

Calcul des Fonds Propres Consolidés au 30 juin 2012

Groupe
Banque Privée Edmond de Rothschild



BANQUE PRIVÉE
EDMOND DE ROTHSCHILD

GROUPE BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD
CALCUL DES FONDS PROPRES CONSOLIDES AU 30 JUIN 2012

30.06.2012
(en milliers CHF)

| Calcul des fonds propres | |
|---|------------------|
| Présentation des fonds propres pouvant être pris en compte | |
| Fonds propres de base bruts (après déduction des propres titres de participation) | 1'275'853 |
| dont intérêts minoritaires | 0 |
| dont instruments « novateurs » | 0 |
| (-) déduction réglementaire | 0 |
| (-) autres éléments à porter en déduction des fonds propres de base | -130'012 |
| = fonds propres de base pouvant être pris en compte | 1'145'841 |
| + fonds propres complémentaires et supplémentaires | 0 |
| (-) autres déductions à imputer sur les fonds propres | 0 |
| Fonds propres pouvant être pris en compte | 1'145'841 |
| Présentation des fonds propres requis | |
| Risques de crédit | 100'069 |
| -dont risques de cours relatifs aux titres de participation dans le portefeuille de la banque | 4'822 |
| Risques non liés à des contreparties | 20'422 |
| Risques de marché | 49'298 |
| -dont sur instruments de taux d'intérêt (risque de marché général et spécifique) | 2'228 |
| -dont sur titres de participation | 4'527 |
| -dont sur devises et métaux précieux | 36'597 |
| -dont sur matières premières | 5'005 |
| Risques opérationnels | 91'614 |
| Total | 261'403 |
| AS-BRI : exigences supplémentaires suisses de fonds propres (multiplicateurs) | 57'601 |
| Total | 319'004 |
| Rapport entre les fonds propres pris en compte et les fonds propres requis selon le droit suisse | 3.59 |
| Ratios BRI en % | |
| Fonds propres de base pouvant être pris en compte (y compris les instruments novateurs) | 28.7% |
| Fonds propres pouvant être pris en compte | 28.7% |