

Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích
 brokerjet České spořitelny, a.s.
 podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 31.12.2012

1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

< 1 > Kapitál ~ DIS20_01	12/31/2012	9/30/2012	6/30/2012	3/31/2012
Kapitál	193,145	193,249	180,553	187,336
Původní kapitál (Tier 1)	194,045	194,270	181,697	188,866
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	41,261	31,266	31,226
Povinné rezervní fondy	8,934	8,934	8,434	8,434
Ostatní fondy z rozdělení zisku	0	0	0	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	32,327	32,327	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	-1,886	-1,151	-3,219	-1765
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 odčitelné položky z původního kapitálu	-5,330	-5,840	6350.3728	-635
Goodwill	0	0	0	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	-5,330	-5,840	6350.3728	-635
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)	0	0	0	0
Hlavní dodatkový kapitál- přebytek v krytí oč.úv.ztrát u IRB	0	0	0	0
Vedlejší dodatkový kapitál	0	0	0	0
Podřízený dluh A	0	0	0	0
Pozit. oceň. rozdíl ze změn RH realiz. akcií a podíl. listů	0	0	0	0
Odčitelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)	-900	-1,021	-1,144	-1,530
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	-900	-1,021	-1,144	-1,530
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 – 31.12.2012

Hrubá hodnota expozice	Uprava 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
2,918,147	0	2,918,147	2,864,956	2,864,956	2,601,054	843,690	67,495

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 30.9.2012

Hrubá hodnota expozice	Uprava 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	Uprava 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	Uprava 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

Kapitálové požadavky k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 - 31.12.2012

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	895 884	890 800	407
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	895 884	890 800	407
Měnové pozice v EUR	4	438 964	435 428	XX
Měnové pozice v USD	5	441 370	439 878	XX
Měnové pozice v GBP	6	3 146	3 118	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	12 404	12 378	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 - 30.9.2012

		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	