

Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích brokerjet České spořitelny, a.s. podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 30.09.2008

1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

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

< 1 > Kapitál ~ DIS20 01	30.9.08	30.6.08	31.3.08	31.12.07
Kapitál	223 241	222 986	220 169	220 035
Původní kapitál (Tier 1)	167 127	167 127	164 136	164 136
Splacený základní kapitál zapsaný v obchodním rejstříku	160 000	160 000	160 000	160 000
Vlastní akcie	0	0	0	0
Emisní ážio	0	0	0	0
Rezervní fondy a nerozdělený zisk	7 127	7 127	4 136	4 136
Povinné rezervní fondy	5 452	5 452	2 802	2 802
Ostatní fondy z rozdělení zisku	0	0	0	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	1 676	1 676	1 334	1 334
Zisk za účetní období po zdanění	0	0	0	0
Neuhrazená ztráta z předchozích období	0	0	0	0
Výsledné kurzové rozdíly z konsolidace	0	0	0	0
Zisk za běžné účetní období	0	0	0	0
Ztráta za běžné účetní období	0	0	0	0
Čistý zisk z kapitalizace budouc. příjmů ze sekuritizace	0	0	0	0
Zisk/ztráta z ocenění závazků v RH z titulu úvěr. rizika	0	0	0	0
Další odčitatelné položky z původního kapitálu	0	0	0	0
Goodwill	0	0	0	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	0	0	0	0
Negat. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. kapitál. nástrojů	0	0	0	0
Účastnické CP vydané osobou s kvalifikov. účastí v bance	0	0	0	0
Dodatkový kapitál (Tier 2)	60 000	60 000	60 000	60 000
Hlavní dodatkový kapitál- přebytek v krytí oč.úv.ztrát u IRB	0	0	0	0
Vedlejší dodatkový kapitál	60 000	60 000	60 000	60 000
Podřízený dluh A	60 000	60 000	60 000	60 000
Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů	0	0	0	0
Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)	-3 887	-4 142	-3 967	-4 101
Kapitálové investice nad 10 % do bank a ost.fin.institucí	0	0	0	0
Kapitálové investice nad 10 % do pojišťoven	0	0	0	0
Kapitálové investice do 10 % do institucí a fin. institucí	0	0	0	0
Význ.obezř.úpravy při tržním oceňování n. oceňování modelem	0	0	0	0
Expozice ze sekuritizace s rizik. váhou 1250%	0	0	0	0
Nedostatek v krytí očekávaných úvěrových ztrát u IRB	0	0	0	0
Převýšení jiných než význ.obezř.úprav nad podřiz.dluhem B	-3 887	-4 142	-3 967	-4 101
Odpočet u volných dodávek	0	0	0	0
Kapitál na krytí tržního rizika (Tier 3)	0	0	0	0
Podřízený dluh B	0	0	0	0
Jiné než význ. obezř. úpravy při trž. oceň. nebo oceň. modelem	0	0	0	0

2. Údaje o kapitálové přiměřenosti a výši kapitálových požadavků

(tis. Kč)

Výše kapitálových požadavků

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

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 30.9.2008

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
2 306 131	0	2 306 131	2 195 033	2 195 033	2 195 033	1 000 371	80 030

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 30.6.2008

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
2 485 349	0	2 485 349	2 403 556	2 403 556	2 403 556	1 184 269	94 742

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 31.3.2008

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

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 31.12.2007

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
4 076 208	0	4 076 208	2 996 208	2 996 208	2 996 208	1 545 816	123 665

Kapitálové požadavky k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 – 30.9.2008

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	690 026	690 223	392
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	690 026	690 223	392
Měnové pozice v EUR	4	452 815	457 721	XX
Měnové pozice v USD	5	190 620	189 621	XX
Měnové pozice v GBP	6	9 078	8 954	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	5 450	5 365	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

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 – 30.6.2008

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	760 008	739 161	2 932
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2			
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	760 008	739 161	2 932
Měnové pozice v EUR	4	541 130	504 607	XX
Měnové pozice v USD	5	205 439	221 247	XX
Měnové pozice v GBP	6	9 130	9 024	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	4 309	4 283	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

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 – 31.3.2008

		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

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 – 31.12.2007

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	905 168	857 292	3 830
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	905 168	857 292	3 830
Měnové pozice v EUR	4	704 643	657 583	XX
Měnové pozice v USD	5	196 418	195 631	XX
Měnové pozice v GBP	6	2 569	2 549	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	1 538	1 529	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