluye pactos de reventa	0	4'337'430	0	0	0	0	0	4'337'430
Créditos sobre clientes	15'696	287'896	3'371	736'040	715'328	0	3'449	1'761'780
Créditos hipotecarios	0	65	0	589	11'319	0	0	11'973
La cartera de efectos / De negociación								
Inmovilizado financiero / Participaciones	60'960	79'515	15'001	93'713	0	44'106	18'093	311'388
Otros activos	94	24'204	0	20'566	604	0	99'301	144'769
Valores de sustitución positivos	3'731	51'246	127	107'450	12'907	0	127	175'588
Fuera del balance								
Compromisos contingentes /								
Créditos por compromisos	6'951	64'984	1'825	41'379	54'880	0	158	170'178
Compromisos irrevocables	0	0	6'700	0	10'558	0	0	17'258
Compromiso de liberar								
desembolsos adicionales	0	0	0	2'178	0	0	0	2'178
Incrementos ("add-on")	1'385	112'697	56	23'607	15'719	0	168	153'632
Total a 30.06.2012	1'502'689	6'151'852	27'080	1'059'906	840'248	44'106	3'939'296	13'565'177
Total a 31.12.2011	4'808'168	6'418'447	29'147	1'028'852	751'407	38'260	102'798	13'177'079

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2012
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	3'818'001	0	0	0	0	0	0	0	0	3'818'001
Créditos sobre bancos	5'751'295	1'160'749	0	49'620	0	36'768	0	0	0	6'998'432
- incluye pactos de reventa	4'337'430	0	0	0	0	0	0	0	0	4'337'430
Créditos sobre clientes	999'621	248'521	0	642	63'079	449'917	0	0	0	1'761'780
Créditos hipotecarios	1'684	0	0	0	0	10'289	0	0	0	11'973
La cartera de efectos / De negociación										
Inmovilizado financiero / Participaciones	57'540	110'342	0	73'511	0	37'655	0	32'341	0	311'388
Otros activos	659	24'153	0	0	122	119'835	0	0	0	144'769
Valores de sustitución positivos	124'178	31'083	0	12'272	474	7'580	0	1	0	175'588
Fuera del balance										
Compromisos contingentes /										
Créditos por compromisos	81'542	3'144	0	57'276	5'972	22'244	0	0	0	170'178
Compromisos irrevocables	0	6'700	0	0	0	10'558	0	0	0	17'258
Compromiso de liberar										
desembolsos adicionales	0	0	0	0	0	2'178	0	0	0	2'178
Incrementos ("add-on")	32'225	91'277	0	16'886	388	12'856	0	0	0	153'632
Total a 30.06.2012	10'866'745	1'675'970	0	210'206	70'035	709'879	0	32'342	0	13'565'177
Total a 31.12.2011	10'623'733	1'445'284	0	268'323	96'242	716'109	0	27'387	0	13'177'079

GRUPO BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CÁLCULO DE LOS FONDOS PROPIOS CONSOLIDADOS A 30 DE JUNIO DE 2012
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	3'818'001	3'818'001
Créditos sobre bancos 2)	4'337'424	0	0	0	2'661'008	6'998'432
- incluye pactos de reventa	4'337'430	0	0	0	0	4'337'430
Créditos sobre clientes	949'658	48'583	0	49'963	713'576	1'761'780
Créditos hipotecarios	1'684	0	10'274	0	15	11'973
La cartera de efectos / De negociación						
Inmovilizado financiero / Participaciones	0	0	0	0	311'388	311'388
Otros activos	559	481	0	6	143'722	144'769
Valores de sustitución positivos	123'881	792	0	297	50'619	175'588
Fuera del balance						
Compromisos contingentes /						
Créditos por compromisos	79'755	1'516	0	1'787	87'120	170'178
Compromisos irrevocables	0	0	0	0	17'258	17'258
Compromiso de liberar						
desembolsos adicionales	0	0	0	0	2'178	2'178
Incrementos ("add-on")	31'835	0	0	391	121'407	153'632
Total a 30.06.2012	5'524'795	51'373	10'274	52'444	7'926'292	13'565'177
Total a 31.12.2011	7'620'851	50'840	8'939	35'156	5'461'293	13'177'079

1) incluye sin garantías KCHF 3'805'253 directamente a la vista, en el Banco Nacional Suizo y el Banco Central de Luxemburgo (cuentas de depósito).

1) incluye sin garantías KCHF 984'401 directamente a la vista en el Banco Central de Luxemburgo (cuentas a plazo).