

Na temelju članka 548. stavka 8. Zakona o tržištu kapitala (Narodne novine br. 65/18) Hrvatska agencija za nadzor financijskih usluga na sjednici Upravnog vijeća održanoj 22. kolovoza 2019. godine donosi

PRAVILNIK O NADZORNIM IZVJEŠTAJIMA SREDIŠNJE DRUGE UGOVORNE STRANE

Uvodne odredbe

Članak 1.

Ovim pravilnikom propisuje se struktura, sadržaj, način i rokovi dostave nadzornih izvještaja iz članka 548. stavaka 1. i 2. Zakona koje su središnje druge ugovorne strane dužne dostavljati Hanfi te u skladu s člankom 548. stavkom 5. i Hrvatskoj narodnoj banci.

Definicije

Članak 2.

(1) Pojmovi koji se koriste u ovom Pravilniku imaju sljedeće značenje:

1. *Hanfa* je Hrvatska agencija za nadzor financijskih usluga
2. *Zakon* je Zakon o tržištu kapitala (Narodne novine br. 65/18).
3. *Uredba (EU) br. 648/2012* je Uredba (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća od 4. srpnja 2012. o OTC izvedenicama, središnjoj drugoj ugovornoj strani i trgovinskom repozitoriju.
4. *Delegirana uredba Komisije (EU) br. 876/2013* je Delegirana uredba Komisije (EU) br. 876/2013 od 28. svibnja 2013. o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća u odnosu na regulatorne tehničke standarde o kolegijima za središnje druge ugovorne strane.
5. *Delegirana uredba Komisije (EU) br. 152/2013* je Delegirana uredba Komisije (EU) br. 152/2013 od 19. prosinca 2012. o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća o OTC izvedenicama, središnjoj drugoj ugovornoj strani i trgovinskom repozitoriju, u vezi s regulatornim tehničkim standardima o kapitalnim zahtjevima za središnje druge ugovorne strane.

6. *Delegirana uredba (EU) br. 153/2013* je Delegirana uredba Komisije (EU) br. 153/2013 od 19. prosinca 2012. o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća u vezi s regulatornim tehničkim standardima o zahtjevima za središnje druge ugovorne strane

(2) Ostali pojmovi u smislu ovog Pravilnika te izvještaja iz priloga ovog Pravilnika imaju istovjetno značenje kao pojmovi upotrijebljeni u Zakonu, Uredbi (EU) br. 648/2012, Delegiranoj uredbi (EU) br. 153/2013, Delegiranoj uredbi Komisije (EU) br. 152/2013 i Delegiranoj uredbi Komisije (EU) br. 876/2013.

Struktura i sadržaj nadzornih izvještaja

Članak 3.

(1) Središnja druga ugovorna strana dostavlja Hanfi nadzorne izvještaje i obavijesti iz članka 1. ovoga Pravilnika putem sljedećih obrazaca koji čine sastavni dio ovoga Pravilnika (Prilog), i to:

a) **Obrazac AK-SDUS** - Izvještaj o adekvatnosti kapitala središnje druge ugovorne strane, sukladno odredbama Delegirane uredba Komisije (EU) br. 152/2013.

b) **Obrazac RPN-SDUS** - Opći podaci o računima poslovnih namjena koje središnja druga ugovorna strana koristi.

c) **Obrazac UK-SDUS** - Izvještaj o upravljanju kolateralom: strukturi kolaterala, članova i clijenata te naknadama.

d) **Obrazac TEST-SDUS** - Izvještaj o provedenom preispitivanju modela, testiranju osjetljivosti, povratnom testiranju otpornosti na stres i retroaktivnom ispitivanju.

e) **Obrazac LI-SDUS** - Izvještaj o likvidnosnoj potpori i pružateljima likvidnosti.

(2) Nadzorni izvještaj iz stavka 1. točke c) ovoga članka sastoji se od:

– skupnih podataka o upravljanju kolateralom: strukturi kolaterala, članova i clijenata, te naknadama (**UK-SDUS 1**),

– pojedinačnih podataka o strukturi kolaterala na kraju izvještajnog razdoblja (**UK-SDUS 2**), koji se sastoji od:

o **UK-SDUS 2.a** -Struktura kolaterala u novčanim sredstvima *a vista*

o **UK-SDUS 2.b** -Struktura kolaterala u depozitima

o **UK-SDUS 2.c** - Struktura kolaterala u financijskim instrumentima

(3) Nadzorni izvještaj iz stavka 1. točke d) ovoga članka sastoji se od:

– podataka o retroaktivnom ispitivanju parametara modela (**RI-SDUS 1**),

– podataka o retroaktivnom ispitivanju iznosa nadoknade (**RI-SDUS 2**),

– podataka o retroaktivnom ispitivanju korektivnih faktora (**RI-SDUS 3**),

– podataka o rezultatima mjesečnih analiza osjetljivosti u izvještajnom razdoblju (šok na parametre modela) (**TO-TEST 1**),

– podataka o rezultatima mjesečnih analiza osjetljivosti u izvještajnom razdoblju (promjena likvidacijskog razdoblja) (**TO-TEST 2**),

– podataka o povratnom ispitivanju otpornosti na stres (**PIOS-TEST**).

(4) Nadzorni izvještaj iz stavka 1. točke e) ovoga članka sastoji se od:

– podataka o korištenju likvidnosne potpore (**LI-SDUS 1**),

– podataka o pružateljima likvidnosti (**LI-SDUS 2**),

(5) Osim izvještaja iz stavka 1. ovoga članka, središnja druga ugovorna strana Hanfi dostavlja i nadzorni izvještaj koji sadrži podatke koji su potrebni za razmjenu informacija s kolegijem regulatora u skladu s člankom 17. Uredbe (EU) br. 648/2012.

(6) Obrazac iz stavka 1. točke a) popunjava se u skladu sa uputom Hanfe za popunjavanje nadzornog izvještaja za središnje druge ugovorne strane (Obrazac AK-SDUS).

(7) Obrasci iz stavka 1. točaka b) do e) ovoga članka popunjavaju se u skladu s uputom Hanfe za popunjavanje nadzornih izvještaja za središnje druge ugovorne strane.

(8) Uz obrasce iz stavka 1. ovoga članka, središnja druga ugovorna strana može priložiti dokumente u svrhu potvrđivanja podataka i navoda u nadzornim izvještajima, te ih kao priloge dostaviti kao zasebne dokumente u PDF formatu u skladu s člankom 4. stavkom 1. ovoga Pravilnika odnosno podneskom u skladu s člankom 4. stavkom 3. ovoga Pravilnika.

(9) Uz obrasce iz stavka 1. ovoga članka, središnja druga ugovorna strana dužna je priložiti izjavu višeg rukovodstva kojom se potvrđuje potpunost i točnost podataka i navoda u nadzornim izvještajima, kao i dokumenata iz stavka 8. ovoga članka.

(10) Ako utvrdi da su nadzorni izvještaji i/ili obavijesti iz ovoga članka nepotpuni odnosno sadrže nedostatke, Hanfa će pozvati središnju drugu ugovornu stranu na ispravak ili dopunu istih ili dostavu dodatne dokumentacije radi otklanjanja nedostataka, u roku koji Hanfa odredi, a koji, osim u iznimnim situacijama, ne može biti kraći od 3 (radna) dana.

Način dostave nadzornih izvještaja i obavijesti

Članak 4.

(1) Nadzorni izvještaji i obavijesti iz članka 3. ovoga Pravilnika dostavljaju se Hanfi isključivo u elektroničkom obliku u skladu s tehničkom uputom Hanfe.

(2) Smatra se da je središnja druga ugovorna strana dostavila nadzorne izvještaje i obavijesti iz stavka 1. ovoga članka u trenutku kada je izvještaj prihvaćen na poslužitelju Hanfe za zaprimanje izvještaja, osim u slučaju iz stavka 6. članka 3. ovoga Pravilnika, kada se smatra da je središnja druga ugovorna strana dostavila nadzorne izvještaje i obavijesti nakon dostave ispravljenih izvještaja.

(3) U opravdanim slučajevima nemogućnosti dostave u elektroničkom obliku, središnja druga ugovorna strana dužna je u propisanom roku dostaviti nadzorne izvještaje i obavijesti u pisanom obliku, neposredno ili poštom u svrhu pravodobnog izvješćivanja, te je dužna Hanfu

obavijestiti o razlozima nemogućnosti dostave u elektroničkom obliku, kao i o koracima koje poduzima da se te okolnosti uklone.

(4) U slučaju iz stavka 3. ovoga članka, središnja druga ugovorna strana dužna je dostaviti nadzorne izvještaje i obavijesti na način propisan stavkom 1. ovoga članka čim prestanu razlozi nemogućnosti dostave, a najkasnije u roku od 5 (pet) dana od prestanka razloga nemogućnosti dostave.

Rokovi dostave nadzornih izvještaja i obavijesti

Članak 5.

(1) Nadzorne izvještaje i obavijesti iz članka 3. ovoga Pravilnika, središnja druga ugovorna strana sastavlja i dostavlja za poslovnu godinu i izvještajna razdoblja tijekom poslovne godine.

(2) Za potrebe izrade i dostave nadzornih izvještaja i obavijesti iz stavka 1. ovoga članka poslovna godina jednaka je kalendarskoj godini, a izvještajna razdoblja tijekom godine jednaka su tromjesečnom, šestomjesečnom i devetomjesečnom razdoblju.

(3) Nadzorne izvještaje na obrascima iz članka 3. stavka 1. ovoga Pravilnika, središnja druga ugovorna strana dužna je dostavljati Hanfi tromjesečno, najkasnije u roku od trideset (30) dana od zadnjeg dana tromjesečnog razdoblja.

(4) Nadzorne izvještaj iz članka 3. stavka 5. ovoga Pravilnika središnja druga ugovorna strana dužna je dostavljati Hanfi tromjesečno, najkasnije u roku od trideset (30) dana od zadnjeg dana tromjesečnog razdoblja s time da se izvještaji moraju sadržavati odvojene podatke za svaki mjesec unutar izvještajnog razdoblja odnosno s podacima na zadnji dan svakog mjeseca unutar izvještajnog kvartala.

(5) Iznimno od stavaka 3. i 4. ovoga članka, središnja druga ugovorna strana dužna je u bez odgode, a u opravdanim slučajevima najkasnije u roku od pet (5) radnih dana od nastanka događaja, Hanfu obavijestiti o:

– nastanku događaja koji ukazuje na materijalne nedostatke u modelu izračuna rizika središnje druge ugovorne strane ili u okviru likvidnosti središnje druge ugovorne strane,

– padu razine adekvatnosti kapitala središnje druge ugovorne strane ispod razine propisane Uredbom (EU) br. 648/2012 i Delegiranom uredbom Komisije (EU) br. 152/2013,

– materijalizaciji bilo koje od okolnosti iz članka 554. stavka 2. Zakona, kada se pretpostavlja da središnja druga ugovorna strana neće biti u mogućnosti kontinuirano ispunjavati uvjete iz članaka 41. do 44., članka 46. ili 47. Uredbe (EU) br. 648/2012 te tehničkih standarda koje je donijela Europska komisija na temelju Uredbe (EU) br. 648/2012.

Izvješća koja se dostavljaju Hrvatskoj narodnoj banci

Članak 6.

(1) Središnja druga ugovorna strana je sukladno članku 548. stavka 5. Zakona, dužna u elektroničkom obliku Hrvatskoj narodnoj banci dostaviti nadzorni izvještaj iz članka 3. stavka 1. točke e ovoga Pravilnika, na način kako to svojom Odlukom propiše Hrvatska narodna banka.

(2) Hanfa tromjesečno Hrvatskoj narodnoj banci dostavlja nadzorni izvještaj iz članka 3. stavka 5. ovoga Pravilnika, a koji između ostalog sadrži podatke o izvorima likvidnosti CCP-a te rezultate o stres testovima likvidnosti.

Stupanje na snagu

Članak 7.

Ovaj Pravilnik stupa na snagu osmog dana od dana objave u Narodnim novinama.

KLASA: 011-02/19-01/01
URBROJ: 326-01-70-72-19-12
Zagreb, 22. kolovoza 2019

PREDSJEDNIK UPRAVNOG VIJEĆA
dr.sc. Ante Žigman

Prilog 1 - Obrazac AK-SDUS - Izvještaj o adekvatnosti kapitala središnje druge ugovorne strane

Obrazac AK-SDUS

Opći podaci	
Naziv SDUS:	
OIB SDUS:	
Izvještaj na datum:	
Datum sastavljanja izvještaja:	
Sastavio/la:	
Telefonski broj:	
Adresa elektroničke pošte	

IZVJEŠTAVANJE O REGULATORNOM KAPITALU I KAPITALNIM ZAHTJEVIMA

OBRASCI COREP			
Broj obrasca	Kod obrasca	Naziv obrasca / skupine obrazaca	Skraćeni naziv
		ADEKVATNOST KAPITALA	CCP-CA
1	CCP-C 01.00	KAPITAL I REGULATORNI KAPITAL	CCP-CA1
2	CCP-C 02.00	KAPITALNI ZAHTJEVI	CCP-CA2
3	CCP-C 03.00	ODNOS REGULATORNOG KAPITALA I KAPITALNIH ZAHTJEVA	CCP-CA3
		KREDITNI RIZIK	CCP-CR
4	CCP-C 04.00	KREDITNI RIZIK I KREDITNI RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE: STANDARDIZIRANI PRISTUP KAPITALNIM ZAHTJEVIMA	CCP-CR SA
		OPERATIVNI RIZIK	CCP-OPR
5	CCP-C 05.00	OPERATIVNI RIZIK	CCP-OPR
		TRŽIŠNI RIZIK:	CCP-MKR
6	CCP-C 06.00	TRŽIŠNI RIZIK: STANDARDIZIRANI PRISTUP POZIJSKIM RIZICIMA DUŽNIČKIH INSTRUMENATA KOJIMA SE TRGUJE	CCP-MKR SA TDI
7	CCP-C 07.00	TRŽIŠNI RIZIK: STANDARDIZIRANI PRISTUP ZA POZIJSKI RIZIK U VLASNIČKIM INSTRUMENTIMA	CCP-MKR SA EQU
8	CCP-C 08.00	TRŽIŠNI RIZIK: STANDARDIZIRANI PRISTUPI VALUTNOM RIZIKU	CCP-MKR SA FX
		RIZIK ZATVARANJA ILI RESTRUKTURIRANJA	CCP - WRR
9	CCP-C 09.00	RIZIK ZATVARANJA ILI RESTRUKTURIRANJA	CCP-WRR
		RIZIK POSLOVANJA	CCP-BR
10	CCP-C 10.00	RIZIK POSLOVANJA	CCP-BR

CCP-C 01.00 – KAPITAL I REGULATORNI KAPITAL (CCP-CA1)					
			(u eurima)	Tečaj	(u kunama)
Redci	Identifikacijski broj	Stavka	Iznos	EUR/HRK	Iznos
010	1	KAPITAL			
020	1.1	Upisani kapital			
	1.1.1.	Vlastita sredstva za za pokriće mogućih gubitaka u slučaju neispunjavanja obveza od strane članova sustava poravnanja			
030	1.2	Rezerve kapitala			
040	1.3	Rezerve			
050	1.3.1	Zakonske rezerve			
060	1.3.2	Statutarne rezerve			
070	1.3.3	Rezerve za pokriće mogućih gubitaka u slučaju neispunjavanja obveza od strane članova sustava poravnanja			
080	1.3.4	Ostale rezerve			
090	1.4	Revalorizacijske rezerve			
100	1.5	Zadržana dobit			
110	1.6	Preneseni gubitak			
120	1.7	Dobit ili gubitak tekuće godine			
130	2	REGULATORNI KAPITAL	0		
140	2.1.	KAPITAL			
150	2.1.1.	Vlastita sredstva za za pokriće mogućih gubitaka u slučaju neispunjavanja obveza od strane članova sustava poravnanja			
160	2.1.2.	Rezerve za pokriće mogućih gubitaka u slučaju neispunjavanja obveza od strane članova sustava poravnanja			
170	2.2.	Iznos kapitala, uključujući zadržanu dobit i rezerve koji nije uložen u skladu sa člankom 47. stavkom 1. Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća od 04. srpnja 2012. o OTC izvedenicama, središnjoj drugoj ugovornoj strani i trgovinskom repozitoriju			

CCP-C 02.00 – KAPITALNI ZAHTJEVI (CCP-CA2)					
			(u eurima)	Tečaj	(u kunama)
Redci	Stavka	Oznaka			Iznos
010	1	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU			
020	1.1	IZNOSI IZLOŽENOSTI PONDERIRANI RIZIKOM ZA KREDITNI RIZIK I KREDITNI RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE			
030	1.1.1	Standardizirani pristup			
040	1.1.1.1	Kategorije izloženosti u skladu sa standardiziranim pristupom isključujući sekuritizacijske pozicije			
050	1.1.1.1.01	Središnje države ili središnje banke			
060	1.1.1.1.02	Jedinice područne (regionalne) ili lokalne samouprave			
070	1.1.1.1.03	Subjekti javnog sektora			
080	1.1.1.1.04	Multilateralne razvojne banke			
090	1.1.1.1.05	Međunarodne organizacije			
100	1.1.1.1.06	Institucije			
110	1.1.1.1.07	Trgovačka društva			
120	1.1.1.1.08	Stanovništvo			
130	1.1.1.1.09	Osigurane nekretninama			
140	1.1.1.1.10	Izloženosti sa statusom neispunjavanja obveza			
150	1.1.1.1.11	Visokorizične stavke			
160	1.1.1.1.12	Pokrivene obveznice			
170	1.1.1.1.13	Potraživanja prema institucijama i trgovačkim društvima s kratkoročnom kreditnom procjenom			
180	1.1.1.1.14	Subjekti za zajednička ulaganja (CIU)			
190	1.1.1.1.15	Vlasnička ulaganja			
200	1.1.1.1.16	Ostale stavke			
210	1.1.2	Iznos izloženosti riziku za uplate u fond za neispunjene obveze središnje druge ugovorne strane u odnosu međudjelovanja			
220	1.2	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU ZA POZICIJSKI I VALUTNI RIZIK			
230	1.2.1	Iznos izloženosti riziku za pozicijski i valutni rizik u skladu sa standardiziranim pristupima			
240	1.2.1.1	Dužnički instrumenti kojima se trguje			
250	1.2.1.2	Vlasnički instrument			
260	1.2.1.3	Devizni instrument			
270	1.3	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU ZA OPERATIVNI RIZIK			
280	1.3.1	Jednostavni pristup operativnom riziku			
290	1.3.2	Napredni pristupi operativnom riziku			
300	1.4	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU ZATVARANJA ILI RESTRUKTURIRANJA			
310	1.5	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI POSLOVNOM RIZIKU			

CCP-C 03.00 – ODNOS REGULATORNOG KAPITALA I KAPITALNIH ZAHTJEVA (CCP-CA3)					
Redci	ID.	Stavka	Zahtjev I (u %)	Zahtjev II (u %)	
010	1	Regulatorni kapital/kapitalni zahtjevi			
			Iznos (u EUR)	Tečaj	(u kunama)
020	2	Višak (+)/manjak (-) kapitala			
			Omjer (u %)	Omjer II (u %)	
030	3	Vlastita financijska sredstva za pokriće mogućih gubitaka u slučaju neispunjavanja obveza od strane članova sustava poravnanja (SiG)/najniži iznos kapitala uključujući zadržanu dobit i rezerve			
			Iznos (u EUR)	Tečaj	(u kunama)
040	4	Višak (+)/manjak (-) SiG sredstava			

CCP-C 04.00 – KREDITNI RIZIK I KREDITNI RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE: STANDARDIZIRANI PRISTUP KAPITALNIM ZAHTJEVIMA (CCP-CR SA)

(u kunamal)

[illegible]

CCP-C 05.00 – OPERATIVNI RIZIK (CCP-OPR)

(u kunama)

SDUS AKTIVNOSTI		RELEVANTNI POKAZATELJ			KAPITALNI ZAHTJEV	BILJEŠKE U SKLADU S NAPREDNIM PRISTUPIMA KOJE JE POTREBNO ISKAZATI AKO JE PRIMJENJIVO				
		GODINA-3	GODINA-2	PRETHODNA GODINA		OD ČEGA: NA TEMELJU ALOKACIJSKOG MEHANIZMA	KAPITALNI ZAHTJEV PRIJE SMANJENJA ZBOG OČEKIVANOGA GUBITKA, DIVERSIFIKACIJE I TEHNIKA SMANJENJA RIZIKA	(-) SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTJEVA ZBOG OČEKIVANOGA GUBITKA OBUHVAĆENOG U POSLOVNIM PRAKSAMA	(-) SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTJEVA ZBOG DIVERSIFIKACIJE	(-) SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTJEVA ZBOG TEHNIKA SMANJENJA RIZIKA (OSIGURANJE I DRUGI MEHANIZMI ZA PRIJENOS RIZIKA)
		010	020	030	040	050	060	070	080	090
010	1. SDUS AKTIVNOSTI KOJE PODLJEŽU JEDNOSTAVNOM PRISTUPU				Ćelija povezana s CCP-CA					
020	2. SDUS AKTIVNOSTI KOJE PODLJEŽU NAPREDNIM PRISTUPIMA				Ćelija povezana s CCP-CA2					

CCP-C 06.00 – TRŽIŠNI RIZIK: STANDARDIZIRANI PRISTUP POZICIJSKIM RIZICIMA DUŽNIČKIH INSTRUMENTATA KOJIMA SE TRGUJE (CCP-MKR SA TDI)

Valuta:

		POZICIJE						UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU
		SVE POZICIJE		NETO POZICIJE		POZICIJE KOJE PODLIJEŽU KAPITALNOM ZAHTJEVU	KAPITALNI ZAHTJEVI	
010	020	030	040	050	060	070		
010	DUŽNIČKI INSTRUMENTI KOJIMA SE TRGUJE U KNJIZI TRGOVANJA					Čelija povezana s CA2	Čelija povezana s CA2	
011	Opći rizik							
012	Izvedenice							
013	Ostala imovina i obveze							
020	Pristup koji se temelji na dospeljeu							
030	Zona 1							
040	0 ≤ 1 mjesec							
050	> 1 ≤ 3 mjeseca							
060	> 3 ≤ 6 mjeseci							
070	> 6 ≤ 12 mjeseci							
080	Zona 2							
090	> 1 ≤ 2 (1,9 za kupon manji od 3 %) godine							
100	> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 za kupon manji od 3 %) godine							
110	> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 za kupon manji od 3 %) godine							
120	Zona 3							
130	> 4 ≤ 5 (> 3,6 ≤ 4,3 za kupon manji od 3 %) godina							
140	> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 za kupon manji od 3 %) godina							
150	> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 za kupon manji od 3 %) godina							
160	> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 za kupon manji od 3 %) godine							
170	> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 za kupon manji od 3 %) godina							
180	> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 za kupon manji od 3 %) godina							
190	(> 12,0 ≤ 20,0 za kupon manji od 3 %) godina							
200	(> 20 za kupon manji od 3 %) godina							
210	Pristup koji se temelji na trajanju							
220	Zona 1							
230	Zona 2							
240	Zona 3							
250	Specifični rizik							
251	Kapitalni zahtjevi za dužničke instrumente koji nisu predmet sekuritizacije							
260	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s prvom kategorijom u tablici 1.							
270	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s drugom kategorijom u tablici 1.							
280	S preostalim rokom ≤ 6 mjeseci							
290	S preostalim rokom > 6 mjeseci i ≤ 24 mjeseca							
300	S preostalim rokom > 24 mjeseca							
310	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s trećom kategorijom u tablici 1.							
320	Dužnički vrijednosni papiri u skladu s četvrtom kategorijom u tablici 1.							
321	Kreditne izvedenice s rejtingom na osnovi „n-log” nastanka statusa neispunjavanja obveza							
325	Kapitalni zahtjev za sekuritizacijske instrumente							
330	Kapitalni zahtjev za korelacijski portfelj namijenjen trgovanju							
340	Poseban pristup pozicijskom riziku za CIU							
350	Dodatni zahtjevi za opcije (rizik osim delta-rizika)							
360	Pojednostavljena metoda							
370	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za gama-rizik							
380	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za vega-rizik							
390	Scenarij matičnog pristupa							

CCP-C 07.00 – TRŽIŠNI RIZIK: STANDARDIZIRANI PRISTUP ZA POZICIJSKI RIZIK U VLASNIČKIM INSTRUMENTIMA (CCP-MKR SA EQU)
Nacionalno tržište:
(u kunama)

		POZICIJE					KAPITALNI ZAHTJEVI	UKUPAN IZNOS IZLOŽENOSTI RIZIKU
		SVE POZICIJE		NETO POZICIJE		POZICIJE KOJE PODLIJEŽU KAPITALNOM ZAHTJEVU		
		DUGE	KRATKE					
				DUGE	KRATKE			
		010	020	030	040	050		
010	VLASNIČKI INSTRUMENTI U KNJIZI TRGOVANJA						Ćelija povezana s CA	Ćelija povezana s CA
020	Opći rizik							
021	Izvedenice							
022	Ostala imovina i obveze							
030	Široko diversificirane budućnosnice na osnovi dioničkog indeksa kojima se trguje na burzi i koje podliježu konkretnom pristupu							
040	Ostali vlasnički instrumenti koji nisu široko diversificirane budućnosnice na osnovi dioničkog indeksa kojima se trguje na burzi							
050	Specifični rizik							
080	Poseban pristup pozicijskom riziku za CIU							
090	Dodatni zahtjevi za opcije (rizici osim delta-rizika)							
100	Pojednostavljena metoda							
110	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za gama-rizik							
120	Pristup delta plus – dodatni zahtjevi za vega-rizik							
130	Scenarij matričnog pristupa							

CCP-C 09.00 – RIZIK ZATVARANJA ILI RESTRUKTURIRANJA (CCP-WRR)

	BRUTO OPERATIVNI TROŠKOVI		PROCIJENJENI BROJ MJESECI ZA PROVOĐENJE ZATVARANJA/RESTRUKTURIRANJA	KAPITALNI ZAHTEJ
	GODIŠNJI	MJESEČNI		
	010	020	030	040
010				Ćelija povezana s CCP-CA

CCP-C 10.00 – RIZIK POSLOVANJA (CCP-BR)

	GODIŠNJI BRUTO OPERATIVNI TROŠKOVI	25% GODIŠNJIH BRUTO OPERATIVNIH TROŠKOVA (REGULATORNI MINIMUM)	VLASTITA PROCJENA KAPITALA	KAPITALNI ZAHTEJ
	010	020	030	040
010				Ćelija povezana s CCP-CA

Prilog 2 - Obrazac RPN-SDUS - Opći podaci o računima poslovnih namjena

Obrazac RPN-SDUS

Opći podaci	
Naziv SDUS:	
OIB SDUS:	
Izveštaj na datum:	
Datum sastavljanja izveštaja:	
Sastavio/la:	
Telefonski broj:	
Adresa elektroničke pošte	

Obrazac RPN-SDUS - Opći podaci o računima poslovnih namjena	
Naziv pravne osobe:	
OIB:	
Izveštajno razdoblje:	

Računi poslovnih namjena					
I.	Računi kolaterala	Naziv kreditne institucije	Oznaka valute	Opunomoćenici	Funkcija opunomoćenika
1.					
2.					
3.					
4.					
5.					
6.					
7.					
8.					
9.					
10.					
II.	Redovni računi SDUS	Naziv kreditne institucije	Oznaka valute	Opunomoćenici	Funkcija opunomoćenika
1.					
2.					
3.					
4.					
5.					
6.					
7.					
8.					
9.					
10.					

Prilog 3 Obrazac TEST-SDUS - Izvještaj o provedenom preispitivanju modela, ispitivanju otpornosti na stres i retroaktivnom ispitivanju (RI-SDUS 1, RI-SDUS 2, RI SDUS 3, TO-SDUS 1, TO-SDUS 2 i PIOS-SDUS 1)

Obrazac TEST-SDUS

Opći podaci	
Naziv SDUS:	
OIB SDUS:	
Izvještaj na datum:	
Datum sastavljanja izvještaja:	
Sastavio/la:	
Telefonski broj:	
Adresa elektroničke pošte	

Obrazac RT-SDUS																
Naziv pravne osobe:																
Izveštajno razdoblje:																
OIB:																
RT-SDUS 2 Rezultati retroaktivnog testiranja margina u izvještajnom razdoblju po računu pozicija																
Oznaka člana	Naziv člana	Oznaka računa pozicija	Razina pouzdanosti (%)	Metoda testiranja	Dopušteni broj odstupanja prema metodi koju SDUS koristi		Dopušteni broj odstupanja prema konzervativnom pristupu		Stvarni broj odstupanja u razdoblju		Broj opservacija u razdoblju	Prosječna veličina odstupanja		Najveće odstupanje		P&L
					u %	Apsolutni iznos broja odstupanja	u %	Apsolutni iznos broja odstupanja	u %	Apsolutni iznos broja odstupanja		u %	u HRK	u %	u HRK	

Obrazac RT-SDUS													
Naziv pravne osobe:													
Izveštajno razdoblje:													
OIB:													
RT-SDUS 3 Rezultati retroaktivnog testiranja korektivnih faktora u izvještajnom razdoblju													
Opis retroaktivnog testa	ISIN	Razdoblje držanja (broj dana)	Razina pouzdanosti (%)	Metoda provođenja testa	Dopušteni broj odstupanja prema metodi koju SDUS koristi		Dopušteni broj odstupanja prema konzervativnom pristupu		Stvarni broj odstupanja u razdoblju		Broj opservacija u razdoblju	Prosječna veličina odstupanja (%)	Najveće odstupanje (u %)
					u %	Apsolutni iznos broja odstupanja	u %	Apsolutni iznos broja odstupanja	u %	Apsolutni iznos broja odstupanja			

Obrazac TO-SDUS					
Naziv pravne osobe:					
Izvršajno razdoblje:					
OIB:					
TO-SDUS 1 Rezultati mjesečnih analiza osjetljivosti u izvještajnom razdoblju (šok na parametre modela)					
Razdoblje	Parametri podvrgnuti stresu	Veličina šoka na parametre	Jesu li zabilježena odstupanja od očekivanih vrijednosti? (DA/NE)	Rezultati testiranja mjesečne analize osjetljivosti	Sažetak korektivnih mjera
I mjesec					
II mjesec					
III mjesec					
*dodati retke po potrebi					

Obrazac TO-SDUS				
Naziv pravne osobe:				
Izveštajno razdoblje:				
OIB:				
TO-SDUS 2 Rezultati mjesečnih analiza osjetljivosti u izvještajnom razdoblju (promjena likvidacijskog razdoblja)				
Razdoblje	Primjenjeno likvidacijsko razdoblje	Jesu li zabilježena odstupanja od očekivanih vrijednosti? (DA/NE)	Rezultati testiranja mjesečne analize osjetljivosti	Sažetak korektivnih mjera
I mjesec				
II mjesec				
III mjesec				
*dodati retke po potrebi				

[illegible]

1. **Prilog 4 - Obrazac UK-SDUS** — Izvještaj o upravljanju kolateralom: strukturi kolaterala, članova i klijenata, te naknadama (UK-SDUS 1 i UK SDUS 2)

Obrazac UK-SDUS

Opći podaci	
Naziv SDUS:	
OIB SDUS:	
Izvještaj na datum:	
Datum sastavljanja izvještaja:	
Sastavio/la:	
Telefonski broj:	
Adresa elektroničke pošte	

Obrazac UK 1 - Izvještaj o upravljanju kolateralom: strukturi kolaterala, članova i klijenata, te naknadama										
Naziv pravne osobe:										
Izveštajno razdoblje:										
OIB:										
		Financijski instrumenti	Depoziti	Novčana sredstva na računu u HNB-u	Stečena kamata (prinos)	Ukupna vrijednost na kraju izvještajnog razdoblja	Ukupna vrijednost na početku izvještajnog razdoblja	Prosječna vrijednost I	Prosječna vrijednost II	Prosječna vrijednost III
I.	UPRAVLJANJE KOLATERALOM					0,00				
II.	STRUKTURA FINANCIJSKIH INSTRUMENATA	Vrijednost na zadnji dan izvještajnog razdoblja (HRK)								
2.1.	VLASNIČKI VRIJEDNOSNI PAPIRI	0,00								
2.1.1.	HR vlasnički vrijednosni papiri									
2.1.2.	Druge DČ - vlasnički vrijednosni papiri									
2.3.	DRŽAVNE OBVEZNICE	0,00								
2.3.1.	HR državne obveznice									
2.3.2.	Druge DČ - državne obveznice									
2.4.	TREZORSKI ZAPISI MINISTARSTVA FINACIJA RH									
2.5.	INSTRUMENTI TRŽIŠTA NOVCA IZDANI OD DRUGIH DČ									
2.6.	OSTALO									
III.	STRUKTURA ČLANOVA I KLIJENATA									
3.1.	UKUPAN BROJ ČLANOVA	0								
3.1.1.	Financijske druge ugovorne strane									
3.1.2.	Nefinancijske druge ugovorne strane									
3.2.	UKUPAN BROJ INDIVIDUALNIH KLIJENATA	0								
3.2.1.	Financijske druge ugovorne strane									
3.2.2.	Nefinancijske druge ugovorne strane									
IV.	OBRACUNATA NAKNADA ZA UPRAVLJANJE KOLATERALOM					0,00		0,00	0,00	0,00
4.1.	Postotak po kojem se obračunava naknada za upravljanje kolateralom									
4.2.	Ostale povezane naknade									

[illegible]

UK-SDUS 2.b - Struktura kolaterala u depozitima															
Vrsta	KI (BIC ili LEI)	Naziv KI	Država KI	Oznaka	Datum ugovoraranja	Datum dospijeća	Ugovoreni iznos u valuti glavnice	Kamatna stopa	Iznos kamate u valuti	Oznaka valute	Tečaj	Zbroj glavnice i kamate u HRK	Kolateral (ISIN)	Kolateral (tržišna vrijednost)	% u ukupnom iznosu
Oročeni depoziti															
Depoziti na poziv															

UK-SDUS 2.c - Struktura kolaterala u financijskim instrumentima																
Vrsta FI	ISIN	Država izdavatelja	Naziv izdavatelja	Količina/Nominalna vrijednost u valuti	Pool faktor	Jedinična cijena u valuti	Kamata (%)	Iznos kamate u valuti	Oznaka valute	Tečaj	Tržišna vrijednost u HRK (bez korektivnog faktora)	Korektivni faktor	Tržišna vrijednost u HRK (s korektivnim faktorom)	% u ukupnom iznosu	Datum dospijeća	% u izdanju FI
Dionice																
Dužnički vrijednosni papiri																
Instrumenti tržišta novca																
*dodati retke po potrebi																

Obrazac LI-SDUS

Opći podaci	
Naziv SDUS:	
OIB SDUS:	
Izveštaj na datum:	
Datum sastavljanja izvještaja:	
Sastavio/la:	
Telefonski broj:	
Adresa elektroničke pošte	

[illegible]

[illegible]