

**Dodatek k dokumentu
Razkritja 2021
(v okviru Stebra 3)**

- **Predloga EU CCR1 – Analiza izpostavljenosti CCR po pristopu**
- **Predloga EU CCR2 – Posli, ki so predmet kapitalskih zahtev za tveganje CVA**
- **Predloga EU CCR5 – Sestava zavarovanja s premoženjem za izpostavljenosti CRR**
- **Predloga EU CCR6 – Izpostavljenosti iz naslova kreditnih izvedenih finančnih instrumentov**
- **Predloga EU CCR8 – Izpostavljenosti CNS**

Predloga EU CCRI – Analiza izpostavljenosti CCR po pristopu

		a	b	c	d	e	f	g	h
		Nadomestitveni stroški (RC)	Potencialna prihodnja izpostavljenost (PFE)	Efektivna EPE	Alfa, uporabljen za izračun regulativne vrednosti izpostavljenosti	Vrednost izpostavljenosti pred CRM	Vrednost izpostavljenosti po CRM	Vrednost izpostavljenosti	RWEA
EU-1	EU – Metoda originalne izpostavljenosti (za izvedene finančne instrumente)	3.707	2.714		1,4	8.989	8.989	8.989	7.193
EU-2	EU – Poenostavljeni SA-CRR (za izvedene finančne instrumente)	0	0		1,4	0	0	0	0
1	SA-CRR (za izvedene finančne instrumente)	0	0		1,4	0	0	0	0
2	Metoda notranjih modelov (za izvedene finančne instrumente in SFT)			0	0	0	0	0	0
2a	<i>Od tega nizi pobotov poslov financiranja z vrednostnimi papirji</i>			0		0	0	0	0
2b	<i>Od tega nizi pobotov izvedenih finančnih instrumentov in poslov z dolgim rokom poravnave</i>			0		0	0	0	0
2c	<i>Od tega nizi pobotov iz pogodbenega pobota med različnimi kategorijami produktov</i>			0		0	0	0	0
3	Enostavna metoda za izračun učinkov zavarovanja s finančnim premoženjem (za SFT)					0	0	0	0
4	Razvita metoda za izračun učinkov zavarovanja s finančnim premoženjem (za SFT)					0	0	0	0
5	Tvegana vrednost (VAR) za SFT					0	0	0	0
6	Skupaj					8.989	8.989	8.989	7.193

Predloga EU CCR2 – Posli, ki so predmet kapitalskih zahtev za tveganje CVA

		a	b
		Področje izpostavljenosti	RWEA
1	Skupaj posli, za katere se uporablja napredna metoda	0	0
2	(i) sestavina VaR (vključno s trikratnim multiplikatorjem)		0
3	(ii) sestavina stresne VaR (vključno s trikratnim multiplikatorjem)		0
4	Posli, za katere se uporablja standardizirana metoda	3.744	3.390
EU-4	Posli, za katere se uporablja alternativni pristop (na podlagi metode originalne izpostavljenosti)	0	0
5	Skupaj posli, ki so predmet kapitalskih zahtev za tveganje CVA	3.744	3.390

Predloga EU CCR5 – Sestava zavarovanja s premoženjem za izpostavljenosti CRR

		a	b	c	d	e	f	g	h
		Zavarovanje s premoženjem, uporabljeno v poslih z izvedenimi finančnimi instrumenti				Zavarovanje s premoženjem, uporabljeno v SFT			
Vrsta zavarovanja s premoženjem		Poštena vrednost prejetega zavarovanja s premoženjem		Poštena vrednost danega zavarovanja s premoženjem		Poštena vrednost prejetega zavarovanja s premoženjem		Poštena vrednost danega zavarovanja s premoženjem	
		Ločeno	Neločeno	Ločeno	Neločeno	Ločeno	Neločeno	Ločeno	Neločeno
1	Denarna sredstva – domača valuta	0	0	0	4.763	0	0	0	0
2	Denarna sredstva – druge valute	0	0	0	0	0	0	0	0
3	Domači državni dolžniški instrumenti	0	0	0	0	0	0	0	0
4	Drugi državni dolžniški instrumenti	0	0	0	0	0	0	0	0
5	Dolžniški instrumenti vladnih agencij	0	0	0	0	0	0	0	0
6	Podjetniške obveznice	0	0	0	0	0	0	0	0
7	Lastniški vrednostni papirji	0	0	0	0	0	0	0	0
8	Drugo zavarovanje s premoženjem	0	0	0	0	0	0	0	0
9	Skupaj	0	0	0	4.763	0	0	0	0

Predloga EU CCR6 – Izpostavljenosti iz naslova kreditnih izvedenih finančnih instrumentov

		a	b
		Kupljeno zavarovanje	Prodano zavarovanje
Hipotetični zneski			
1	Kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost	0	0
2	Indeksi kreditnih zamenjav	0	0
3	Zamenjave skupnega donosa	0	0
4	Kreditne opcije	0	0
5	Drugi kreditni izvedeni finančni instrumenti	0	0
6	Skupaj hipotetični zneski	0	0
Poštene vrednosti			
7	Pozitivna poštena vrednost (sredstvo)	0	0
8	Negativna poštena vrednost (obveznost)	0	0

Predloga EU CCR8 – Izpostavljenosti CNS

		a	b
		Vrednost izpostavljenosti	RWEA
1	Izpostavljenosti do KCNS (skupaj)		384
2	Izpostavljenosti za trgovalne posle pri KCNS (brez vplačil začetnega kritja in prispevkov v jamstveni sklad); od tega	63	63
3	(i) izvedeni finančni instrumenti OTC	63	63
4	(ii) izvedeni finančni instrumenti, s katerimi se trguje na borzi	0	0
5	(iii) SFT	0	0
6	(iv) nizi pobotov, kjer je bil odobren pogodbeni pobot med različnimi kategorijami produktov	0	0
7	Ločeno začetno kritje	0	
8	Neločeno začetno kritje	322	322
9	Predhodno plačani prispevki v jamstveni sklad	0	0
10	Nefinancirani prispevki v jamstveni sklad	0	0
11	Izpostavljenosti do nekvificiranih CNS (skupaj)		0
12	Izpostavljenosti za trgovalne posle pri nekvificiranih CNS (brez vplačil začetnega kritja in prispevkov v jamstveni sklad); od tega	0	0
13	(i) izvedeni finančni instrumenti OTC	0	0
14	(ii) izvedeni finančni instrumenti, s katerimi se trguje na borzi	0	0
15	(iii) SFT	0	0
16	(iv) nizi pobotov, kjer je bil odobren pogodbeni pobot med različnimi kategorijami produktov	0	0
17	Ločeno začetno kritje	0	
18	Neločeno začetno kritje	0	0
19	Predhodno plačani prispevki v jamstveni sklad	0	0
20	Nefinancirani prispevki v jamstveni sklad	0	0

Opomba: Dokument predstavlja popravek Razkritij 2021 (v okviru Stebra 3) zaradi dejstva, da je Skupina razkrila samo vrstice/stolpce in predloge, ki so imele ne-nižne vrednosti v dokumentu Razkritja 2021 (v okviru Stebra 3). Vendar pa glede na to, da imajo regulatorne predloge fiksiran format in se morajo razkrivati v celoti, tudi če posamezne vrstice/stolpce ali predloge niso relevantne za institucijo, je Skupina pripravila ta dodatek za predloge EU CCR1, EU CCR2, EU CCR5, EU CCR6 in EU CCR8 v dokumentu Razkritja 2021 (v okviru Stebra 3).