



algorithmic
trading

www.rsj.cz

RSJ a.s.

(dále jen „Společnost“)

Údaje o Společnosti, o složení akcionářů, o činnosti a finanční situaci dle ustanovení § 206 vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 30. 06. 2011

1. Údaje o povinné osobě

Název společnosti: **RSJ a.s.**

Sídlo: **Tržiště 366/13, 118 00 Praha 1**

IČ: **00884855**

Zápisy do OR:

- 18. 7. 2001, změna právní formy společnosti z RSJ Invest, spol. s r.o. (den zápisu do OR 31. 5. 1994) na RSJ Invest, a.s. (Krajský soud v Plzni, oddíl B, vložka 932)
- 6. 10. 2008, změna sídla Společnosti (Městský soud v Praze, oddíl B, vložka 14743)
- 2. 12. 2008, rozšířen předmět podnikání o výrobu, obchod a služby neuvedené v přílohách 1 až 3 živnostenského zákona
- 8. 3. 2010, změna názvu společnosti z RSJ Invest, a.s. na RSJ a.s.

Údaje o vlastních akciích a základním kapitálu obchodníka s CP:

- základní kapitál činí 27 000 000,- Kč (v roce 2001 došlo ke zvýšení základního kapitálu z 10 000 000,- Kč na 27 000 000,- Kč – den zápisu do OR je 10. 10. 2001, splaceno v plné výši);
- celkový objem emise 27 000 000,- Kč je rozdělen na 27 tis. ks akcií o jmenovité hodnotě 1 000,- Kč;
- akcie jsou na jméno, v listinné podobě, nejsou kótované;
- akcie jsou omezeně převoditelné – k převodu akcie na jinou osobu je nutný souhlas představenstva společnosti, akcionáři společnosti mají předkupní právo k akciím každý v poměru splacené jmenovité hodnoty svých akcií k základnímu kapitálu, které jsou povinni využít do 21 dnů po té, co se o volných akciích dozví;
- akcionář má právo na podíl na zisku společnosti (dividendě), který valná hromada podle výsledku hospodaření určila k rozdělení, právo účastnit se valné hromady, hlasovací právo, právo na likvidačním zůstatku;
- každých 1 000,- Kč jmenovité hodnoty představuje 1 hlas na valné hromadě;
- v předchozích letech nebyly vyplaceny žádné dividendy;
- o výplatě dividend rozhoduje na návrh představenstva valná hromada společnosti, tento návrh musí být přezkoumán dozorčí radou společnosti. Nárok na výplatu dividendy vzniká všem akcionářům k rozhodnému dni. Datum rozhodné pro výplatu dividend je datum konání valné hromady, která o výplatě rozhodla.

Počet zaměstnanců: 46

Představenstvo:

Jméno, příjmení a titul	funkce	Od	do
Karel Janeček, PhD.	předseda	23.02.2010	dosud
Ing.Libor Winkler, CSc.	člen	23.02.2010	dosud
Ing.Michal Šaňák	člen	06.02.2009	dosud

Karel Janeček, PhD.

Je zakladatelem společnosti RSJ a.s. a zároveň jejím největším akcionářem. Ve společnosti zodpovídá za obchodování na derivátových burzách. Vytváří matematické modely, stanovuje investiční strategii a podílí se na vyhledávání nových příležitostí. Publikuje v prestižních vědeckých časopisech v oblasti aplikací stochastické analýzy a přednáší na Matematicko-fyzikální fakultě Univerzity Karlovy. Je absolventem Matematicko-fyzikální fakulty Univerzity Karlovy v Praze - obor

matematika a teorie pravděpodobnosti. Je také absolventem Bradly University, Peoria v USA – obor finance. V roce 2004 úspěšně dokončil postgraduální studium na Carnegie Mellon University, Pittsburgh v USA a získal titul PhD. Je držitelem Certifikátu Treasury Bond & Note Futures a Advanced Futures společnosti Carrfutures (New York). Je držitelem makléřské licence kategorie I., II., III. (od roku 1995 - kategorie I., II., od roku 2002 - kategorie III.). Pět let byl členem dozorčí rady RSJ Invest, a.s., tři roky členem představenstva a nyní je předsedou představenstva.

Členství v orgánech jiných právnických osob:

Název	Funkce	Vznik funkce
5P uzavřený investiční fond, a.s.	člen dozorčí rady	08.07.2010
NF K. Janečka na podporu vědy	člen správní rady	11.06.2010
NF pro boj proti korupci	předseda správní rady	15.03.2011
DUHOVKA GROUP a.s.	člen dozorčí rady	05.04.2011
Nadace CERGE-EI	člen správní rady	02.02.2011

Ing. Libor Winkler, CSc.

Je akcionářem RSJ a.s., podílí se na strategickém řízení společnosti. V praxi zúročuje svoje hluboké zkušenosti s řízením burzovního obchodníka a budováním back-office, účetního a provozního zázemí. V RSJ a.s. je zodpovědný za řízení rizik. Je absolvent Vysoké školy zemědělské v Brně, v letech 1990 – 93 se zabýval studiem matematické informatiky na Masarykově univerzitě. Je držitelem makléřské licence (kategorie I.,II.,III.) od roku 1993. Má jedenáct let praxe na tuzemských a šest let na zahraničních finančních trzích jako hlavní makléř. Tři roky působil jako člen dozorčí rady u obchodníka s cennými papíry Katnek Securities. Devět let působil jako předseda představenstva společnosti RSJ a.s., nyní je členem představenstva.

Členství v orgánech jiných právnických osob:

Název	Funkce	Vznik funkce
5P uzavřený investiční fond, a.s.	předseda dozorčí rady	08.07.2010
NF pro boj proti korupci	člen dozorčí rady	15.03.2011

Ing. Michal Šaňák

V RSJ a.s. pracuje na pozici ředitele informačních technologií. Ve společnosti působí od roku 2003, kdy se podílel na zahájení algoritmického obchodování RSJ a.s.. Od počátku se věnoval tvorbě technologického zázemí společnosti, zejména vývoji blackboxů a budování veškeré technologické infrastruktury. Je akcionářem RSJ a.s.. Odpovídá za celou infrastrukturu pro algoritmické obchodování v oblasti technologií a komunikací, což představuje zejména návrh a vývoj vlastních systémů a veškeré vztahy s burzami a třetími stranami. Je absolventem VŠE v Praze se specializací na informační technologie, peněžní ekonomii a bankovníctví. Nyní je členem

představenstva. V současné době nemá členství v orgánech jiných právnických osob.

Souhrnná výše úvěrů poskytnutých Společností členům představenstva:

žádné úvěry nebyly poskytnuty

Souhrnná výše záruk vydaných Společností za členy představenstva:

žádné záruky nebyly vydány

Dozorčí rada:

Titul, jméno a příjmení	funkce	od	do
Ing.Václav Dejčmar	předseda	17.05.2001	dosud
Ing.Tomáš Janeček	člen	06.02.2009	dosud
Ing. Bronislav Kandřík	člen	26.05.2009	dosud

Ing. Václav Dejčmar

Je absolvent VŠE v Praze – obor finance a bankovníctví. Má deset let praxe ve vedoucích funkcích u společností zabývajících se informačními systémy, internetem a reklamou. Devět let působí jako předseda dozorčí rady společnosti RSJ a.s..

Členství v orgánech jiných právnických osob:

Název	Funkce	Vznik funkce
5P uzavřený investiční fond, a.s.	člen dozorčí rady	08.07.2010
INTERACTIVE ONE s.r.o.	jednatel	2.12.1998
BOX a.s.	člen dozorčí rady	07.12.2007
MEET FACTORY, o.p.s.	člen dozorčí rady	01.04.2010
I3CZ s.r.o.	jednatel	03.03.2000
BEACH RESORTS INVESTMENT a.s.	člen představenstva	19.01.2011

Ing. Tomáš Janeček

Pracoval v RSJ a.s. na pozici manažera řízení lidských zdrojů. Je absolventem VŠE v Praze se specializací na finance a obchodní právo. Je držitelem makléřské licence kategorie I., II., III. (od roku 1996 - kategorie I., II., od roku 2002 - kategorie III.) Má deset let praxe u společnosti RSJ na pozicích makléře a portfolio manažera. Zabývá se přednáškovou činností k problematice kapitálového trhu. Osm let byl členem představenstva společnosti RSJ Invest, a.s.. V současné době je členem dozorčí rady RSJ a.s..

Členství v orgánech jiných právnických osob:

Název	Funkce	Vznik funkce
5P uzavřeném investičním fondu, a.s.	předseda představenstva	08.07.2010
Mateřská škola Duhovka, s.r.o.	jednatel	13.05.2008

JKT Technik, s.r.o.	jednatel	02.01.1997
Maagd a.s.	předseda dozorčí rady	22.06.2009
DUHOVKA GROUP a.s.	předseda představenstva	15.02.2010
Gymnázium Duhovka s.r.o.	jednatel	28.04.2010
Soukromá základní Škola Hrou, s.r.o.	jednatel	29.07.2010

Ing. Bronislav Kandřík

Je absolvent VŠE v Praze – obor finance a bankovníctví. Ve společnosti RSJ a.s. pracuje od roku 2003. Od roku 2007 je vedoucím oddělení trading desk. V současné době nemá členství v orgánech jiných právnických osob a je členem dozorčí rady RSJ a.s..

Souhrnná výše úvěrů poskytnutých Společnostmi členům dozorčí rady:

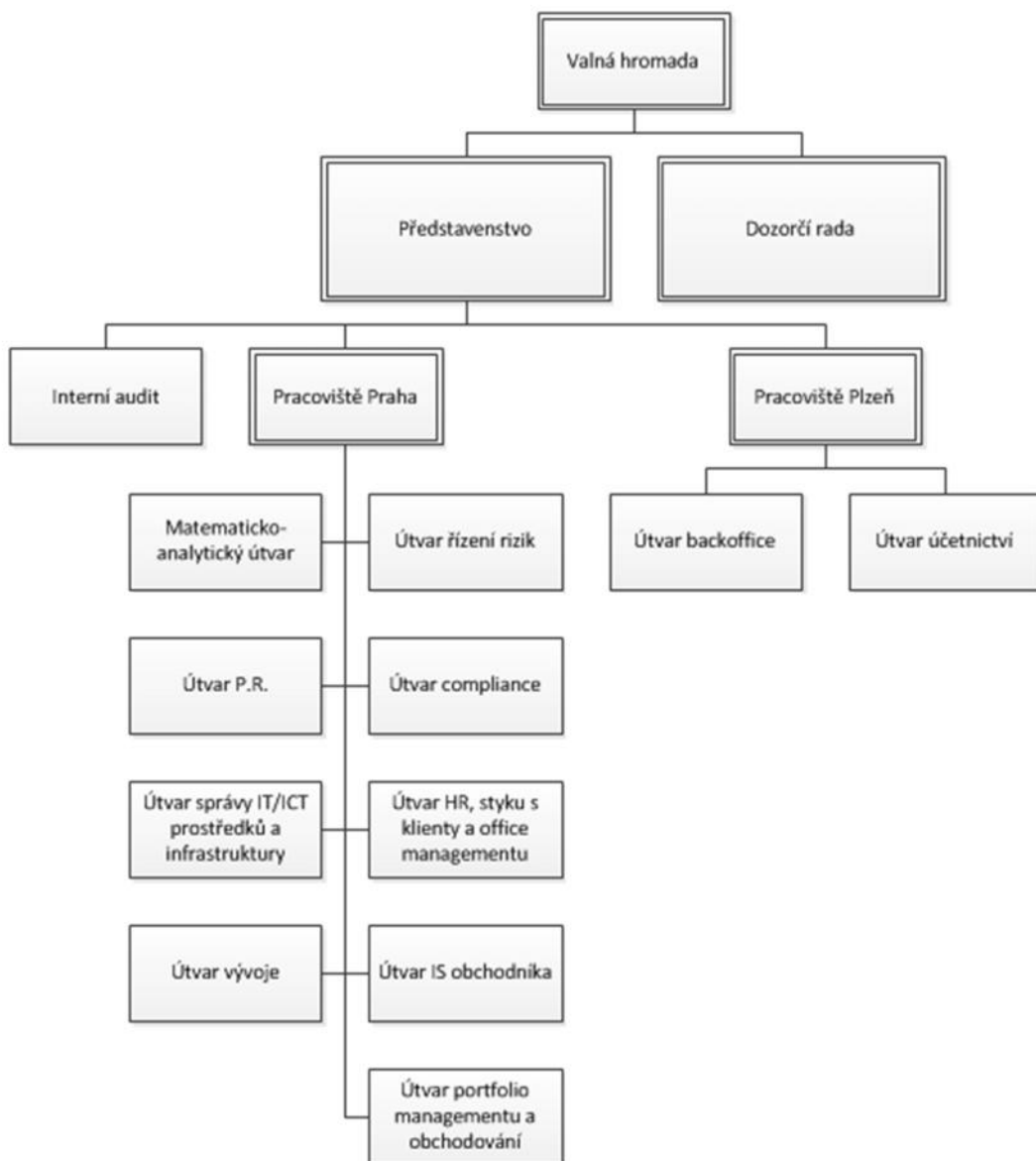
žádné úvěry nebyly poskytnuty

Souhrnná výše záruk vydaných Společnostmi za členy dozorčí rady:

žádné záruky nebyly vydány

Vrcholné vedení Společnosti: viz výše Představenstvo

Organigram společnosti:



2. Údaje o složení akcionářů Společnosti

Akcionáři a výše podílu na hlasovacích právech v procentech:

Karel Janeček PhD.	42.91%
Ing. Václav Dejčmar	21.56%
Ing. Libor Winkler, CSc.	12.00%
Ing. Tomáš Janeček	11.29%
Ing. Michal Šaňák	5.65%
Ing. Karel Janeček	3.30%
Ing. Bronislav Kandřík	1.20%
Mgr. Martin Ducháček	1.00%
Mgr. Anton Tyutin	0.60%
Mgr. Petr Altman	0.29%
Mgr. Jakub Petrásek	0.20%

3. Údaje o činnosti povinné osoby:

Zákonné vymezení činnosti

RSJ a.s. je obchodníkem s cennými papíry ve smyslu zákona č. 256/2004 Sb., o podnikání na kapitálovém trhu. Jako držitel licence České národní banky je Společnost oprávněna poskytovat všechny hlavní i vedlejší investiční služby, kromě služby pronájmu bezpečnostních schránek.

Spektrum činnosti je možné obecně definovat s pomocí zákona č. 256/2004 Sb., o podnikání na kapitálovém trhu. Mezi hlavní investiční služby patří:

- a) přijímání a předávání pokynů týkajících se investičních nástrojů, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona
- b) provádění pokynů týkajících se investičních nástrojů na účet zákazníka, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,
- c) obchodování s investičními nástroji na vlastní účet, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,

- d) obhospodařování majetku zákazníka na základě smlouvy se zákazníkem, je-li součástí majetku investiční nástroj, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,
- e) investiční poradenství týkající se investičních nástrojů, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,
- f) upisování nebo umístování emisí investičních nástrojů, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona.

Jako doplňkové investiční služby lze uvést:

- a) úschova a správa investičních nástrojů, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,
- b) poskytování úvěru nebo půjčky zákazníkovi za účelem umožnění obchodu s investičním nástrojem, na němž se poskytovatel úvěru nebo půjčky podílí, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,
- c) poradenská činnost týkající se struktury kapitálu, průmyslové strategie a s tím souvisejících otázek, jakož i poskytování porad a služeb týkajících se přeměn společností nebo převodů podniků,
- d) poskytování investičních doporučení a analýz investičních příležitostí týkajících se obchodování s investičními nástroji, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona,
- e) provádění devizových operací souvisejících s poskytováním investičních služeb,
- f) služby související s upisováním nebo umístováním investičních nástrojů, a to ve vztahu k investičním nástrojům podle ustanovení § 3 odst. 1 písm. a), b), c) a d) téhož zákona.

V roce 2008 byl rozšířen předmět činnosti Společnosti o další registrovanou podnikatelskou činnost – poskytování software a poradenství v oblasti informačních technologií.

Údaje o objemu obchodů:

Objemy obchodování mimo derivátů:

Investiční cenné papíry - akcie 52,051,795 CZK	
Investiční cenné papíry - dluhopisy CZK	2,238,687
Cenné papíry kolektivního investování 249,609,287 CZK	
Celkem CZK	303,8 99,769

Objemy obchodování derivátů:

Počet	Popis	Objem	Objem v CZK
4,211,456	Akciový index. futures	193,240,105,915.65	4,101,909,711,779.00
5,378,367	Bondový futures	615,986,772,728.13	14,982,055,301,893.00
1,815,508	Komoditní futures	9,059,096,326.87	153,070,651,918.00
47,221	Měnový futures	10,328,692,696.00	172,998,423,862.00
58,744,955	Úrokové futures	55,348,869,723,936.60	1,112,198,542,436,770.00

Shrnutí 2Q/2011:

Období 2Q/2011 se neslo zejména ve znamení finalizace příprav na spuštění obchodování na burze CBOT.

V technologické a analytické rovině pokračují přípravy na expanzi na burzu ICE a další burzy.

Zároveň proběhlo posílení technologického týmu provádějícího výzkum nových technologií pro obchodování.

4. Údaje o finanční situaci Společnosti

Výkaz zisku a ztráty obchodníka s CP

Část 1: Přehled výnosů, nákladů, zisků a ztrát

Datová oblast: VIS10_01 Výnosy, náklady, zisky a ztráty vykazujícího subjektu

A	B	1
Zisk z finanční a provozní činnosti	1	38748
Úrokové výnosy	2	596
Úroky z pohledávek vůči centrálním bankám	3	0
Úroky z finančních aktiv k obchodování	4	0
Úroky z finančních aktiv v reálné hodnotě vykázaných do Z/Z	5	18
Úroky z realizovatelných finančních aktiv	6	0
Úroky z úvěrů a jiných pohledávek	7	0
Úroky z finančních investic držených do splatnosti	8	578
Zisk ze zajišťovacích úrokových derivátů	9	0
Úroky z ostatních aktiv	10	0
Úrokové náklady	11	-125
Úroky na vklady, úvěry a ost.fin.závazky vůči centr.bankám	12	0
Úroky na finanční závazky k obchodování	13	0

Úroky na finanční závazky v reálné hodnotě vykázané do Z/Z	14	0
Úroky na finanční závazky v naběhlé hodnotě	15	-125
Ztráta ze zajišťovacích úrokových derivátů	16	0
Úroky na ostatní závazky	17	0
Náklady na základní kapitál splatný na požádání	18	0
Výnosy z dividend	19	0
Výnosy z dividend z finančních aktiv k obchodování	20	0
Výnosy z dividend z finan.aktiv v RH vykázaných do Z/Z	21	0
Výnosy z dividend z realizovatelných finančních aktiv	22	0
Výnosy z dividend od přidružených a ovládaných osob	23	0
Výnosy z poplatků a provizí	24	36587
Poplatky a provize z operací s finan.nástroji pro zákazníky	25	0
Poplatky a provize z obstarání emisí	26	0
Poplatky a provize z obstarání finančních nástrojů	27	0
Poplatky a provize za poradenskou činnost	28	0
Poplatky a provize z clearingů a vypořádání	29	0
Poplatky a provize za obhospodařování hodnot	30	28215
Poplatky a provize za správu, úschovu a uložení hodnot	31	0
Poplatky a provize z příslibů a záruk	32	0
Poplatky a provize z platebního styku	33	0
Poplatky a provize ze strukturovaného financování	34	0
Poplatky a provize ze sekuritizace	35	0
Poplatky a provize z ostatních služeb	36	8372
Náklady na poplatky a provize	37	-9081
Poplatky a provize na operace s finančními nástroji	38	-8
Poplatky a provize na obhospodařování hodnot	39	0
Poplatky a provize na správu, úschovu a uložení hodnot	40	-3
Poplatky a provize na clearing a vypořádání	41	0
Poplatky a provize na sekuritizaci	42	0
Poplatky a provize na ostatní služby	43	-9070
Realizované Z/Z z finan.aktiv a závazků nevykáz. v RH do Z/Z	44	0
Zisk (ztráta) z realizovatelných finančních aktiv	45	0
Zisk (ztráta) z úvěrů a jiných pohledávek	46	0
Zisk (ztráta) z finančních investic držených do splatnosti	47	0
Zisk (ztráta) z finančních závazků v naběhlé hodnotě	48	0
Zisk (ztráta) z ostatních závazků	49	0
Zisk (ztráta) z finančních aktiv a závazků k obchodování	50	0
Zisk (ztráta) z kapitálových nástrojů a akciových derivátů	51	0
Zisk (ztráta) z úrokových nástrojů (včetně úrok. derivátů)	52	0
Zisk (ztráta) z měnových nástrojů (včetně měn. derivátů)	53	0
Zisk (ztráta) z úvěrových nástrojů (včetně úvěr. derivátů)	54	0
Zisk (ztráta) z komodit a komoditních derivátů	55	0
Zisk (ztráta) z ostatních nástrojů včetně hybridních	56	0
Zisk (ztráta) z finan. aktiv a závazků v RH vykázané do Z/Z	57	0
Zisk (ztráta) ze zajišťovacího účetnictví	58	0
Kurzové rozdíly	59	-1243
Zisk (ztráta) z odúčtování aktiv j. než držených k prodeji	60	0
Ostatní provozní výnosy	61	12627
Ostatní provozní náklady	62	-613
Správní náklady	63	-25272
Náklady na zaměstnance	64	-15074
Mzdy a platy	65	-10910
Sociální a zdravotní pojištění	66	-3670
Penzijní a podobné výdaje	67	-472
Náklady na dočasné zaměstnance	68	0
Odměny - vlastní kapitálové nástroje	69	0
Ostatní náklady na zaměstnance	70	-22
Ostatní správní náklady	71	-10198
Náklady na reklamu	72	-3041

Náklady na poradenství	73	-823
Náklady na informační technologie	74	-1221
Náklady na outsourcing	75	0
Nájemné	76	-1825
Jiné správní náklady	77	-3288
Odpisy	78	-3004
Odpisy pozemků, budov a zařízení	79	-2557
Odpisy investic do nemovitostí	80	0
Odpisy nehmotného majetku	81	-447
Tvorba rezerv	82	0
Ztráty ze znehodnocení	83	-75
Ztráty ze znehodnocení finan.aktiv nevykázaných v RH do Z/Z	84	-75
Ztráty ze znehodnocení finančních aktiv v pořizovací ceně	85	0
Ztráty ze znehodnocení realizovatelných finančních aktiv	86	0
Ztráty ze znehodnocení úvěrů a jiných pohledávek	87	0
Ztráty ze znehodnocení finan.investic držených do splatnosti	88	-75
Ztráty ze znehodnocení nefinančních aktiv	89	0
Ztráty ze znehodnocení pozemků, budov a zařízení	90	0
Ztráty ze znehodnocení z investic do nemovitostí	91	0
Ztráty ze znehodnocení goodwillu	92	0
Ztráty ze znehodnocení nehmotného majetku	93	0
Ztráty ze znehodnocení účastí v přídr.a ovlád.os.a sp.podn.	94	0
Ztráty ze znehodnocení ostatních nefinančních aktiv	95	0
Negativní goodwill bezprostředně zahrnutý do výkazu Z/Z	96	0
Podíl na Z/Z přídr. a ovládaných osob a společných podniků	97	0
Zisk nebo ztráta z neoběžných aktiv a vyřazovaných skupin	98	0
Zisk nebo ztráta z pokračujících činností před zdaněním	99	10397
Náklady na daň z příjmů	100	0
Zisk nebo ztráta z pokračujících činností po zdanění	101	10397
Zisk nebo ztráta z ukončované činnosti po zdanění	102	0
Zisk nebo ztráta po zdanění	103	10397

Rozvaha obchodníka s cennými papíry

Část 1: Základní rozvaha							
Datová oblast: RIS15_01 Aktiva vykazujícího subjektu v základním členění							
		Údaj nekompenzovaný o opravné položky a oprávky	Údaj nekompenzovaný o opravné položky a oprávky	Údaj nekompenzovaný o opravné položky a oprávky	Údaj nekompenzovaný o opravné položky a oprávky	Opravné položky a oprávky	Údaj kompenzovaný o opravné položky a oprávky
		Koruna česká	Koruna česká	Všechny cizí měny (bez CZK)	Všechny cizí měny (bez CZK)	Všechny měny	Všechny měny
		Rezidenti	Nerezidenti	Rezidenti	Nerezidenti	Rezidenti a nerezidenti celkem	Rezidenti a nerezidenti celkem
A	B	1	2	3	4	5	10
Aktiva celkem	1	116460	0	639811	514119	32430	1237960
Pokladní hotovost a pohledávky vůči centrálním	2	24	0	21	0	0	45
Pokladní hotovost	3	24	0	21	0		45
Pohledávky vůči centrálním bankám	4	0	0	0	0	0	0
Finanční aktiva k obchodování	5	0	0	0	0		0
Deriváty k obchodování s kladnou reálnou hodnotou	6	0	0	0	0		0
Kapitálové nástroje k obchodování	7	0	0	0	0		0
Dluhové cenné papíry k obchodování	8	0	0	0	0		0
Pohledávky k obchodování	9	0	0	0	0		0
Pohledávky k obchodování vůči úvěrovým institucím	10	0	0	0	0		0
Pohledávky k obchodování vůči j. osobám než úvěr.	11	0	0	0	0		0
Ostatní pohledávky k obchod. sektorové nečleněné	12	0	0	0	0		0
Finanční aktiva v reálné hodnotě vykaz. do zisku nebo	13	22211	0	635828	9602		667641
Kapitálové nástroje v reálné hodnotě vykazované do Z/Z	14	0	0	0	0		0
Dluhové cenné papíry v reálné hodnotě vykazované do	15	0	0	0	0		0
Pohledávky v reálné hodnotě vykazované do zisku	16	22211	0	635828	9602		667641
Pohledávky v reálné hodnotě vykazované do Z/Z vůči	17	22211	0	635828	9602		667641
Pohledávky v RH vykazované do Z/Z vůči j.osobám	18	0	0	0	0		0
Ostatní pohledávky v RH vykazované do Z/Z sektorové	19	0	0	0	0		0
Realizovatelná finanční aktiva	20	1549	0	3749	488251	0	493549
Kapitálové nástroje realizovatelné	21	0	0	0	0	0	0
Dluhové cenné papíry realizovatelné	22	0	0	0	0		0
Pohledávky realizovatelné	23	1549	0	3749	488251		493549
Pohledávky realizovatelné vůči úvěrovým institucím	24	0	0	0	0		0
Pohledávky realizovatelné vůči j.osobám než	25	0	0	0	0		0
Ostatní pohledávky realizovatelné sektorové	26	1549	0	3749	488251		493549

Úvěry a jiné pohledávky	27	200	0	213	1284	0	1697
Dluhové cenné papíry neobchodovatelné	28	0	0	0	0	0	0
Pohledávky	29	200	0	213	1284	0	1697
Pohledávky vůči úvěrovým institucím	30	0	0	0	0	0	0
Pohledávky vůči osobám jiným než úvěrovým institucím	31	0	0	0	0	0	0
Ostatní pohledávky sektorově nečleněné	32	200	0	213	1284	0	1697
Finanční investice držené do splatnosti	33	41815	0	0	0	1203	40612
Dluhové cenné papíry držené do splatnosti	34	41815	0	0	0	1203	40612
Pohledávky držené do splatnosti	35	0	0	0	0	0	0
Pohledávky držené do splatnosti vůči úvěrovým	36	0	0	0	0	0	0
Pohledávky držené do splatnosti vůči j.osobám než	37	0	0	0	0	0	0
Ostatní pohledávky držené do splatnosti sektorově	38	0	0	0	0	0	0
Zajišťovací deriváty s kladnou reálnou hodnotou	39	0	0	0	0		0
Zajišť. deriváty s kladnou RH - zajištění reálné hodnoty	40	0	0	0	0		0
Zajišť. deriváty s kladnou RH - zajištění peněžních toků	41	0	0	0	0		0
Zajišť.deriváty s kl.RH- zaj. čistých investic do	42	0	0	0	0		0
Zajišť.deriváty s kladnou RH- zajištění úrok.rizika - RH	43	0	0	0	0		0
Zajišť.deriváty s kladnou RH- zajištění úrok.rizika-pen.toky	44	0	0	0	0		0
Kladné změny reálné hodnoty portfolia zajišťovaných nástrojů	45	0	0	0	0		0
Hmotný majetek	46	37252	0	0	0	24903	12349
Pozemky, budovy a zařízení	47	37252	0	0	0	24903	12349
Investice do nemovitostí	48	0	0	0	0	0	0
Nehmotný majetek	49	8327	0	0	0	6324	2003
Goodwill	50	0	0	0	0	0	0
Ostatní nehmotný majetek	51	8327	0	0	0	6324	2003
Účasti v přidružených a ovládaných osobách a ve	52	0	0	0	0	0	0
Daňové pohledávky	53	4510	0	0	0		4510
Pohledávky ze splatné daně	54	4510	0	0	0		4510
Pohledávky z odložené daně	55	0	0	0	0		0
Ostatní aktiva	56	572	0	0	14982	0	15554
Neoběžná aktiva a vyřazované skupiny určené k	57	0	0	0	0	0	0

Datová oblast: RIS15_03 Závazky a vlastní kapitál vykaz.subjektu v základním členění

		Všechny měny	Koruna česká	Koruna česká	Všechny cizí měny (bez CZK)	Všechny cizí měny (bez CZK)
		Rezidenti a nerezidenti celkem	Rezidenti	Nerezidenti	Rezidenti	Nerezidenti
A	B	1	2	3	4	5
Závazky a vlastní kapitál celkem	1	1237960	112567	3	33884	1091506
Závazky celkem	2	1147269	21876	3	33884	1091506
Vklady, úvěry a ostatní finanční závazky vůči centr.bankám	3	0	0	0	0	0
Finanční závazky k obchodování	4	1143231	18113	3	33884	1091231
Deriváty k obchodování se zápornou reálnou hodnotou	5	0	0	0	0	0
Závazky z krátkých prodejů	6	0	0	0	0	0
Vklady, úvěry a ostatní finanční závazky k obchodování	7	1143231	18113	3	33884	1091231
Vklady, úvěry a ostatní fin.závazky k obch. vůči úvěr.inst.	8	0	0	0	0	0
Vklady, úvěry a ost.fin.závaz.k obch.vůči jos.než úvěr.inst.	9	0	0	0	0	0
Ostatní finanční závazky k obchodování sektorově nečleněné	10	1143231	18113	3	33884	1091231
Emitované dluhové CP určené k odkupu v krátkém období	11	0	0	0	0	0
Finanční závazky v reálné hodnotě vykázané do zisku/ztráty	12	0	0	0	0	0
Vklady, úvěry a ostatní finanční závazky v RH vykázané do Z/Z	13	0	0	0	0	0
Vklady, úvěry a ost.fin.závaz.v RH vyk.do Z/Z vůči úvěr.inst.	14	0	0	0	0	0
Vklady a ost.fin.záv.v RH vyk.do Z/Z vůči jos.než úvěr.inst.	15	0	0	0	0	0
Ostatní fin.závazky v RH hodnotě vykázané do Z/Z sektor.nečlen.	16	0	0	0	0	0
Emitované dluhové CP v RH vykázané do zisku nebo ztráty	17	0	0	0	0	0
Podřízené závazky v RH vykázané do zisku nebo ztráty	18	0	0	0	0	0
Finanční závazky v naběhlé hodnotě	19	0	0	0	0	0
Vklady, úvěry a ostatní finanční závazky v naběhlé hodnotě	20	0	0	0	0	0
Vklady a ost.fin.závazky v naběhlé hodnotě vůči úvěr.inst.	21	0	0	0	0	0
Vklady a ost.fin.záv.v naběhlé hodn.vůči jos.než úvěr.inst.	22	0	0	0	0	0
Ostatní finanční závazky v naběhlé hodnotě sektor.nečleněné	23	0	0	0	0	0
Emitované dluhové cenné papíry v naběhlé hodnotě	24	0	0	0	0	0
Podřízené závazky v naběhlé hodnotě	25	0	0	0	0	0
Finanční závazky spojené s převáděnými aktivy	26	0	0	0	0	0
Zajišťovací deriváty se zápornou reálnou hodnotou	27	0	0	0	0	0
Zajišť. deriváty se zápornou RH - zajištění reálné hodnoty	28	0	0	0	0	0
Zajišť. deriváty se zápornou RH - zajištění peněžních toků	29	0	0	0	0	0
Zajišť.deriváty s záp.RH- zajištění investic do zahr.jedn.	30	0	0	0	0	0
Zajišť.deriváty se zápornou RH-zajištění úrok.rizika - RH	31	0	0	0	0	0
Zajišť.deriváty s záp.RH-zajištění úrok.rizika-peněžní toky	32	0	0	0	0	0
Záporné změny reál. hodnoty portfolia zajišťovaných nástrojů	33	0	0	0	0	0
Rezervy	34	0	0	0	0	0
Rezervy na restrukturalizace	35	0	0	0	0	0
Rezervy na daně a soudní spory	36	0	0	0	0	0
Rezervy na důchody a podobné závazky	37	0	0	0	0	0
Rezervy na podrozvahové položky	38	0	0	0	0	0
Rezervy na nevýhodné smlouvy	39	0	0	0	0	0
Ostatní rezervy	40	0	0	0	0	0
Daňové závazky	41	845	845	0	0	0
Závazky ze splatné daně	42	276	276	0	0	0
Závazky z odložené daně	43	569	569	0	0	0
Ostatní závazky	44	3193	2918	0	0	275
Základní kapitál družstev splatný na požádání	45					
Závazky spojené s vyřazovanými skupinami určenými k prodeji	46	0	0	0	0	0
Vlastní kapitál celkem	47	90691	90691	0	0	0
Základní kapitál	48	27000	27000	0	0	0
Splacený základní kapitál	49	27000	27000	0	0	0
Nesplacený základní kapitál	50	0	0	0	0	0
Emisní ážio	51	0	0	0	0	0
Další vlastní kapitál	52	0				
Kapitálová složka finančních nástrojů	53	0	0	0	0	0
Ostatní kapitálové nástroje	54	0	0	0	0	0
Fondy z přecenění a ostatní oceňovací rozdíly	55	0	0	0	0	0
Oceňovací rozdíly z hmotného majetku	56	0	0	0	0	0
Oceňovací rozdíly z nehmotného majetku	57	0	0	0	0	0
Zajištění čistých investic do zahraničních jednotek	58	0	0	0	0	0
Zajištění peněžních toků	59	0	0	0	0	0
Oceňovací rozdíly z realizovatelných finančních aktiv	60	0	0	0	0	0
Oceň.rozdíly z neoběž.aktiv a ukončov.čin.určených k prodeji	61	0	0	0	0	0
Ostatní oceňovací rozdíly	62	0	0	0	0	0
Rezervní fondy	63	4700	4700	0	0	0
Nerozdělený zisk (neuhrazená ztráta) z předchozích období	64	48594	48594	0	0	0
Vlastní akcie	65	0	0	0	0	0
Zisk (ztráta) za běžné účetní období	66	10397	10397	0	0	0

5. Údaje o strategiích a postupech řízení

Řízení rizika a likvidity Společnosti je určeno Řádem kapitálové přiměřenosti, řízení rizik a likvidity (dále jen „Řád řízení rizik“), který provádí

- požadavky zákona č. 256/2004 Sb. o podnikání na kapitálovém trhu, v platném znění, (dále jen „ZPKT“), zejména ustanovení § 9 a násl ZPKT;
- Vyhlášku České národní banky č. 123/2007 Sb. o pravidlech obezřetného podnikání bank, spořitelních a úvěrových družstev a obchodníků s cennými papíry, v platném znění, (dále jen "Vyhláška BASEL 2");
- Vyhlášku č. 237/2008 Sb. o podrobnostech některých pravidel při poskytování investičních služeb, zejména ustanovení § 11 až 17;

Řád řízení rizik dále též stanovuje:

- typy činností, které budou Společností prováděny,
- postupy pro identifikaci, měření, sledování a omezování rizik,
- postupy stanovení reálných hodnot nástrojů,
- soustavu limitů používanou při řízení rizik, včetně postupů při překročení limitů,
- způsob organizování toku informací zejména o výsledných pozicích z realizovaných operací a o vyhodnocení vnitřních limitů,
- vymezení pravomocí a povinností odpovědných zaměstnanců při řízení rizik a
- povinnosti útvaru interního auditu při prověřování systému řízení rizik.

Základní přístupy řízení rizik

Společnost uplatňuje pouze základní přístupy ve smyslu Vyhlášky BASEL 2.

- Výpočet kapitálové přiměřenosti je prováděn průběžným udržováním kapitálů na individuálním základě minimálně ve výši odpovídající součtu kapitálových požadavků k úvěrovému, tržnímu a operačnímu riziku stanovených na individuálním základě dle ustanovení § 37 a násl. Vyhlášky BASEL 2. Společnost neaplikuje výpočet ve smyslu obchodníka s cennými papíry s omezeným rozsahem investičních služeb anebo obchodníka s cennými papíry s omezeným obchodováním na vlastní účet.
- Pro výpočet kapitálového požadavku k úvěrovému riziku investičního portfolia aplikuje Společnost základní přístup pro výpočet kapitálových požadavků - standardizovaný přístup dle ustanovení § 83 a násl. Vyhlášky BASEL 2.
- Pro výpočet kapitálového požadavku k úvěrovému riziku obchodního portfolia a k tržnímu riziku aplikuje Společnost standardizovaný přístup dle ustanovení § 127 odst. 1 písm. a) Vyhlášky BASEL 2.
- Pro výpočet kapitálového požadavku k operačnímu riziku aplikuje Společnost přístup základního ukazatele (BIA) ve smyslu ustanovení § 171 Vyhlášky BASEL 2.

- Společnost neaplikuje využití možnosti stanovovat kapitálové požadavky k nástrojům zařazeným do malého obchodního portfolia jako k nástrojům zařazeným do investičního portfolia.
- Společnost zásadně nepodstupuje úvěrové expozice, neaplikuje vlastní ratingy a v případě potřeby aplikace externího ratingu postupuje v souladu s Vyhláškou a dle seznamu příslušných zapsaných ratingových agentur vedeného regulátorem.
- Společnost disponuje povolením k investiční službě obchodování na vlastní účet primárně s ohledem na požadavky a podmínky členství či účasti regulovaných trhů, případně jejich vypořádacích systémů.

Systém řízení rizik

- Osobou odpovědnou za řízení rizik je pracovník útvaru řízení rizik.
- Systém řízení rizik musí být efektivně uplatňován tak, aby poskytl nezkreslený obraz o míře podstupovaných rizik Společnosti. Systém řízení rizik (zejména úvěrových a tržních) musí poskytovat informace o pozicích zaujímaných Společností, o její angažovanosti vůči jednotlivým osobám či ekonomicky spjatým skupinám. Proto jsou všechna oddělení RSJ a.s., kterým je stanovena odpovědnost v systému řízení rizik povinna kontrolovat zejména pozice a angažovanost Společnosti soustavně a na denní bázi.
- Typy činností prováděné Společností, kdy je třeba sledovat rizika dle tohoto řádu, jsou především:
 - o poskytování investičních služeb, do kterých vstupuje vlastní majetek Společnosti,
 - o obchodování na vlastní účet RSJ a.s., ač by nenaplnilo znaky poskytování investiční služby,
 - o poskytování investiční služby asset management (§4 odst. 2, písm. d) ZPKT).
- Stejně tak je třeba řídit rizika u veškerých dalších činností, těmito riziky jsou zejména rizika operační a compliance riziko.
- Příslušné útvary RSJ a.s. odpovědné za sledování a řízení rizik identifikují, měří, sledují a omezují rizika dle příslušných vnitřních předpisů Společnosti. Sledování a řízení finančních a operačních rizik je upraveno v Řádu kapitálové přiměřenosti, řízení rizik a likvidity. Sledování a řízení operačních rizik ve smyslu funkce vnitřní kontroly je upraveno ve Vnitřním řídicím a kontrolním systému Společnosti a v předpise Pravidla řízení operačních rizik a business continuity plan.
- Soustavu limitů používanou při řízení rizik stanoví Společnost ve smyslu limitů vymezených právními předpisy, a to zejména Vyhláškou BASEL 2, čímž není dotčena pravomoc pracovníka útvaru řízení rizik předmětné limity zpřísnit či stanovit doplňující limity. V případě překročení limitů je třeba neprodleně informovat tohoto pracovníka a předsedu Investičního výboru. Nápravu a postup eliminující překročení limitů pak stanoví Investiční výbor.
- Účetní oddělení předává denní informace týkající se výsledných pozic z realizovaných operací Společnosti na vědomí statutárnímu orgánu (ve smyslu a

v návaznosti na povinnost přeceňovat určité pozice v souladu s Vyhláškou BASEL 2 na denní bázi, tj. především ve vztahu k obchodnímu portfoliu).

- Pravomoci a povinnosti odpovědných zaměstnanců při řízení rizik jsou vymezeny v Organizačním řádu a Vnitřním řídicím a kontrolním systému RSJ a.s.
- Povinnosti útvaru interního auditu při prověřování systému řízení rizik jsou vymezeny v Organizačním řádu a Vnitřním řídicím a kontrolním systému Společnosti. Interní audit informuje statutární orgán RSJ a.s. pravidelně (v souladu s ročním auditním plánem) a spolehlivě o dodržování postupů a zásad definovaných v Řádu řízení rizik a ve Vnitřním řídicím a kontrolním systému Společnosti, včetně dodržování limitů kapitálové přiměřenosti a dalších vnitřních limitů stanovených Společností v rámci roční zprávy interního auditora.

6. Údaje o kapitálu a údaje o kapitálové přiměřenosti a výši kapitálových požadavků

Kapitálová přiměřenost

Společnost splňuje kapitálovou přiměřenost průběžným udržováním kapitálu na úrovni kapitálu stanoveném na individuálním základě podle pravidel Vyhlášky č. 123/2007 Sb. o pravidlech obezřetného podnikání bank, spořitelních a úvěrových družstev a obchodníků s cennými papíry, v platném znění, tj. minimálně ve výši odpovídající součtu kapitálových požadavků k úvěrovému, tržnímu a operačnímu riziku stanovených na individuálním základě.

Pro vyjádření kapitálové přiměřenosti v procentech se používá ukazatel kapitálové přiměřenosti, který se rovná 8% z podílu, v jehož čitateli je kapitál a ve jmenovateli kapitálové požadavky.

Kapitál

Kapitál na individuálním základě se stanoví jako součet původního kapitálu na individuálním základě (složka tier 1) a dodatkového kapitálu na individuálním základě (složka tier 2) snížený o odčitatelné položky na individuálním základě a zvýšený o kapitál na individuálním základě na krytí tržního rizika (složka tier 3).

Původní kapitál na individuálním základě se člení na hlavní a vedlejší.

Hlavní původní kapitál zahrnuje splacený základní kapitál zapsaný do obchodního rejstříku,

- a) snížený o nabyté vlastní podíly, přičemž součástí této položky jsou také položky z obchodů s vlastními podíly, snižující vlastní kapitál,
- b) zvýšený o emisní ážio, přičemž součástí této položky je splacené emisní ážio, které souvisí se splaceným základním kapitálem zapsaným do obchodního rejstříku a emisní ážio vzniklé z obchodů s vlastními podíly,
- c) zvýšený o rezervní fondy a nerozdělený zisk,

- d) zvýšený o zisk za běžné účetní období uvedený v mezitímní účetní závěrce ověřené auditorem snížený o předpokládaný podíl na zisku a další předpokládané platby z rozdělení zisku,
- e) zvýšený, anebo snížený, o výsledné kurzové rozdíly z konsolidace dat zahraniční organizační složky,
- f) snížený o ztrátu za běžné účetní období,
- g) snížený o goodwill,
- h) snížený o nehmotný majetek jiný než goodwill,
- i) snížený o oceňovací rozdíl ze změn reálných hodnot kapitálových nástrojů zařazených pro účely vedení účetnictví do portfolia realizovatelných finančních nástrojů, je-li negativní,
- j) snížený o čistý zisk z kapitalizace budoucích příjmů ze sekuritizace, je-li součástí položky podle písmene c) nebo d).

Společnost nemá žádné nástroje, které by splňovaly podmínky pro zařazení do vedlejšího původního kapitálu.

Dodatkový kapitál na individuálním základě se také člení na hlavní a vedlejší. Společnost nemá žádné nástroje ani pozice, které by bylo možné zahrnout do hlavního nebo vedlejšího dodatkového kapitálu.

Kapitál na individuálním základě na krytí tržního rizika tvoří podřízený dluh B snížený

- a) o jiné než významné omezitelné úpravy při tržním oceňování nebo oceňování modelem a
- b) v případě obchodníka s cennými papíry dále snížený o hmotný majetek, zásoby, kapitálové investice do jiných osob, než které jsou odčitelnými položkami a které nelze okamžitě uplatnit na trhu, a pohledávky se zbytkovou splatností nad 90 dnů kromě vkladů složených jako zajištění pro obchody s deriváty obchodovanými na uznaných burzách.

Pokud výše položek podle písmene a) a b) převyšuje podřízený dluh B, částka odpovídající převýšení se odčítá od součtu původního a dodatkového kapitálu.

Podřízený dluh B v kapitálu na individuálním základě může mít podobu přijatého úvěru, půjčky, vkladu a v případě obchodníka s cennými papíry také podobu vydaného podřízeného dluhopisu.

Vzhledem k tomu, že Společnost, coby obchodník s cennými papíry, nemá žádné pozice, které by bylo možné zahrnout do podřízeného dluhu B, převyšuje součet položek uvedených pod písmeny a) a b) tento podřízený dluh B a je tudíž položkou odčitelnou.

Odčitelné položky od původního a dodatkového kapitálu na individuálním základě tvoří

- a) hodnota kapitálové investice investičního portfolia do institucí, pojišťoven, zajišťoven, pojišťovacích holdingových osob či pojišťovacích holdingových

osob se smíšenou činností nebo ostatních finančních institucí, pokud přesahují 10% základního kapitálu osob, do nichž je investováno,

- b) součet hodnot kapitálových investic investičního portfolia do institucí, pojišťoven, zajišťoven, pojišťovacích holdingových osob či pojišťovacích holdingových osob se smíšenou činností nebo ostatních finančních institucí, a to v částce, která přesahuje 10% kapitálu na individuálním základě před odečtením položek podle písmene a), pokud jednotlivé kapitálové investice představují podíl do 10% včetně základního kapitálu osob, do nichž je investováno.
- c) hodnota expozice ze sekuritizace s rizikovou váhou 1250%, ledaže je zahrnuta do výpočtu kapitálového požadavku k úvěrovému riziku podle ustanovení pro sekuritizaci,
- d) nedostatek v krytí očekávaných úvěrových ztrát,
- e) významné obezřetné úpravy při tržním oceňování nebo oceňování modelem,
- f) převýšení položek uvedených v kapitálu na krytí tržního rizika pod písmenem b) nad podřízeným dluhem B,
- g) odpočet u volných dodávek, a to od 5 obchodních dnů po splatnosti druhé smluvní platby nebo dodávky do ukončení transakce ve výši součtu převedené hodnoty a rozdílu mezi sjednanou vypořádací cenou a aktuálním tržním oceněním, je-li kladný.

Kapitálové požadavky

Pro účely výpočtu kapitálové přiměřenosti stanovuje Společnost minimální kapitálové požadavky k úvěrovému, tržnímu a operačnímu riziku.

Kapitálové požadavky **k úvěrovému riziku** zahrnují kapitálové požadavky k

- a) úvěrovému riziku investičního portfolia a riziku rozmělnění investičního portfolia,
- b) specifickému úrokovému riziku obchodního portfolia,
- c) specifickému akciovému riziku obchodního portfolia,
- d) riziku protistrany u repo obchodů nebo půjček či výpůjček cenných papírů nebo komodit, derivátů, transakcí s delší dobou vypořádání a maržových obchodů,
- e) vypořádacímu riziku obchodního portfolia a volným dodávkám,
- f) ostatním nástrojům obchodního portfolia,
- g) riziku angažovanosti obchodního portfolia.

Kapitálové požadavky **k tržnímu riziku** zahrnují kapitálové požadavky k

- a) obecnému úrokovému riziku obchodního portfolia,
- b) obecnému akciovému riziku obchodního portfolia,
- c) měnovému riziku investičního a obchodního portfolia,

d) komoditnímu riziku investičního a obchodního portfolia.

Kapitálové požadavky **k operačnímu riziku** se stanoví podle typu přístupu pro výpočet těchto požadavků.

Společnost uplatňuje při stanovení všech kapitálových požadavků na individuálním základě pouze základní přístupy ve smyslu Vyhlášky č. 123/2007 Sb. o pravidlech obezřetného podnikání bank, spořitelních a úvěrových družstev a obchodníků s cennými papíry, v platném znění.

Část 1: Kapitál, kapitálové požadavky a kapitálová přiměřenost
Datová oblast: DIS20_01 Kapitál

A	B	1
Kapitál	1	65231
Původní kapitál (Tier 1)	2	77658
Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku	3	27000
Vlastní podíly	4	0
Emisní ážio	5	0
Rezervní fondy a nerozdělený zisk	6	52661
Povinné rezervní fondy	7	4067
Ostatní fondy z rozdělení zisku	8	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	9	48594
Zisk za účetní období po zdanění	10	0
Neuhrazená ztráta z předchozích období	11	0
Výsledné kurzové rozdíly z konsolidace	12	0
Zisk za běžné účetní období	13	0
Ztráta za běžné účetní období	14	0
Čistý zisk z kapitalizace budouc. příjmů ze sekuritizace	15	0
Zisk/ztráta z ocenění závazků v RH z titulu úvěr. rizika	16	0
Další odčitatelné položky z původního kapitálu	17	-2003
Goodwill	18	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	19	-2003
Negat. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. kapitál. nástrojů	20	0
Účastnické CP vydané osobou s kvalifikov. účastí v bance	21	0
Hybridní nástroje celkem	22	0
Hybridní nástroje zohledňované do výše původního kapitálu	23	0
Hybridní nástroje zohledňované do výše 35% původ. kapitálu	24	0
Hybridní nástroje zohledňované do výše 15% původ. kapitálu	25	0
Dodatkový kapitál (Tier 2)	26	0
Hlavní dodatkový kapitál	27	0
Přebytek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB	28	0
Překročení limitů pro hybridní nástroje	29	0
Vedlejší dodatkový kapitál	30	0
Podřízený dluh A	31	0
Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů	32	0
Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)	33	-12427
Kapitálové investice nad 10 % do bank a ost.fin.institucí	34	0
Kapitálové investice nad 10 % do pojišťoven	35	0
Kapitálové investice do 10 % do institucí a fin. institucí	36	0
Význ.obezř.úpravy při tržním oceňování n. oceňování modelem	37	0
Expozice ze sekuritizace s rizik. váhou 1250%	38	0
Nedostatek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB	39	0
Převýšení jiných než význ.obezř.úprav nad podřiz.dluhem B	40	-12427
Odpočet u volných dodávek	41	0
Kapitál na krytí tržního rizika (Tier 3)	42	0

Podřízený dluh B	43	0
Jiné než význ. obezř. úpravy při trž. oceň. nebo oceň. modelem	44	0

Datová oblast: DIS20_02 Přehled kapitálových požadavků

A	B	1
Kapitálové požadavky celkem	1	15312
Kap. pož. k úvěrovému riziku celkem	2	1801
Kap. pož. k úvěr. riziku při STA celkem	3	1801
Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k expozicím celkem	4	1801
Kap. pož. při STA k expoz. vůči centr. vládám a bankám	5	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči reg. vládám a míst. orgánům	6	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči org. veřejného sektoru a ost.	7	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči mezinárodním rozvoj. bankám	8	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči mezinárodním organizacím	9	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči institucím	10	1712
Kap. pož. při STA k podnikovým expoz.	11	0
Kap. pož. při STA k retailovým expoz.	12	0
Kap. pož. při STA k expoz. zajištěným nemovitostmi	13	0
Kap. pož. při STA k expoz. po splatnosti	14	0
Kap. pož. při STA k regulatorně vysoce rizikovým expoz.	15	0
Kap. pož. při STA k expoz. v krytých dluhopisech	16	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči inst. a podn. - s krátk. ratingem	17	0
Kap. pož. při STA k expoz. vůči fondům kolekt. investování	18	0
Kap. pož. při STA k ostatním expoz.	19	89
Kap. pož. k úvěr. riziku při STA v IRB k expozicím celkem	20	0
Kap. pož. při STA v IRB k expoz. vůči centr. vládám a bankám	21	0
Kap. pož. při STA v IRB k expoz. vůči institucím	22	0
Kap. pož. při STA v IRB k podnikovým expoz.	23	0
Kap. pož. při STA v IRB k retailovým expoz.	24	0
Kap. pož. při STA v IRB k akciovým expoz.	25	0
Kap. pož. při STA v IRB k ostatním expoz.	26	0
Kap. pož. k úvěr. riziku při STA k sekuritizovaným expozicím	27	0
Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB celkem	28	0
Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k vybr. expozicím celkem	29	0
Kap. pož. při IRB k expoz. vůči centr. vládám a bankám	30	0
Kap. pož. při IRB k expoz. vůči institucím	31	0
Kap. pož. při IRB k podnikovým expoz.	32	0
Kap. pož. při IRB k retailovým expoz.	33	0
Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k akciovým expozicím	34	0
Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k sekuritizovaným expozicím	35	0
Kap. pož. k úvěr. riziku při IRB k ostatním expozicím	36	0
Kap. pož. k vypořádacímu riziku	37	0
Kap. pož. k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku celkem	38	2308
Kap. pož. k trž. riziku při stand. přístupu (STA) celkem	39	2308
Kap. pož. při STA k úrokovému riziku	40	0
Kap. pož. při STA k akciovému riziku	41	0
Kap. pož. při STA k měnovému riziku	42	2308
Kap. pož. při STA ke komoditnímu riziku	43	0
Kap. pož. k trž. riziku při přístupu založ. na vl. modelech	44	0
Kap. pož. k operačnímu riziku celkem	45	11203
Kap. pož. k oper. riziku při BIA	46	11203
Kap. pož. k oper. riziku při TSA	47	0
Kap. pož. k oper. riziku při ASA	48	0
Kap. pož. k oper. riziku při AMA	49	0
Kap. pož. k riziku angažovanosti obch. portfolia	50	0
Kap. pož. k ostatním nástrojům obch. portfolia	51	0
Přechodný kap. pož. - dorovnání k Basel 1	52	0

Datová oblast: DIS20_03 Kapitálová přiměřenost a doplňující informace

A	B	1
Původní kapitál (Tier 1) pro propočet kapit. přiměřenosti	1	65231
Dodatkový kapitál (Tier 2) pro propočet kapit. přiměřenosti	2	0
Kapitál relev. pro výpočet limitů ang. a limitů kval. účastí	3	65231
Přebyt./nedost. kapitálu před zápočtem přech. kap. pož.	4	49919
Kapit. přiměřenost před zápočtem přech. kap. pož.	5	34.08
Přebytek/nedostatek kapitálu	6	49919
Kapitálová přiměřenost	7	34.08
Přebytek/nedostatek v krytí oček. ztrát při IRB	8	0
Úpravy ocenění expozic a rezervy k podrozv. položkám při IRB	9	0
OP k portfoliím expozic při IRB	10	0
OP k individuálním expozicím při IRB	11	0
Ost. úpravy ocenění exp. a rezervy k podroz. položkám při IRB	12	0
Očekávané úvěrové ztráty při IRB	13	0
Celková výše podřízeného dluhu	14	0

7. Údaje o odměňování

Zásady a postupy odměňování upravuje vnitřní předpis Politika odměňování, který stanovuje působnost, základní zásady odměňování, organizační uspořádání systému odměňování a měření výkonosti v souvislosti s odměňováním. Vnitřní předpis politika odměňování:

- rozděluje zaměstnance na zaměstnance, kteří mají významný vliv na rizikový profil Společnosti a na ostatní zaměstnance;
- stanovuje kritéria pro přiznání pohyblivé složky odměny;
- stanovuje periodu vyhodnocování doporučení na udělení pohyblivé složky odměny na základě kvalitativního hodnocení na čtvrtletí;
- stanovuje návaznost na koeficient vnitřní kapitálové přiměřenosti;
- zakazuje pohyblivé složky odměny členům představenstva;
- určuje Dozorčí radu společnosti jako dozorčí orgán Politiky odměňování;
- definuje proces přiznání a vyplacení individuální pohyblivé složky odměny, se zásadou schválení představenstvem společnosti jedná-li se o odměny pro zaměstnance mající významný vliv na rizikový profil Společnosti;
- stanovuje povinnost vést a uchovávat záznamy o vyplacených pohyblivých odměnách.

Tabulka shrnuje odměňování uplatněné v období 2Q/2011:

Útvar	Částka
Vývoje	51,800 CZK
IS obchodníka	21,100 CZK
Správy IT/ICT prostředků a infrastruktury	50,000 CZK
Portfolio managementu a obchodování	20,000 CZK
Matematicko – analytický	15,000 CZK
Backoffice	78,000 CZK
Účetnictví	99,125 CZK