

VZOR

Toto hlásenie sa predkladá Úradu pre finančný trh
do 22 dní po uplynutí príslušného kalendárneho mesiaca.

H (OCP) 9-12

MESAČNÉ HLÁSENIE O PRIMERANOSTI VLASTNÝCH ZDROJOV

Rok

Mesiac

IČO

Obchodné meno

Sídlo (ulica a číslo)

PSČ

Obec

Číslo telefónu

Číslo faxu

e-mail

Vyhotovené dňa:

Člen (členovia) štatutárneho orgánu
(meno a priezvisko, podpis):

Zamestnanec zodpovedný za
vypracovanie hlásenia
(meno a priezvisko, podpis):

A. Vlastné zdroje

(v tis. Sk)

Vlastné zdroje obchodníka	Č. r.	Hodnota ukazovateľa
Základné vlastné zdroje obchodníka (súčet riadkov 1a až 1d)	1	
Splatené základné imanie a emisné ážio okrem prioritných akcií	1a	
Nerozdelený zisk minulých rokov	1b	
Zákonný rezervný fond	1c	
Ostatné rezervné fondy a fondy tvorené zo zisku	1d	
Dodatkové vlastné zdroje obchodníka (riadok 2a až 2e)	2	
Podriadené dlhy, ktorých zostávajúca lehota splatnosti je dlhšia ako dva roky	2a	
Rezervy zákonné	2b	
Rezervy na kurzové straty	2c	
Ostatné rezervy na pokrytie rizík z investičných služieb	2d	
Iné zdroje podľa osobitného predpisu ¹⁾	2e	
Odpočítateľné položky (súčet riadkov 3a až 3f)	3	
Účtovná hodnota vlastných akcií obchodníka, ktoré obchodník nadobudol	3a	
Nehmotný investičný majetok	3b	
Strata bežného účtovného obdobia	3c	
Neuhradená strata z minulých rokov	3d	
Hrubá účtovná hodnota vkladu do základného imania podľa osobitného predpisu ²⁾	3e	
Rozdiely z prepočtu základného imania obchodníka v cudzej mene na slovenské koruny	3f	
Kapitál obchodníka (riadok 1 + 2) – r. 3	4	
Doplnkové vlastné zdroje obchodníka (riadok 5a + 5b)	5	
Podriadené dlhy podľa osobitného predpisu ³⁾	5a	
Iné podriadené dlhy podľa osobitného predpisu ⁴⁾	5b	
Vlastné zdroje obchodníka (riadok 4 + 5)	6	

B. Trhové riziko

(v tis. Sk)

Trhové riziko	Č. r.	Hodnota ukazovateľa
Všeobecné riziko pre dlhové nástroje	7	
Špecifické riziko pre dlhové nástroje	8	
Všeobecné riziko pre majetkové nástroje	9	
Špecifické riziko pre majetkové nástroje	10	
Riziko termínových obchodov a opcii	11	
Riziko vyrovnania	12	

Trhové riziko	Č. r.	Hodnota ukazovateľa
Riziko obchodného partnera	13	
Riziko veľkých majetkových angažovaností	14	
Devízové riziko	15	
Komoditné riziko	16	
Trhové riziko (súčet riadkov 7 až 16) × 12,5	17	

C. Aktíva obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého

(v tis. Sk)

Aktíva obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého	Č. r.	Hodnota ukazovateľa
Aktíva obchodníka zaradené do neobchodného portfólia	18	
Aktíva obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého	19	

D. Primeranosť vlastných zdrojov

(v tis. Sk)

Primeranosť vlastných zdrojov	Č. r.	Hodnota ukazovateľa
Vlastné zdroje obchodníka (riadok 6)	20	
Trhové riziko (riadok 17)	21	
Aktíva obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého (riadok 19)	22	
Kapitálová primeranosť v % na dve desatinné miesta [r. 20/(r. 21+22)/100]	23	

Poznámky:

- ¹⁾ § 5 ods. 1 písm. c) vyhlášky Ministerstva financií Slovenskej republiky č. 559/2002 Z. z. o primeranosti vlastných zdrojov obchodníkov s cennými papiermi v znení vyhlášky č. 753/2002 Z. z.
- ²⁾ § 4 ods. 3 písm. d) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.
- ³⁾ § 7 ods. 1 písm. a) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.
- ⁴⁾ Vyhláška č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 753/2002 Z. z.

Vysvetlivky:

Hlásenie o primeranosti vlastných zdrojov obsahuje údaje preukazujúce, že primeranosť vlastných zdrojov obchodníka je najmenej 8 %. Primeranosť vlastných zdrojov sa vypočíta ako podiel, v ktorého čitateli je hodnota vlastných zdrojov obchodníka vypočítaná podľa osobitného predpisu⁴⁾ a v menovateli súčet hodnoty aktív obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého (rizikovo vážené aktíva neobchodného portfólia) a hodnoty trhových rizík vypočítaných podľa osobitného predpisu.⁴⁾

Použité skratky:

Č. r. – číslo riadka