

# Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích brokerjet České spořitelny, a.s. podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 30.9.2009

## 1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

< 1 > Kapitál ~ DIS20_01	30.9.09	30.6.09	31.3.09	31.12.08
Kapitál	225 615	220 309	213 558	222 477
Původní kapitál (Tier 1)	167 460	162 470	155 970	165 236
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	8 997	7 127	7 127	7 127
Povinné rezervní fondy	7 321	5 452	5 452	5 452
Ostatní fondy z rozdělení zisku	0		0	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	1 677	1 676	1 676	1 676
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	-3 002	-9 384	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	-1 537	-1 655	-1 774	-1 892
Goodwill	0	0	0	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	-1 537	-1 655	-1 774	-1 892
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)	-1 845	-2 161	-2 412	-2 759
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	-1 845	-2 161	-2 412	-2 759
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 – 30.9.2009

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
3 223 888	-155	3 223 733	3 152 327	3 152 327	2 830 001	1 103 157	88 253

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20\_60 – 30.6.2009

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
1 696 674	0	1 696 674	1 696 674	1 696 674	1 696 674	339 335	27 147

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20\_60 – 31.3.2009

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
2 847 779	-176	2 847 603	2 774 927	2 774 927	2 538 467	912 020	72 962

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20\_60 – 31.12.2008

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
2 559 132	-165	2 558 967	2 473 090	2 473 090	2 212 920	889 009	71 121

Kapitálové požadavky k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20\_92 – 30.9.2009

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	9 203	0	736
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	9 203	0	736
Měnové pozice v EUR	4	5 594	0	XX
Měnové pozice v USD	5	3 563	0	XX
Měnové pozice v GBP	6	36	0	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	10	0	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 – 30.6.2009

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	10 708	0	857
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	10 708	0	857
Měnové pozice v EUR	4	8 017	0	XX
Měnové pozice v USD	5	2 622	0	XX
Měnové pozice v GBP	6	53	0	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	16	0	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 – 31.3.2009

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	11 062	0	885
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	11 062	0	885
Měnové pozice v EUR	4	7 414	0	XX
Měnové pozice v USD	5	3 548	0	XX
Měnové pozice v GBP	6	55	0	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	45	0	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 – 31.12.2008

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	648 527	660 996	1 269
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	648 527	660 996	1 269
Měnové pozice v EUR	4	425 161	441 019	XX
Měnové pozice v USD	5	213 441	210 111	XX
Měnové pozice v GBP	6	4 682	4 639	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	5 243	5 227	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