

Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích
brokerjet České spořitelny, a.s.
podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 31.03.2008

1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

OCP (ČNB) 40-12 Hlášení o kapitálové přiměřenosti obchodníka s CP

< 1 > Kapitál ~ DIS20_01

	@	I
Kapitál	1	220 169
Původní kapitál (Tier 1)	2	164 136
Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku	3	160 000
Vlastní akcie	4	0
Emisní ážio	5	0
Rezervní fondy a nerozdělený zisk	6	4 136
Povinné rezervní fondy	7	2 802
Ostatní fondy z rozdělení zisku	8	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	9	1 334
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	0
Goodwill	18	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	19	0
Negat. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. kapitál. nástrojů	20	0
Účastnické CP vydané osobou s kvalifikov. účastí v bance	21	0
Dodatkový kapitál (Tier 2)	22	60 000
Hlavní dodatkový kapitál- přebytek v krytí oč.úv.ztrát u IRB	23	0
Vedlejší dodatkový kapitál	24	60 000
Podřízený dluh A	25	60 000
Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů	26	0
Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)	27	-3 967
Kapitálové investice nad 10 % do bank a ost.fin.institucí	28	0
Kapitálové investice nad 10 % do pojišťoven	29	0
Kapitálové investice do 10 % do institucí a fin. institucí	30	0
Význ.obezř.úpravy při tržním oceňování n. oceňování modelem	31	0
Expozice ze sekuritizace s rizik. váhou 1250%	32	0
Nedostatek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB	33	0
Převýšení jiných než význ.obezř.úprav nad podříz.dluhem B	34	-3 967
Odpčet u volných dodávek	35	0
Kapitál na krytí tržního rizika (Tier 3)	36	0
Podřízený dluh B	37	0
Jiné než význ. obezř. úpravy při trž.oceň. nebo oceň.modelem	38	0

2. Údaje o kapitálové přiměřenosti a výši kapitálových požadavků
(tis. Kč)

Výše kapitálových požadavků

1. k úvěrovému riziku v členění na

1.1. Kapitálové požadavky k úvěrovému riziku podle standardizovaného přístupu a dále v členění podle jednotlivých kategorií expozic

Hrubá hodnota expozice	Úprava ocenění expozic a rezervy k podrozvah. položkám	Čistá hodnota expozice	Expozice po zohlednění substitučního vlivu zajištění	Plně upravená hodnota expozice E*	Hodnota expozice po konverzi	Rizikově vážená expozice	Kapitálový požadavek
2 774 914	0	2 774 914	2 638 188	2 638 188	2 638 188	1 242 416	99 393

1.2. Kapitálové požadavky k úvěrovému riziku /včetně rizika rozmělnění) podle přístupu IRB, a dále v členění podle jednotlivých kategorií expozic

N/A

2. k vypořádacímu riziku

N/A

3. k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	897 296	867 850	2 356
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	897 296	867 850	2 356
Měnové pozice v EUR	4	682 629	654 172	XX
Měnové pozice v USD	5	196 762	195 828	XX
Měnové pozice v GBP	6	5 184	5 161	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	12 721	12 689	XX
Měnové pozice v nástrojích FKI považovaných za zvláštní měny	9	0	0	XX
Kap. pož. k měn. futures a opcím stanovený metodou marží	10	XX	XX	0
Ostatní kap. pož. k opčním kontraktům	11	XX	XX	0

4. k operačnímu riziku

N/A

5. k riziku angažovanosti obchodního portfolia

N/A

6. ostatních a přechodných, které vyplývají z přechodu na přístup IRB nebo přístup AMA

N/A