

Informace o kapitálu a kapitálových požadavcích
 brokerjet České spořitelny, a.s.
 podle vyhlášky č. 123/2007 Sb. k 30.09.2013

1. Údaje o kapitálu

(tis. Kč)

< 1 > Kapitál ~ DIS20_01	9/30/2013	6/30/2013	3/31/2013	12/31/2012
Kapitál	187,415	185,329	189,203	193,145
Původní kapitál (Tier 1)	187,993	186,013	189,993	194,045
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	39,374	39,374	39,374	41,261
Povinné rezervní fondy	8,934	8,934	8,934	8,934
Ostatní fondy z rozdělení zisku	0	0	0	0
Nerozdělený zisk z předchozích období	30,441	32,327	32,327	32,327
Zisk za účetní období po zdanění	0	0	0	0
Neuhrazená ztráta z předchozích období	0	-1,886	-1,886	0
Výsledné kurzové rozdíly z konsolidace	0	0	0	0
Zisk za běžné účetní období	0	0	0	0
Ztráta za běžné účetní období	-7,047	-8,640	-4,444	-1,886
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	-4,334	-4,722	-4,938	-5,330
Goodwill	0	0	0	0
Nehmotný majetek jiný než goodwill	-4,334	-4,722	-4,938	-5,330
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
Odčitatelné položky od původ. a dodat.kapitálu (Tier1+Tier2)	0	0	0	0
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	-578	-683	-790	-900
Převýšení jiných než význ.obezř.úprav nad podřiz.dluhem B	0	0	0	0
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 – 30.9.2013

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
2,835,506	0	2,835,506	2,792,670	2,792,670	2,538,812	755,413	60,433

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 30.6.2013

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
2,549,622	0	2,549,622	2,486,157	2,486,157	2,247,016	705,627	56,450

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 31.3.2013

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
2,593,787	0	2,593,787	2,547,911	2,547,911	2,304,137	775,196	62,016

< 9 > Kap. pož. k úvěr. riziku - STA celkem ~ DIS20_60 – 31.12.2012

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
2,918,147	0	2,918,147	2,864,956	2,864,956	2,601,054	843,690	67,495

Kapitálové požadavky k pozičnímu, měnovému a komoditnímu riziku

< 24 > Kap. pož. k měnovému riziku - STA ~ DIS20_92 – 30.9.2013

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	1,053,627	1,038,943	1,175
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	1,053,627	1,038,943	1,175
Měnové pozice v EUR	4	522,276	509,179	XX
Měnové pozice v USD	5	520,744	519,218	XX
Měnové pozice v GBP	6	3,987	3,970	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	6,619	6,576	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 – 30.6.2013

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	901,548	884,803	1,340
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	901,548	884,803	1,340
Měnové pozice v EUR	4	481,428	466,246	XX
Měnové pozice v USD	5	398,911	397,460	XX
Měnové pozice v GBP	6	14,981	14,913	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	6,227	6,184	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 – 31.3.2013

		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 – 31.12.2012

		Pozice dlouhé	Pozice krátké	Kapitálový požadavek
Kap. pož. k měnovému riziku	1	960,402	969,978	880
Kap. pož. ke kompenzované pozici silně korelovaných měn	2	0	0	0
Kap. pož. k celkové měnové pozici	3	960,402	969,978	880
Měnové pozice v EUR	4	507,988	518,993	XX
Měnové pozice v USD	5	419,846	418,489	XX
Měnové pozice v GBP	6	14,877	14,821	XX
Měnové pozice v JPY	7	0	0	XX
Měnové pozice v ost měnách	8	17,692	17,674	XX
Měnové pozice v nástrojích FKÍ 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