

(banka) *

Obrazec IZP-trg 4

IZPOSTAVLJENOST IZ POSTAVK TRGOVANJA
na dan _____

v tisoč SIT

Zap. števil.	Naziv osebe	Matična številka ali druga oznaka	Pozicija v finančnih instrumentih	Pozicije v VP iz priprave prodaje z obveznostjo odkupa	Izpostavljenosti zaradi tveganja neizpolnitve nasprotne stranke	Pozicije v blagu	Bruto izpostavljenost iz postavk trgovanja
	1	2	3	4	5	6	7=3+4+5+6
	I. Posamezne osebe: . . . Skupaj posamezne osebe		<i>Dolge</i> <i>Kratke</i> <i>Vsota neto dolgih pozicij</i>	<i>Obveznost odkupa</i> <i>Preneseno na tretjo osebo</i> <i>Razlika</i>		<i>Dolge</i> <i>Kratke</i> <i>Vsota neto dolgih pozicij</i>	
	II. Skupine povezanih oseb . . . Skupaj skupina . . . Skupaj vse skupine						
	III. Skupaj I. + II.						

V obrazec se vnesejo vse posamezne osebe (tudi osebe iz 8.1. točke sklepa) in skupine povezanih oseb (z navedbo posameznih oseb znotraj skupine) ter tudi osebe v posebnem razmerju do banke, pri katerih znesek skupne bruto izpostavljenosti iz obrazca IZP-trg 1 presega ali je enak 10% kapitala. Posamezna oseba, ki je vključena v II. delu v skupini povezanih oseb, se v I. delu ne navaja, čeprav bi izpostavljenost do nje presegala 10% kapitala.

V stolpec 2: se vpiše matična številka ali druga oznaka v skladu z navodili za izvajanje sklepa o razvrstitvi aktivnih bilančnih in zunajbilančnih postavk bank in hranilnic.

V stolpec 3: se vpiše tržna vrednost dolgih in kratkih pozicij v vseh finančnih instrumentih, izdanih s strani posamezne osebe. Pobot med dolgimi in kratkimi pozicijami v določenem fin. instrumentu je dovoljen ob izpolnjevanju pogojev iz 20. točke sklepa o kapitalski ustreznosti. Za izračun izpostavljenosti do posamezne osebe iz naslova pozicij v različnih finančnih instrumentih je potrebno sešteti neto dolge pozicije v različnih finančnih instrumentih teh oseb.

V stolpec 4: se vpiše znesek izpostavljenosti iz naslova obveznosti odkupa VP posamezne osebe zaradi priprave in izvedbe prodaje VP, zmanjšan za znesek VP, že prenesenih na tretje osebe ter izračunana neto izpostavljenost iz tega naslova (razlika).

V stolpec 5: se vpiše znesek izpostavljenosti zaradi tveganja neizpolnitve nasprotne stranke iz pogodb s posamezno osebo, izračunan v skladu z VIII. poglavjem sklepa o kapitalski ustreznosti, vendar brez množenja z utežmi iz 12. točke sklepa o kapitalski ustreznosti.

V stolpec 6: se vpiše tržna vrednost dolgih in kratkih pozicij v blagu ter se izračuna vsota neto dolgih pozicij v različnih vrstah blaga, kupljenega/prodanega s strani posamezne osebe.

V stolpec 7: se vpiše vsota zneskov iz stolpcev 3, 4, 5 in 6, ki predstavlja bruto izpostavljenost iz postavk trgovanja.

* Izpolni banka, ki je v skladu z 9. točko sklepa o kapitalski ustreznosti zavezana k izpolnjevanju zahtev za tržna tveganja.