

Informacje upowszechniane na podstawie Polityki Informacyjnej DMBH

a) Szczegółowe dane o poziomie kapitałów nadzorowanych

	31/12/2010	31/12/2009
Kapitały nadzorowane (1 + 2 + 4):	81 974 007,87	69 072 960,28
1. Kapitały podstawowe (1.1+1.2+1.3)	81 188 947,18	68 417 292,56
1.1. Kapitał zakładowy	70 950 000,00	70 950 000,00
1.2. Kapitał zapasowy	12 104 003,08	11 500 422,28
1.3. Pozycje pomniejszające kapitały podstawowe:	-1 865 055,90	-14 033 129,72
<i>wartości niematerialne i prawne</i>	<i>-1 865 055,90</i>	<i>-2 076 199,12</i>
<i>inne pozycje pomniejszające kapitały podstawowe</i>		<i>-11 956 930,60</i>
2. Kapitały uzupełniające II kategorii	622 506,86	0,00
3. Kapitały uzupełniające III kategorii		
3.1. Zysk rynkowy	922 964,47	728 587,29
4. Wysokość kapitałów III kategorii uwzględniana w poziomie kapitałów nadzorowanych	162 553,83	655 667,72

b) Wymogi kapitałowe

1. Zasady ustalanie kapitału wewnętrznego.

1.1 Proces szacowania kapitału wewnętrznego.

Proces szacowania kapitału wewnętrznego przez Dom Maklerski Banku Handlowego S.A. określa "Procedura szacowania kapitału wewnętrznego", przyjęta przez Zarząd i Radę Nadzorczą DMBH. Proces ten obejmuje w szczególności:

- ustalenie dopuszczalnego poziomu ryzyka („apetytu na ryzyko”, „ogólny poziom ryzyka”);
- ustalenie kryteriów uznawania poszczególnych rodzajów ryzyka za istotne;
- ustalenie polityki oraz procedur identyfikowania, pomiaru i sprawozdawania o ryzyku występującym w działalności domu maklerskiego;
- ustalenie wysokości kapitału w zależności od poziomu ryzyka w domu maklerskim opisujące przekształcanie miar ryzyka w ujęciu ilościowym w wymogi kapitałowe;
- ustalenie celów kapitałowych w zakresie adekwatności kapitałowej (docelowy poziom kapitału);
- kontrolę jakości i poprawności działalności domu maklerskiego w obszarze szacowania i utrzymywania kapitału wewnętrznego zgodnie z zasadami, limitami i procedurami dotyczącymi tego obszaru.

1.2. Przekształcanie miar ryzyka w wymogi kapitałowe - ustalenie kapitału wewnętrznego.

Kapitał wymagany na pokrycie zidentyfikowanych przez DMBH ryzyk istotnych w działalności Spółki obliczany jest jako wysokość straty, jaką poniosłaby Spółka w przypadku materializacji danego rodzaju ryzyka. Kapitał wewnętrzny stanowi sumę wymogów z tytułu wszystkich ryzyk istotnych.

2. Szczegółowe dane dotyczące wymogu kapitałowego z tytułu ryzyka kredytowego - kapitał regulacyjny

Klasa ekspozycji	zaangażowanie	waga ryzyka	zaangażowanie ważone ryzykiem	wymóg kapitałowy
1. Ekspozycje w-c instytucji	526 229 951,91		72 455 539,56	5 796 443,16
	163 952 254,13	0%	0,00	0,00
	362 277 697,78	20%	72 455 539,56	5 796 443,16
2. Ekspozycje w-c przedsiębiorców	16 828 801,41		5 452 801,41	436 224,11
	2 608 801,41	100%	2 608 801,41	208 704,11
	14 220 000,00	20%	2 844 000,00	227 520,00
3. Ekspozycje należące do kategorii wysokiego ryzyka	343 001,00	150%	514 501,50	41 160,12
4. Inne ekspozycje	2 763 189,59	100%	2 763 189,59	221 055,17
Wymóg z tytułu ryzyka kredytowego - kapitał całkowity:				6 494 882,56

3. Wymogi kapitałowe z tytułu ryzyka rynkowego, ryzyka rozliczenia, dostawy i ryzyka kredytowego kontrahenta, przekroczenia limitu koncentracji zaangażowania i limitu dużych zaangażowań

rodzaj ryzyka	2010		2009	
	całkowity wymóg kapitałowy	kapitał wewnętrzny	całkowity wymóg kapitałowy	kapitał wewnętrzny
ryzyko rynkowe	162 553,83	143 830,69	655 667,72	nie dotyczy
ryzyko rozliczenia	0,00	0,00	0,00	nie dotyczy
ryzyko dostawy	0,00	0,00	0,00	nie dotyczy
ryzyko kredytowe kontrahenta	6 494 882,56	8 620 055,49	0,00	nie dotyczy
przekroczenie limitu koncentracji zaangażowania	0,00	0,00	0,00	nie dotyczy
przekroczenie limitu dużych zaangażowań	0,00	0,00	0,00	nie dotyczy

4. Łączny wymóg kapitałowy z tytułu ryzyka operacyjnego

rodzaj ryzyka	2010		2009	
	całkowity wymóg kapitałowy	kapitał wewnętrzny	całkowity wymóg kapitałowy	kapitał wewnętrzny
ryzyko operacyjne	7 955 163,17	7 955 163,17	nie dotyczy	nie dotyczy

Warszawa, 21 czerwca 2011 roku