

PRILOGA 2
OBRAZEC IS/TVEG 2

Poročilo o merjenju tveganj posameznih naložb investicijskega sklada

Datum, na katerega se nanašajo podatki v tem poročilu:

Družba za upravljanje

INVESTICIJSKI SKLAD (naziv sklada)	v tisočih SIT	TVEGANJA		IZPOSTAVLJENOST PRI POSAMEZNEM INSTRUMENTU	metodologija izračuna
		vrsta tveganj	osnova za merjenje tveganj		
IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI					XXXXXXXXXX
za varovanje pred tveganji					XXXXXXXXXX
...					XXXXXXXXXX
...					XXXXXXXXXX
za trgovanje					XXXXXXXXXX
...					XXXXXXXXXX
...					XXXXXXXXXX
SKUPAJ IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI					(1)
ČISTA VREDNOST SREDSTEV SKLADA, v tisočih SIT					(2)
KOLIČNIK IZPOSTAVLJENOSTI ZA IZVEDENE FINANČNE INSTRUMENTE po 1. odstavku 67. člena ZISDU-1					(3) = (1) / (2)

Datum izpolnitve obrazca

Ime, priimek in podpis osebe, ki je izpolnila obrazec

Ime, priimek in podpis odgovorne osebe družbe za upravljanje, ki je pregledala izpolnjeni obrazec

Navodilo za izpolnjevanje obrazca IS/TVEG 2:

1. V obrazcu se zajamejo posamezne vrste naložb glede na vrste, ki jih opredeljuje prvi odstavek 64. člena ZISDU-1.
2. V obrazcu se zajamejo vse vrste tveganj, opredeljene z načrtom iz tretjega odstavka 65. člena ZISDU-1, pri posameznih vrstah naložb, zlasti pri naložbah v izvedene finančne instrumente.
3. Prikažejo se tudi vsota izpostavljenosti pri vseh naložbah v izvedene finančne instrumente skupaj ter pri vseh naložbah investicijskega sklada skupaj.
4. Izpostavljenost se ugotavlja na način in najmanj v višini, kot jo določa Sklep, izdan na podlagi 3. točke prvega odstavka 77. člena ZISDU-1.
5. Obrazec se izpolnjuje po stanju na zadnji delovni dan v mesecu.