

**Príloha č. 11 k vyhláške č. 558/2002 Z. z.**

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)

<b>Vlastné zdroje obchodníka</b>	<b>Č. r.</b>	<b>Hodnota ukazovateľa</b>
<b>Základné vlastné zdroje obchodníka</b> (súčet riadkov 1a až 1c) – (súčet riadkov 1d až 1h)	1	
Splatené základné imanie okrem prioritných akcií a emisné ážio	1a	
Nerozdelený zisk minulých rokov	1b	
Rezervný fond a ostatné fondy tvorené zo zisku	1c	
Účtovná hodnota vlastných akcií obchodníka, ktoré obchodník nadobudol	1d	
Nehmotný investičný majetok	1e	
Strata bežného účtovného obdobia	1f	
Neuhradená strata z minulých rokov	1g	
Účtovná hodnota vkladu do základného imania akcionára obchodníka s cennými papiermi podľa osobitného predpisu <sup>1)</sup>	1h	
<b>Dodatkové vlastné zdroje obchodníka</b> (riadok 2a až 2e)	2	
Podriadené dlhy, ktorých zostávajúca lehota splatnosti je dlhšia ako jeden rok	2a	
Rezervy zákonné	2b	
Rezervy na kurzové straty	2c	
Ostatné rezervy na pokrytie rizík z investičných služieb	2d	
Iné zdroje podľa osobitného predpisu <sup>2)</sup>	2e	
<b>Odpočítateľné položky</b> (súčet riadkov 3a až 3c)	3	
Čistá účtovná hodnota podľa osobitného predpisu <sup>3)</sup>	3a	
Súčet čistých účtovných hodnôt podľa osobitného predpisu <sup>4)</sup>	3b	
Súčet čistých účtovných hodnôt podľa osobitného predpisu <sup>5)</sup>	3c	
<b>Kapitál obchodníka</b> (riadok 1 + 2) – r. 3	4	
<b>Doplnkové vlastné zdroje obchodníka</b> (riadok 5a + 5b)	5	
Podriadené dlhy podľa osobitného predpisu <sup>6)</sup>	5a	
Iné podriadené dlhy podľa osobitného predpisu <sup>7)</sup>	5b	
<b>Vlastné zdroje obchodníka</b> (riadok 4 + 5)	6	

**B. Trhové riziko**

(v tis. Sk)

<b>Trhové riziko</b>	<b>Č. r.</b>	<b>Hodnota ukazovateľa</b>
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 opcí	11	
Riziko vyrovnaní	12	
Riziko obchodného partnera	13	
Riziko veľkých majetkových angažovaností	14	
Devízové riziko	15	
Komoditné riziko	16	
<b>Trhové riziko</b> (súčet riadkov 7 až 16) × 12,5	17	

**C. Aktíva obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého**

(v tis. Sk)

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

**D. Primeranosť vlastných zdrojov**

(v tis. Sk)

<b>Primeranosť vlastných zdrojov</b>	<b>Č. r.</b>	<b>Hodnota ukazovateľa</b>
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:**

- <sup>1)</sup> § 4 ods. 3 písm. d) vyhlášky Ministerstva financií Slovenskej republiky č. 559/2002 Z. z. o primeranosti vlastných zdrojov obchodníka s cennými papiermi.  
<sup>2)</sup> § 5 ods. 1 písm. c) vyhlášky č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 753/2002 Z. z.  
<sup>3)</sup> § 6 ods. 1 písm. a) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.  
<sup>4)</sup> § 6 ods. 1 písm. b) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.  
<sup>5)</sup> § 6 ods. 1 písm. c) vyhlášky č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 166/2005 Z. z.  
<sup>6)</sup> § 7 ods. 1 písm. a) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.  
<sup>7)</sup> § 7 ods. 1 písm. b) vyhlášky č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 753/2002 Z. z.  
<sup>8)</sup> 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 predpisu<sup>8)</sup> a v menovateli súčet hodnoty aktív obchodníka podľa stupňa úverového rizika v nich obsiahnutého (rizikovo vážené aktíva neobchodného portfólia) a hodnoty trhových rizík vypočítané podľa osobitného predpisu.<sup>8)</sup>

**Použité skratky:**

Č. r. – číslo riadka.