

PRILOGA III

Prejemnik:

Banka Slovenije
Slovenska cesta 35
1505 Ljubljana

Vložnik:

(Firma in sedež banke, navedba zakonitih zastopnikov, ki so upravičeni vložiti zahtevo oziroma izdati pooblastilo za vložitev zahteve)

Pooblaščenec¹:

(Osebno ime oziroma firma, naslov prebivališča oziroma sedež)

ZAHTEVA ZA IZDAJO DOVOLJENJA BANKE SLOVENIJE ZA UPORABO MODELOV OBČUTLJIVOSTI ZA IZRAČUN POZICIJ V IZVEDENIH FINANČNIH INSTRUMENTIH
--

Kontaktna oseba za obravnavo zahteve	
Delovno mesto	
Naziv	
Telefon	
E-pošta	

Podpisi zakonitih zastopnikov in/ali pooblaščenecv

¹ Izpolni se samo, če ga banka ima. V tem primeru mora biti priloženo tudi ustrezno pooblastilo.

UTEMELJITEV ZAHTEVE

ODDELEK – A Dokumentacija o vrstah finančnih instrumentov, za katere nameravate uporabiti model občutljivosti in o osnovnih informacijah o teh modelih, kakor je določeno v točki (a) četrtega odstavka 22. člena tega sklepa.

- A1. Priložite preglednico modelov občutljivosti, ki jih nameravate uporabiti, in za vsakega od njih navedite, za katere produkte se bo uporabljal (vrste izvedenih finančnih instrumentov iz 17. do 20. člena tega sklepa, obveznice, ki se namesto enega končnega poplačila glavnice amortizira do svoje preostale zapadlosti).
- A2. Opišite modele občutljivosti in metodologijo ocenjevanja občutljivosti.

ODDELEK – B Dokumentacija, ki dokazuje, da modeli ustvarjajo pozicije, ki so enako občutljive na spremembe obrestne mere kot denarni tokovi osnovnih finančnih instrumentov, kakor je navedeno v točki (b) četrtega odstavka 22. člena tega sklepa. Zahtevane informacije in dokumentacijo predložite za vsak model občutljivosti, ki ga nameravate uporabiti.

- B1. Opišite model s posebnim poudarkom na metodologiji ocenjevanja občutljivosti.
- B2. Kako upoštevate denarne tokove osnovnih finančnih instrumentov pri ocenjevanju občutljivosti?

ODDELEK – C Dokumentacija, ki dokazuje, da se občutljivost ocenjuje glede na samostojna gibanja vzorca obrestnih mer na krivulji donosa z vsaj eno točko občutljivosti v vsakem razredu zapadlosti iz Tabele 2 četrtega odstavka 32. člena tega sklepa, kakor je določeno v točki (c) četrtega odstavka 22. člena tega sklepa. Zahtevane informacije in dokumentacijo predložite za vsak model občutljivosti, ki ga nameravate uporabiti.

- C1. Natančno opišite metodologijo oblikovanja lastne krivulje donosa, in sicer:
- kakšno obdobje je upoštevano,
 - kateri finančni instrumenti so upoštevani?
- C2. Katere predpostavke uporabljate pri oblikovanju sprememb lastne krivulje donosa, kot na primer:
- uporaba pozitivnega ali negativnega premika krivulje donosa in razlaga te uporabe,
 - razpon sprememb, ki se upoštevajo (eno ali več bazičnih točk glede na zapadlost in finančni instrument),
- koliko razredov zapadlosti oziroma točk, ki predstavljajo krivuljo donosnosti, uporabljate.
- C3. Opišite razloge za uporabo posameznih predpostavk pri oblikovanju sprememb lastne krivulje donosa.
- C4. Kateri vzorci obrestnih mer se uporabljajo pri ocenjevanju občutljivosti?
- C5. Banka naj smiselno doda tudi zahtevano dokumentacijo iz zahteve za izdajo dovoljenja Banke Slovenije za uporabo notranjih modelov za izračun kapitalskih zahtev za pozicijsko tveganje, valutno tveganje in/ali tveganje spremembe cen blaga iz Priloge VIII.