

\_\_\_\_\_  
(banka)

Obrazec IZP-trg

**POROČILO O VELIKI SKUPNI IZPOSTAVLJENOSTI**  
**na dan** \_\_\_\_\_

v tisoč EUR

**I. Izračun omejitev:**

Znesek kapitala banke <sup>1</sup> po stanju na dan poročanja		=	_____
Velika skupna izpostavljenost	≥ 10% kapitala banke	≥	_____
Največja dopustna skupna izpostavljenost	- v višini 25% kapitala banke	=	_____
	- v višini 20% kapitala banke	=	_____
Vsota skupnih izpostavljenosti	- v višini 800% kapitala banke	=	_____
	- v višini 200% kapitala banke	=	_____

**II. Vsota velikih skupnih izpostavljenosti**

	število <sup>2</sup> oseb	seštevek <sup>2</sup> zneskov	% od kapitala
1. iz obr. IZP-trg 1 - Posamezne osebe	_____	_____	_____
2. iz obr. IZP-trg 1 - Skupine povezanih oseb	_____	_____	_____
<b>Skupaj 1 + 2</b>	_____	_____	_____

**III. Prekoračitve in preseganja:<sup>3</sup>**

Datum:

Žig in podpis odgovorne osebe

Sestavil:

Telefonska številka:

<sup>1</sup> Kapital banke izračunan ob upoštevanju 7. člena tega sklepa.

<sup>2</sup> Upoštevajo se vse osebe, pri katerih izpostavljenost iz stolpca 7 obrazca IZP-trg 1 presega 10% kapitala banke.

Vključena mora biti tudi izpostavljenost do oseb v posebnem razmerju z banko, če izračunani znesek presega 10% kapitala banke.

<sup>3</sup> Navedejo se prekoračitve omejitev skupne izpostavljenosti (oseba, znesek iz stolpca 7 obrazca IZP-trg 1, % od kapitala iz stolpca 8 obrazca IZP-trg 1 in razlogi za prekoračitev) ter preseganja največjih dopustnih izpostavljenosti iz naslova postavk trgovalne knjige (oseba, znesek in čas trajanja preseganja).

(banka)

Obrazec IZP-trg 1

**VELIKE SKUPNE IZPOSTAVLJENOSTI**  
na dan \_\_\_\_\_

v tisoč EUR

Zap. številka	Naziv osebe	Matična številka ali druga oznaka	Izpostavljenost iz postavk bančne knjige	Izpostavljenost iz postavk trgovalne knjige	Skupna izpostavljenost	% od kapitala	Skupna izpostavljenost po 2. poglavju sklepa	% od kapitala	Predpisana omejitev
	1	2	3	4	5=3+4	6	7	8	9
	<b>I. Posamezne osebe:</b> . . . Skupaj posamezne osebe								
	<b>II. Skupine povezanih oseb:</b> . . . Skupaj skupina . . . Skupaj vse skupine								
	<b>III. Skupaj I. + II.</b>								

V stolpec 1 se vnesejo vse posamezne osebe, skupine povezanih oseb (z navedbo posameznih oseb znotraj skupine) in osebe v posebnem razmerju z banko, pri katerih znesek iz stolpca 5 presega ali je enak 10% kapitala banke. Posamezna oseba, ki je vključena v II. del v skupino povezanih oseb, se v I. delu ne navaja, čeprav bi izpostavljenost do nje presegala 10% kapitala banke.

V stolpec 2 se vpiše matična številka ali druga oznaka v skladu z navodilom za izvajanje sklepa o ocenjevanje izgub.

V stolpec 3 se vnesejo zneski iz stolpca 3 obrazca IZP-trg 3 (izpostavljenost iz postavk bančne knjige).

V stolpec 4 se vnesejo zneski iz stolpca 6 obrazca IZP-trg 4 (izpostavljenost iz postavk trgovalne knjige).

V stolpec 5 se vnesejo seštevki zneskov iz stolpcev 3 in 4 (skupna izpostavljenost).

V stolpec 6 se vpiše izračunani odstotek izpostavljenosti iz stolpca 5 glede na kapital banke.

V stolpec 7 se vnese znesek skupne izpostavljenosti, izračunan v skladu z 2. poglavjem tega sklepa.

V stolpec 8 se vpiše izračunani odstotek izpostavljenosti iz stolpca 7 glede na kapital banke.

V stolpec 9 se vpiše 25% ali 20% glede na to, katera omejitev iz 8. točke tega sklepa velja za posamezno osebo oziroma skupino povezanih oseb.

Pri skupini povezanih oseb v II. delu se predpisana omejitev vpiše le v vrstici - skupaj skupina.

\_\_\_\_\_  
(banka)

**IZPOSTAVLJENOST DO OSEB V POSEBNEM RAZMERJU Z BANKO**  
na dan \_\_\_\_\_

v tisoč EUR

Zap. št.	Naziv osebe *	Matična številka ali druga oznaka	Skupna izpostavljenost po 4. členu sklepa	Skupna izpostavljenost po 2. poglavju sklepa	% od kapitala
	1	2	3	4	5
	<b>I. Posamezne osebe:</b> . . .				
	<b>II. Skupine povezanih oseb:</b> . . .				
	<b>Skupaj I. + II.</b>				

V stolpec 1 se vnesejo vse posamezne osebe in skupine povezanih oseb (z navedbo posameznih oseb znotraj skupine) iz 164. člena Zban-1.

V stolpec 2 se vpiše matična številka ali druga oznaka v skladu z navodilom za izvajanje sklepa o ocenjevanju izgub.

V stolpec 3 se vnese znesek skupne izpostavljenosti, to je vsote izpostavljenosti iz postavk bančne knjige in postavk trgovalne knjige, izračunane v skladu s 4. členom tega sklepa.

V stolpec 4 se vnese znesek skupne izpostavljenosti, izračunan v skladu z 2. poglavjem tega sklepa.

V stolpec 5 se vpiše izračunani odstotek skupne izpostavljenosti iz stolpca 4 glede na kapital banke.

\* Fizičnih oseb ni potrebno navajati poimensko.

(banka)

Obrazec IZP-trg 3

**IZPOSTAVLJENOST IZ POSTAVK BANČNE KNJIGE**  
**na dan \_\_\_\_\_**

v tisoč EUR

Zap. številka	Naziv osebe	Matična številka ali druga oznaka	Izpostavljenost iz postavk bančne knjige	Izpostavljenost iz postavk bančne knjige po 2. poglavju sklepa	% od kapitala	Predpisana omejitvev
	1	2	3	4	5	6
	<b>I. Posamezne osebe:</b> . . . Skupaj posamezne osebe					
	<b>II. Skupine povezanih oseb:</b> . . . Skupaj skupina . . . Skupaj vse skupine					
	<b>III. Skupaj I. + II.</b>					

V stolpec 1 se vnesejo vse posamezne osebe, skupine povezanih oseb (z navedbo posameznih oseb znotraj skupine) in osebe v posebnem razmerju z banko, pri katerih znesek iz stolpca 5 obrazca IZP-trg 1 presega ali je enak 10% kapitala banke. Posamezna oseba, ki je vključena v II. del v skupino povezanih oseb, se v I. delu ne navaja, čeprav bi izpostavljenost do nje presegala 10% kapitala banke.

V stolpec 2 se vpiše matična številka ali druga oznaka v skladu z navodilom za izvajanje sklepa o ocenjevanju izgub.

V stolpec 3 se vnese znesek izpostavljenosti, ki spadajo med postavke bančne knjige po sklepu o tržnih tveganjih, izračunan v skladu s 3. členom tega sklepa.

V stolpec 4 se vnese znesek izpostavljenosti iz postavk bančne knjige, izračunan v skladu z 2. poglavjem tega sklepa.

V stolpec 5 se vpiše izračunani odstotek izpostavljenosti iz stolpca 4 glede na kapital banke.

V stolpec 6 se vpiše 25% ali 20% glede na to, katera omejitvev iz 8. točke tega sklepa velja za posamezno osebo oziroma skupino povezanih oseb.

(banka)

**IZPOSTAVLJENOST IZ POSTAVK TRGOVALNE KNJIGE**

na dan \_\_\_\_\_

v tisoč EUR

Zap. št.	Naziv osebe	Matična številka ali druga oznaka	Pozicije v finančnih instrumentih	Pozicije v finančnih instrumentih zaradi priprave in izvedbe prve prodaje z obveznostjo odkupa	Izpostavljenosti zaradi kreditnega tveganja nasprotne stranke	Izpostavljenost iz postavk trgovalne knjige
	1	2	3	4	5	6=3+4+5
	<b>I. Posamezne osebe:</b> . . . Skupaj posamezne osebe  <b>II. Skupine povezanih oseb</b> . . . Skupaj skupina . . . Skupaj vse skupine  <b>III. Skupaj I. + II.</b>		<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>		

V stolpec 1 se vnesejo vse posamezne osebe, skupine povezanih oseb (z navedbo posameznih oseb znotraj skupine) in osebe v posebnem razmerju z banko, pri katerih znesek iz stolpca 5 obrazca IZP-trg 1 presega ali je enak 10% kapitala. Posamezna oseba, ki je vključena v II. del v skupino povezanih oseb, se v I. delu ne navaja, čeprav bi izpostavljenost do nje presegala 10% kapitala banke.

V stolpec 2 se vpiše matična številka ali druga oznaka v skladu z navodilom za izvajanje sklepa o ocenjevanju izgub.

V stolpec 3 se vpiše vrednost dolgih in kratkih pozicij v vseh finančnih instrumentih, izdanih s strani posamezne osebe, pri čemer se neto pozicije v posameznem finančnem instrumentu izračunajo v skladu s 15. členom sklepa o tržnih tveganjih. 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 finančnih instrumentov posamezne osebe zaradi priprave in izvedbe njihove prve prodaje, zmanjšan za znesek finančnih instrumentov, že prenesenih na tretje osebe ter izračunana neto izpostavljenost iz tega naslova (razlika).

V stolpec 5 se vpiše znesek izpostavljenosti do posamezne osebe iz naslova poslov, sporazumov ali pogodb zaradi kreditnega tveganja nasprotne stranke, izračunan v skladu s sklepom o standardiziranem pristopu in 46. členom sklepa o tržnih tveganjih.

V stolpec 6 se vpiše vsota zneskov iz stolpcev 3, 4 in 5, ki predstavlja izpostavljenost iz postavk trgovalne knjige.