

Calcul des Fonds Propres au 30 juin 2011

**Banque Privée
Edmond de Rothschild S. A.
Genève**



**BANQUE PRIVÉE
EDMOND DE ROTHSCHILD**

BANQUE PRIVEE EDMOND DE ROTHSCHILD S.A., GENEVE
CALCUL DES FONDS PROPRES AU 30 JUIN 2011

30.06.2011
(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) | 607'979 |
| dont intérêts minoritaires | 0 |
| dont instruments « novateurs » | 0 |
| (-) déduction réglementaire | 0 |
| (-) autres éléments à porter en déduction des fonds propres de base | -152'079 |
| = fonds propres de base pouvant être pris en compte | 455'900 |
| + fonds propres complémentaires et supplémentaires | 57'660 |
| (-) autres déductions à imputer sur les fonds propres | 0 |
| Fonds propres pouvant être pris en compte | 513'560 |
| Présentation des fonds propres requis | |
| Risques de crédit | 43'413 |
| -dont risques de cours relatifs aux titres de participation dans le portefeuille de la banque | 1'586 |
| Risques non liés à des contreparties | 6'856 |
| Risques de marché | 18'272 |
| -dont sur instruments de taux d'intérêt (risque de marché général et spécifique) | 2'886 |
| -dont sur titres de participation | 2'388 |
| -dont sur devises et métaux précieux | 4'066 |
| -dont sur matières premières | 5'992 |
| Risques opérationnels | 36'079 |
| Total | 104'620 |
| AS-BRI : exigences supplémentaires suisses de fonds propres (multiplicateurs) | 20'274 |
| Total | 124'894 |
| Rapport entre les fonds propres pris en compte et les fonds propres requis selon le droit suisse | 4.11 |
| Ratios BRI en % | |
| Fonds propres de base pouvant être pris en compte (y compris les instruments novateurs) | 29.2% |
| Fonds propres pouvant être pris en compte | 32.9% |