

Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích brokerjet České spořitelny, a.s. podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 31.12.2011

1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

< 1 > Kapitál ~ DIS20_01	31.12.2011	30.9.2011	30.6.2011	31.3.2011
Kapitál	188 730	188 431	231 496	230 557
Původní kapitál (Tier 1)	190 486	189 466	172 664	171 819
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	31 266	30 389	13 732	13 732
Povinné rezervní fondy	8 434	7 557	7 557	7 557
Ostatní fondy z rozdělení zisku	0	0	0	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	22 832	22 832	6 174	6 174
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	-935
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	-779	-923	-1 068	-978
Goodwill	0	0	0	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	-779	-923	-1 068	-978
Negat. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. kapitál. nástrojů	0	0	0	0
Účastnické CP vydané osobou s kvalifikov. účastí v bance	00	0	0	0
Dodatkový kapitál (Tier 2)	0	0	60 000	60 000
Hlavní dodatkový kapitál- přebytek v krytí oč.úv.ztrát u IRB	0	0	0	0
Vedlejší dodatkový kapitál	0	0	60 000	60 000
Podřízený dluh A	0	0	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)	-1 756	-1 035	-1 168	-1 262
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	-1 756	-1 035	-1 168	-1 262
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 – 31.12.2011

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
2 696 918	0	2 696 918	2 632 108	2 632 108	2 406 288	768 262	61 461

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 30.9.2011

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
2 743 659	0	2 743 659	2 666 910	2 666 910	2 435 053	924 009	73 921

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 30.6.2011

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
3 195 679	0	3 195 679	3 120 823	3 120 823	2 813 368	1 187 785	95 023

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 31.3.2011

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
3 283 207	0	3 283 207	3 208 351	3 208 351	2 892 677	1 226 189	98 095

Kapitálové požadavky k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 – 31.12.2011

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	829 207	826 107	248
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	829 207	826 107	248
Měnové pozice v EUR	4	478 692	478 367	XX
Měnové pozice v USD	5	339 730	337 003	XX
Měnové pozice v GBP	6	3 067	3 049	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	7 718	7 688	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 – 30.9.2011

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	11 036	0	1 193
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	11 036	12	1 193
Měnové pozice v EUR	4	13 490	0	XX
Měnové pozice v USD	5	1 366	0	XX
Měnové pozice v GBP	6	27	0	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	23	12	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 – 30.6.2011

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	11 765	0	941
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2			
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	11 765	0	941
Měnové pozice v EUR	4	9 393	0	XX
Měnové pozice v USD	5	2 322	0	XX
Měnové pozice v GBP	6	33	0	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	17	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	
Ostatní kap. pož. k opčním kontraktům	11	XX	XX	

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20 92 – 31.3.2011

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	11 516	0	921
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2			
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	11 516	0	921
Měnové pozice v EUR	4	9 121	0	XX
Měnové pozice v USD	5	2 338	0	XX
Měnové pozice v GBP	6	32	0	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	25	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	
Ostatní kap. pož. k opčním kontraktům	11	XX	XX	