

Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích  
 brokerjet České spořitelny, a.s.  
 podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 30.09.2012

## 1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

< 1 > Kapitál ~ DIS20_01	30.9.2012	30.6.2012	31.3.2012	31.12.2011
Kapitál	193,249	180 553	187 336	188 730
Původní kapitál (Tier 1)	194,270	181 697	188 866	190 486
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	41,261	31226	31 226	31 266
Povinné rezervní fondy	8,934	8 434	8 434	8 434
Ostatní fondy z rozdělení zisku	0	0	0	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	32,327	22832	22 832	22 832
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	-1,151	-3 219	-1 765	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	-5,840	-6 350	-635	-779
Goodwill	0	0	0	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	-5,840	-6 350	-635	-779
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	00
Dodatkový kapitál (Tier 2)	0	0	0	0
Hlavní dodatkový kapitál- přebytek v krytí oč.úv.ztrát u IRB	0	0	0	0
Vedlejší dodatkový kapitál	0	60 000	0	0
Podřízený dluh A	0	60 000	0	0
Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů	0	0	0	0
Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)	-1,021	-1 144	-1 530	-1 756
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	-1,021	-1 144	-1 530	-1 756
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 – 30.9.2012

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
2 876 778	0	2 876 778	2 828 224	2 828 224	2 582 779	810 744	64 860

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20\_60 – 30.6.2012

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
2 595 584	0	2 595 584	2 534 467	2 534 467	2 306 588	770 217	61 617

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20\_60 – 31.3.2012

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
2 794 761	0	2 794 761	2 752 079	2 752 079	2 499 063	815 082	65 207

< 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

Kapitálové požadavky k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20\_92 – 30.9.2012

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	929 509	924 249	421
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	929 509	924 249	421
Měnové pozice v EUR	4	476 500	472 690	XX
Měnové pozice v USD	5	418 680	417 362	XX
Měnové pozice v GBP	6	14 478	14 427	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	19 851	19 771	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 – 30.6.2012

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	843 668	832 532	891
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2			
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	843 668	832 532	891
Měnové pozice v EUR	4	447 940	438 256	XX
Měnové pozice v USD	5	375 170	373 818	XX
Měnové pozice v GBP	6	13 012	12 989	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	7 545	7 469	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 – 31.3.2012

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	841 269	833 166	648
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2			
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	841 269	833 166	648
Měnové pozice v EUR	4	470 062	463 859	XX
Měnové pozice v USD	5	359 937	358 108	XX
Měnové pozice v GBP	6	2 733	2 685	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	8 537	8 515	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 – 31.12.2011

		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