

Na temelju članka 560. stavka 8. i članka 580. stavka 4. Zakona o tržištu kapitala (»Narodne novine« br. 65/18., 17/20. i 83/21.), Hrvatska agencija za nadzor financijskih usluga na sjednici Upravnog vijeća održanoj 8. prosinca 2022. godine donosi

**PRAVILNIK
O IZMJENAMA PRAVILNIKA O
PERIODIČKOM, STATISTIČKOM I KAPITALNOM IZVJEŠTAVANJU
OD STRANE SREDIŠNJEG DEPOZITORIJA VRIJEDNOSNIH PAPIRA
TE IZVJEŠTAVANJU OD STRANE SREDIŠNJEG DEPOZITORIJA
VRIJEDNOSNIH PAPIRA IZ DRUGE DRŽAVE ČLANICE**

Članak 1.

U Pravilniku o periodičkom, statističkom i kapitalnom izvještavanju od strane središnjeg depozitorija vrijednosnih papira te izvještavanju od strane središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice (»Narodne novine«, br. 91/19. i 144/21.) u članku 3. stavci 2. i 3. mijenjaju se i glase:

„(2) Izvještaj iz stavka 1. ovoga članka središnji depozitorij vrijednosnih papira dostavlja Hanfi u formatima predložaka iz Priloga II, Tablica 1., 2. i 3. Provedbene uredbe Komisije (EU) 2017/394, na godišnjoj osnovi, u roku od 4 (četiri) mjeseca od zadnjeg dana poslovne godine za koju se izvještaj dostavlja.

(3) Cjeloviti skup zadnjih revidiranih financijskih izvještaja CSD-a iz točke 1. tablice 2. Priloga II Provedbene uredbe Komisije (EU) 2017/394 odnosno iz članka 41. točke (a) Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/392, nije potrebno dostaviti u skladu sa stavkom 2. ovoga Pravilnika pod uvjetom da je isti dostavljen Hanfi u skladu s Pravilnikom o strukturi, sadržaju, načinu i rokovima dostave godišnjih financijskih izvještaja i revizorskog izvješća, financijskih izvještaja za razdoblja tijekom godine te primjeni kontnog plana za središnji depozitorij vrijednosnih papira u kojem slučaju je uz izvještaje iz Priloga II., tablice 2 Provedbene uredbe (EU) 2017/394, a koji se dostavlja u skladu sa stavkom 2. ovoga članka, potrebno naznačiti datum kada je isti dostavljen uz oznaku dokumenta pod kojim je isti dostavljen Hanfi.“.

Stavak 8. briše se.

Članak 2.

U članku 4. stavku 3. prvom podstavku iza riječi „datum“ briše se zarez te se riječi: „u elektroničkom obliku,“ brišu.

U stavku 3. drugom podstavku iza riječi „godinu“ briše se zarez i stavlja točka te se riječi: „u elektroničkom obliku, sve u skladu s člankom 6. stavkom 1. ovoga Pravilnika“ brišu.

Članak 3.

Članak 5. mijenja se i glasi:

„(1) Za potrebe članka 560. stavka 6. Zakona, Hanfa može od središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice zatražiti dostavu godišnjeg izvještaja o njegovim aktivnostima na području Republike Hrvatske s podacima iz članka 41. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/392 točaka (b), (c), (d), (f), (g), (l), (m), (n), (q) i (r), s tim da se dostavljeni podaci posebno odnose na informacije vezano uz:

- prenosive vrijednosne papire čiji su izdavatelji pravne osobe sa sjedištem u Republici Hrvatskoj,
- izdavatelje sa sjedištem u Republici Hrvatskoj čiji se prenosivi vrijednosni papiri vode i/ili se namiruju u sustavu središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice

– sudionike sustava namire kojim upravlja središnji depozitorij vrijednosnih papira iz druge države članice, a koji su pravne osobe sa sjedištem u Republici Hrvatskoj,

– klijente sudionika sustava namire kojim upravlja središnji depozitorij vrijednosnih papira iz druge države članice ili klijente središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice, a koji su fizičke ili pravne osobe sa prebivalištem ili sjedištem u Republici Hrvatskoj, pod uvjetom da su takvi klijenti poznati središnjem depozitoriju vrijednosnih papira iz druge države članice.

(2) Za potrebe članka 560. stavka 7. Zakona, Hanfa može u okviru godišnjeg izvještaja iz stavka 1. ovoga članka, od središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice zatražiti dostavu statističkih informacija iz članka 42. stavka 1. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/392 koje se odnose na subjekte i instrumente iz stavka 1. ovoga članka, a po potrebi i na mjesečnoj ili kvartalnoj osnovi.

(3) Hanfa od središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice može zatražiti i dostavu revidiranih financijskih izvještaja iz članka 41. točke a) Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/392, uključujući one konsolidirane na razini grupe.

(4) Hanfa može od središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice zatražiti da je obavještava o operativnim incidentima iz članka 41. točke (h) Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/392 ako se radi o događaju koji može materijalno utjecati na provođenje namire instrumenata iz stavka 1. ovog članka ili koji može materijalno utjecati na stabilnost financijskog tržišta u Republici Hrvatskoj u kojem slučaju se obavijesti dostavljaju bez odgode, a ako isto iz opravdanih razloga nije moguće, najkasnije u roku od 5 radnih dana od dana operativnog incidenta.

(5) Hanfa može od središnjeg depozitorija vrijednosnih papira iz druge države članice zatražiti da je obavještava o ručnim intervencijama iz članka 41. točke (j) Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/392 kada takva intervencija može imati materijalne posljedice na tržište i ulagatelje u Republici Hrvatskoj, u kojem slučaju se obavijesti dostavljaju bez odgode, a ako isto iz opravdanih razloga nije moguće, najkasnije u roku od 5 radnih dana od dana izvršene intervencije.

(6) Izvještaje iz stavaka 1. do 5. ovoga članka središnji depozitorij vrijednosnih papira iz druge države članice koji pruža usluge na području Republike Hrvatske, dostavlja Hanfi u formatu predloška iz Priloga II, Tablica 1. do 3. Provedbene uredbe Komisije (EU) 2017/394, na način propisan Uputama Hanfe.“

Članak 4.

Naslov iznad članka 6. mijenja se i glasi „IV. IZVJEŠTAVANJE“.

Članak 6. mijenja se i glasi:

„Izvješća iz članaka 3., 4. i 5. ovoga Pravilnika dostavljaju se Hanfi na način propisan Uputama Hanfe.“

Članak 5.

Članak 7. briše se.

Članak 6.

U PRILOGU I. uz Pravilnik „Obrazac AK-SDVP – IZVJEŠTAJ O ADEKVATNOSTI KAPITALA SREDIŠNJE DRUGE UGOVORNE STRANE“ mijenja se naslov i glasi: „OBRAZAC AK-SDVP – IZVJEŠTAJ O ADEKVATNOSTI KAPITALA SREDIŠNJEG DEPOZITORIJA VRIJEDNOSNIH PAPIRA“.

Obrasci iz Priloga I. uz Pravilnik zamjenjuju se novim obrascima pod istim nazivima koji čine Prilog I. ovog Pravilnika i njegov su sastavni dio.

Članak 7.

Ovaj Pravilnik objavljuje se u »Narodnim novinama«, a stupa na snagu 1. siječnja 2023. godine.

KLASA: 011-01/22-01/03
URBROJ:326-01-70-72-22-23
Zagreb, 8. prosinca 2022.

PREDSJEDNIK UPRAVNOG VIJEĆA
dr.sc. Ante Žigman

PRILOG I

OBRAZAC AK-SDVP – IZVJEŠTAJ O ADEKVATNOSTI KAPITALA SREDIŠNJEG DEPOZITORIJA VRIJEDNOSNIH PAPIRA

T_01.00 - Minimalni kapitalni zahtjevi		
		(u eurima)
		Stupci
		Iznos
		010
Retci	Ukupni kapital CSD-a	010
	Minimalni kapital koji CSD mora držati	020
	Kapitalni zahtjevi za operativni, pravni i skrbnički rizik	030
	Kapitalni zahtjevi za investicijski rizik	040
	Kapitalni zahtjevi za poslovni rizik	050
	Kapitalni zahtjevi za likvidaciju ili restrukturiranje	060
	<i>Provjera valjanosti</i>	<i>CSD ima dovoljno kapitala</i>

T_02.00 - Kapitalni zahtjevi za operativne, pravne i skrbničke rizike														
		(u eurima)												
		Stupci												
		RELEVANTNI POKAZATELJ GODINA-3	RELEVANTNI POKAZATELJ GODINA-2	RELEVANTNI POKAZATELJ PRETHODNA GODINA	KREDITI I PREDUJMOVI (U SLUČAJU PRIMJENE ALTERNATIVNOG STANDARDIZIRANOG PRISTUPA) GODINA-3	KREDITI I PREDUJMOVI (U SLUČAJU PRIMJENE ALTERNATIVNOG STANDARDIZIRANOG PRISTUPA) GODINA -2	KREDITI I PREDUJMOVI (U SLUČAJU PRIMJENE ALTERNATIVNOG STANDARDIZIRANOG PRISTUPA) PREHODNA GODINA	Kapitalni zahtjevi	Ukupan iznos izloženosti operativnom riziku	BILJEŠKE U SKLADU S NAPREDNIM PRISTUPIMA KOJE JE POTREBNO ISKAZATI AKO JE PRIMJENJIVO				
		010	020	030	040	050	060	070	071	OD ČEGA: NA TEMELJU ALOKACIJSKOG MEHANIZMA	KAPITALNI ZAHTEJEV PRIJE SMANJENJA ZBOG DIVERSIFIKACIJE I TEHNIKA SMANJENJA RIZIKA	(-) SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTEJEVA ZBOG OČEKIVANOGA GUBITKA U POSLOVNIM PRAKSAMA	(-) SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTEJEVA ZBOG DIVERSIFIKACIJE	(-) SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTEJEVA ZBOG TEHNIKA SMANJENJA RIZIKA (OSIGURANJE I DRUGI MEHANIZMI ZA PRIJENOS RIZIKA)
		010	020	030	040	050	060	070	071	080	090	100	110	120
Razici	AKTIVNOSTI KOJE PODLIJEŽU JEDNOSTAVNOM PRISTUPU (BIA)	010												
	AKTIVNOSTI KOJE PODLIJEŽU STANDARDIZIRANOM (TSA) / ALTERNATIVNOM STANDARDIZIRANOM PRISTUPU (ASA)	020												
	PODLOŽNO STANDARDIZIRANOM PRISTUPU (TSA)													
	KORPORATIVNO FINANCIRANJ	030												
	TRGOVANJE I PRODAJA	040												
	BROKERSKI POSLOVI SA STANOVNIŠTVOM	050												
	POSLOVNO BANKARSTVO	060												
	POSLOVANJE SA STANOVNIŠTVOM	070												
	PLAĆANJA I NAMIRE	080												
	AGENCIJSKE USLUGE	090												
	UPRAVLJANJE IMOVINOM	100												
	PODLOŽNO ALTERNATIVNOM STANDARDIZIRANOM PRISTUPU													
	POSLOVNO BANKARSTVO	110												
POSLOVANJE SA STANOVNIŠTVOM	120													
AKTIVNOSTI KOJE PODLIJEŽU NAPREDNIM PRISTUPIMA (AMA)	130													

T_03.00 - Kapitalni zahtjevi za investicijski rizik			
		(u eurima)	
		Stupci	
		Iznos	
		010	
Row	Kapitalni zahtjevi za investicijski rizik	010	
	Kapitalni zahtjevi za kreditni i kreditni rizik druge ugovorne strane u skladu sa standardiziranim pristupom (SA)	020	
	Središnja država ili središnje banke	030	
	Jedinice regionalne i lokalne samouprave	040	
	Subjekti javnog sektora	050	
	Multilateralne razvojne banke	060	
	Međunarodne organizacije	070	
	Institucije	080	
	Trgovačka društva	090	
	Stanovništvo	100	
	Osigurane nekretninama	110	
	Izloženosti sa statusom neispunjavanja obveza	120	
	Visokorizične stavke	130	
	Pokrivene obveznice	140	
	Potraživanja prema institucijama i trgovačkim društvima s kratkoročnom kreditnom procjenom	150	
	Potraživanja u obliku ulaganja u subjekte za zajednička ulaganja (CIU)	160	
	Izloženost na osnovi vlasničkih ulaganja	170	
	Ostale izloženosti	180	
	Kapitalni zahtjevi za tržišni rizik u skladu sa standardiziranim pristupom (SA)	190	
	Kapitalni zahtjevi za dužničke instrumente kojima se trguje	200	
	Kapitalni zahtjev za specifični rizik u sekuritizacijama	210	
	Kapitalni zahtjev za specifični rizik u korelacijskom portfelju namijenjenom trgovanju	220	
	Kapitalni zahtjevi za pozicijski rizik vlasničkih instrumenata	230	
	Kapitalni zahtjevi za valutni rizik	240	
	Kapitalni zahtjev za robni rizik	250	

T 03.01 - Kreditni rizik, kreditni rizik druge ugovorne strane i slobodna ispruka: standardizirani pristup kaoplatnim zahtjevima																											
Kategorija izloženosti u skladu sa standardiziranim pristupom:																											
(u eurima)																											
	ORIGINALNA IZLOŽENOST PRIJE KONVERZIJSKIH FAKTORA	(-) VRIJEDNOSTNA USKLADJENJA I REZERVACIJE POVEZANE S ORIGINALNOM IZLOŽENOSTI	IZLOŽENOST UMANJENA ZA VRIJEDNOSNA USKLADJENJA I REZERVACIJE	TEHNIKE SMANJENJA KREDITNOG RIZIKA S UČINOM ZAMJENE NA IZLOŽENOST						NETO IZLOŽENOST NAKON PRIMJENE TEHNIKE SMANJENJA KREDITNOG RIZIKA S UČINOM ZAMJENE NA IZLOŽENOST	Stuci				VRIJEDNOST IZLOŽENOSTI				IZNOS IZLOŽENOSTI PONDERRAN RIZIKOM PRIJE PRILAGODBE POMOĆNOG FAKTORA ZA MSP-ove	USKLADJENJE IZNOSA IZLOŽENOSTI PONDERRANOG RIZIKOM ZBOG POMOĆNOG FAKTORA ZA MSP-ove (+)	USKLADJENJE IZNOSA IZLOŽENOSTI PONDERRANOG RIZIKOM ZBOG POMOĆNOG FAKTORA ZA MSP-ove (-)	IZNOS IZLOŽENOSTI PONDERRAN RIZIKOM NAKON PRILAGODBE POMOĆNOG FAKTORA ZA MSP-ove					
				NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA PRILAGODBE VRIJEDNOSTI (qs)			MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		ZAMJENA IZLOŽENOSTI ZBOG SMANJENJA KREDITNOG RIZIKA		KOREKTIVNI FAKTOR ZA IZLOŽENOST	(-) FINANCIJSKI KOLATERALNI POMOĆNI FAKTORI ZA IZLOŽENOST (pam)			POTPUNO PRILAGODENA VRIJEDNOST IZLOŽENOSTI (E)	RAŠČLAMB POPUNO PRILAGODENE VRIJEDNOSTI IZLOŽENOSTI IZVANBILANČNIH STAVKI PREMA						OD ČEGA: KOJI PROIZLAZ IZ KREDITNOG RIZIKA DRUGE UGOVORNE STRANE		OD ČEGA: KOJI PROIZLAZ IZ KREDITNOG RIZIKA DRUGE UGOVORNE STRANE NE UKLJUČUJU IZLOŽENOSTI PORAVNANE PREKO SPREŠNE DRUGE UGOVORNE STRANE		OD ČEGA: S PROCJENOM KREDITNOG RIZIKA ODBRANOG VIPRKA	OD ČEGA: S PROCJENOM KREDITNOG RIZIKA SPREŠNE DRŽAVE
				(-) JAMSTVA	(-) KREDITNE IZVEDENICE	(-) FINANCIJSKI KOLATERALNI JEDINSTAVNA METODA	(-) OSTALA MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA (-)	(-) UKUPNI ODLJEVI	UKUPNI PRILJEVI (+)			0%	20%	50%		100%	OD ČEGA: KOJI PROIZLAZ IZ KREDITNOG RIZIKA DRUGE UGOVORNE STRANE	OD ČEGA: KOJI PROIZLAZ IZ KREDITNOG RIZIKA DRUGE UGOVORNE STRANE NE UKLJUČUJU IZLOŽENOSTI PORAVNANE PREKO SPREŠNE DRUGE UGOVORNE STRANE									
											OD ČEGA: S PROCJENOM KREDITNOG RIZIKA ODBRANOG VIPRKA				OD ČEGA: S PROCJENOM KREDITNOG RIZIKA SPREŠNE DRŽAVE												
	010	030	040	050	060	070	080	090	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	211	215	216	217	220	230	240
UKUPNE IZLOŽENOSTI	010																										
od čega: izloženosti sa statusom neispunjenja obveza	015																										
od čega: MSP	020																										
od čega: izloženosti koje podliježu pomoćnom faktoru za MSP-ove	030																										
od čega: izloženosti koje podliježu pomoćnom faktoru za infrastrukturu	035																										
od čega: osigurane nekretnima – stambene nekretnine	040																										
od čega: izloženosti u skladu s trajnim izuzetom od primjene standardiziranog pristupa	050																										
od čega: izloženosti u skladu s trajnim izuzetom od primjene standardiziranog pristupa s prethodnim nadzornim odobrenjem za poslušno uvođenje IFR pristupa	060																										
RAŠČLAMB UKUPNIH IZLOŽENOSTI PREMA VRSTAMA IZLOŽENOSTI:																											
Bilance izloženosti koje podliježu kreditnom riziku	070																										
Izvanbilančne izloženosti koje podliježu kreditnom riziku	080																										
izloženosti/transakcije koje podliježu kreditnom riziku druge ugovorne strane																											
Skupni za nefinanciranje transakcija financiranja vliednosnih papira	090																										
od čega: poravnane centralno preko kvalificirane središnje druge ugovorne strane	100																										
Skupni za nefinanciranje izvedenica i transakcija s dugim rokom namire	110																										
od čega: poravnane centralno preko kvalificirane središnje druge ugovorne strane	120																										
iz skupine za nefinanciranje između različitih kategorija proizvodila	130																										
RAŠČLAMB UKUPNIH IZLOŽENOSTI PREMA PONDERAMA RIZIKA:																											
0%	140																										
2%	150																										
4%	160																										
10%	170																										
20%	180																										
35%	190																										
50%	200																										
70%	210																										
75%	220																										
100%	230																										
150%	240																										
250%	250																										
300%	260																										
1250%	270																										
Ostali ponderi rizika	280																										
RAŠČLAMB UKUPNIH IZLOŽENOSTI PREMA PRISTUPU GJU:																											
Pristup odobrenim izloženostima	021																										
Pristup koji se temelji na meritu	022																										
Zamjenjivi pristup	023																										
BILJEŠKE																											
Izloženosti osigurane poslovnim nekretninama	290																										
Izloženosti sa statusom neispunjenja obveza na koje se primjenjuje ponder rizika od 100 %	300																										
Izloženosti osigurane stambenim nekretninama	310																										
Izloženosti sa statusom neispunjenja obveza na koje se primjenjuje ponder rizika od 150 %	320																										

T_03.02 - Tržišni rizik: standardizirani pristup pozicijskim rizicima dužničkih instrumenata kojima se trguje									
Valuta									(u eurima)
		Stupci					KAPITALNI ZAHTJEVI	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU	
		POZICIJE				POZICIJE KOJE PODLIJEŽU KAPITALNOM ZAHTJEVU			
		SVE POZICIJE		NETO POZICIJE					
		DUGE	KRATKE	DUGE	KRATKE	050	060	070	
		010	020	030	040				
Retci	DUŽNIČKI INSTRUMENTI KOJIMA SE TRGUJE U KNJIZI TRGOVANJA	010							
	Opći rizik	011							
	Izvedenice	012							
	Ostala imovina i obveze	013							
	Pristup koji se temelji na dospjeću	020							
	1.1 Zona 1	030							
	0 ≤ 1 mjesec	040							
	> 1 ≤ 3 mjeseca	050							
	> 3 ≤ 6 mjeseci	060							
	> 6 ≤ 12 mjeseci	070							
	1.2 Zona 2	080							
	> 1 ≤ 2 (1,9 za kupon manji od 3 %) godine	090							
	> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 za kupon manji od 3 %) godine	100							
	> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 za kupon manji od 3 %) godine	110							
	1.3 Zona 3	120							
	> 4 ≤ 5 (> 3,6 ≤ 4,3 za kupon manji od 3 %) godina	130							
	> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 za kupon manji od 3 %) godina	140							
	> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 za kupon manji od 3 %) godina	150							
	> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 za kupon manji od 3 %) godine	160							
	> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 za kupon manji od 3 %) godina	170							
	> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 za kupon manji od 3 %) godina	180							
	> 20 (> 12,0 ≤ 20,0 za kupon manji od 3 %) godina	190							
	> 20 (> 20 za kupon manji od 3 %) godina	200							
	Pristup koji se temelji na trajanju	210							
	Zona 1	220							
	Zona 2	230							
	Zona 3	240							
	Specifični rizik	250							
	Kapitalni zahtjevi za dužničke instrumente koji nisu predmet sekuritizacije	251							
	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s prvom kategorijom u tablici 1.	260							
	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s drugom kategorijom u tablici 1.	270							
	S preostalim rokom ≤ 6 mjeseci	280							
	S preostalim rokom > 6 mjeseci i ≤ 24 mjeseca	290							
	S preostalim rokom > 24 mjeseca	300							
	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s trećom kategorijom u tablici 1.	310							
	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s četvrtom kategorijom u tablici 1.	320							
	Kreditne izvedenice s rejtingom na osnovi „n-log” nastanka statusa neispunjavanja obveza	321							
	Kapitalni zahtjev za sekuritizacijske instrumente	325							
	Kapitalni zahtjev za korelacijski portfelj namijenjen trgovanju	330							
Dodatni zahtjevi za opcije (rizici osim delta-rizika)	350								
Pojednostavljena metoda	360								
Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za gama-rizik	370								
Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za vega-rizik	380								
Pristup delta plus – nekontinuirane opcije ili varanti	385								
Scenarij matičnog pristupa	390								

T_0304 - TRŽIŠNI RIZIK: STANDARDIZIRANI PRISTUP SPECIFIČNOM RIZIKU U KORELACIJSKOM PORTFELJU NAMJENJENOM																																															(u eur/ml)																																												
		Stupci																																																																																									
		SVE POZICJE		(-) POZICJE KOJE ČINE ODBITNU STAVKU OD REGULATORNOG KAPITALA		NETO POZICJE		RAŠČLJABA NETO POZICJE (DUGE) PREMA PONDERIMA RIZIKA U SKLADU SA STANDARDIZIRANIM I RB PRISTUPOM																				RAŠČLJABA NETO POZICJE (KRATKE) PREMA PONDERIMA RIZIKA U SKLADU SA STANDARDIZIRANIM I RB PRISTUPOM										PRILJE PRIMJENE GORNJE GRANICE		NAKON PRIMJENE GORNJE GRANICE		UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ																																																	
		DUGE		KRATKE		(-) DUGE		(-) KRATKE		DUGE		KRATKE		PONDER RIZIKA < 1250%										1250%		METODA SUPERVIZORSKE FORMULE		PRISTUP INTERNE PROCJENE		PONDER RIZIKA < 1250%										1250%		METODA SUPERVIZORSKE FORMULE		PRISTUP INTERNE PROCJENE		PONDERIRAN E NETO DUGE POZICJE		PONDERIRAN E NETO KRATKE POZICJE		PONDERIRAN E NETO DUGE POZICJE		PONDERIRAN E NETO KRATKE POZICJE		UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ																																					
		010		020		030		040		050		060		070		080		090		100		110		120		130		140		150		160		170		180		190		200		210		220		230		240		250		260		270		280		290		300		310		320		330		340		350		360		370		380		390		400		410		420		430		440		450	
UKUPNE IZLOŽENOSTI																																																																																											
118 SEKURITIZACIJSKE POZICJE																																																																																											
INDICATOR: UKUPNE IZLOŽENOSTI																																																																																											
SEKURITIZACIJE																																																																																											
OSTALE CTP POZICJE																																																																																											
INVESTITOR: UKUPNE IZLOŽENOSTI																																																																																											
SEKURITIZACIJE																																																																																											
OSTALE CTP POZICJE																																																																																											
SPONZOR: UKUPNE IZLOŽENOSTI																																																																																											
SEKURITIZACIJE																																																																																											
OSTALE CTP POZICJE																																																																																											
119 KREDITNE IZVEŠENJE NA OSNOVU N-TOG NASTANKA STATUSA NEISPUNJAVANJA OBEZBE																																																																																											
KREDITNE IZVEŠENJE NA OSNOVU N-TOG NASTANKA STATUSA NEISPUNJAVANJA OBEZBE																																																																																											
OSTALE CTP POZICJE																																																																																											

T_03.05 - Tržišni rizik: standardizirani pristup za pozicijski rizik u vlasničkim instrumentima										
Nacionalno tržište										
(u eurima)										
		SVE POZICIJE		NETO POZICIJE		POZICIJE KOJE PODLIJEŽU KAPITALNOM ZAHTJEVU	KAPITALNI ZAHTJEVI	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU		
		DUGE	KRATKE	DUGE	KRATKE				050	060
		010	020	030	040					
Retci	VLASNIČKI INSTRUMENTI U KNJIZI TRGOVANJA	010								
	Opći rizik	020								
	Izvedenice	021								
	Ostala imovina i obveze	022								
	Široko diversificirane budućnosnice na osnovi dioničkog indeksa kojima se trguje na burzi i koje podliježu konkretnom pristupu	030								
	Ostali vlasnički instrumenti koji nisu široko diversificirane budućnosnice na osnovi dioničkog indeksa kojima se trguje na burzi	040								
	Specifični rizik	050								
	Dodatni zahtjevi za opcije (rizici osim delta-rizika)	090								
	Pojednostavljena metoda	100								
	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za gama-rizik	110								
	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za vega-rizik	120								
	Pristup delta plus – nekontinuirane opcije ili varanti	125								
	Scenarij matričnog pristupa	130								

T_03.06 - Tržišni rizik: standardizirani pristupi valutnom riziku

												(u eurima)
		Stupci										
		SVE POZICIJE		NETO POZICIJE		POZICIJE KOJE PODLIJEŽU KAPITALNOM ZAHTJEVU (uključujući ponovnu raspodjelu neusklađenih pozicija u valutama koje podliježu posebnom tretmanu za usklađene pozicije)			KAPITALNI ZAHTJEVI	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU		
		DUGE	KRATKE	DUGE	KRATKE	DUGE	KRATKE	USKLAĐENE				
		020	030	040	050	060	070	080	090	100		
Retci	UKUPNE POZICIJE U NEIZVJEŠTAJNIM VALUTAMA	010										
	Visokokorelirane valute	020										
	od čega: izvještajna valuta	025										
	Sve ostale valute (uključujući CIU-e koji se tretiraju kao različite valute)	030										
	Zlato	040										
	Dodatni zahtjevi za opcije (rizici osim delta-rizika)	050										
	Pojednostavljena metoda	060										
	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za gama-rizik	070										
	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za vega-rizik	080										
	Pristup delta plus – nekontinuirane opcije ili varanti	085										
	Pristup na temelju matrice scenarija	090										
	095 RAŠČLAMBA UKUPNIH POZICIJA (UKLJUČUJUĆI IZVJEŠTAJNU VALUTU) PREMA VRSTAMA IZLOŽENOSTI											
		Ostala imovina i obveze osim izvanbilančnih stavki i izvedenica	100									
		Izvanbilančne stavke	110									
		Izvedenice	120									
	125 Bilješke: DEVIZNE POZICIJE											
		lek	140									
		argentinski pezo	150									
		australski dolar	160									
		brazilski real	170									
		bugarski lev	180									
		kanadski dolar	190									
		češka kruna	200									
		danska kruna	210									
		egipatska funta	220									
		funta sterlinga	230									
		forinta	240									
		jen	250									
		litavski litas	270									
		dinar	280									
		meksički pezo	290									
		zlot	300									
		rumunjski leu	310									
		ruski rubalj	320									
		srpski dinar	330									
		švedska kruna	340									
		švicarski franak	350									
		turska lira	360									
		hrivnja	370									
		američki dolar	380									
		islandska kruna	390									
		norveška kruna	400									
		hongkonški dolar	410									
		novotajvanski dolar	420									
		novozelandski dolar	430									
		singapurski dolar	440									
		von	450									
	renminbi-juan	460										
	ostale	470										

T_05.00 - Kapitalni zahtjevi za rizik zatvaranja ili restrukturiranja		
		(u eurima)
		Stupci
		Iznos
		010
Retci	Kapitalni zahtjevi za rizik zatvaranja ili restrukturiranja	010
	Procijenjeni broj mjeseci potreban za provođenje likvidacije ili restrukturiranja	020
	Godišnji bruto operativni troškovi	030
	Mjesečni bruto operativni troškovi	040