

ИЗВЕШТАЈ

за капиталот потребен за покривање на надминувањето на лимитите на изложеност

1. Вкупен износ на изложеност на секое одделно надминување

Ред. бр.	ОПИС	Пондер	Износ	Пондерирана позиција
1	2	3	4	5=3*4
1	Сопствени средства			
2	Дозволен износ на изложеност			
3	Изложеност од позиции во портфолиото на банкарски активности			
4	Износ на слободни сопствени средства (2-3)			
5	Нето-изложеност од позиции во портфолиото за тргување (од табела бр. 2)		0	
	Инструмент 2			
	Инструмент 1			
	Инструмент 3			
	...			
6	Надминување на изложеноста (5-4)			
7	Нето-изложеност од позиции во портфолиото за тргување за кои се пресметува капитал потребен за покривање на надминување на лимитот		0	0
	Инструмент			
	Инструмент			
	...			

Затемнетите полиња не се пополнуваат

2. Нето-изложеност од позиции од портфолиото за тргување за секое одделно надминување

Ред. бр.	ПОЗИЦИИ ВО ПОРТФОЛИОТО ЗА ТРГУВАЊЕ	Пондер	Изложеност	Пондерирана позиција
1	2	3	4	5=3*4
1	Инструмент 1		0	
	долга позиција			
	кратка позиција			
2	Инструмент 2		0	
	долга позиција			
	кратка позиција			

3	Инструмент 3		0	
	долга позиција			
	кратка позиција			
4	...			
1	Нето-изложеност од позиции во портфолиото за тргување		0	
	Инструмент 2			
	Инструмент 1			
	Инструмент 3			
	...			

3. Потребен капитал за секое одделно надминување на лимитот на изложеност

Ред. бр.	ОПИС	Пондерирана позиција	Пондер	Потребен капитал
1	2	3	4	5=3*4
1	Нето-изложеност чие надминување трае до 10 дена		200%	
2	Нето-изложеност чие надминување трае 10 и повеќе дена			
	надминување до 40% од сопствените средства		200%	
	надминување од 40-60% од сопствените средства		300%	
	надминување од 60-80% од сопствените средства		400%	
	надминување од 80-100% од сопствените средства		500%	
	надминување од 100-250% од сопствените средства		600%	
	надминување над 250% од сопствените средства		900%	
3	Вкупно потребен капитал (1+2)			0

4. Вкупен капитал потребен за покривање на надминувањето на лимитите на изложеност

Ред. бр.	Капитал потребен за покривање на надминувањето на лимитите на изложеност	Потребен капитал
1	2	3
1		
2		
3		
...		
1	Вкупен износ на капитал потребен за надминување на сите надминувања на лимитите на изложеност	0