

ИЗВЕШТАЈ

за капиталот потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна

1. Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна кога нема усогласеност помеѓу датумот на плаќање и датумот на испорака (free deliveries)

Ред. бр.	ОПИС	Изложеност	Пондер за кредитен	Пондерирана изложеност	Потребен капитал
1	2	3	4	5=3*4	6=8%*5
1	Побарувања со пондер на ризичност 0%		0%		
2	Побарувања со пондер на ризичност 20%		20%		
3	Побарувања со пондер на ризичност 50%		50%		
4	Побарувања со пондер на ризичност 100%		100%		
5	Побарувања со пондер на ризичност 125%		125%		
6	Вкупно потребен капитал				0

2. Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна кај репо-договорите за продажба или купување хартии од вредност и стоки и договорите за давање на заем или за зајмување хартии од вредност и стоки

Ред. бр.	ОПИС	Пазарна вредност	Изложеност	Пондер за кредитен ризик	Пондерирана изложеност	Потребен капитал
1	2	3	4	5	6=4*5	7=8%*6
1	Побарувања со пондер на ризичност 0%			0%		
2	Побарувања со пондер на ризичност 20%			20%		
3	Побарувања со пондер на ризичност 50%			50%		
4	Побарувања со пондер на ризичност 100%			100%		
5	Побарувања со пондер на ризичност 125%			125%		
6	Вкупно потребен капитал					0

3. Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна за позиции во финансиски деривати со кои се тргува преку шалтер

Ред. бр.	ОПИС	Номинална вредност	Фактор на конверзија	Потенцијална изложеност	Тековна изложеност	Изложеност
1	2	3	4	5=3*4	6	7=(5+6)
1	Договори чиј предмет се каматните стапки					
	До 1 година		0.0%			
	Од 1 до 5 години		0.5%			
	Над 5 години		1.5%			
2	Договори чиј предмет се девизниот курс и златото					
	До 1 година		1.0%			
	Од 1 до 5 години		5.0%			
	Над 5 години		7.5%			
3	Договори чиј предмет се сопственичките хартии од вредност					
	До 1 година		6%			
	Од 1 до 5 години		8%			

	Над 5 години		10%			
4	Договори чиј предмет се благородните метали, освен злато					
	До 1 година		7%			
	Од 1 до 5 години		7%			
	Над 5 години		8%			
5	Договори чиј предмет се стоките					
	До 1 година		10%			
	Од 1 до 5 години		12%			
	Над 5 години		15%			
Ред. бр.	ОПИС	Изложеност	Пондер за кредитен ризик	Пондерирана изложеност	Потребен капитал	
1	2	3	4	5=3*4	6=8%*5	
1	Побарувања со пондер на ризичност 0%		0%			
2	Побарувања со пондер на ризичност 20%		20%			
3	Побарувања со пондер на ризичност 50%		50%			
4	Побарувања со пондер на ризичност 100%		100%			
5	Побарувања со пондер на ризичност 125%		125%			
6	Вкупно потребен капитал					0

4. Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна за други позиции од потфолиото за тргување

Ред. бр.	ОПИС	Изложеност	Пондер за кредитен ризик	Пондерирана изложеност	Потребен капитал	
1	2	3	4	5=3*4	6=8%*5	
1	Побарувања со пондер на ризичност 0%		0%			
2	Побарувања со пондер на ризичност 20%		20%			
3	Побарувања со пондер на ризичност 50%		50%			
4	Побарувања со пондер на ризичност 100%		100%			
5	Побарувања со пондер на ризичност 125%		125%			
6	Вкупно потребен капитал					0

5. Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна - збиен извештај

Ред. бр.	Потребен капитал за покривање на ризикот од другата договорна страна	Износ
1	2	3
1	Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна кога нема усогласеност помеѓу датумот на плаќање и датумот на испорака	0
2	Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна кај репо-договорите за продажба или купување хартии од вредност и стоки и договорите за давање заем или за зајмување хартии од вредност и стоки	0
3	Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна за позиции во финансиски деривати со кои се тргува преку шалтер	0
4	Капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна за други позиции од потфолиото за тргување	0
5	Вкупно капитал потребен за покривање на ризикот од другата договорна страна	0