

(banka)

Obrazec IZP-trg 3

IZPOSTAVLJENOST IZ POSTAVK TRGOVALNE KNJIGE
na dan _____

v tisoč EUR

Zap. števil.	Naziv osebe	Matična številka ali druga oznaka	Oznaka osebe	Pozicije v finančnih instrumentih	Pozicije v finančnih instrumentih zaradi priprave in izvedbe prve prodaje z obveznostjo odkupa	Izpostavljenost zaradi kreditnega tveganja nasprotne stranke	Izpostavljenost pred upoštevanjem izvzetij in učinkov kreditnih zavarovanj (trgovalna knjiga) =4+5+6
	1	2	3	4	5	6	7
	I. 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>		
	II. Skupine povezanih oseb . . Skupaj skupina .						

- 1 Posamezne osebe in skupine povezanih oseb (z navedbo posameznih oseb znotraj skupine), pri katerih znesek iz stolpca 6 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.
- 2 Matična številka ali druga oznaka v skladu z navodilom za izvajanje sklepa o ocenjevanju izgub.
- 3 Oznaka osebe: "1" za vse osebe, ki niso kreditne institucije, "2" za kreditne institucije, "3" za kreditne institucije znotraj bančne skupine, "4" za osebe v bančni skupini, ki niso kreditne institucije. Za namen tega sklepa kot osebe v bančni skupini štejejo: banki nadrejena družba, posamezna oseba, ki jo banka posredno ali neposredno obvladuje in posamezna oseba, ki jo posredno ali neposredno oseba obvladuje ista oseba kot banko. Skupina povezanih oseb, v kateri je vsaj ena institucija, ima oznako "2", skupina povezanih oseb, v kateri je vsaj ena kreditna institucija iz bančne skupine, v kateri je tudi banka poročevalka, ima oznako "3".
- 4 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 sklepom 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.
- 5 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).
- 6 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.
- 7 Vsota zneskov iz stolpcev 4, 5 in 6, ki predstavlja izpostavljenost iz postavk trgovalne knjige.