

VZOR

Toto hlásenie sa predkladá Národnej banke Slovenska
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 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 ¹⁾	1h	
Dodatkové vlastné zdroje obchodníka (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 ²⁾	2e	
Odpočítateľné položky (súčet riadkov 3a až 3c)	3	
Čistá účtovná hodnota podľa osobitného predpisu ³⁾	3a	
Súčet čistých účtovných hodnôt podľa osobitného predpisu ⁴⁾	3b	
Súčet čistých účtovných hodnôt podľa osobitného predpisu ⁵⁾	3c	
Kapitál obchodníka (riadok 1 + 2) – r. 3	4	
Doplňkové vlastné zdroje obchodníka (riadok 5a + 5b)	5	
Podriadené dlhy podľa osobitného predpisu ⁶⁾	5a	
Iné podriadené dlhy podľa osobitného predpisu ⁷⁾	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 opcí	11	
Riziko vyrovnaní	12	
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⁾ § 4 ods. 3 písm. d) vyhlášky Ministerstva financií Slovenskej republiky č. 559/2002 Z. z. o primeranosti vlastných zdrojov obchodníka s cennými papiermi.
²⁾ § 5 ods. 1 písm. c) vyhlášky č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 753/2002 Z. z.
³⁾ § 6 ods. 1 písm. a) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.
⁴⁾ § 6 ods. 1 písm. b) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.
⁵⁾ § 6 ods. 1 písm. c) vyhlášky č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 166/2005 Z. z.
⁶⁾ § 7 ods. 1 písm. a) vyhlášky č. 559/2002 Z. z.
⁷⁾ § 7 ods. 1 písm. b) vyhlášky č. 559/2002 Z. z. v znení vyhlášky č. 753/2002 Z. z.
⁸⁾ 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 predpisu⁸⁾ 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.⁸⁾

Použité skratky:

Č. r. – číslo riadka.